

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS
Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Amortisation

FECHA DE PAGO / *Payment date*

15.12.2016 15.12.2016 15.12.2016

Periodo de Interés / *Interest accrual period*

desde / <i>From</i>	15.09.2016	(incluido) / <i>(included)</i>	15.09.2016	(incluido) / <i>(included)</i>	15.09.2016	(incluido) / <i>(included)</i>
hasta / <i>To</i>	15.12.2016	(excluido) / <i>(excluded)</i>	15.12.2016	(excluido) / <i>(excluded)</i>	15.12.2016	(excluido) / <i>(excluded)</i>
plazo / <i>Term</i>	91	días / <i>days</i>	91	días / <i>days</i>	91	días / <i>days</i>

Bonos Serie A1	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Series A1 Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>
ES0366366005	ES0366366021	ES0366366039

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / <i>3 Month Euribor</i>	13.09.2016	-0,302%	-0,302%	-0,302%
+ Margen / <i>Margin</i>		0,130%	0,210%	0,550%
Tipo de Interés Nominal calculado / <i>Interest Rate</i>		-0,172%	-0,092%	0,248%
Tipo de Interés Nominal aplicable / <i>Interest Rate</i>		0,000% *	0,000% *	0,248%

Número de Bonos / *N.Bonds*

Nominal / *Face value*

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>
	9.571		192		237
21.897,11	209.577.239,81	43.647,36	8.380.293,12	49.641,70	11.765.082,90

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / *Day count fraction*

Act /

360

Intereses Brutos / *Gross*

Interés Retención / *Interest Withholding tax*

Neto / *Net*

(Euros)

19%

0,000000	0,00	0,000000	0,00	31,119830	7,375,40
0,000000	0,00	0,000000	0,00	5,912768	1,401,33
0,000000	0,00	0,000000	0,00	25,207062	5,974,07

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / *Redemption*

(Euros)

A determinar/To be determined

A determinar/To be determined

A determinar/To be determined

* El Tipo de Interés Nominal aplicable se ha fijado en el 0,000% debido a que los términos del Folleto y en concreto los apartados II.10 y V.4.2.1 del Folleto Informativo no contemplan la posibilidad de un Tipo de Interés Nominal negativo que pudiera dar lugar a intereses a satisfacer por los tenedores de los Bonos a favor del Fondo.

* The applicable Nominal Interest Rate has been set at 0.000% because the terms of the Prospectus and specifically sections II.10 and V.4.2.1 of the Prospectus do not provide for the possibility of a negative Nominal Interest Rate which might result in interest being payable by Bondholders to the Fund.