

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Redemption

FECHA DE PAGO / Payment date

27.12.2016

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

27.09.2016 (incluido) / (included)
27.12.2016 (excluido) / (excluded)
91 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B
Series A Bonds	Series B Bonds
ES0361747001	ES0361747019

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor

23.09.2016

-0,302%

-0,302%

Margen / Margin

0,300%

0,700%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

0,000%*

0,398%

Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value (Euros)

2.745 1.755
41.893,34 114.997.218,30 100.000,00 175.500.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross

0,000000

0,00

100,605556

176.562,75

Interés Retención / Withholding tax

19%

0,000000

0,00

19,115056

33.546,92

Interés Neto / Net

0,000000

0,00

81,490500

143.015,83

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined

0,00

0,00

Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles

Payments not made due to insufficient Available Funds

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date

27.06.2013 / 27.06.2016

Intereses Brutos / Gross Interest

2.735,666666

4.801.095,00

Interés Retención / Withholding tax

19%

519,776667

912.208,05

Interés Neto / Net Interest

2.215,889999

3.888.886,95

* 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 4.8 de la Nota de Valores y 3.4.6.2.1 del Módulo Adicional a la Nota de Valores 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 4.8 of the Securities Note and 3.4.6.2.1 of the Securities Note Building Block do not provide for the possibility of a negative Nominal Interest Rate which might result in interest being payable by Bondholders to the Fund.