

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

20.06.2017

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From 21.03.2017 (incluido) / (included)
hasta / To 20.06.2017 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie AG	Bonos Serie B (CA)	Bonos Serie B (CM)	Bonos Serie B (CP)	Bonos Serie B (CT)
Series A2 Bonds	Series A3 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds
ES0341068007	ES0341068015	ES0341068023	ES0341068031	ES0341068049

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor	16.03.2017	-0,329%	-0,329%	-0,329%	-0,329%	-0,329%
Margen / Margin		0,500%	0,800%	0,800%	0,800%	0,800%

Tipo de Interes Nominal aplicable / Interest Rate

0,171%	0,471%	0,471%	0,471%	0,471%
--------	--------	--------	--------	--------

Número de Bonos / N.Bonds

	3.316	98	33	27	20
--	-------	----	----	----	----

Nominal / Face value

(Euros)	32.453,86	107.616.999,76	100.000,00	9.800.000,00	100.000,00	3.300.000,00	100.000,00	2.700.000,00	100.000,00	2.000.000,00
---------	-----------	----------------	------------	--------------	------------	--------------	------------	--------------	------------	--------------

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest	14,028181	46.517,45	119,058333	11.667,72	119,058333	3.928,92	119,058333	3.214,57	119,058333	2.381,17
Retención / Withholding tax	19,00%	2,665354	8.838,31	22,621083	2.216,87	22,621083	746,50	22,621083	610,77	22,621083
Neto / Net Interest		11,362827	37.679,14	96,437250	9.450,85	96,437250	3.182,42	96,437250	2.603,80	96,437250

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined A determinar / To be determined A determinar / To be determined A determinar / To be determined A determinar / To be determined

Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles

Payments not made due to insufficient Available Funds

(Euros)

Fecha vencimiento / Maturity date

Amortización de Principal / Principal Redemption

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax 19,00%

Neto / Net Interest

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

20.06.2017

Periodo de Interés /

desde / From

21.03.2017

(incluido) / (included)

Interest accrual period

hasta / To

20.06.2017

(excluido) / (excluded)

plazo / Term

91

días / days

Bonos Serie C (CA)	Bonos Serie C (CM)	Bonos Serie C (CP)	Bonos Serie C (CT)
Series A3 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds
ES0341068056	ES0341068064	ES0341068072	ES0341068080

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor

16.03.2017

-0,329%

-0,329%

-0,329%

-0,329%

Margen / Margin

2,000%

2,000%

2,000%

2,000%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

1,671%

1,671%

1,671%

1,671%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	32		23		15		15
Número de Bonos / N.Bonds							
Nominal / Face value	(Euros)	100.000,00	3.200.000,00	100.000,00	2.300.000,00	100.000,00	1.500.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

422,391667

13.516,53

422,391667

9.715,01

422,391667

6.335,88

422,391667

6.335,88

Retención / Withholding tax

19,00%

80,254417

2.568,14

80,254417

1.845,85

80,254417

1.203,82

80,254417

1.203,82

Neto / Net Interest

342,137250

10.948,39

342,137250

7.869,16

342,137250

5.132,06

342,137250

5.132,06

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined

A determinar / To be determined

A determinar / To be determined

A determinar / To be determined

Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles

Payments not made due to insufficient Available Funds

(Euros)

Fecha vencimiento / Maturity date

Amortización de Principal / Principal Redemption

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

19,00%

Neto / Net Interest

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

20.06.2017

Periodo de Interés /

desde / From

21.03.2017

(incluido) / (included)

Interest accrual period

hasta / To

20.06.2017

(excluido) / (excluded)

plazo / Term

91

días / days

Bonos Serie D (CA)	Bonos Serie D (CM)	Bonos Serie D (CP)	Bonos Serie D (CT)
Series A3 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds
ES0341068098	ES0341068106	ES0341068114	ES0341068122

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor

16.03.2017

-0,329%

-0,329%

-0,329%

-0,329%

Margen / Margin

5,000%

5,000%

5,000%

5,000%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

4,671%

4,671%

4,671%

4,671%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie		
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class		
	61		25		16		14		
Número de Bonos / N.Bonds									
Nominal / Face value	(Euros)	100.000,00	6.100.000,00	100.000,00	2.500.000,00	82.273,24	1.316.371,84	98.929,64	1.385.014,96

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

1.180,725000

72.024,23

1.180,725000

29.518,13

971,420713

15.542,73

1.168,086992

16.353,22

Retención / Withholding tax

19,00%

224,337750

13.684,60

224,337750

5.608,44

184,569935

2.953,12

221,936528

3.107,11

Neto / Net Interest

956,387250

58.339,63

956,387250

23.909,69

786,850778

12.589,61

946,150464

13.246,11

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined

A determinar / To be determined

A determinar / To be determined

A determinar / To be determined

Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles

Payments not made due to insufficient Available Funds

(Euros)

Fecha vencimiento / Maturity date

22.06.2015 / 21.03.2017

22.06.2015 / 21.03.2017

21.03.2016 / 21.03.2017

20.12.2012 / 21.03.2017

Amortización de Principal / Principal Redemption

Intereses Brutos / Gross Interest

9.655,667049

588.995,69

9.047,666000

226.191,65

4.569,097500

73.105,56

21.756,655000

304.593,17

Retención / Withholding tax

19,00%

1.834,576739

111.909,18

1.719,056540

42.976,41

868,128525

13.890,06

4.133,764450

57.872,70

Neto / Net Interest

7.821,090310

477.086,51

7.328,609460

183.215,24

3.700,968975

59.215,50

17.622,890550

246.720,47