

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

27.03.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

27.12.2016 (incluido) / (included)
27.03.2017 (excluido) / (excluded)
90 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

22.12.2016

-0,316%

-0,316%

Margen / Margin

0,300%

0,700%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

0,000%*

0,384%

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
39.989,50	109.771.177,50	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

96,000000

168.480,00

Interés Retención / Withholding tax 19%

0,000000

0,00

18,240000

32.011,20

Interés Neto / Net

0,000000

0,00

77,760000

136.468,80

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

Intereses Brutos / Gross Interest

27.06.2013 / 27.12.2016

2.836,272222

4.977.657,75

Interés Retención / Withholding tax 19%

538,891722

945.754,97

Interés Neto / Net Interest

2.297,380500

4.031.902,78

* 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.