

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
16.05.2017
Periodo de Interés / Interest accrual period

 desde / From
 hasta / To
 plazo / Term

16.02.2017 (incluido) / (included)
16.05.2017 (excluido) / (excluded)
 89 días / days

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation
Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

14/02/2017

-0,328%

-0,328%

-0,328%

-0,328%

-0,328%

Margen / Margin

0,120%

0,220%

0,520%

2,100%

3,900%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,208%

-0,108%

0,192%

1,772%

3,572%

Tipo de interés aplicable / Interest rate

0,000%*

0,000%*

0,192%

1,772%

3,572%

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series B Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0313716013	ES0313716021	ES0313716039	ES0313716047	ES0313716054

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

6.820

162

275

107

146

2.842,50

19.385.850,00

100.000,00

16.200.000,00

100.000,00

27.500.000,00

100.000,00

10.700.000,00

100.000,00

14.600.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

47,466667

13.053,33

438,077778

46.874,32

883,077778

128.929,36

Interés Retención / Withholding tax

19%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

9,018667

2.480,13

83,234778

8.906,12

167,784778

24.496,58

Interés Neto / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

38,448000

10.573,20

354,843000

37.968,20

715,293000

104.432,78

Amortización de Principal
Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles
Payments outstanding due to insufficient Available Funds

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date

Interest Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

19%

Neto / Net Interest

16.11.2009-16.02.2017

33.062,041667

4.827.058,07

6.281,787917

917.141,04

26.780,253750

3.909.917,03

* 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.