

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

16.02.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

16.11.2016 (incluido) / (included)
16.02.2017 (excluido) / (excluded)
92 días / days

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

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

14/11/2016

-0,312%

-0,312%

-0,312%

-0,312%

-0,312%

Margen / Margin

0,120%

0,220%

0,520%

2,100%

3,900%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,192%

-0,092%

0,208%

1,788%

3,588%

Tipo de interés aplicable / Interest rate

0,000%*

0,000%*

0,208%

1,788%

3,588%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie		
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series		
	6.820		162		275		107		146		
Número de Bonos / N.Bonds											
Nominal / Face value	(Euros)	3.623,67	24.713.429,40	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

53,155556

14.617,78

456,933333

48.891,87

916,933333

133.872,27

Interés Retención / Interest Withholding tax

19%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

10,099556

2.777,38

86,817333

9.289,45

174,217333

25.435,73

Neto / Net

0,000000

0,00

0,000000

0,00

43,056000

11.840,40

370,116000

39.602,42

742,716000

108.436,54

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

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

16.11.2009-16.11.2016

32.145,108334

4.693.185,80

6.107,570584

891.705,31

26.037,537750

3.801.480,49

* 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.