

## 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

16.10.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 17.07.2017 (incluido) / (included)  
hasta / To 16.10.2017 (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie A2a	Bonos Serie A2b	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2a Bonds	Series A2b Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0345721015	ES0345721023	ES0345721031	ES0345721049	ES0345721056	ES0345721064

### Determinación Interés Nominal Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 13.07.2017 -0,331%  
Margen / Margin 0,130%  
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,201%  
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate 0,000%\*

-0,331%	-0,331%	-0,331%	-0,331%	-0,331%	-0,331%
0,130%	0,130%	0,170%	0,290%	0,530%	4,500%
-0,201%	-0,201%	-0,161%	-0,041%	0,199%	4,169%
0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,199%	4,169%

Número de Bonos / N.Bonds  
Nominal / Face value

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
5.000	2.362	220	183	235	160						
25.795,43	128.977.150,00	25.795,43	60.928.805,66	100.000,00	22.000.000,00	100.000,00	18.300.000,00	100.000,00	23.500.000,00	100.000,00	16.000.000,00

### Liquidación de Intereses Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross 0,000000  
Retención / Withholding tax 19,00%  
Neto / Net 0,000000

0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	50,302778	11.821,15	1.053,830556	168.612,89
0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	9,557528	2.246,02	200,227806	32.036,45
0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	40,745250	9.575,13	853,602750	136.576,44

### Amortización de Principal Principal Redemption

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined	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

Fecha de Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross  
Retención / Withholding tax 19,00%  
Neto / Net

	15/07/2014 - 17/07/2017	15/01/2009 - 17/07/2017	
1.487,630000	349.593,05	45.690,670000	7.310.507,20
282,649700	66.422,68	8.681,227300	1.388.996,37
1.204,980300	283.170,37	37.009,442700	5.921.510,83

### Pago de Intereses por Aplazamiento de Intereses Impagados Interest Payment of deferred unpaid interest

Fecha de Vencimiento / Maturity Date

Intereses Brutos / Gross  
Retención / Withholding tax 19,00%  
Neto / Net

	15.07.2014 - 17.07.2017	15.01.2009 - 17.07.2017	
10,032851	2.357,72	10.127,594000	1.620.415,04
1,906242	447,97	1.924,242860	307.878,86
8,126609	1.909,75	8.203,351140	1.312.536,18

\* 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 3.4.6.1.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 3.4.6.1 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.