

## 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

15.10.2018

Periodo de Interés /  
Interest accrual period

desde / From 16.07.2018 (incluido) / (included)  
hasta / To 15.10.2018 (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 12.07.2018 -0,321%  
Margen / Margin 0,130%  
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,191%  
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate 0,000%\*

-0,321%	-0,321%	-0,321%	-0,321%	-0,321%	-0,321%
0,130%	0,130%	0,170%	0,290%	0,530%	4,500%
-0,191%	-0,191%	-0,151%	-0,031%	0,209%	4,179%
0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,209%	4,179%

Número de Bonos / N.Bonds  
Nominal / Face value

(Euros) 20.248,54 101.242.700,00 20.248,54 47.827.051,48 100.000,00 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

(Euros) Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest  
Retención / Withholding tax  
Intereses Netos / Net Interest

19,00% 0,000000 0,00 0,000000 0,00 0,000000 0,00 0,000000 0,00 52,830556 12.415,18 1.056,358333 169.017,33  
0,000000 0,00 0,000000 0,00 0,000000 0,00 0,000000 0,00 10,037806 2.358,88 200,708083 32.113,29  
0,000000 0,00 0,000000 0,00 0,000000 0,00 0,000000 0,00 42,792750 10.056,30 855,650250 136.904,04

### Amortización de Principal Principal Redemption

(Euros) 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

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

(Euros) Fecha de Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest  
Retención / Withholding tax  
Intereses Netos / Net Interest

15.07.2014 - 16.07.2018 15.01.2009 - 16.07.2018  
1.690,357777 397.234,08 49.907,508889 7.985.201,43  
321,167977 75.474,47 9.482,426689 1.517.188,28  
1.369,189800 321.759,61 40.425,082200 6.468.013,15

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

(Euros) Fecha de Vencimiento / Maturity Date

Intereses Brutos / Gross Interest  
Retención / Withholding tax  
Intereses Netos / Net Interest

15.07.2014 - 16.07.2018 15.01.2009 - 16.07.2018  
13,202851 3.102,67 12.120,977375 1.939.356,38  
2,508542 589,51 2.302,985701 368.477,71  
10,694309 2.513,16 9.817,991674 1.570.878,67

\* 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.