

**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

20.08.2018

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 18.05.2018 (incluido) / (included)  
hasta / To 20.08.2018 (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 94 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie A3(G)	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series A3(G) Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0313273015	ES0313273023	ES0313273031	ES0313273049	ES0313273056	ES0313273064

**Determinación Interés Nominal**  
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	16.05.2018	-0,326%	-0,326%	-0,326%	-0,326%	-0,326%	-0,326%
Margen / Margin		0,200%	0,020%	0,350%	0,900%	1,800%	3,900%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,126%	-0,306%	0,024%	0,574%	1,474%	3,574%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,024%	0,574%	1,474%	3,574%

Número de Bonos / N.Bonds  
Nominal / Face value

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	
	2.889	912	231	60	108	174						
(Euros)	1.701,27	4.914.969,03	36.950,70	33.699.038,40	100.000,00	23.100.000,00	100.000,00	6.000.000,00	100.000,00	10.800.000,00	100.000,00	17.400.000,00

**Liquidación de Intereses**  
Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360  
Intereses Brutos / Gross Interest  
Retención / Withholding tax 19,00%  
Intereses Netos / Net Interest

0,000000	0,00	0,000000	0,00	6,266667	1.447,60	149,877778	8.992,67	384,877778	41.566,80	933,211111	162.378,73
0,000000	0,00	0,000000	0,00	1,190667	275,04	28,476778	1.708,61	73,126778	7.897,69	177,310111	30.851,96
0,000000	0,00	0,000000	0,00	5,076000	1.172,56	121,401000	7.284,06	311,751000	33.669,11	755,901000	131.526,77

**Amortización de Principal**  
Principal Redemption

Amortización / Redemption

A determinar / To be determine A determinar / To be determin 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 Interest  
Retención / Withholding tax 19,00%  
Intereses Netos / Net Interest

18/08/2009 - 18/05/2018  
38.894,786110 6.767.692,77  
7.390,009360 1.285.861,61  
31.504,776750 5.481.831,16

\* 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.