

FECHA DE PAGO / Payment date

14.11.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 14.08.2017 (incluido) / (included)  
hasta / To 14.11.2017 (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 92 días / days

Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D
<b>Series B Bonds</b>	<b>Series C Bonds</b>	<b>Series D Bonds</b>
ES0372259038	ES0372259046	ES0372259053

Tipo de Interes Nominal aplicable / Applicable Interest Rate

0,000%*	0,221%	3,671%
---------	--------	--------

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	627		241		288
6.072,47	3.807.438,69	100.000,00	24.100.000,00	100.000,00	28.800.000,00

Liquidación de Intereses Periodo Actual

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

19,00%

Intereses Netos / Net Interest

0,000000	0,00	56,477778	13.611,14	938,144444	270.185,60
0,000000	0,00	10,730778	2.586,12	178,247444	51.335,26
0,000000	0,00	45,747000	11.025,02	759,897000	218.850,34

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

6.072,47	3.807.438,69	100.000,00	24.100.000,00	59.942,32	17.263.388,16
----------	--------------	------------	---------------	-----------	---------------

Pago de Intereses Impagados de Periodos Anteriores

Interest Payment of unpaid interest from previous periods

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity Date

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

19,00%

Intereses Netos / Net Interest

16.02.2009 / 14.08.2017

38.524,131736 11.094.949,94

7.319,585029 2.108.040,47

31.204,546707 8.986.909,47

Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles

Payments not made due to insufficient Available Funds

(Euros)

Fecha vencimiento / Maturity date

Amortización de Principal / Principal Redemption

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

19,00%

Intereses Netos / Net Interest

14.11.2017

40.057,68 11.536.611,84

\* 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.