

FECHA DE PAGO / Payment date

27.12.2017

Período de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

25.09.2017
27.12.2017
93

(incluido) / (included)
(excluido) / (excluded)
días / days

Tipo de Interés Nominal aplicable
Applicable interest rate

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Class A Bonds	Class B Bonds	Class C Bonds
ES0312882006	ES0312882014	ES0312882022

0,000%*	0,170%	6,750%
---------	--------	--------

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	5.001		104		104
Número de Bonos / N.Bonds					
Nominal / Face value	(Euros)				
	7.309,83	36.556.459,83	27.315,79	2.840.842,16	100.000,00
					10.400.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest	(Euros)	0,000000	0,00	11,996184	1.247,60	1.743,750000	181.350,00
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	2,279275	237,04	331,312500	34.456,50
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	9,716909	1.010,56	1.412,437500	146.893,50

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption	(Euros)	7.309,83	36.556.459,83	27.315,79	2.840.842,16	100.000,00	10.400.000,00
---------------------------	---------	----------	---------------	-----------	--------------	------------	---------------

* 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 II.10 y V.4.2.1 del Folleto Informativo 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 II.10 and V.4.2.1 of the Prospectus do not provide for the possibility of a negative Nominal Interest Rate which might result in interest being payable by Bondholders to the Fund.