

FECHA DE PAGO / Payment date

17.11.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

17.08.2017

(incluido) / (included)

17.11.2017

(excluido) / (excluded)

92

días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds
ES0361794003	ES0361794011	ES0361794029	ES0361794037

Tipo de interes aplicable
Applicable interest rate

0,000%*	0,000%*	0,101%	0,511%
---------	---------	--------	--------

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	6.306		145		311		138
2.355,93	14.856.494,58	41.383,70	6.000.636,50	41.391,62	12.872.793,82	45.180,71	6.234.937,98

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	10,683637	3.322,61	59,000987	8.142,14
0,000000	0,00	0,000000	0,00	2,029891	631,30	11,210188	1.547,01
0,000000	0,00	0,000000	0,00	8,653746	2.691,31	47,790799	6.595,13

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

2.355,93	14.856.494,58	41.383,70	6.000.636,50	41.391,62	12.872.793,82	45.180,71	6.234.937,98
----------	---------------	-----------	--------------	-----------	---------------	-----------	--------------

* 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.