

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 17.04.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period
desde / From 17.01.2017 (incluido) / (included)
hasta / To 18.04.2017 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
ES0374306001	ES0374306019	ES0374306027

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	13.01.2017	-0,327%	-0,327%	-0,327%
Margen / Margin		0,180%	0,400%	0,950%
Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate		0,000%*	0,073%	0,623%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	
	9.091		285		124	
Número de Bonos / N.Bonds						
Nominal / Face value	(Euros) 15.278,79	138.899.479,89	31.996,94	9.119.127,90	31.990,49	3.966.820,76

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross	(Euros)	0,000000	0,00	5,904324	1.682,73	50,378801	6.246,97
Intereses Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	1,121822	319,72	9,571972	1.186,92
Intereses Neto / Net		0,000000	0,00	4,782502	1.363,01	40,806829	5.060,05

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption A determinar A determinar A determinar A determinar A determinar A determinar
To be determined To be determined To be determined To be determined To be determined To be determined

* 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.

C/ Lagasca, 120 -MADRID, SPAIN - Tel. (34) 91 411 84 67 - Fax (34) 91 411 84 68

info@edt-sg.com

www.edt-sg.com