

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

17.04.2018

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 17.01.2018 (incluido) / (included)
hasta / To 17.04.2018 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 90 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>
ES0374306001	ES0374306019	ES0374306027

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 Meses / 3 Months Euribor 15.01.2018 -0,329%
Margen / Margin 0,180%
Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate -0,149%

-0,329% -0,329% -0,329%
0,180% 0,400% 0,950%
-0,149% 0,071% 0,621%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate

0,000%* **0,071%** **0,621%**

Número de Bonos / N. Bonds

Nominal / Face value (Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>
	9.091		285		124
12.771,32	116.104.070,12	26.745,78	7.622.547,30	26.740,39	3.315.808,36

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest (Euros) 0,000000
Retención / Withholding tax 19,00% 0,000000
Intereses Netos / Net Interest 0,000000

0,00 4,747376 1.353,00 41,514455 5.147,79
0,00 0,902001 257,07 7,887746 978,08
0,00 3,845375 1.095,93 33,626709 4.169,71

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@edf-sg.com

www.edf-sg.com