

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*

17.10.2017

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / *From* 17.07.2017 (incluido) / *(included)*
hasta / *To* 17.10.2017 (excluido) / *(excluded)*
plazo / *Term* 92 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 / <i>3 Month Euribor</i>	13.07.2017	-0,331%	-0,331%	-0,331%
Margen / <i>Margin</i>		0,180%	0,400%	0,950%
Tipo de interés calculado / <i>Calculated interest rate</i>		-0,151%	0,069%	0,619%

Tipo de Interes Nominal aplicable / *Interest Rate*

0,000%*	0,069%	0,619%
---------	--------	--------

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
14.013,46	127.396.364,86	29.347,08	8.363.917,80	29.341,16	3.638.303,84

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / *Day count fraction* Act / 360

Intereses Brutos / <i>Gross Interest</i>	(Euros)	0,000000	0,00	5,174868	1.474,84	46,414455	5.755,39
Retención / <i>Withholding tax</i>	19,00%	0,000000	0,00	0,983225	280,22	8,818746	1.093,52
Neto / <i>Net</i>		0,000000	0,00	4,191643	1.194,62	37,595709	4.661,87

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