

**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

17.01.2020

Periodo de Interés /  
Interest accrual period

desde / From 17.10.2019 (incluido) / (included)  
hasta / To 17.01.2020 (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 92 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 Months Euribor 15.10.2019

Margen / Margin

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate

-0,418%	-0,418%	-0,418%
0,180%	0,400%	0,950%
<b>-0,238%</b>	<b>-0,018%</b>	<b>0,532%</b>

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate

<b>0,000%*</b>	<b>0,000%*</b>	<b>0,532%</b>
----------------	----------------	---------------

Número de Bonos / N. Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	9.091		285		124
9.524,14	86.583.956,74	19.969,34	5.691.261,90	20.799,36	2.579.120,64

**Liquidación de Intereses**

Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

(Euros)

19,00%

0,000000	0,00	0,000000	0,00	28,277885	3.506,46
0,000000	0,00	0,000000	0,00	5,372798	666,23
0,000000	0,00	0,000000	0,00	22,905087	2.840,23

**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

info@edt-sg.com

www.edt-sg.com