

**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** **17.07.2017**

**Periodo de Interés / Interest accrual period**  
desde / From **18.04.2017** (incluido) / (included)  
hasta / To **17.07.2017** (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>
<b>ES0374306001</b>	<b>ES0374306019</b>	<b>ES0374306027</b>

**Determinación Tipo Interés Nominal**

*Nominal Interest Rate Calculation*

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	11.04.2017	-0,332%	-0,332%	-0,332%
Margen / Margin		0,180%	0,400%	0,950%
<b>Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate</b>		<b>0,000%*</b>	<b>0,068%*</b>	<b>0,618%*</b>

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>
	<b>9.091</b>		<b>285</b>		<b>124</b>
<b>Número de Bonos / N.Bonds</b>					
<b>Nominal / Face value</b>	<b>(Euros)</b>	<b>14.711,94</b>	<b>133.746.246,54</b>	<b>30.809,84</b>	<b>8.780.804,40</b>
				<b>30.803,62</b>	<b>3.819.648,88</b>

**Liquidación de Intereses**

*Interest Payment*

Base / Day count fraction **Act / 360**

<b>Intereses Brutos / Gross</b>	<b>(Euros)</b>	<b>0,000000</b>	0,00	<b>5,237673</b>	1.492,74	<b>47,591593</b>	5.901,36
<b>Interés Retención / Withholding tax</b>	<b>19,00%</b>	<b>0,000000</b>	0,00	<b>0,995158</b>	283,62	<b>9,042403</b>	1.121,26
<b>Interés Neto / Net</b>		<b>0,000000</b>	0,00	<b>4,242515</b>	1.209,12	<b>38,549190</b>	4.780,10

**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