

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 17.01.2018

Periodo de Interés / Interest accrual period
desde / From 17.10.2017 (incluido) / (included)
hasta / To 17.01.2018 (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 / 3 Months Euribor	13.10.2017	-0,329%	-0,329%	-0,329%
Margen / Margin		0,180%	0,400%	0,950%
Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate		-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
13.394,87	121.772.763,17	28.051,62	7.994.711,70	28.045,96	3.477.699,04

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest (Euros)	0,000000	0,00	5,089811	1.450,60	44,508939	5.519,11
Retención / Withholding tax 19,00%	0,000000	0,00	0,967064	275,61	8,456698	1.048,63
Intereses Netos / Net Interest	0,000000	0,00	4,122747	1.174,99	36,052241	4.470,48

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