

## 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

25.08.2016

Periodo de Interés /  
Interest accrual period

desde / From 25.05.2016 (incluido) / (included)  
hasta / To 25.08.2016 (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 92 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds
ES0312886015	ES0312886023	ES0312886031	ES0312886049

Determinación Interés Nominal  
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	23.05.2016	-0,258%	-0,258%	-0,258%	-0,258%
Margen / Margin		0,180%	0,390%	0,780%	2,500%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,078%	0,132%	0,522%	2,242%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

	0,000%*	0,132%	0,522%	2,242%
--	---------	--------	--------	--------

Número de Bonos / N.Bonds  
Nominal / Face value

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	
	16.702		399		238		161	
(Euros)	20.241,43	338.072.363,86	38.849,97	15.501.138,03	38.845,89	9.245.321,82	38.856,00	6.255.816,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross	0,000000	0,00	13,105390	5.229,05	51,820417	12.333,26	222,627611	35.843,05
Interés Retención / Withholding tax	19,00%	0,00	2,490024	993,52	9,845879	2.343,32	42,299246	6.810,18
Interés Neto / Net	0,000000	0,00	10,615366	4.235,53	41,974538	9.989,94	180,328365	29.032,87

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined

A determinar / To be determined

A determinar / To be determined

A determinar / 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.

EUROPEA DE TITULIZACIÓN, S.A., S.G.F.T

C/Lagasca, 120 -MADRID, SPAIN - Tel. (34) 91 411 84 67 - Fax (34) 91 411 84 68

info@edt-sg.com

http://www.edt-sg.com/

**FECHA DE PAGO / Payment date**

**Periodo de Interés /** desde / From  
*Interest accrual period* hasta / To  
plazo / Term

**Determinación Interés Nominal**

*Nominal Interest Calculation*

**Euribor 3 meses / 3 Month Euribor** 23.05.2016

**Margen / Margin**

**Tipo de interés calculado / Calculated interest rate**

**Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate**

**Número de Bonos / N.Bonds**

**Nominal / Face value** (Euros)

**Liquidación de Intereses**

*Interest Payment*

(Euros)

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

**Intereses Brutos / Gross**

**Interés Retención / Withholding tax** **19,00%**

**Neto / Net**

**Amortización de Principal**

*Principal Redemption*

(Euros)

**Amortización / Redemption**

**\* El Tipo de Interés Nominal aplicable se ha fijado en el 0 posibilidad de un Tipo de Interés Nominal negativo que p**

**\* The applicable Nominal Interest Rate has been set at 0.00% negative Nominal Interest Rate which might result in interest |**

**EUROPEA DE TITULIZACIÓN, S.A., S.G.F.T**

**C/ Lagasca, 120 -MADRID, SPAIN - Tel. (34) 91 411 84 67**

**info@edt-sg.com**

**http://www.ed**