

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining interest rate and redemption applicable to the bonds

FECHA DE PAGO / Payment date

17.07.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

18.04.2017
17.07.2017
90

(incluido) / (included)
(excluido) / (excluded)
días / days

Bonos Serie A2(P)	Bonos Serie B(P)	Bonos Serie C(P)
<i>Class A2(P) Bonds</i>	<i>Class B(P) Bonds</i>	<i>Class C(P) Bonds</i>
ES0313814016	ES0313814024	ES0313814032

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

11.04.2017

-0,332%

-0,332%

-0,332%

Margen / Margin

0,110%

0,500%

0,950%

Tipo de interés calculado / Calculated interest

-0,222%

0,168%

0,618%

Tipo de interés aplicable / Interest rate

0,000%*

0,168%

0,618%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>
	6.560		153		71
Número de Bonos / N.Bonds					
Nominal / Face value	25.022,32	164.146.419,20	48.703,63	7.451.655,39	48.707,14
	(Euros)				3.458.206,94

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross

0,000000

0,00

20,455525

3.129,70

75,252531

5.342,93

Interés Retención / Withholding tax

19%

0,000000

0,00

3,886550

594,64

14,297981

1.015,16

Interés Neto / Net

0,000000

0,00

16,568975

2.535,06

60,954550

4.327,77

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

* 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.4.2.1.1 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.4.2.1.1 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

www.edt-sg.com

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining interest rate and redemption applicable to the bonds

FECHA DE PAGO / Payment date

17.07.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

18.04.2017 (incluido) / (included)
17.07.2017 (excluido) / (excluded)
90 días / days

Bonos Serie A2(T)	Bonos Serie B(T)	Bonos Serie C(T)
<i>Class A2(T) Bonds</i>	<i>Class B(T) Bonds</i>	<i>Class C(T) Bonds</i>
ES0313814057	ES0313814065	ES0313814073

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

11.04.2017

-0,332%

-0,332%

-0,332%

Margen / Margin

0,110%

0,500%

0,950%

Tipo de interés calculado / Calculated interest

-0,222%

0,168%

0,618%

Tipo de interés aplicable / Interest rate

0,000%*

0,168%

0,618%

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>
	2.442		172		70
31.419,74	76.727.005,08	63.515,64	10.924.690,08	63.521,46	4.446.502,20

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross

0,000000

0,00

26,676569

4.588,37

98,140656

6.869,85

Interés Retención / Withholding tax

19%

0,000000

0,00

5,068548

871,79

18,646725

1.305,27

Interés Neto / Net

0,000000

0,00

21,608021

3.716,58

79,493931

5.564,58

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

* 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.4.2.2.1 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.4.2.2.1 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

www.edt-sg.com