

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

21.11.2017

Período de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

21.08.2017 (incluido) / (included)
21.11.2017 (excluido) / (excluded)
92 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0313714018	ES0313714026	ES0313714034	ES0313714042	ES0313714059

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	17.08.2017	-0,329%	-0,329%	-0,329%	-0,329%	-0,329%
Margen / Margin		0,140%	0,300%	0,550%	2,250%	3,900%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,189%	-0,029%	0,221%	1,921%	3,571%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,221%	1,921%	3,571%

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	8.168		156		153		98		125
30.727,08	250.978.789,44	62.279,68	9.715.630,08	62.272,73	9.527.727,69	62.286,19	6.104.046,62	64.500,07	8.062.508,75

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act / 360

Intereses Brutos / Gross	0,000000	0,00	0,000000	0,00	35,170254	5,381,05	305,776748	29,966,12	588,620472	73,577,56
Interés Retención / Withholding tax	19,0%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	6,682348	1,022,40	58,097582	5,693,56	111,837890
Interés Neto / Net	0,000000	0,00	0,000000	0,00	28,487906	4,358,65	247,679166	24,272,56	476,782582	59,597,82

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	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	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 4.8 de la Nota de Valores y 3.4.6.2.1 del Módulo Adicional a la Nota de Valores 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 4.8 of the Securities Note and 3.4.6.2.1 of the Securities Note Building Block 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