

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

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Redemption

FECHA DE PAGO / Payment date

26.09.2016

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

27.06.2016
26.09.2016
91

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

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
ES0313547004	ES0313547012	ES0313547020

Determinación Interés Nominal Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 23.06.2016 -0,269%
Margen / Margin 0,210%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,059%
Tipo de interés aplicable / Interest rate 0,000%*

-0,269%	-0,269%	-0,269%
0,210%	0,550%	1,200%
-0,059%	0,281%	0,931%
0,000%*	0,281%	0,931%

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	4.718		130		52
19.812,74	93.476.507,32	41.155,14	5.350.168,20	40.766,88	2.119.877,76

Liquidación de Intereses Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act / 360

Intereses Brutos / Gross 0,000000 0,00
Interés Retención / Withholding tax 19,0% 0,000000 0,00
Interés Neto / Net 0,000000 0,00

29,232725 3.800,25 95,939190 4.988,84
5,554218 722,05 18,228446 947,88
23,678507 3.078,20 77,710744 4.040,96

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

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

www.edt-sg.com