

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
22.02.2019
Periodo de Interés / Interest accrual period

 desde / From
 hasta / To
 plazo / Term

22.11.2018 (incluido) / (included)
22.02.2019 (excluido) / (excluded)
 92 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie A3	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series A3 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0312872015	ES0312872023	ES0312872031	ES0312872049	ES0312872056	ES0312872064

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	20.11.2018	-0,316%	-0,316%	-0,316%	-0,316%	-0,316%	-0,316%
Margen / Margin		0,120%	0,190%	0,270%	0,500%	1,900%	4,000%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,196%	-0,126%	-0,046%	0,184%	1,584%	3,684%

Tipo de Interés Nominal aplicable
Applicable interest rate

0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,184%	1,584%	3,684%
----------------	----------------	----------------	---------------	---------------	---------------

Número de Bonos / N. Bonds		15.370	5.000	650	520	260	310						
Nominal / Face value	(Euros)	19.218,36	295.386.193,20	97.199,77	485.998.850,00	100.000,00	65.000.000,00	100.000,00	52.000.000,00	100.000,00	26.000.000,00	100.000,00	31.000.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction	Act / 360												
Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	47,022222	24.451,56	404,800000	105.248,00	941,466667	291.854,67
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	8,934222	4.645,80	76,912000	19.997,12	178,878667	55.452,39
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	38,088000	19.805,76	327,888000	85.250,88	762,588000	236.402,28

Amortización de Principal
Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption	(Euros)	A determinar / To be determined		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
----------------------------------	---------	---------------------------------	--	------	------	------	------	------	------	------	------	------	------

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles
Payments outstanding due to insufficient Available Funds

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date		24.02.2014 / 22.11.2018		22.08.2013 / 22.11.2018		24.11.2008 / 22.11.2018	
Intereses Brutos / Gross Interest		1.939,583334	1.008.583,34	10.120,161110	2.631.241,90	46.543,440771	14.428.466,61
Retención / Withholding tax	19,00%	368,520834	191.630,84	1.922,830610	499.935,95	8.843,253744	2.741.408,65
Intereses Netos / Net Interest		1.571,062500	816.952,50	8.197,330500	2.131.305,95	37.700,187027	11.687.057,96

* 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

info@edt-sg.com

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