

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

18.04.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

16.01.2017 (incluido) / (included)
18.04.2017 (excluido) / (excluded)
92 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 12.01.2017 -0,327%
Margen / Margin 0,110%
Tipo de interés calculado / Calculated interest -0,217%
Tipo de interés aplicable / Interest rate

-0,327%	-0,327%	-0,327%
0,110%	0,500%	0,950%
-0,217%	0,173%	0,623%
0,000%*	0,173%	0,623%

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value (Euros)

	6.560		153		71
	25.995,12	170.527.987,20	48.703,63	7.451.655,39	48.707,14
					3.458.206,94

Liquidación de Intereses
Interest Payment (Euros)

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

Intereses Brutos / Gross	0,000000	0,00	21,532416	3.294,46	77,547179	5.505,85
Intereses Retención / Withholding tax	0,000000	0,00	4,091159	625,95	14,733964	1.046,11
Intereses Neto / Net	0,000000	0,00	17,441257	2.668,51	62,813215	4.459,74

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

18.04.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

16.01.2017 (incluido) / (included)
18.04.2017 (excluido) / (excluded)
92 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

12.01.2017

-0,327%

-0,327%

-0,327%

Margen / Margin

0,110%

0,500%

0,950%

Tipo de interés calculado / Calculated interest

-0,217%

0,173%

0,623%

Tipo de interés aplicable / Interest rate

0,000%*

0,173%

0,623%

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
32.173,88	78.568.614,96	65.040,15	11.186.905,80	65.046,10	4.553.227,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross

0,000000

0,00

28,754973

4.945,86

103,560619

7.249,24

Interés Retención / Withholding tax

19%

0,000000

0,00

5,463445

939,71

19,676518

1.377,36

Interés Neto / Net

0,000000

0,00

23,291528

4.006,15

83,884101

5.871,88

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