

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		22.02.2017
Periodo de Interés / Interest accrual period	desde / From	22.11.2016 (incluido) / (included)
	hasta / To	22.02.2017 (excluido) / (excluded)
	plazo / Term	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 Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	18.11.2016	-0,313%	-0,313%	-0,313%	-0,313%	-0,313%	-0,313%
Margen / Margin		0,120%	0,190%	0,270%	0,500%	1,900%	4,000%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,193%	-0,123%	-0,043%	0,187%	1,587%	3,687%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,187%	1,587%	3,687%

Número de Bonos / N. Bonds		15.370	5.000	650	520	260	310						
Nominal / Face value	(Euros)	29.971,76	460.665.951,20	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

Base / Day count fraction	Act /	360											
Intereses Brutos / Gross Interest		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	47,788889	24.850,22	405,566667	105.447,33	942,233333	292.092,33	
Retención / Withholding tax	19,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	9,079889	4.721,54	77,057667	20.034,99	179,024333	55.497,54	
Neto / Net		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	38,709000	20.128,68	328,509000	85.412,34	763,209000	236.594,79	

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption	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	0,00
----------------------------------	--	-------------	------	------	------	------	------	------	------	------	------	------

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

Fecha de Vencimiento / Maturity date												
Intereses Brutos / Gross Interest												
Retención / Withholding tax	19,00%											
Neto / Net Interest												

* 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

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