

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

14.11.2016

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

12.08.2016
14.11.2016
94

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

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Class A Bonds	Class B Bonds	Class C Bonds
ES0313919005	ES0313919013	ES0313919021

Determinación Interés Nominal Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 10.08.2016 -0,297%

Margen / Margin 0,220%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,077%

Tipo de interes aplicable / Applicable interest rate

0,000%*

0,153%

0,903%

Número de Bonos / N. Bonds

Nominal / Face value (Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	9.876		215		159
12.280,82	121.285.378,32	20.759,55	4.463.303,25	100.000,00	15.900.000,00

Liquidación de Intereses Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360 (Euros)

Intereses Brutos / Gross

Interest Retención / Withholding tax 19,0%

Neto / Net

0,00	0,00	8,29	1.782,35	235,78	37.489,02
0,00	0,00	1,58	339,70	44,80	7.123,20
0,00	0,00	6,71	1.442,65	190,98	30.365,82

Amortización de Principal Principal Redemption

Amortización / Redemption

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

0,00

0,00

* 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 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 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