

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

16.01.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

17.10.2016 (incluido) / (included)
16.01.2017 (excluido) / (excluded)
91 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

13.10.2016

-0,311%

-0,311%

-0,311%

Margen / Margin

0,110%

0,500%

0,950%

Tipo de interés calculado / Calculated interest

-0,201%

0,189%

0,639%

Tipo de interés aplicable / Interest rate

0,000%*

0,189%

0,639%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>

Número de Bonos / N.Bonds

(Euros)

6.560

153

71

Nominal / Face value

26.967,34

176.905.750,40

50.525,14

7.730.346,42

50.528,78

3.587.543,38

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross

0,000000

0,00

24,138386

3.693,17

81,616612

5.794,78

Intereses Retención / Withholding tax

19%

0,000000

0,00

4,586293

701,70

15,507156

1.101,01

Intereses Neto / Net

0,000000

0,00

19,552093

2.991,47

66,109456

4.693,77

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

16.01.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

17.10.2016 (incluido) / (included)
16.01.2017 (excluido) / (excluded)
91 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 13.10.2016 -0,311%
Margen / Margin 0,110%
Tipo de interés calculado / Calculated interest -0,201%
Tipo de interés aplicable / Interest rate 0,000%*

-0,311%	-0,311%	-0,311%
0,110%	0,500%	0,950%
-0,201%	0,189%	0,639%
0,000%*	0,189%	0,639%

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
33.188,22	81.045.633,24	67.090,67	11.539.595,24	67.096,81	4.696.776,70

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest	0,000000	0,00	32,052568	5.513,04	108,378122	7.586,47
Retención / Withholding tax	19%	0,000000	0,00	6,089988	1.047,48	20,591843
Intereses Netos / Net Interest	0,000000	0,00	25,962580	4.465,56	87,786279	6.145,04

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