

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 /

desde / *From*

12.08.2016

(incluido) / *(included)*

Interest accrual period

hasta / *To*

14.11.2016

(excluido) / *(excluded)*

plazo / *Term*

94

días / *days*

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Class A Bonds</i>	<i>Class B Bonds</i>	<i>Class C Bonds</i>
ES0313920003	ES0313920011	ES0313920029

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / *3 Month Euribor*

10.08.2016

-0,297%

-0,297%

-0,297%

Margen / *Margin*

0,240%

0,450%

1,250%

Tipo de interés calculado / *Calculated interest rate*

-0,057%

0,153%

0,953%

Tipo de interes aplicable / *Interest rate*

0,000%*

0,153%

0,953%

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*

Nominal / *Face value*

(Euros)

6.841

95.529.502,66

149

4.328.198,19

110

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / *Day count fraction*

Act /

360

Intereses Brutos / *Gross*

0,00

0,00

11,60

1.728,40

72,27

7.949,70

Interés Retención / *Withholding tax*

19%

0,00

0,00

2,20

327,80

13,73

1.510,30

Intereses Neto / *Net*

0,00

0,00

9,40

1.400,60

58,54

6.439,40

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / *Redemption*

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

To be determined

To be determined

To be determined

To be determined

To be determined

To be determined

* 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