

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

22.08.2016

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From **23.05.2016** (incluido) / (included)
hasta / To **22.08.2016** (excluido) / (excluded)
plazo / Term 91 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
ES031287201€	ES031287202€	ES0312872031	ES031287204€	ES031287205€	ES0312872064

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	19.05.2016	-0,258%	-0,258%	-0,258%	-0,258%	-0,258%	-0,258%
Margen / Margin		0,120%	0,190%	0,270%	0,500%	1,900%	4,000%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,138%	-0,068%	0,012%	0,242%	1,642%	3,742%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,012%	0,242%	1,642%	3,742%

	Bono		Serie		Bono		Serie		Bono		Serie		Bono		Serie	
	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
Número de Bonos / N.Bonds		15.370	5.000	650	520	260	310									
Nominal / Face value	(Euros)	33.040,16	507.827.259,20	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		0,000000	0,00	0,000000	0,00	3,033333	1.971,67	61,172222	31.809,56	415,061111	107.915,8€	945,894444	293.227,28			
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,576333	374,62	11,622722	6.043,82	78,861611	20.504,02	179,719944	55.713,18			
Neto / Net		0,000000	0,00	0,000000	0,00	2,457000	1.597,05	49,549500	25.765,74	336,199500	87.411,87	766,174500	237.514,10			

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	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/