

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

14.08.2017

Periodo de Interés /

Interest accrual period

desde / From

12.05.2017

(incluido) / (included)

hasta / To

14.08.2017

(excluido) / (excluded)

plazo / Term

94

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

10.05.2017

-0,329%

-0,329%

-0,329%

Margen / Margin

0,220%

0,450%

1,200%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,109%

0,121%

0,871%

Tipo de interes aplicable / Applicable interest rate

0,000%*

0,121%

0,871%

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
10.582,36	104.511.387,36	17.888,47	3.846.021,05	100.000,00	15.900.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act / 360

Intereses Brutos / Gross

0,000000

0,00

5,651763

1.215,13

227,427778

36.161,02

Interés Retención / Withholding tax

19,0%

0,000000

0,00

1,073835

230,87

43,211278

6.870,59

Neto / Net

0,000000

0,00

4,577928

984,26

184,216500

29.290,43

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

0,00

0,00

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