

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*

16.08.2018

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / *From*
hasta / *To*
plazo / *Term*

16.05.2018 (incluido) / *(included)*
16.08.2018 (excluido) / *(excluded)*
92 días / *days*

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / *3 Month Euribor* 11/05/2018 -0,327%
Margen / *Margin* 0,220%
Tipo de interés calculado / *Calculated interest rate* -0,107%
Tipo de interés aplicable / *Applicable interest rate* 0,000%*

Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
<i>Series B Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series D Bonds</i>	<i>Series E Bonds</i>
ES0313716021	ES0313716039	ES0313716047	ES0313716054

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	
	162		275		107		146	
Número de Bonos / <i>N. Bonds</i>								
Nominal / <i>Face value</i>	(Euros) 79.231,60	12.835.519,20	100.000,00	27.500.000,00	100.000,00	10.700.000,00	100.000,00	14.600.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / *Day count fraction* Act / 360 (Euros)
Intereses Brutos / *Gross Interest* 0,000000 0,00 49,322222 13.563,61 453,100000 48.481,70 913,100000 133.312,60
Retención / *Withholding tax* 19% 0,000000 0,00 9,371222 2.577,09 86,089000 9.211,52 173,489000 25.329,39
Intereses Netos / *Net Interest* 0,000000 0,00 39,951000 10.986,52 367,011000 39.270,18 739,611000 107.983,21

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*

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles

Payments outstanding due to insufficient Available Funds

Fecha de Vencimiento / *Maturity date* 16.11.2009-16.05.2018
Intereses Brutos / *Gross Interest* 37.565.963890 5.484.630,73
Retención / *Withholding tax* 19% 7.137.533140 1.042.079,86
Intereses Netos / *Net Interest* 30.428.430750 4.442.550,87

* 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 www.edt-sg.com