

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 18.01.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period desde / From **18.10.2016** (incluido) / (included) hasta / To **18.01.2017** (excluido) / (excluded) plazo / Term 92 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0374273003	ES0374273011	ES0374273029	ES0374273037	ES0374273045

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	14/10/2016	-0,311%	-0,311%	-0,311%	-0,311%	-0,311%
Margen / Margin		0,170%	0,340%	0,550%	2,000%	4,000%
Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate		0,000%*	0,029%	0,239%	1,689%	3,689%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	
	10.081		363		80		128		128	
Número de Bonos / N.Bonds										
Nominal / Face value (Euros)	19.668,28	198.275.930,68	100.000,00	36.300.000,00	100.000,00	8.000.000,00	100.000,00	12.800.000,00	100.000,00	12.800.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	7,411111	2.690,23	61,077778	4.886,22	431,633333	55.249,07	942,744444	120.671,29
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	1,408111	511,14	11,604778	928,38	82,010333	10.497,32	179,121444	22.927,54
Neto / Net		0,000000	0,00	6,003000	2.179,09	49,473000	3.957,84	349,623000	44.751,75	763,623000	97.743,75

Amortización de Principal
Principal Redemption

(Euros)

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
----------------------------------	--	------	------	------	------	------	------	------	------	------

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles
Payments outstanding due to insufficient Available Funds (Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax 19,00%

Neto / Net
19.04.2016 / 18.10.2016

1.968.554184 251.974,95

374.025295 47.875,25

1.594.528889 204.099,70

* 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

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