

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

24.11.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

24.08.2017 (incluido) / (included)
24.11.2017 (excluido) / (excluded)
92 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>
ES0382744003	ES0382744011	ES0382744029

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

22.08.2017

-0,328%

-0,328%

-0,328%

Margen / Margin

0,185%

0,530%

1,050%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate

-0,143%

0,202%

0,722%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate

0,000%*

0,202%

0,722%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>
	4.543		118		59
Número de Bonos / N.Bonds					
Nominal / Face value	(Euros)	10.877,47	49.416.346,21	22.636,90	2.671.154,20
				22.636,90	1.335.577,10

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross

(Euros)

0,000000

0,00

11,685671

1.378,91

41,767596

2.464,29

Interés Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000

0,00

2,220277

261,99

7,935843

468,21

Interés Neto / Net

0,000000

0,00

9,465394

1.116,92

33,831753

1.996,08

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

A determinar
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.4.2.1 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.4.2.1 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