

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

17.01.2018

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

17.10.2017 (incluido) / (included)
17.01.2018 (excluido) / (excluded)
92 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0313270011	ES0313270029	ES0313270037	ES0313270045	ES0313270052

Determinación Interés Nominal Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	13.10.2017	-0,329%	-0,329%	-0,329%	-0,329%	-0,329%
Margen / Margin		0,150%	0,270%	0,480%	2,250%	3,900%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,179%	-0,059%	0,151%	1,921%	3,571%
Tipo de interes aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,151%	1,921%	3,571%

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	13.974		224		241		205		206
37.770,87	527.810.137,38	74.569,25	16.703.512,00	74.583,48	17.974.618,68	74.575,41	15.287.959,05	80.936,89	16.672.999,34

Liquidación de Intereses Interest Payment

Base / Day count fraction

Act /

(Euros)

360

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

19,00%

0,000000	0,00	0,000000	0,00	28,780936	6.936,21	366,107260	75.051,99	738,621065	152.155,94
0,000000	0,00	0,000000	0,00	5,468378	1.317,88	69,560379	14.259,88	140,338002	28.909,63
0,000000	0,00	0,000000	0,00	23,312558	5.618,33	296,546881	60.792,11	598,283063	123.246,31

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	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 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