

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

25.05.2018

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From 26.02.2018 (incluido) / (included)
hasta / To 25.05.2018 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 88 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E	Bonos Serie F
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds	Series F Bonds
ES0361795000	ES0361795018	ES0361795026	ES0361795034	ES0361795042	ES0361795059

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor
Margen / Margin

22/02/2018	-0,328%	-0,328%	-0,328%	-0,328%	-0,328%	-0,328%
	0,150%	0,240%	0,340%	0,500%	1,850%	4,000%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate
Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate

	-0,178%	-0,068%	0,012%	0,172%	1,522%	3,672%
	0,000% *	0,000% *	0,012%	0,172%	1,522%	3,672%

Número de Bonos / N. Bonds
Nominal / Face value

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	
	7.544		132		104		88		132		92	
(Euros)	12.047,55	90.886.717,20	29.619,49	3.909.772,68	29.619,49	3.080.426,96	29.619,49	2.606.515,12	100.000,00	13.200.000,00	54.347,83	5.000.000,36

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / Day count fraction Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax
Intereses Netos / Net Interest

(Euros)	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,868838	90,36	12,453350	1,095,89	372,044444	49,109,87	487,826122	44,880,00
19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,165079	17,17	2,366137	208,22	70,688444	9,330,87	92,686963	8,527,20
	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,703759	73,19	10,087213	887,67	301,356000	39,779,00	395,139159	36,352,80

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

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles
Intereses Impagados Periodos Anteriores

Payments outstanding due to insufficient Available Funds
Unpaid Interest from previous periods

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity Date

Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax
Intereses Netos / Net Interest

19%

26.02.2018

460,543853	42.370,03
87,503332	8.050,31
373,040521	34.319,72

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles
Intereses por Aplazamiento de Intereses Impagados

Payments outstanding due to insufficient Available Funds
Interest Payment of deferred unpaid interest

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity Date

Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax
Intereses Netos / Net Interest

19%

26.02.2018

4,834130	444,74
0,918485	84,50
3,915645	360,24

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