

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Redemption

FECHA DE PAGO / Payment date

15.01.2018

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

16.10.2017 (incluido) / (included)
15.01.2018 (excluido) / (excluded)
91 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie A3	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D
Serie A2 Bonds	Serie A3 Bonds	Serie B Bonds	Serie C Bonds	Serie D Bonds
ES0345672010	ES0345672028	ES0345672036	ES0345672044	ES0345672051

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 11.10.2017 -0,329%
Margen / Margin 0,130%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,199%
Tipo de interés Nominal aplicable / Applicable interest rate 0,000%*

-0,329%	-0,329%	-0,329%	-0,329%	-0,329%
0,130%	0,160%	0,260%	0,500%	4,500%
-0,199%	-0,169%	-0,069%	0,171%	4,171%
0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,171%	4,171%

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
	10.832	2.000	528	640	280				
24.771,60	268.325.971,20	41.692,43	83.384.860,00	100.000,00	52.800.000,00	100.000,00	64.000.000,00	100.000,00	28.000.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax 19%
Intereses Netos / Net Interest

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	43,225000	27.664,00	1.054,336111	295.214,11
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	8,212750	5.256,16	200,323861	56.090,68
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	35,012250	22.407,84	854,012250	239.123,43

Amortización de Principal
Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

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 no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles
Payments not made due to insufficient Available Funds

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date
Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax 19%
Intereses Netos / Net Interest

	15.10.2010-16.10.2017	15.01.2010-16.10.2017	15.01.2009-16.10.2017
Intereses Brutos / Gross Interest	4.480,750000	2.365.836,00	7.074,749757
Retención / Withholding tax	851,342500	449.508,84	1.344,202453
Intereses Netos / Net Interest	3.629,407500	1.916.327,16	5.730,547304

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 19%
Intereses Netos / Net Interest

	15.10.2010-16.10.2017	15.01.2010-16.10.2017	15.01.2009-16.10.2017
Intereses Brutos / Gross Interest	93,927462	49.593,70	239,209984
Retención / Withholding tax	17,846218	9.422,80	45,449897
Intereses Netos / Net Interest	76,081244	40.170,90	193,760087

* 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 3.4.6.1 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 3.4.6.1 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.c www.edt-sg.com