

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*

13.02.2017

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / *From*
hasta / *To*
plazo / *Term*

14.11.2016
13.02.2017
91

(incluido) / *(included)*
(excluido) / *(excluded)*
días / *days*

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Class A Bonds</i>	<i>Class B Bonds</i>	<i>Class C Bonds</i>
ES0313919005	ES0313919013	ES0313919021

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / *3 Month Euribor*

10.11.2016

-0,312%

-0,312%

-0,312%

Margen / *Margin*

0,220%

0,450%

1,200%

Tipo de interés calculado / *Calculated interest rate*

-0,092%

0,138%

0,888%

Tipo de interés aplicable / *Applicable interest rate*

0,000%*

0,138%

0,888%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>
	9.876		215		159
Número de Bonos / <i>N.Bonds</i>					
Nominal / <i>Face value</i>	(Euros)				
	11.754,10	116.083.491,60	19.869,18	4.271.873,70	100.000,00
					15.900.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / *Day count fraction*

Act. 360

Intereses Brutos / *Gross*

0,00

0,00

6,93

1.489,95

224,47

35.690,73

Interés Retención / *Withholding tax* 19,0%

0,00

0,00

1,32

283,80

42,65

6.781,35

Neto / *Net*

0,00

0,00

5,61

1.206,15

181,82

28.909,38

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / *Redemption*

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

0,00

0,00

To be determined

To be determined

To be determined

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 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 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