

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*

16.11.2017

Periodo de Interés /
Interest accrual period

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

16.08.2017 (incluido) / *(included)*
16.11.2017 (excluido) / *(excluded)*
92 días / *days*

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
<i>Series A2 Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series D Bonds</i>	<i>Series E Bonds</i>
ES0313716013	ES0313716021	ES0313716039	ES0313716047	ES0313716054

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / <i>3 Month Euribor</i>	11/08/2017	-0,329%	-0,329%	-0,329%	-0,329%	-0,329%
Margen / <i>Margin</i>		0,120%	0,220%	0,520%	2,100%	3,900%
Tipo de interés calculado / <i>Calculated interest rate</i>		-0,209%	-0,109%	0,191%	1,771%	3,571%
Tipo de interés aplicable / <i>Interest rate</i>		0,000%*	0,000%*	0,191%	1,771%	3,571%

Número de Bonos / <i>N.Bonds</i>	Serie		Serie		Serie		Serie		Serie	
<i>Nominal / Face value</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>
(Euros)	1.378,84	6.820	100.000,00	162	100.000,00	275	100.000,00	107	100.000,00	146
		9.403.688,80		16.200.000,00		27.500.000,00		10.700.000,00		14.600.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / <i>Day count fraction</i>	Act /										
	360										
Intereses Brutos / <i>Gross Interest</i>		0,000000	0,00	0,000000	0,00	48,811111	13.423,06	452,588889	48.427,01	912,588889	133.237,98
Retención / <i>Withholding tax</i>	19%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	9,274111	2.550,38	85,991889	9.201,13	173,391889	25.315,22
Neto / <i>Net</i>		0,000000	0,00	0,000000	0,00	39,537000	10.872,68	366,597000	39.225,88	739,197000	107.922,76

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / <i>Redemption</i>	A determinar / <i>To be determined</i>	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
----------------------------------	--	------	------	------	------	------	------	------	------	------

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles

Payments outstanding due to insufficient Available Funds

Fecha de Vencimiento / <i>Maturity date</i>	16.11.2009-16.08.2017											
Interés Brutos / <i>Gross Interest</i>	34.857,708334		5.089.225,41		6.622,964584		966.952,84		28.234,743750		4.122.272,57	
Retención / <i>Withholding tax</i>												
Neto / <i>Net Interest</i>												

* 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