

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
18.10.2017
Periodo de Interés / Interest accrual period

 desde / From **18.07.2017** (incluido) / (included)
 hasta / To **18.10.2017** (excluido) / (excluded)
 plazo / Term **92** días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
<i>Serie A Bonds</i>	<i>Serie B Bonds</i>	<i>Serie C Bonds</i>	<i>Serie D Bonds</i>	<i>Serie E Bonds</i>
ES0374273003	ES0374273011	ES0374273029	ES0374273037	ES0374273045

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	14/07/2017	-0,331%	-0,331%	-0,331%	-0,331%	-0,331%
Margen / Margin		0,170%	0,340%	0,550%	2,000%	4,000%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,161%	0,009%	0,219%	1,669%	3,669%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

0,000%*	0,009%	0,219%	1,669%	3,669%
----------------	---------------	---------------	---------------	---------------

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
<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>	
	10.081		363		80		128		128	
Número de Bonos / N.Bonds										
Nominal / Face value	19.463,19	196.208.418,39	42.805,81	15.538.509,03	42.801,57	3.424.125,60	100.000,00	12.800.000,00	49.931,25	6.391.200,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment
(Euros)
Base / Day count fraction
Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	0,984534	357,39	23,954612	1.916,37	426,522222	54.594,84	468,172044	59.926,02
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,187061	67,90	4,551376	364,11	81,039222	10.373,02	88,952688	11.385,94
Neto / Net		0,000000	0,00	0,797473	289,49	19,403236	1.552,26	345,483000	44.221,82	379,219356	48.540,08

Amortización de Principal
Principal Redemption
(Euros)

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

* 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

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