

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
24.08.2016
Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From **24.05.2016** (incluido) / (included)
hasta / To **24.08.2016** (excluido) / (excluded)
plazo / Term 92 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>
ES0382744003	ES0382744011	ES0382744029

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

20.05.2016

-0,258%

-0,258%

-0,258%

Margen / Margin

0,185%

0,530%

1,050%

Tipo de Interés Nominal calculado / Interest Rate

-0,073%

0,272%

0,792%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate
0,000%*
0,272%
0,792%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>

Número de Bonos / N.Bonds

(Euros)

	4.543		118		59	
Nominal / Face value	14.231,43	64.653.386,49	29.616,76	3.494.777,68	29.616,76	1.747.388,84

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / Day count fraction

Act /

360
Intereses Brutos / Gross

(Euros)

0,000000

0,00

20,586939

2.429,26

59,944322

3.536,71

Interés Retención / Withholding tax
19,00%
0,000000

0,00

3,911518

461,56

11,389421

671,98

Neto / Net
0,000000

0,00

16,675421

1.967,70

48,554901

2.864,73

Amortización de Principal
Principal Redemption
Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar
<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</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 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