

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

Determining interest rate and redemption applicable to the bonds

FECHA DE PAGO / Payment date

17.10.2016

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

18.07.2016 (incluido) / (included)
17.10.2016 (excluido) / (excluded)
91 días / days

Bonos Serie A2(P)	Bonos Serie B(P)	Bonos Serie C(P)
<i>Class A2(P) Bonds</i>	<i>Class B(P) Bonds</i>	<i>Class C(P) Bonds</i>
ES0313814016	ES0313814024	ES0313814032

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

14.07.2016

-0,295%

-0,295%

-0,295%

Margen / Margin

0,110%

0,500%

0,950%

Tipo de interés calculado / Calculated interest

-0,185%

0,205%

0,655%

Tipo de interés aplicable / Interest rate

0,000%*

0,205%

0,655%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>
	6.560		153		71
Número de Bonos / N.Bonds					
Nominal / Face value (Euros)	27.710,37	181.780.027,20	51.917,26	7.943.340,78	51.921,00
				3.686.391,00	

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross

0,000000

0,00

26,903236

4.116,20

85,965311

6.103,54

Interés Retención / Withholding tax

19%

0,000000

0,00

5,111615

782,08

16,333409

1.159,67

Interés Neto / Net

0,000000

0,00

21,791621

3.334,12

69,631902

4.943,87

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

* 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.4.2.1.1 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.4.2.1.1 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

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

Determining interest rate and redemption applicable to the bonds

FECHA DE PAGO / Payment date

17.10.2016

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

18.07.2016 (incluido) / (included)
17.10.2016 (excluido) / (excluded)
91 días / days

Bonos Serie A2(T)	Bonos Serie B(T)	Bonos Serie C(T)
<i>Class A2(T) Bonds</i>	<i>Class B(T) Bonds</i>	<i>Class C(T) Bonds</i>
ES0313814057	ES0313814065	ES0313814073

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 14.07.2016
Margen / Margin
Tipo de interés calculado / Calculated interest
Tipo de interés aplicable / Interest rate

-0,295%	-0,295%	-0,295%
0,110%	0,500%	0,950%
-0,185%	0,205%	0,655%
0,000%*	0,205%	0,655%

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>
	2.442		172		70
33.950,36	82.906.779,12	68.631,33	11.804.588,76	68.637,62	4.804.633,40

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross	0,000000	0,00	35,564374	6.117,07	113,642926	7.955,00
Interés Retención / Withholding tax	19%	0,000000	0,00	6,757231	1.162,24	21,592156
Interés Neto / Net		0,000000	0,00	28,807143	4.954,83	92,050770

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar A determinar A determinar A determinar A determinar A determinar

* 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.4.2.2.1 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.4.2.2.1 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