

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

19.02.2018

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 20.11.2017 (incluido) / (included)
hasta / To 19.02.2018 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie A3(G)	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series A3(G) Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0313273015	ES0313273023	ES0313273031	ES0313273049	ES0313273056	ES0313273064

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	16.11.2017	-0,329%	-0,329%	-0,329%	-0,329%	-0,329%	-0,329%
Margen / Margin		0,200%	0,020%	0,350%	0,900%	1,800%	3,900%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,129%	-0,309%	0,021%	0,571%	1,471%	3,571%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,021%	0,571%	1,471%	3,571%

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	2.889	912	231	60	108	174					
5.144,05	14.861.160,45	36.950,70	33.699.038,40	100.000,00	23.100.000,00	100.000,00	6.000.000,00	100.000,00	10.800.000,00	100.000,00	17.400.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax
Intereses Netos / Net Interest

19,00%

0,000000	0,00	0,000000	0,00	5,308333	1.226,22	144,336111	8.660,17	371,836111	40.158,30	902,669444	157.064,48
0,000000	0,00	0,000000	0,00	1,008583	232,98	27,423861	1.645,43	70,648861	7.630,08	171,507194	29.842,25
0,000000	0,00	0,000000	0,00	4,299750	993,24	116,912250	7.014,74	301,187250	32.528,22	731,162250	127.222,23

Amortización de Principal
Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determine A determinar / To be determin 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

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax
Intereses Netos / Net Interest

19,00%

18/08/2009 - 20/11/2017

37.118,961110 6.458.699,22
7.052,602610 1.227.152,84
30.066,358500 5.231.546,38

* 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