

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS
Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Amortisation

FECHA DE PAGO / *Payment date*

17.10.2017

Periodo de Interés /
Interest accrual period

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

17.07.2017 (incluido) / *(included)*
17.10.2017 (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 C Bonds</i>	<i>Series D Bonds</i>	<i>Series E Bonds</i>
ES0313270011	ES0313270029	ES0313270037	ES0313270045	ES0313270052

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / *3 Month Euribor* 13.07.2017 -0,331%
Margen / *Margin* 0,150%
Tipo de interés calculado / *Calculated interest rate* -0,181%

Tipo de interés aplicable / *Applicable interest rate*

0,000%* 0,000%* 0,149% 1,919% 3,569%

Número de Bonos / *N.Bonds*
Nominal / *Face value*

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>
	13.974		224		241		205		206
38.713,95	540.988.737,30	76.431,13	17.120.573,12	76.445,72	18.423.418,52	76.437,45	15.669.677,25	85.049,58	17.520.213,48

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / *Day count fraction* Act / 360

Intereses Brutos / *Gross* 0,000000
Interés Retención / *Withholding tax* 19,0% 0,000000
Neto / *Net* 0,000000

0,000000 0,00 0,000000 0,00 29,108831 7.015,23 374,857748 76.845,84 775,718319 159.797,97
0,000000 0,00 0,000000 0,00 5,530678 1.332,89 71,222972 14.600,71 147,386481 30.361,62
0,000000 0,00 0,000000 0,00 23,578153 5.682,34 303,634776 62.245,13 628,331838 129.436,35

Amortización de Principal
Principal Redemption

(Euros)

Amortización / *Redemption*

A determinar A determinar A determinar A determinar A determinar A determinar A determinar A determinar A determinar A determinar
To be determined To be determined To be determined To be determined To be determined To be determined To be determined To be determined To be determined To be determined

* 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