

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

FECHA DE PAGO / Payment date

21.09.2016

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 21.06.2016 (incluido) / (included)
hasta / To 21.09.2016 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 92 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0313529010	ES0313529028	ES0313529036	ES0313529044	ES0313529051

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	17.06.2016	-0,265%	-0,265%	-0,265%	-0,265%	-0,265%
Margen / Margin		0,160%	0,290%	0,700%	2,000%	3,900%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,105%	0,025%	0,435%	1,735%	3,635%
Tipo de interés aplicable / Interest rate		0,000%*	0,025%	0,435%	1,735%	3,635%

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	
	15.754		207		224		191		224	
(Euros)	30.757,25	484.549.716,50	60.818,22	12.589.371,54	60.820,02	13.623.684,48	60.825,88	11.617.743,08	60.633,46	13.581.895,04

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / Day count fraction	Act /	360									
Intereses Brutos / Gross		0,000000	0,00	3,885609	804,32	67,611589	15.145,00	269,695193	51.511,78	563,251158	126.168,26
Interés Retención / Withholding tax	19%	0,000000	0,00	0,738266	152,82	12,846202	2.877,55	51,242087	9.787,24	107,017720	23.971,97
Interés Neto / Net		0,000000	0,00	3,147343	651,50	54,765387	12.267,45	218,453106	41.724,54	456,233438	102.196,29

Amortización de Principal
Principal Redemption

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 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