

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

27.08.2018

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From 25.05.2018 (incluido) / (included)
hasta / To 27.08.2018 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 94 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E	Bonos Serie F
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds	Series F Bonds
ES0361795000	ES0361795018	ES0361795026	ES0361795034	ES0361795042	ES0361795059

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor
Margen / Margin

23/05/2018 -0,323% -0,323% -0,323% -0,323% -0,323% -0,323%
0,150% 0,240% 0,340% 0,500% 1,850% 4,000%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate
Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate

-0,173% -0,063% 0,017% 0,177% 1,527% 3,677%
0,000% **0,000%** **0,017%** **0,177%** **1,527%** **3,677%**

Número de Bonos / N. Bonds
Nominal / Face value

(Euros) 11.549,82 87.131.842,08 27.348,13 3.609.953,16 27.348,13 2.844.205,52 29.619,49 2.606.515,12 100.000,00 13.200.000,00 54.347,83 5.000.000,36

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / Day count fraction Act /

360

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

(Euros) 0,000000 0,00 0,000000 0,00 1,213953 126,25 13,689141 1.204,64 398,716667 52.630,60 521,796535 48.005,28
19,00% 0,000000 0,00 0,000000 0,00 0,230651 23,99 2,609937 228,88 75,756167 9.999,81 99,141342 9.121,00
0,000000 0,00 0,000000 0,00 0,983302 102,26 11,088204 975,76 322,960500 42.630,79 422,655193 38.884,28

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros) A determinar / To Be Determined A determinar / To Be Determined A determinar / To Be Determined A determinar / To Be Determined A determinar / To Be Determined A determinar / 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