

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

15.09.2016

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

15.06.2016 (incluido)/(included)
15.09.2016 (excluido)/(excluded)
92 días/days

Determinación Tipo de Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 13.06.2016 -0,263%
Margen / Margin 0,250%
Tipo de Interés Nominal calculado / Interest Rate -0,013%
Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate **0,000%***

Bonos Serie A1	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A1 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
ES0358284000	ES0358284026	ES0358284034

-0,263%	-0,263%	-0,263%
0,250%	0,650%	1,450%
-0,013%	0,387%	1,187%
0,000%*	0,387%	1,187%

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	5.668		188		94
17.757,75	100.650.927,00	31.458,52	5.914.201,76	31.458,52	2.957.100,88

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction Act / **360**

Intereses Brutos / Gross (Euros)	0,00	0,00	31,11	5.848,68	95,43	8.970,42
Interés Retención / Withholding tax 19,00%	0,00	0,00	5,91	1.111,08	18,13	1.704,22
Interés Neto / Net	0,00	0,00	25,20	4.737,60	77,30	7.266,20

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption (Euros) **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 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 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