

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 24.11.2016

Periodo de Interés / Interest accrual period
desde / From **24.08.2016** (incluido / included)
hasta / To **24.11.2016** (excluido / excluded)
plazo / Term 92 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
ES0382744003	ES0382744011	ES0382744029

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	22.08.2016	-0,299%	-0,299%	-0,299%
Margen / Margin		0,185%	0,530%	1,050%
Tipo de Interés Nominal calculado / Interest Rate		-0,114%	0,231%	0,751%
Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate		0,000%*	0,231%	0,751%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class

Número de Bonos / N. Bonds
Nominal / Face value (Euros)

	4.543	118	59
13.532,63	61.478.738,09	28.162,51	3.323.176,18
28.162,51	1.661.588,09		

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross (Euros)	0,000000	0,00	16,625268	1,961,78	54,050115	3,188,96
Interest Retención / Withholding tax 19,00%	0,000000	0,00	3,158801	372,74	10,269522	605,90
Neto / Net	0,000000	0,00	13,466467	1.589,04	43,780593	2.583,06

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption (Euros)

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

* 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