

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

27.12.2016

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From 26.09.2016 (incluido) / (included)
hasta / To 27.12.2016 (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
ES0361796016	ES0361796024	ES0361796032	ES0361796040	ES0361796057

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 22.09.2016

Margen / Margin

Tipo de Interés Nominal calculado / Interest Rate

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

-0,301%	-0,301%	-0,301%	-0,301%	-0,301%
0,150%	0,190%	0,290%	0,500%	4,000%
-0,151%	-0,111%	-0,011%	0,199%	3,699%
0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,199%	3,699%

Número de Bonos / N. Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	
	6.680		132		116		72		100	
	26.245,91	175.322.678,80	100.000,00	13.200.000,00	100.000,00	11.600.000,00	100.000,00	7.200.000,00	100.000,00	10.000.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

(Euros)

Retención / Withholding tax

Neto / Net

19,00%

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	50,855556	3.661,60	945,300000	94.530,00
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	9,662556	695,70	179,607000	17.960,70
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	41,193000	2.965,90	765,693000	76.569,30

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar / To be determined

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

* 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