

## 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

17.10.2016

Periodo de Interés /  
Interest accrual period

desde / From  
hasta / To  
plazo / Term

18.07.2016 (incluido) / (included)  
17.10.2016 (excluido) / (excluded)  
91 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
ES0313270011	ES0313270029	ES0313270037	ES0313270045	ES0313270052

### Determinación Interés Nominal Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	14/07/2016	-0,295%	-0,295%	-0,295%	-0,295%	-0,295%
Margen / Margin		0,150%	0,270%	0,480%	2,250%	3,900%
Tipo de interes calculado / Calculated interest rate		-0,145%	-0,025%	0,185%	1,955%	3,605%
Tipo de interes aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,185%	1,955%	3,605%

Número de Bonos / N. Bonds Nominal / Face value	(Euros)	Bono Serie	Bono Serie	Bono Serie	Bono Serie	Bono Serie	Bono Serie	Bono Serie	Bono Serie		
		Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series		
			13.974		224		241		205		
		42.892,88	599.385.105,12	84.681,39	18.968.631,36	84.697,57	20.412.114,37	84.688,39	17.361.119,95	96.894,73	19.960.314,38

### Liquidación de Intereses Interest Payment

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest	0,000000	0,00	0,000000	0,00	39,607878	9.545,50	418,513556	85.795,28	882,966685	181.891,14
Retención / Withholding tax Neto / Net	19,0%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	7,525497	1.813,64	79,517576	16.301,10	167,763670
		0,000000	0,00	0,000000	0,00	32,082381	7.731,86	338,995980	69.494,18	715,203015

### Amortización de Principal Principal Redemption

Amortización / Redemption

A determinar A determinar A determinar A determinar A determinar A determinar A determinar A determinar 0,00 0,00  
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 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