

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
22.08.2018
Periodo de Interés / Interest accrual period

 desde / From
 hasta / To
 plazo / Term

22.05.2018 (incluido) / (included)
22.08.2018 (excluido) / (excluded)
 92 días / days

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation
Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 18.05.2018 -0,326%
Margen / Margin 0,120%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,206%

Bonos Serie A2	Bonos Serie A3	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series A3 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0312872015	ES0312872023	ES0312872031	ES0312872049	ES0312872056	ES0312872064

Tipo de Interés Nominal aplicable
Applicable interest rate

0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,174%	1,574%	3,674%
---------	---------	---------	--------	--------	--------

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

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	15.370		5.000		650		520		260		310
21.738,90	334.126.893,00	97.199,77	485.998.850,00	100.000,00	65.000.000,00	100.000,00	52.000.000,00	100.000,00	26.000.000,00	100.000,00	31.000.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment (Euros)

Base / Day count fraction Act / 360
Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax 19,00%
Intereses Netos / Net Interest

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	44,466667	23.122,67	402,244444	104.583,56	938,911111	291.062,44
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	8,448667	4.393,31	76,426444	19.870,88	178,393111	55.301,86
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	36,018000	18.729,36	325,818000	84.712,68	760,518000	235.760,58

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

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles
Payments outstanding due to insufficient Available Funds (Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date
Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax 19,00%
Intereses Netos / Net Interest

24.02.2014 / 22.05.2018		22.08.2013 / 22.05.2018		24.11.2008 / 22.05.2018	
1.848,861111	961.407,78	9.313,883333	2.421.609,67	44.663,829660	13.845.787,17
351,283611	182.667,48	1.769,637833	460.105,82	8.486,127633	2.630.699,56
1.497,577500	778.740,30	7.544,245500	1.961.503,85	36.177,702027	11.215.087,61

* 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

http://www.edt-sg.com/