

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*

18.10.2018

Periodo de Interés / *Interest accrual period*
desde / *From*
hasta / *To*
plazo / *Term*

18.07.2018 (incluido) / *(included)*
18.10.2018 (excluido) / *(excluded)*
92 días / *days*

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
<i>Serie A Bonds</i>	<i>Serie B Bonds</i>	<i>Serie C Bonds</i>	<i>Serie D Bonds</i>	<i>Serie E Bonds</i>
ES0374273003	ES0374273011	ES0374273029	ES0374273037	ES0374273045

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / <i>3 Month Euribor</i>	16/07/2018	-0,321%	-0,321%	-0,321%	-0,321%	-0,321%
Margen / <i>Margin</i>		0,170%	0,340%	0,550%	2,000%	4,000%
Tipo de interés calculado / <i>Calculated interest rate</i>		-0,151%	0,019%	0,229%	1,679%	3,679%

Tipo de Interés Nominal aplicable / *Applicable Interest Rate*

	0,000%*	0,019%	0,229%	1,679%	3,679%
--	---------	--------	--------	--------	--------

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie		
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>		
	10.081		363		80		128		128		
Número de Bonos / <i>N.Bonds</i>											
Nominal / <i>Face value</i>	(Euros)	17.300,61	174.407.449,41	36.680,79	13.315.126,77	36.677,16	2.934.172,80	36.674,11	4.694.286,08	49.931,25	6.391.200,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / *Day count fraction*

Act / **360**

Intereses Brutos / <i>Gross Interest</i>		0,000000	0,00	1,781056	646,52	21,464289	1.717,14	157,360456	20.142,14	469,448065	60.089,35
Retención / <i>Withholding tax</i>	19,00%	0,000000	0,00	0,338401	122,84	4,078215	326,26	29,898487	3.827,01	89,195132	11.416,98
Intereses Netos / <i>Net Interest</i>		0,000000	0,00	1,442655	523,68	17,386074	1.390,88	127,461969	16.315,13	380,252933	48.672,37

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

* 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

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