

**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

20.02.2017

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 18.11.2016 (incluido) / (included)  
hasta / To 20.02.2017 (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 94 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie A3(G)	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series A3(G) Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0313273015	ES0313273023	ES0313273031	ES0313273049	ES0313273056	ES0313273064

**Determinación Interés Nominal**  
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	16.11.2016	-0,311%	-0,311%	-0,311%	-0,311%	-0,311%	-0,311%
Margen / Margin		0,200%	0,020%	0,350%	0,900%	1,800%	3,900%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,111%	-0,291%	0,039%	0,589%	1,489%	3,589%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,039%	0,589%	1,489%	3,589%

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
	2.889		912		231		60		108		174
12.972,88	37.478.650,32	36.950,70	33.699.038,40	100.000,00	23.100.000,00	100.000,00	6.000.000,00	100.000,00	10.800.000,00	100.000,00	17.400.000,00

**Liquidación de Intereses**

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest 0,000000  
Retención / Withholding tax 19,00%  
Neto / Net 0,000000

0,000000	0,00	0,000000	0,00	10,183333	2.352,35	153,794444	9.227,67	388,794444	41.989,80	937,127778	163.060,23
0,000000	0,00	0,000000	0,00	1,934833	446,95	29,220944	1.753,26	73,870944	7.978,06	178,054278	30.981,44
0,000000	0,00	0,000000	0,00	8,248500	1.905,40	124,573500	7.474,41	314,923500	34.011,74	759,073500	132.078,79

**Amortización de Principal**

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined A determinar / To be determined 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%

Neto / Net Interest

18/08/2009 - 18/11/2016

33.474,094443 5.824.492,43

6.360,077943 1.106.653,56

27.114,016500 4.717.838,87

\* 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