

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

16.05.2018

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

16.02.2018 (incluido) / (included)
16.05.2018 (excluido) / (excluded)
89 días / days

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor
Margen / Margin
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate

	Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
14/02/2018	-0,328%	-0,328%	-0,328%	-0,328%	-0,328%
	0,120%	0,220%	0,520%	2,100%	3,900%
	-0,208%	-0,108%	0,192%	1,772%	3,572%
	0,000%*	0,000%*	0,192%	1,772%	3,572%

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
6.820	162	275	107	146					
51,69	352.525,80	100.000,00	16.200.000,00	100.000,00	27.500.000,00	100.000,00	10.700.000,00	100.000,00	14.600.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

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

0,000000	0,00	0,000000	0,00	47,466667	13.053,33	438,077778	46.874,32	883,077778	128.929,36
0,000000	0,00	0,000000	0,00	9,018667	2.480,13	83,234778	8.906,12	167,784778	24.496,58
0,000000	0,00	0,000000	0,00	38,448000	10.573,20	354,843000	37.968,20	715,293000	104.432,78

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

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

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%
Intereses Netos / Net Interest

16.11.2009-16.02.2018
36.682,886112 5.355.701,37
6.969,748362 1.017.583,28
29.713,137750 4.338.118,09

* 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