

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining interest rate and redemption applicable to the bonds

FECHA DE PAGO / Payment date

18.07.2016

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

18.04.2016

(incluido) / (included)

18.07.2016

(excluido) / (excluded)

91

días / days

Bonos Serie A2(P)	Bonos Serie B(P)	Bonos Serie C(P)
<i>Class A2(P) Bonds</i>	<i>Class B(P) Bonds</i>	<i>Class C(P) Bonds</i>
ES0313814016	ES0313814024	ES0313814032

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

14.04.2016

-0,251%

-0,251%

-0,251%

Margen / Margin

0,110%

0,500%

0,950%

Tipo de interés calculado / Calculated interest

-0,141%

0,249%

0,699%

Tipo de interés aplicable / Interest rate

0,000%*

0,249%

0,699%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>
	6.560		153		71
Número de Bonos / N.Bonds					
Nominal / Face value	(Euros) 28.571,84	187.431.270,40	53.531,28	8.190.285,84	53.535,13
					3.800.994,23

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross

0,000000

0,00

33,693480

5.155,10

94,592113

6.716,04

Interés Retención / Withholding tax

19%

0,000000

0,00

6,401761

979,47

17,972501

1.276,05

Interés Neto / Net

0,000000

0,00

27,291719

4.175,63

76,619612

5.439,99

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

* 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 II.10 y V.4.2.1.1 del Folleto Informativo 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 II.10 and V.4.2.1.1 of the Prospectus 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

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining interest rate and redemption applicable to the bonds

FECHA DE PAGO / Payment date

18.07.2016

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

18.04.2016

(incluido) / (included)

18.07.2016

(excluido) / (excluded)

91

días / days

Bonos Serie A2(T)	Bonos Serie B(T)	Bonos Serie C(T)
<i>Class A2(T) Bonds</i>	<i>Class B(T) Bonds</i>	<i>Class C(T) Bonds</i>
ES0313814057	ES0313814065	ES0313814073

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 14.04.2016 -0,251%
Margen / Margin 0,110%
Tipo de interés calculado / Calculated interest -0,141%
Tipo de interés aplicable / Interest rate

-0,251%	-0,251%	-0,251%
0,110%	0,500%	0,950%
-0,141%	0,249%	0,699%
0,000%*	0,249%	0,699%

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value (Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>
	2.442		172		70
34.699,13	84.735.275,46	70.145,00	12.064.940,00	70.151,42	4.910.599,40

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act / **360**

Intereses Brutos / Gross Interest	0,000000	0,00	44,150432	7.593,87	123,951713	8.676,62
Retención / Withholding tax 19%	0,000000	0,00	8,388582	1.442,84	23,550825	1.648,56
Neto / Net	0,000000	0,00	35,761850	6.151,03	100,400888	7.028,06

Amortización de Principal

Principal Redemption (Euros)

Amortización / Redemption

A determinar A determinar **A determinar** A determinar **A determinar** A determinar

* 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 II.10 y V.4.2.2.1 del Folleto Informativo 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 II.10 and V.4.2.2.1 of the Prospectus 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