

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 12.08.2016

Periodo de Interés / Interest accrual period
desde / From 12.05.2016 (incluido) / (included)
hasta / To 12.08.2016 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 92 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Class A Bonds</i>	<i>Class B Bonds</i>	<i>Class C Bonds</i>
ES0313920003	ES0313920011	ES0313920029

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	10.05.2016	-0,260%	-0,260%	-0,260%
Margen / Margin		0,240%	0,450%	1,250%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,020%	0,190%	0,990%
Tipo de interes aplicable / Interest rate		0,000%*	0,190%	0,990%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>
	6.841		149		110
Número de Bonos / N.Bonds					
Nominal / Face value	(Euros) 14.551,95	99.549.889,95	30.270,82	4.510.352,18	30.264,27
					3.329.069,70

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross		0,00	0,00	14,70	2.190,30	76,57	8.422,70
Interés Retención / Withholding tax	19%	0,00	0,00	2,79	415,71	14,55	1.600,50
Interés Neto / Net		0,00	0,00	11,91	1.774,59	62,02	6.822,20

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar
	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined

* 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 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 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