

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS
Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Redemption
FECHA DE PAGO / Payment date
22.05.2018
Periodo de Interés / Interest accrual period

 desde / From
 hasta / To
 plazo / Term

22.02.2018 (incluido) / (included)
22.05.2018 (excluido) / (excluded)
 89 días / days

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation
Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

20.02.2018

-0,329%

-0,329%

-0,329%

-0,329%

-0,329%

-0,329%

Margen / Margin

0,120%

0,190%

0,270%

0,500%

1,900%

4,000%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate
-0,209%
-0,139%
-0,059%
0,171%
1,571%
3,671%
Tipo de Interés Nominal aplicable
Applicable interest rate
0,000%*
0,000%*
0,000%*
0,171%
1,571%
3,671%
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	
	15.370		5.000		650		520		260		310	
	22.996,79	353.460.662,30	97.199,77	485.998.850,00	100.000,00	65.000.000,00	100.000,00	52.000.000,00	100.000,00	26.000.000,00	100.000,00	31.000.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax
Intereses Netos / Net Interest

19,00%

	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	42,275000	21.983,00	388,386111	100.980,39	907,552778	281.341,36
	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	8,032250	4.176,77	73,793361	19.186,27	172,435028	53.454,86
	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	34,242750	17.806,23	314,592750	81.794,12	735,117750	227.886,50

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
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
Intereses Netos / Net Interest

19,00%

24.02.2014 / 22.02.2018		22.08.2013 / 22.02.2018		24.11.2008 / 22.02.2018	
1.806,586111	939.424,78	8.925,497222	2.320.629,28	43.756,276882	13.564.445,81
343,251361	178.490,71	1.695,844472	440.919,55	8.313,692605	2.577.244,70
1.463,334750	760.934,07	7.229,652750	1.879.709,73	35.442,584277	10.987.201,11

* 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

http://www.edt-sg.com/