

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
26.09.2016
Periodo de Interés / Interest accrual period

 desde / From **27.06.2016** (incluido) / (included)
 hasta / To **26.09.2016** (excluido) / (excluded)
 plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0361796016	ES0361796024	ES0361796032	ES0361796040	ES0361796057

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	23.06.2016	-0,269%	-0,269%	-0,269%	-0,269%	-0,269%
Margen / Margin		0,150%	0,190%	0,290%	0,500%	4,000%
Tipo de Interés Nominal calculado / Interest Rate		-0,119%	-0,079%	0,021%	0,231%	3,731%
Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate		0,000%*	0,000%*	0,021%	0,231%	3,731%

	Bono		Bono		Bono		Bono		Bono	
	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
Número de Bonos / N.Bonds	6.680	132	116	72	100					
Nominal / Face value (Euros)	27.149,84	181.360.931,20	100.000,00	13.200.000,00	100.000,00	11.600.000,00	100.000,00	7.200.000,00	100.000,00	10.000.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

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

Intereses Brutos / Gross Interest (Euros)	0,000000	0,00	0,000000	0,00	5,308333	615,77	58,391667	4.204,20	943,113889	94.311,39
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,000000	0,00	1,008583	117,00	11,094417	798,80	179,191639	17.919,16
Neto / Net	0,000000	0,00	0,000000	0,00	4,299750	498,77	47,297250	3.405,40	763,922250	76.392,23

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 **0,00** 0,00 **0,00** 0,00

Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles
Payments not made due to insufficient Available Funds
Fechas vencimiento / Maturity dates

Intereses Brutos / Gross Interest (Euros)		28.09.2015 a / to 27.06.2016
Retención / Withholding tax	19,00%	3.894,079533 389.407,95
Neto / Net Interest		739,875111 73.987,51
		3.154,204422 315.420,44

* 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