

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

16.10.2018

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / *From*
hasta / *To*
plazo / *Term*

16.07.2018

(incluido) / *(included)*

16.10.2018

(excluido) / *(excluded)*

92

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 12.07.2018 -0,321%
Margen / Margin 0,110%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,211%
Tipo de interés Nominal aplicable / Applicable interest rate 0,000%*

-0,321%	-0,321%	-0,321%
0,110%	0,500%	0,950%
-0,211%	0,179%	0,629%
0,000%*	0,179%	0,629%

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>
	6.560		153		71
20.873,97	136.933.243,20	39.108,80	5.983.646,40	39.111,62	2.776.925,02

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	17,890103	2.737,19	62,869756	4.463,75
0,000000	0,00	3,399120	520,07	11,945254	848,11
0,000000	0,00	14,490983	2.217,12	50,924502	3.615,64

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / I to be determined

A determinar / I to be determined

A determinar / I 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.4.2.1.1 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.

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

16.10.2018

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

16.07.2018

(incluido) / (included)

16.10.2018

(excluido) / (excluded)

92

días / days

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 12.07.2018 -0,321%

Margen / Margin 0,110%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,211%

Tipo de interés Nominal aplicable / Applicable interest rate **0,000%***

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

-0,321%	-0,321%	-0,321%
0,110%	0,500%	0,950%
-0,211%	0,179%	0,629%
0,000%*	0,179%	0,629%

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
26.582,17	64.913.659,14	53.736,40	9.242.660,80	53.741,31	3.761.891,70

Liquidación de Intereses
Interest Payment

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

Intereses Brutos / Gross Interest	0,000000	0,00	24,581418	4.228,00	86,386170	6.047,03
Retención / Withholding tax 19%	0,000000	0,00	4,670469	803,32	16,413372	1.148,94
Intereses Netos / Net Interest	0,000000	0,00	19,910949	3.424,68	69,972798	4.898,09

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption

A determinar / to be determined

A determinar / to be determined

A determinar / 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.4.2.2.1 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