

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*

16.10.2019

Periodo de Interés /
Interest accrual period

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

16.07.2019

(incluido) / *(included)*

16.10.2019

(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* 12.07.2019 -0,363%
 Margen / *Margin* 0,110%
 Tipo de interés calculado / *Calculated interest rate* -0,253%
 Tipo de interés Nominal aplicable / *Applicable interest rate* 0,000%*

-0,363%	-0,363%	-0,363%
0,110%	0,500%	0,950%
-0,253%	0,137%	0,587%
0,000%*	0,137%	0,587%

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
18.064,04	118.500.102,40	33.844,20	5.178.162,60	33.846,65	2.403.112,15

Liquidación de Intereses *Interest Payment*

(Euros)

Base / *Day count fraction*

Act /

360

Intereses Brutos / *Gross Interest* 0,000000
 Retención / *Withholding tax* 19% 0,000000
 Intereses Netos / *Net Interest* 0,000000

0,00	0,00	11,849230	1.812,93	50,773736	3.604,94
0,000000	0,00	2,251354	344,46	9,647010	684,94
0,000000	0,00	9,597876	1.468,47	41,126726	2.920,00

Amortización de Principal *Principal Redemption*

(Euros)

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.4.2.1.1 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*

16.10.2019

Periodo de Interés /
Interest accrual period

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

16.07.2019

(incluido) / *(included)*

16.10.2019

(excluido) / *(excluded)*

92

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* 12.07.2019 -0,363%
 Margen / *Margin* 0,110%
 Tipo de interés calculado / *Calculated interest rate* -0,253%
 Tipo de interés Nominal aplicable / *Applicable interest rate* 0,000%*

-0,363%	-0,363%	-0,363%
0,110%	0,500%	0,950%
-0,253%	0,137%	0,587%
0,000%*	0,137%	0,587%

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
23.460,69	57.291.004,98	47.426,25	8.157.315,00	47.430,60	3.320.142,00

Liquidación de Intereses *Interest Payment*

(Euros)

Base / *Day count fraction*

Act /

360

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

19%

0,000000	0,00	16,604457	2.855,97	71,151170	4.980,58
0,000000	0,00	3,154847	542,63	13,518722	946,31
0,000000	0,00	13,449610	2.313,34	57,632448	4.034,27

Amortización de Principal *Principal Redemption*

(Euros)

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

info@edt-sg.com

www.edt-sg.com