

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

17.04.2020

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

17.01.2020 (incluido) / (included)
17.04.2020 (excluido) / (excluded)
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
ES0313270011	ES0313270029	ES0313270037	ES0313270045	ES0313270052

Determinación Interés Nominal Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	15.01.2020	-0,393%	-0,393%	-0,393%	-0,393%	-0,393%
Margen / Margin		0,150%	0,270%	0,480%	2,250%	3,900%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,243%	-0,123%	0,087%	1,857%	3,507%
Tipo de interes aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,087%	1,857%	3,507%

	Bono		Bono		Bono		Bono		Bono		
	Serie	Class	Serie	Class	Serie	Class	Serie	Class	Serie	Class	
Número de Bonos / N.Bonds	13.974		224		241		205		206		
Nominal / Face value	(Euros)	29.216,25	408.267.877,50	57.680,27	12.920.380,48	57.691,28	13.903.598,48	57.685,04	11.825.433,20	59.096,49	12.173.876,94

Liquidación de Intereses Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	12,687274	3.057,63	270,778385	55.509,57	523,885459	107.920,40
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	2,410582	580,95	51,447893	10.546,82	99,538237	20.504,88
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	10,276692	2.476,68	219,330492	44.962,75	424,347222	87.415,52

Amortización de Principal Principal Redemption

Amortización / Redemption (Euros)

A determinar A determinar A determinar A determinar 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 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 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

info@edt-sg.com

www.edt-sg.com