

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*

16.04.2020

Periodo de Interés /
Interest accrual period

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

16.01.2020 (incluido) / *(included)*
16.04.2020 (excluido) / *(excluded)*
91 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* 14.01.2020 -0,391%
Margen / *Margin* 0,110%
Tipo de interés calculado / *Calculated interest rate* -0,281%
Tipo de interés Nominal aplicable / *Applicable interest rate* 0,000%*

-0,391%	-0,391%	-0,391%
0,110%	0,500%	0,950%
-0,281%	0,109%	0,559%
0,000%*	0,109%	0,559%

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
16.593,07	108.850.539,20	32.631,70	4.992.650,10	32.634,05	2.317.017,55

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	8,990940	1.375,61	46,112819	3.274,01
0,000000	0,00	1,708279	261,37	8,761436	622,06
0,000000	0,00	7,282661	1.114,24	37,351383	2.651,95

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*

16.04.2020

Periodo de Interés /
Interest accrual period

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

16.01.2020

(incluido) / *(included)*

16.04.2020

(excluido) / *(excluded)*

91

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* 14.01.2020 -0,391%
 Margen / *Margin* 0,110%
 Tipo de interés calculado / *Calculated interest rate* -0,281%
 Tipo de interés Nominal aplicable / *Applicable interest rate* 0,000%*

-0,391%	-0,391%	-0,391%
0,110%	0,500%	0,950%
-0,281%	0,109%	0,559%
0,000%*	0,109%	0,559%

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
21.889,35	53.453.792,70	44.249,76	7.610.958,72	44.253,81	3.097.766,70

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	12,192038	2,097,03	62,531863	4,377,23
0,000000	0,00	2,316487	398,44	11,881054	831,67
0,000000	0,00	9,875551	1,698,59	50,650809	3,545,56

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