

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

22.05.2019

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

22.02.2019 (incluido) / (included)
22.05.2019 (excluido) / (excluded)
89 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie A3	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series A3 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0312872015	ES0312872023	ES0312872031	ES0312872049	ES0312872056	ES0312872064

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

20/02/2019

-0,308%

-0,308%

-0,308%

-0,308%

-0,308%

-0,308%

Margen / Margin

0,120%

0,190%

0,270%

0,500%

1,900%

4,000%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,188%

-0,118%

-0,038%

0,192%

1,592%

3,692%

Tipo de Interés Nominal aplicable
Applicable interest rate

0,000%*

0,000%*

0,000%*

0,192%

1,592%

3,692%

Número de Bonos / N. Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	
	15.370		5.000		650		520		260		310	
	17.746,89	272.769.699,30	97.199,77	485.998.850,00	100.000,00	65.000.000,00	100.000,00	52.000.000,00	100.000,00	26.000.000,00	100.000,00	31.000.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

47,466667

24.682,67

393,577778

102.330,22

912,744444

282.950,78

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

9,018667

4.689,71

74,779778

19.442,74

173,421444

53.760,65

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

38,448000

19.992,96

318,798000

82.887,48

739,323000

229.190,13

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

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles

Payments outstanding due to insufficient Available Funds

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

19,00%

Intereses Netos / Net Interest

	24.02.2014 / 22.02.2019	22.08.2013 / 22.02.2019	24.11.2008 / 22.02.2019
	1.986,605556	1.033.034,90	10.524,961110
	2.736.489,90	47.484,907438	14.720.321,28
	377,455056	196.276,64	1.999,742610
	519.933,07	9.022,132411	2.796.861,04
	1.609,150500	836.758,26	8.525,218500
	2.216.556,83	38.462,775027	11.923.460,24

* 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

http://www.edt-sg.com/