

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
18.10.2019
Periodo de Interés / desde / From
Interest accrual period hasta / To
 plazo / Term

18.07.2019 (incluido) / (included)
18.10.2019 (excluido) / (excluded)
 92 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>	<i>Series D Bonds</i>	<i>Series E Bonds</i>
ES0374273003	ES0374273011	ES0374273029	ES0374273037	ES0374273045

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	16/07/2019	-0,367%	-0,367%	-0,367%	-0,367%	-0,367%
Margen / Margin		0,170%	0,340%	0,550%	2,000%	4,000%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,197%	-0,027%	0,183%	1,633%	3,633%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate

0,000%*	0,000%	0,183%	1,633%	3,633%
----------------	---------------	---------------	---------------	---------------

Número de Bonos / N. Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>
	10.081		363		80		128		128
14.755,29	148.748.078,49	31.284,20	11.356.164,60	31.281,10	2.502.488,00	31.278,50	4.003.648,00	49.931,25	6.391.200,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act 360

Intereses Brutos / Gross Interest		0,00	0,000000	0,00	14,629128	1.170,33	130,532131	16.708,11	463,578369	59.338,03
Retención / Withholding tax	19,00%	0,00	0,000000	0,00	2,779534	222,36	24,801105	3.174,54	88,079890	11.274,23
Intereses Netos / Net Interest		0,00	0,000000	0,00	11,849594	947,97	105,731026	13.533,57	375,498479	48.063,80

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
----------------------------------	---------	--	------	------	------	------	------	------	------	------

* 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

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