

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*

18.01.2021

Periodo de Interés /
Interest accrual period

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

16.10.2020

(incluido) / *(included)*

18.01.2021

(excluido) / *(excluded)*

94

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* 14.10.2020 -0,511%
 Margen / *Margin* 0,110%
 Tipo de interés calculado / *Calculated interest rate* -0,401%
 Tipo de interés Nominal aplicable / *Applicable interest rate* 0,000%*

-0,511%	-0,511%	-0,511%
0,110%	0,500%	0,950%
-0,401%	-0,011%	0,439%
0,000%*	0,000%*	0,439%

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
14.524,27	95.279.211,20	27.212,20	4.163.466,60	27.214,16	1.932.205,36

Liquidación de Intereses *Interest Payment*

(Euros)

Base / *Day count fraction*

Act /

360

Intereses Brutos / *Gross Interest* 0,000000 0,00 0,000000 0,00 31,194987 2.214,84
 Retención / *Withholding tax* 19% 0,000000 0,00 0,000000 0,00 5,927048 420,82
 Intereses Netos / *Net Interest* 0,000000 0,00 0,000000 0,00 25,267939 1.794,02

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.*

EUROPEA DE TITULIZACIÓN, S.A., S.G.F.T

C/ Jorge Juan, 68 -MADRID, SPAIN - Tel. (34) 91 411 84 67

info@edt-sg.com

www.edt-sg.com

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

18.01.2021

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

16.10.2020
18.01.2021
94

(incluido) / (included)
(excluido) / (excluded)
días / days

Bonos Serie A2(T)	Bonos Serie B(T)	Bonos Serie C(T)
Class A2(T) Bonds	Class B(T) Bonds	Class C(T) Bonds
ES0313814057	ES0313814065	ES0313814073

Determinación Interés Nominal Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 14.10.2020 -0,511%
Margen / Margin 0,110%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,401%
Tipo de interés Nominal aplicable / Applicable interest rate 0,000%*

-0,511%	-0,511%	-0,511%
0,110%	0,500%	0,950%
-0,401%	-0,011%	0,439%
0,000%*	0,000%*	0,439%

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	2.442		172		70
19.489,32	47.592.919,44	39.398,05	6.776.464,60	39.401,66	2.758.116,20

Liquidación de Intereses Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest 0,000000 0,00 0,000000 0,00 45,165247 3.161,57
Retención / Withholding tax 19% 0,000000 0,00 0,000000 0,00 8,581397 600,70
Intereses Netos / Net Interest 0,000000 0,00 0,000000 0,00 36,583850 2.560,87

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/ Jorge Juan, 68 -MADRID, SPAIN - Tel. (34) 91 411 84 67

info@edt-sg.com

www.edt-sg.com