

GAT ICO-FTVPO 1 FTH

(N.I.F.V65102576)

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

20.09.2021

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

21.06.2021 (incluido) / (included)
20.09.2021 (excluido) / (excluded)
91 días / days

Bonos Serie AG	Bonos Serie B (CA)	Bonos Serie B (CM)	Bonos Serie B (CP)	Bonos Serie B (CT)
Series AG Bonds	Series B (CA) Bonds	Series B (CM) Bonds	Series B (CP) Bonds	Series B (CT) Bonds
ES0341068007	ES0341068015	ES0341068023	ES0341068031	ES0341068049

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor

Margen / Margin

17.06.2021

-0,543%	-0,543%	-0,543%	-0,543%	-0,543%
0,500%	0,800%	0,800%	0,800%	0,800%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,043%	0,257%	0,257%	0,257%	0,257%
---------	--------	--------	--------	--------

Tipo de Interés Nominal aplicable

Applicable interest rate

0,000%*	0,257%	0,257%	0,257%	0,257%
---------	--------	--------	--------	--------

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	3.316		98		33		27		20
5.879,30	19.495.758,80	100.000,00	9.800.000,00	100.000,00	3.300.000,00	67.843,11	1.831.763,97	100.000,00	2.000.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

19,00%

0,000000	0,00	64,963889	6.366,46	64,963889	2.143,81	44,073523	1.189,99	64,963889	1.299,28
0,000000	0,00	12,343139	1.209,63	12,343139	407,32	8,373969	226,10	12,343139	246,86
0,000000	0,00	52,620750	5.156,83	52,620750	1.736,49	35,699554	963,89	52,620750	1.052,42

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined A determinar / To be determined 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 4.8 de la Nota de Valores y 3.4.6. 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. 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/Jorge Juan 68 -MADRID, SPAIN - Tel. (34) 91 411 84 67

info@edt-sg.com

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

1/3

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 20.09.2021

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 21.06.2021 (incluido) / (included)
hasta / To 20.09.2021 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie C (CA)	Bonos Serie C (CM)	Bonos Serie C (CP)	Bonos Serie C (CT)
Series C (CA) Bonds	Series C (CM) Bonds	Series C (CP) Bonds	Series C (CT) Bonds
ES0341068056	ES0341068064	ES0341068072	ES0341068080

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor 17.06.2021 -0,543% -0,543% -0,543% -0,543%
Margen / Margin 2,000% 2,000% 2,000% 2,000%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate 1,457% 1,457% 1,457% 1,457%

Tipo de Interés Nominal aplicable

Applicable interest rate

1,457% **1,457%** **1,457%** **1,457%**

Número de Bonos / N. Bonds

Nominal / Face value

(Euros) **100.000,00** **3.200.000,00** **100.000,00** **2.300.000,00** **100.000,00** **1.500.000,00** **100.000,00** **1.500.000,00**

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros) **Base / Day count fraction** Act / **360**

Intereses Brutos / Gross Interest 368,297222 11.785,51 368,297222 8.470,84 368,297222 5.524,46 368,297222 5.524,46
Retención / Withholding tax 19,00% 69,976472 2.239,25 69,976472 1.609,46 69,976472 1.049,65 69,976472 1.049,65
Intereses Netos / Net Interest 298,320750 9.546,26 298,320750 6.861,38 298,320750 4.474,81 298,320750 4.474,81

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption **A determinar / To be determined** **A determinar / To be determined** **A determinar / To be determined** **A determinar / To be determined**

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

20.09.2021

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 21.06.2021 (incluido) / (included)
hasta / To 20.09.2021 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie D (CA)	Bonos Serie D (CM)	Bonos Serie D (CP)	Bonos Serie D (CT)
Series D (CA) Bonds	Series D (CM) Bonds	Series D (CP) Bonds	Series D (CT) Bonds
ES0341068098	ES0341068106	ES0341068114	ES0341068122

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor	17.06.2021	-0,543%	-0,543%	-0,543%	-0,543%
Margen / Margin		5,000%	5,000%	5,000%	5,000%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

4,457% 4,457% 4,457% 4,457%

Tipo de Interés Nominal aplicable

Applicable interest rate

4,457% **4,457%** **4,457%** **4,457%**

Número de Bonos / N. Bonds

Nominal / Face value (Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	61		25		16		14
51.936,20	3.168.108,20	86.926,49	2.173.162,25	56.200,51	899.208,16	72.914,96	1.020.809,44

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction	Act /	360							
Intereses Brutos / Gross Interest		585,129099	35.692,88	979,340397	24.483,51	633,172118	10.130,75	821,482219	11.500,75
Retención / Withholding tax	19,00%	111,174529	6.781,65	186,074675	4.651,87	120,302702	1.924,84	156,081622	2.185,14
Intereses Netos / Net Interest		473,954570	28.911,23	793,265722	19.831,64	512,869416	8.205,91	665,400597	9.315,61

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined A determinar / To be determined A determinar / To be determined A determinar / To be determined

Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles

Payments not made due to insufficient Available Funds

Fecha vencimiento / Maturity date		22.06.2020 / 21.06.2021	20.06.2019 / 21.06.2021	20.12.2018 / 21.06.2021	20.03.2020 / 21.06.2021				
Intereses Brutos / Gross Interest		2.989,237042	182.343,46	8.220,597781	205.514,95	6.925,720589	110.811,53	5.043,975401	70.615,65
Retención / Withholding tax	19,00%	567,955037	34.645,26	1.561,913578	39.047,83	1.315,886910	21.054,18	958,355327	13.416,96
Intereses Netos / Net Interest		2.421,282005	147.698,20	6.658,684203	166.467,12	5.609,833679	89.757,35	4.085,620074	57.198,69