

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

15.10.2021

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 15.07.2021 (incluido) / (included)
hasta / To 15.10.2021 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 92 días / days

Bonos Serie A2a	Bonos Serie A2b	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2a Bonds	Series A2b Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0345721015	ES0345721023	ES0345721031	ES0345721049	ES0345721056	ES0345721064

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

13.07.2021

-0,546%

-0,546%

-0,546%

-0,546%

-0,546%

-0,546%

Margen / Margin

0,130%

0,130%

0,170%

0,290%

0,530%

4,500%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,416%

-0,416%

-0,376%

-0,256%

-0,016%

3,954%

Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate

0,000%*

0,000%*

0,000%*

0,000%*

0,000%*

3,954%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	5.000		2.362		220		183		235		160

Número de Bonos / N.Bonds

(Euros)

9.967,17

49.835.850,00

9.967,17

23.542.455,54

100.000,00

22.000.000,00

100.000,00

18.300.000,00

100.000,00

23.500.000,00

100.000,00

16.000.000,00

160

Nominal / Face value

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

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

1.010,466667

161.674,67

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

191,988667

30.718,19

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

818,478000

130.956,48

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar / To be determined

A determinar / To be determined

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

0,00

Pagos no satisfechos por insuficiencia

de Fondos Disponibles

Payments not made due to insufficient Available Funds

Fecha de Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

(Euros)

15.01.2009-15.07.2021

62.401,625555

9.984.260,07

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

19,00%

11.856,308855

1.897.009,40

50.545,316700

8.087.250,67

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles

Intereses por Aplazamiento de Intereses Impagados

Payments outstanding due to insufficient Available Funds

Interest Payment of deferred unpaid interest

Fecha de Vencimiento / Maturity Date

Intereses Brutos / Gross Interest

(Euros)

15.01.2009-15.07.2021

19.071,914500

3.051.506,32

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

19,00%

3.623,663755

579.786,20

15.448,250745

2.471.720,12

* 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 3.4.6.1.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 3.4.6.1 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/ Jorge Juan 68, 28009 Madrid, SPAIN - Tel. (34) 91 411 84 67

info@edt-sg.com

www.edt-sg.com