

**FECHA DE PAGO / Payment date**
**27.12.2021**
**Periodo de Interés / Interest accrual period**

desde / From  
hasta / To  
plazo / Term

**27.09.2021** (incluido) / (included)  
**27.12.2021** (excluido) / (excluded)  
91 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0361796016	ES0361796024	ES0361796032	ES0361796040	ES0361796057

**Determinación Tipo Interés Nominal**
*Nominal Interest Rate Calculation*

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

23/09/2021

-0,543%

-0,543%

-0,543%

-0,543%

-0,543%

**Margen / Margin**

0,150%

0,190%

0,290%

0,500%

4,000%

**Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated Interest Rate**

-0,393%

-0,353%

-0,253%

-0,043%

3,457%

**Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate**
**0,000%\***
**0,000%\***
**0,000%\***
**0,000%\***
**3,457%**

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie		
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series		
	6.680		132		116		72		100		
Número de Bonos / N. Bonds											
Nominal / Face value	(Euros)	12.902,68	86.189.902,40	33.385,02	4.406.822,64	34.589,59	4.012.392,44	100.000,00	7.200.000,00	100.000,00	10.000.000,00

**Liquidación de Intereses**
*Interest Payment*

Base / Day count fraction

Act /

**360**
**Intereses Brutos / Gross Interest**

(Euros)

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

873,852778

87.385,28

**Retención / Withholding tax**
**19,00%**

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

166,032028

16.603,20

**Intereses Netos / Net Interest**

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

707,820750

70.782,08

**Amortización de Principal**
*Principal Redemption*
**Amortización / Redemption**

(Euros)

**A determinar** /To be determined

**A determinar** /To be determined

**A determinar** /To be determined

**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**
**27.09.2021**
**Intereses Brutos / Gross Interest**

711,096700

71.109,67

**Retención / Withholding tax**

135,108373

13.510,84

**Intereses Netos / Net Interest**

575,988327

57.598,83

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

info@edt-sg.com

www.edt-sg.com