

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

26.02.2021

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 26.11.2020 (incluido) / (included)
hasta / To 26.02.2021 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 92 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
ES0313546006	ES0313546014	ES0313546022

Determinación Interés Nominal Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 24.11.2020 -0,523%
Margen / Margin 0,230%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,293%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate 0,000%*

-0,523%	-0,523%	-0,523%
0,230%	0,600%	1,350%
-0,293%	0,077%	0,827%
0,000%*	0,077%	0,827%

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value (Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	12.953		277		270
9.304,16	120.516.784,48	20.399,30	5.650.606,10	20.417,73	5.512.787,10

Liquidación de Intereses Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360 (Euros)

Intereses Brutos / Gross Interest 0,000000	0,00	4,014129	1.111,91	43,151738	11.650,97
Retención / Withholding tax 19%	0,00	0,762685	211,26	8,198830	2.213,68
Intereses Netos / Net Interest	0,000000	3,251444	900,65	34,952908	9.437,29

Amortización de Principal Principal Redemption

Amortización / Redemption

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