

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*

26.08.2020

Periodo de Interés /
Interest accrual period

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

26.05.2020 (incluido) / *(included)*
26.08.2020 (excluido) / *(excluded)*
92 días / *days*

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>
ES0313546006	ES0313546014	ES0313546022

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / *3 Month Euribor* 22.05.2020 -0,279%
Margen / *Margin* 0,230%
Tipo de interés calculado / *Calculated interest rate* -0,049%
Tipo de interes aplicable / *Applicable interest rate* 0,000%*

-0,279%	-0,279%	-0,279%
0,600%	0,600%	1,350%
0,321%	0,321%	1,071%
0,000%*	0,321%	1,071%

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>
	12.953		277		270
10.208,83	132.234.974,99	21.297,81	5.899.493,37	21.317,05	5.755.603,50

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / *Day count fraction* Act / 360

Intereses Brutos / *Gross Interest*
Retención / *Withholding tax* 19%
Intereses Netos / *Net Interest*

0,000000	0,00	17,471303	4.839,55	58,344766	15.753,09
0,000000	0,00	3,319548	919,51	11,085506	2.993,09
0,000000	0,00	14,151755	3.920,04	47,259260	12.760,00

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

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/ Lagasca, 120 -MADRID, SPAIN - Tel. (34) 91 411 84 67

info@edt-sg.com

www.edt-sg.com