

### DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

*Determining interest rate and redemption applicable to the bonds*

FECHA DE PAGO / *Payment date*

16.10.2020

Periodo de Interés /  
*Interest accrual period*

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

16.07.2020

(incluido) / *(included)*

16.10.2020

(excluido) / *(excluded)*

92

días / *days*

Bonos Serie A2(P)	Bonos Serie B(P)	Bonos Serie C(P)
<i>Class A2(P) Bonds</i>	<i>Class B(P) Bonds</i>	<i>Class C(P) Bonds</i>
ES0313814016	ES0313814024	ES0313814032

#### Determinación Interés Nominal *Nominal Interest Calculation*

Euribor 3 meses / *3 Month Euribor* 14.07.2020 -0,433%  
 Margen / *Margin* 0,110%  
 Tipo de interés calculado / *Calculated interest rate* -0,323%  
 Tipo de interés Nominal aplicable / *Applicable interest rate* 0,000%\*

-0,433%	-0,433%	-0,433%
0,110%	0,500%	0,950%
-0,323%	0,067%	0,517%
0,000%*	0,067%	0,517%

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>
	6.560		153		71
15.013,10	98.485.936,00	28.128,06	4.303.593,18	28.130,09	1.997.236,39

#### Liquidación de Intereses *Interest Payment*

(Euros)

Base / *Day count fraction*

Act /

360

Intereses Brutos / *Gross Interest* 0,000000  
 Retención / *Withholding tax* 19% 0,000000  
 Intereses Netos / *Net Interest* 0,000000

0,00	0,00	4,816149	736,87	37,166100	2.638,79
0,000000	0,00	0,915068	140,01	7,061559	501,37
0,000000	0,00	3,901081	596,86	30,104541	2.137,42

#### Amortización de Principal *Principal Redemption*

(Euros)

Amortización / *Redemption*

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 II.10 y V.4.2.1.1 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.4.2.1.1 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.*

### DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

*Determining interest rate and redemption applicable to the bonds*

FECHA DE PAGO / *Payment date*

16.10.2020

Periodo de Interés /  
*Interest accrual period*

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

16.07.2020

(incluido) / *(included)*

16.10.2020

(excluido) / *(excluded)*

92

días / *days*

Bonos Serie A2(T)	Bonos Serie B(T)	Bonos Serie C(T)
<i>Class A2(T) Bonds</i>	<i>Class B(T) Bonds</i>	<i>Class C(T) Bonds</i>
ES0313814057	ES0313814065	ES0313814073

#### Determinación Interés Nominal *Nominal Interest Calculation*

Euribor 3 meses / *3 Month Euribor* 14.07.2020 -0,433%  
 Margen / *Margin* 0,110%  
 Tipo de interés calculado / *Calculated interest rate* -0,323%  
 Tipo de interés Nominal aplicable / *Applicable interest rate* 0,000%\*

-0,433%	-0,433%	-0,433%
0,110%	0,500%	0,950%
-0,323%	0,067%	0,517%
0,000%*	0,067%	0,517%

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>
	2.442		172		70
20.142,10	49.187.008,20	40.717,66	7.003.437,52	40.721,39	2.850.497,30

#### 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	6,971768	1.199,14	53,802005	3.766,14
0,000000	0,00	1,324636	227,84	10,222381	715,57
0,000000	0,00	5,647132	971,30	43,579624	3.050,57

#### Amortización de Principal *Principal Redemption*

(Euros)

Amortización / *Redemption*

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 II.10 y V.4.2.2.1 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.4.2.2.1 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