

MBS BANCAJA 4 Fondo de Titulización de Activos (C.I.F.: V85082675)

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

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Redemption

FECHA DE PAGO / Payment date

23.10.2020

Periodo de Interés /

Interest accrual period

desde / From 23.07.2020 (incluido) / (included)

hasta / To 23.10.2020 (excluido) / (excluded)

plazo / Term 92 días / days

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

21/07/2020

Margen / Margin

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated Interest Rate

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate

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
ES0361797014	ES0361797030	ES0361797048	ES0361797055	ES0361797063

-0,452%	-0,452%	-0,452%	-0,452%	-0,452%
0,150%	0,220%	0,330%	0,580%	4,000%
-0,302%	-0,232%	-0,122%	0,128%	3,548%
0,000%*	0,000%*	0,000%	0,128%	3,548%

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	11.821		305		189		185		231
24.949,67	294.930.049,07	41.329,11	12.605.378,55	100.000,00	18.900.000,00	100.000,00	18.500.000,00	100.000,00	23.100.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction

Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

(Euros)

19,00%

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	32,711111	6.051,56	906,711111	209.450,27
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	6,215111	1.149,80	172,275111	39.795,55
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	26,496000	4.901,76	734,436000	169.654,72

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

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

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

(Euros)

19%

23.01.2015 a / to 23.07.2020

21.796,770381	5.035.053,93
4.141,386373	956.660,26
17.655,384008	4.078.393,67

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

info@edt-sg.com

www.edt-sg.com