

**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**
**19.10.2020**
**Periodo de Interés /** desde / *From*  
*Interest accrual period* hasta / *To*  
plazo / *Term*
**20.07.2020** (incluido) / *(included)*  
**19.10.2020** (excluido) / *(excluded)*  
91 días / *days*

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>	<i>Series D Bonds</i>	<i>Series E Bonds</i>
ES0374273003	ES0374273011	ES0374273029	ES0374273037	ES0374273045

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

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	16/07/2020	-0,449%	-0,449%	-0,449%	-0,449%	-0,449%
Margen / Margin		0,170%	0,340%	0,550%	2,000%	4,000%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,279%	-0,109%	0,101%	1,551%	3,551%
Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate		0,000%*	0,000%	0,101%	1,551%	3,551%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	
	10.081		363		80		128		128	
Número de Bonos / N.Bonds										
Nominal / Face value (Euros)	12.603,67	127.057.597,27	26.722,33	9.700.205,79	26.719,69	2.137.575,20	26.717,46	3.419.834,88	49.931,25	6.391.200,00

**Liquidación de Intereses**
*Interest Payment* (Euros)  
Base / Day count fraction Act 360

Intereses Brutos / Gross Interest		0,00	0,000000	0,00	6,821685	545,73	104,748028	13.407,75	448,189835	57.368,30
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	1,296120	103,69	19,902125	2.547,47	85,156069	10.899,98
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	5,525565	442,04	84,845903	10.860,28	363,033766	46.468,32

**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
-----------------------------------	---------------------------------	------	------	------	------	------	------	------	------	------

\* 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

**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