

**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

15.07.2021

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 15.04.2021 (incluido) / (included)  
hasta / To 15.07.2021 (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie A2a	Bonos Serie A2b	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2a Bonds	Series A2b Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0345721015	ES0345721023	ES0345721031	ES0345721049	ES0345721056	ES0345721064

Determinación Interés Nominal  
*Nominal Interest Calculation*

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

13.04.2021

-0,538%

-0,538%

-0,538%

-0,538%

-0,538%

-0,538%

Margen / Margin

0,130%

0,130%

0,170%

0,290%

0,530%

4,500%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,408%

-0,408%

-0,368%

-0,248%

-0,008%

3,962%

Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate

0,000%\*

0,000%\*

0,000%\*

0,000%\*

0,000%\*

3,962%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	5.000		2.362		220		183		235		160

Número de Bonos / N.Bonds

(Euros)

10.830,00

54.150.000,00

10.830,00

25.580.460,00

100.000,00

22.000.000,00

100.000,00

18.300.000,00

100.000,00

23.500.000,00

100.000,00

16.000.000,00

Nominal / Face value

Liquidación de Intereses

*Interest Payment*

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

1.001,505556

160.240,89

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

190,286056

30.445,77

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

811,219500

129.795,12

Amortización de Principal

*Principal Redemption*

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar / To be determined

A determinar / To be determined

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

(Euros)

15.01.2009-15.04.2021

61.400,119999

9.824.019,18

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

19,00%

11.666,022799

1.866.563,63

49.734,097200

7.957.455,55

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles

Intereses por Aplazamiento de Intereses Impagados

*Payments outstanding due to insufficient Available Funds*

*Interest Payment of deferred unpaid interest*

Fecha de Vencimiento / Maturity Date

Intereses Brutos / Gross Interest

(Euros)

15.01.2009-15.04.2021

18.456,988875

2.953.118,22

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

19,00%

3.506,827886

561.092,46

14.950,160989

2.392.025,76

\* 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 3.4.6.1.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 3.4.6.1 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/ Jorge Juan 68, 28009 Madrid, SPAIN - Tel. (34) 91 411 84 67

info@edt-sg.com

www.edt-sg.com