

## 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

15.07.2022

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 19.04.2022 (incluido) / (included)  
 hasta / To 15.07.2022 (excluido) / (excluded)  
 plazo / Term 87 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  
 Margen / Margin  
 Tipo de interés calculado / Calculated interest rate  
 Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate

12.04.2022	-0,433%	-0,433%	-0,433%	-0,433%	-0,433%
	0,130%	0,130%	0,170%	0,290%	0,500%
	-0,303%	-0,303%	-0,263%	-0,143%	0,097%
	0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,097%
				0,097%	4,067%

Número de Bonos / N.Bonds  
 Nominal / Face value

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	
(Euros)	8.114,04	40.570.200,00	8.114,04	19.165.362,48	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

Liquidación de Intereses  
Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest  
 Retención / Withholding tax  
 Intereses Netos / Net Interest

19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	23,441667	5.508,79	982,858333	157,257,33
	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	4,453917	1.046,67	186,743083	29,878,89
	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	18,987750	4.462,12	796,115250	127,378,44

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	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)												15.04.2009-19.04.2022	
19,00%												62.807,740688	10.049,238,51
												11.933,470731	1.909,355,32
												50.874,269957	8.139,883,19

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  
 Retención / Withholding tax  
 Intereses Netos / Net Interest

(Euros)													15.01.2009-19.04.2022	
19,00%													21.005,204000	3.360,832,64
													3.990,988760	638,558,20
													17.014,215240	2.722,274,44

\* 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