

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
19.04.2022
Periodo de interés /
Interest accrual period
desde / From
hasta / To
plazo / Term
17.01.2022
19.04.2022
92
(incluido) / (included)
(excluido) / (excluded)
días / days
Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation
Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 13.01.2022 -0,563%
Margen / Margin 0,130%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,433%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate 0,000%*

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

-0,563%	-0,563%	-0,563%	-0,563%	-0,563%	-0,563%
0,130%	0,130%	0,170%	0,290%	0,530%	4,500%
-0,433%	-0,433%	-0,393%	-0,273%	-0,033%	3,937%
0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,000%*	3,937%

Número de Bonos / N. Bonds
Nominal / Face value (Euros)

Bono	Serie	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>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>
	5.000		2.362		220		183		235		160
8.725,22	43.626.100,00	8.725,22	20.608.969,64	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 19,00%
Intereses Netos / Net Interest

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	1,006,122222	160.979,56
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	191,163222	30.586,12
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	814,959000	130.393,44

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	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 (Euros) 19,00%
Intereses Netos / Net Interest
15.01.2009-17.01.2022
64.444,003333 10.311.040,52
12.244,360633 1.959.097,69
52.199,642700 8.351.942,83

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 (Euros) 19,00%
Intereses Netos / Net Interest
15.01.2009-17.01.2022
20.356,818563 3.257.090,97
3.867,795527 618.847,28
16.489,023036 2.638.243,69

* 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**