

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*

23.11.2020

Periodo de Interés / *Interest accrual period*
desde / *From* hasta / *To*
plazo / *Term*

21.08.2020 (incluido) / *(included)*
23.11.2020 (excluido) / *(excluded)*
94 días / *days*

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
<i>Series A2 Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>	<i>Series D Bonds</i>	<i>Series E Bonds</i>
ES0313714018	ES0313714026	ES0313714034	ES0313714042	ES0313714059

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / <i>3 Month Euribor</i>	19.08.2020	-0,488%	-0,488%	-0,488%	-0,488%	-0,488%
Margen / <i>Margin</i>		0,140%	0,300%	0,550%	2,250%	3,900%
Tipo de interés calculado / <i>Calculated interest rate</i>		-0,348%	-0,188%	0,062%	1,762%	3,412%
Tipo de interés aplicable / <i>Applicable interest rate</i>		0,000%*	0,000%*	0,062%	1,762%	3,412%

Número de Bonos / *N.Bonds*
Nominal / *Face value*

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>
	8.168		156		153		98		125
19.942,58	162.890.993,44	46.645,83	7.276.749,48	46.640,63	7.136.016,39	46.650,71	4.571.769,58	49.700,00	6.212.500,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / *Day count fraction* Act /

360

Intereses Brutos / <i>Gross Interest</i>		0,000000	0,00	0,000000	0,00	7,550600	1.155,24	214,629550	21.033,70	442,782822	55.347,85
Retención / <i>Withholding tax</i>	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	1,434614	219,50	40,779615	3.996,40	84,128736	10.516,09
Intereses Netos / <i>Net Interest</i>		0,000000	0,00	0,000000	0,00	6,115986	935,74	173,849935	17.037,30	358,654086	44.831,76

Amortización de Principal
Principal Redemption

(Euros)

Amortización / *Redemption*

A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar
<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>

* 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