

## 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

21.02.2022

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

22.11.2021 (incluido) / (included)  
21.02.2022 (excluido) / (excluded)  
91 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0313714018	ES0313714026	ES0313714034	ES0313714042	ES0313714059

### Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	18.11.2021	-0,564%	-0,564%	-0,564%	-0,564%	-0,564%
Margen / Margin		0,140%	0,300%	0,550%	2,250%	3,900%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,424%	-0,264%	-0,014%	1,686%	3,336%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,000%*	1,686%	3,336%

Número de Bonos / N.Bonds

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie		
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class		
	8.168		156		153		98		125		
Nominal / Face value	(Euros)	16.311,09	133.228.983,12	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

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	198,817551	19.484,12	419,103533	52.387,94
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	37,775335	3.701,98	79,629671	9.953,71
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	161,042216	15.782,14	339,473862	42.434,23

### Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption

A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar
To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined

\* 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/ Jorge Juan, 68 - MADRID, SPAIN - Tel. (34) 91 411 84 67  
info@edt-sg.com www.edt-sg.com