

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

21.05.2021

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

22.02.2021
21.05.2021
88

(incluido) / (included)
(excluido) / (excluded)
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 18.02.2021

-0,543%

-0,543%

-0,543%

-0,543%

-0,543%

Margen / Margin

0,140%

0,300%

0,550%

2,250%

3,900%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,403%

-0,243%

0,007%

1,707%

3,357%

Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate

0,000%*

0,000%

0,007%

1,707%

3,357%

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)	18.373,86	150.077.688,48	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 / Gross Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,798073

122,11

194,657863

19.076,47

407,838200

50.979,78

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,151634

23,20

36,984994

3.624,53

77,489258

9.686,16

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,646439

98,91

157,672869

15.451,94

330,348942

41.293,62

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

A determinar
To be determined

A determinar
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