

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
23.05.2022
Periodo de Interés /
Interest accrual period

 desde / From
 hasta / To
 plazo / Term

21.02.2022 (incluido) / (included)
23.05.2022 (excluido) / (excluded)
 91 días / days

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

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation
Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 17.02.2022

-0,529% -0,529% -0,529% -0,529% -0,529%

Margen / Margin

0,140% 0,300% 0,560% 2,250% 3,900%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,389% -0,229% 0,021% 1,721% 3,371%

Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate
0,000% **0,000%** **0,021%** **1,721%** **3,371%**
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 |
| 15.517,03 | 126.743.101,04 | 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 2,475840 378,80 202,944843 19.888,59 423,500603 52.937,58

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000 0,00 0,000000 0,00 0,470410 71,97 38,559520 3.778,83 80,465115 10.058,14

Intereses Netos / Net Interest

0,000000 0,00 0,000000 0,00 2,005430 306,83 164,385323 16.109,76 343,035488 42.879,44

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
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