

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Redemption

FECHA DE PAGO / Payment date

22.05.2020

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

24.02.2020 (incluido) / (included)
22.05.2020 (excluido) / (excluded)
88 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie A3	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series A3 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0312872015	ES0312872023	ES0312872031	ES0312872049	ES0312872056	ES0312872064

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 20/02/2020
Margen / Margin
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,410%	-0,410%	-0,410%	-0,410%	-0,410%	-0,410%
0,120%	0,190%	0,270%	0,500%	1,900%	4,000%
-0,290%	-0,220%	-0,140%	0,090%	1,490%	3,590%

Tipo de Interés Nominal aplicable
Applicable interest rate

0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,090%	1,490%	3,590%
---------	---------	---------	--------	--------	--------

Número de Bonos / N. Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
12.641,29	15.370	97.199,77	5.000	100.000,00	650	100.000,00	520	100.000,00	260	100.000,00	310
194.296.627,30	485.998.850,00	650.000.000,00	520.000.000,00	260.000.000,00	310.000.000,00						

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax
Intereses Netos / Net Interest

19,00%

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	22,000000	11.440,00	364,222222	94.697,78	877,555556	272.042,22
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	4,180000	2.173,60	69,202222	17.992,58	166,735556	51.688,02
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	17,820000	9.266,40	295,020000	76.705,20	710,820000	220.354,20

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

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 pendientes por insuficiencia
de Fondos Disponibles
Payments outstanding due to insufficient
Available Funds

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

19,00%

Intereses Netos / Net Interest

		24.02.2014 / 24.02.2020	22.08.2013 / 24.02.2020	24.11.2008 / 24.02.2020	
2.126,338889	1.105.696,23	12.091,916666	3.143.898,34	51.192,696326	15.869.735,83
404,004389	210.082,29	2.297,464166	597.340,67	9.726,612299	3.015.249,80
1.722,334500	895.613,94	9.794,452500	2.546.557,67	41.466,084027	12.854.486,03

* 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

http://www.edt-sg.com/