

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

19.10.2020

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

17.07.2020 (incluido) / (included)
19.10.2020 (excluido) / (excluded)
94 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
ES0313270011	ES0313270029	ES0313270037	ES0313270045	ES0313270052

Determinación Interés Nominal Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 15.07.2020

-0,443%

-0,443%

-0,443%

-0,443%

-0,443%

Margen / Margin

0,150%

0,270%

0,480%

2,250%

3,900%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,293%

-0,173%

0,037%

1,807%

3,457%

Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate

0,000%*

0,000%*

0,037%

1,807%

3,457%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	
	13.974		224		241		205		206	
Número de Bonos / N. Bonds Nominal / Face value (Euros)	26.913,67	376.091.624,58	53.134,39	11.902.103,36	53.144,53	12.807.831,73	53.138,79	10.893.451,95	54.302,57	11.186.329,42

Liquidación de Intereses Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

5,134352

1.237,38

250,723572

51.398,33

490,168182

100.974,65

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,975527

235,10

47,637479

9.765,68

93,131955

19.185,18

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

4,158825

1.002,28

203,086093

41.632,65

397,036227

81.789,47

Amortización de Principal Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

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/ Lagasca, 120 - MADRID, SPAIN - Tel. (34) 91 411 84 67

info@edt-sg.com

www.edt-sg.com