

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
28.03.2022
**Periodo de Interés /
Interest accrual period**

desde / From
hasta / To
plazo / Term

27.12.2021 (incluido) / (included)
28.03.2022 (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
ES0361796016	ES0361796024	ES0361796032	ES0361796040	ES0361796057

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

23/12/2021

-0,588%

-0,588%

-0,588%

-0,588%

-0,588%

Margen / Margin

0,150%

0,190%

0,290%

0,500%

4,000%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated Interest Rate

-0,438%

-0,398%

-0,298%

-0,088%

3,412%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate
0,000%*
0,000%*
0,000%*
0,000%*
3,412%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie		
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series		
	6.680		132		116		72		100		
Número de Bonos / N. Bonds											
Nominal / Face value	(Euros)	12.576,68	84.012.222,40	24.310,30	3.208.959,60	24.310,30	2.819.994,80	100.000,00	7.200.000,00	100.000,00	10.000.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / Day count fraction

Act /

360
Intereses Brutos / Gross Interest

(Euros)

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

862,477778

86.247,78

Retención / Withholding tax
19,00%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

163,870778

16.387,08

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

698,607000

69.860,70

Amortización de Principal
Principal Redemption
Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar

/To be determined

A determinar

/To be determined

A determinar

/To be determined

0,00

0,00

0,00

0,00

* 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