

# GAT ICO-FTVPO 1 FTH

(N.I.F.V65102576 )

## 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

21.12.2020

Periodo de Interés /  
Interest accrual period

desde / From  
hasta / To  
plazo / Term

21.09.2020

(incluido) / (included)

21.12.2020

(excluido) / (excluded)

91

días / days

Bonos Serie AG	Bonos Serie B (CA)	Bonos Serie B (CM)	Bonos Serie B (CP)	Bonos Serie B (CT)
Series AG Bonds	Series B (CA) Bonds	Series B (CM) Bonds	Series B (CP) Bonds	Series B (CT) Bonds
ES0341068007	ES0341068015	ES0341068023	ES0341068031	ES0341068049

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor

Margen / Margin

17.09.2020

-0,501%

-0,501%

-0,501%

-0,501%

-0,501%

0,500%

0,800%

0,800%

0,800%

0,800%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,001%

0,299%

0,299%

0,299%

0,299%

Tipo de Interés Nominal aplicable

Applicable interest rate

0,000%\*

0,299%

0,299%

0,299%

0,299%

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

9.458,87

3.316  
31.365.612,92

100.000,00

98  
9.800.000,00

100.000,00

33  
3.300.000,00

100.000,00

27  
2.700.000,00

100.000,00

20  
2.000.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

0,000000

0,00

75,580556

7.406,89

75,580556

2.494,16

75,580556

2.040,68

75,580556

1.511,61

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000

0,00

14,360306

1.407,31

14,360306

473,89

14,360306

387,73

14,360306

287,21

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

61,220250

5.999,58

61,220250

2.020,27

61,220250

1.652,95

61,220250

1.224,40

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

\* 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. 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. 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/

1/3

## 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** 21.12.2020

**Periodo de Interés / Interest accrual period**

desde / From 21.09.2020 (incluido) / (included)  
hasta / To 21.12.2020 (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie C (CA)	Bonos Serie C (CM)	Bonos Serie C (CP)	Bonos Serie C (CT)
Series C (CA) Bonds	Series C (CM) Bonds	Series C (CP) Bonds	Series C (CT) Bonds
ES0341068056	ES0341068064	ES0341068072	ES0341068080

**Determinación Tipo Interés Nominal**

*Nominal Interest Rate Calculation*

**Euribor 3 meses / 3 Months Euribor** 17.09.2020 -0,501%  
**Margen / Margin** 2,000%

**Tipo de interés calculado / Calculated interest rate** 1,499%

**Tipo de Interés Nominal aplicable**

*Applicable interest rate*

**1,499%** **1,499%** **1,499%** **1,499%**

**Número de Bonos / N. Bonds**

*Nominal / Face value*

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	32		23		15		15
100.000,00	3.200.000,00	100.000,00	2.300.000,00	100.000,00	1.500.000,00	100.000,00	1.500.000,00

**Liquidación de Intereses**

*Interest Payment*

(Euros)

**Base / Day count fraction** Act / 360

**Intereses Brutos / Gross Interest**

**Retención / Withholding tax** 19,00%

**Intereses Netos / Net Interest**

378,913889	12.125,24	378,913889	8.715,02	378,913889	5.683,71	378,913889	5.683,71
71,993639	2.303,80	71,993639	1.655,85	71,993639	1.079,90	71,993639	1.079,90
306,920250	9.821,44	306,920250	7.059,17	306,920250	4.603,81	306,920250	4.603,81

**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**

## 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

21.12.2020

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 21.09.2020 (incluido) / (included)  
 hasta / To 21.12.2020 (excluido) / (excluded)  
 plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie D (CA)	Bonos Serie D (CM)	Bonos Serie D (CP)	Bonos Serie D (CT)
Series D (CA) Bonds	Series D (CM) Bonds	Series D (CP) Bonds	Series D (CT) Bonds
ES0341068098	ES0341068106	ES0341068114	ES0341068122

### Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor	17.09.2020	-0,501%	-0,501%	-0,501%	-0,501%
Margen / Margin		5,000%	5,000%	5,000%	5,000%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

4,499%

### Tipo de Interés Nominal aplicable

Applicable interest rate

4,499%

Número de Bonos / N. Bonds

Nominal / Face value (Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	61		25		16		14

### Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction	Act /	360							
Intereses Brutos / Gross Interest		590,642992	36.029,22	988,569093	24.714,23	639,138739	10.226,22	829,223357	11.609,13
Retención / Withholding tax	19,00%	112,222168	6.845,55	187,828128	4.695,70	121,436360	1.942,98	157,552438	2.205,73
Intereses Netos / Net Interest		478,420824	29.183,67	800,740965	20.018,53	517,702379	8.283,24	671,670919	9.403,40

### Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined

### Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles

Payments not made due to insufficient Available Funds

(Euros)

Fecha vencimiento / Maturity date	22.06.2020 / 21.09.2020	20.06.2019 / 21.09.2020	20.12.2018 / 21.09.2020	20.03.2020 / 21.09.2020					
Intereses Brutos / Gross Interest	1.228,073286	74.912,47	5.272,908432	131.822,71	5.019,953489	80.319,26	2.571,418980	35.999,86	
Retención / Withholding tax	19,00%	233,333924	14.233,37	1.001,852602	25.046,31	953,791162	15.260,65	488,569606	6.839,97
Intereses Netos / Net Interest		994,739362	60.679,10	4.271,055830	106.776,40	4.066,162327	65.058,61	2.082,849374	29.159,89