

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
17.01.2020
Periodo de Interés / Interest accrual period

 desde / From
 hasta / To
 plazo / Term

17.10.2019 (incluido) / (included)
17.01.2020 (excluido) / (excluded)
 92 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	15.10.2019	-0,418%	-0,418%	-0,418%	-0,418%	-0,418%
Margen / Margin		0,150%	0,270%	0,480%	2,250%	3,900%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,268%	-0,148%	0,062%	1,832%	3,482%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,062%	1,832%	3,482%

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)	30.166,24	421.543.037,76	59.555,79	13.340.496,96	59.567,16	14.355.685,56	59.560,71	12.209.945,55	59.585,19	12.274.549,14

Liquidación de Intereses
Interest Payment

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

Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	9,438086	2.274,58	278,850009	57.164,25	530,215503	109.224,39
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	1,793236	432,17	52,981502	10.861,21	100,740946	20.752,63
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	7,644850	1.842,41	225,868507	46.303,04	429,474557	88.471,76

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
		<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>

* 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