

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
22.08.2019
Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

22.05.2019 (incluido) / (included)
22.08.2019 (excluido) / (excluded)
92 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	20/05/2019	-0,314%	-0,314%	-0,314%	-0,314%	-0,314%	-0,314%
Margen / Margin		0,120%	0,190%	0,270%	0,500%	1,900%	4,000%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,194%	-0,124%	-0,044%	0,186%	1,586%	3,686%

Tipo de Interés Nominal aplicable
Applicable interest rate

0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,186%	1,586%	3,686%
----------------	----------------	----------------	---------------	---------------	---------------

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	
	15.370		5.000		650		520		260		310	
	16.485,32	253.379.368,40	97.199,77	485.998.850,00	100.000,00	65.000.000,00	100.000,00	52.000.000,00	100.000,00	26.000.000,00	100.000,00	31.000.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment (Euros)

Base / Day count fraction	Act /	360											
Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	47,533333	24.717,33	405,311111	105.380,89	941,977778	292.013,11
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	9,031333	4.696,29	77,009111	20.022,37	178,975778	55.482,49
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	38,502000	20.021,04	328,302000	85.358,52	763,002000	236.530,62

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								24.02.2014 / 22.05.2019	22.08.2013 / 22.05.2019	24.11.2008 / 22.05.2019			
Retención / Withholding tax	19,00%							2.034,072223	1.057.717,57	10.918,538888	2.838.820,12	48.397,651882	15.003.272,06
Intereses Netos / Net Interest								386,473723	200.966,35	2.074,522388	539.375,81	9.195,553855	2.850.621,69
								1.647,598500	856.751,22	8.844,016500	2.299.444,31	39.202,098027	12.152.650,37

* 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/