

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

25.08.2021

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

25.05.2021 (incluido) / (included)
25.08.2021 (excluido) / (excluded)
92 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds
ES0312886015	ES0312886023	ES0312886031	ES0312886049

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 21.05.2021
Margen / Margin -0,543%

Tipo de interés calculado
Calculated interest rate

-0,543% -0,543% -0,543% -0,543%
0,180% 0,390% 0,780% 2,500%
-0,363% -0,153% 0,237% 1,957%

Tipo de Interés Nominal aplicable
Applicable interest rate

0,000%* 0,000%* 0,237% 1,957%

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	16.702		399		238		161
9.190,50	153.499.731,00	22.057,36	8.800.886,64	22.055,04	5.249.099,52	22.060,78	3.551.785,58

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act /

360

Intereses Brutos / Gross
Retención / Withholding tax 19,00%
Intereses Netos / Net Interest

0,000000 0,00 0,000000 0,00 13,358003 3.179,20 110,330863 17.763,27
0,000000 0,00 0,000000 0,00 2,538021 604,05 20,962864 3.375,02
0,000000 0,00 0,000000 0,00 10,819982 2.575,15 89,367999 14.388,25

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption (Euros)

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 II.10 y V.4.2.1 del Folleto Informativo 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 II.10 and V.4.2.1 of the Prospectus do not provide for the possibility of a negative Nominal Interest Rate which might result in interest being payable by Bondholders to the Fund.