

FECHA DE PAGO / Payment date
17.01.2022
Periodo de Interés /
Interest accrual period

 desde / From
 hasta / To
 plazo / Term

15.10.2021 (incluido) / (included)
17.01.2022 (excluido) / (excluded)
 94 días / days

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation
Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 13.10.2021 -0,548%
Margen / Margin 0,130%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,418%
Tipo de interés Nominal aplicable / Applicable interest rate 0,000%*

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds
ES0345672010	ES0345672036	ES0345672044	ES0345672051

-0,548%	-0,548%	-0,548%	-0,548%
0,130%	0,260%	0,500%	4,500%
-0,418%	-0,288%	-0,048%	3,952%
0,000%*	0,000%*	0,000%*	3,952%

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
	10.832		528		640		280
14.907,45	161.477.498,40	100.000,00	52.800.000,00	100.000,00	64.000.000,00	100.000,00	28.000.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

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

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	1.031,911111	288.935,11
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	196,063111	54.897,67
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	835,848000	234.037,44

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

Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles
Payments not made due to insufficient Available Funds

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date
Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax 19%
Intereses Netos / Net Interest

	15.10.2010-15.10.2021	15.01.2010-15.10.2021	15.01.2009-15.10.2021
4.482,266667	2.366.636,80	7.554,774757	4.835.055,84
851,630667	449.660,99	1.435,407203	918.660,61
3.630,636000	1.916.975,81	6.119,367554	3.916.395,23
			63.412,092222
			17.755.385,82
			12.048,297522
			3.373.523,30
			51.363,794700
			14.381.862,52

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles
Intereses por Aplazamiento de Intereses Impagados
Payments outstanding due to insufficient Available Funds
Interest Payment of deferred unpaid interest

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date
Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax 19%
Intereses Netos / Net Interest

	15.10.2010-15.10.2021	15.01.2010-15.10.2021	15.01.2009-15.10.2021
93,995417	49.629,58	274,217656	175.499,30
17,859129	9.429,62	52,101355	33.344,87
76,136288	40.199,96	222,116301	142.154,43
			19.702,462143
			5.516.689,40
			3.743,467807
			1.048.170,99
			15.958,994336
			4.468.518,41

* 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 3.4.6.1 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 3.4.6.1 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.