

FECHA DE PAGO / Payment date
24.01.2022
Periodo de Interés / Interest accrual period

 desde / From
 hasta / To
 plazo / Term

25.10.2021 (incluido) / (included)
24.01.2022 (excluido) / (excluded)
 91 días / days

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation
Euribor 3 meses / 3 Months Euribor 21.10.2021 -0,548%
Margen / Margin 0,300%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,248%

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
ES0312847009	ES0312847017	ES0312847025

-0,548%	-0,548%	-0,548%
0,300%	0,600%	1,200%
-0,248%	0,052%	0,652%

Tipo de interes Nominal aplicable / Applicable interest rate
0,000%*
0,052%
0,652%
Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value (Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	25.837		1.520		1.593
34.484,93	890.987.136,41	100.000,00	152.000.000,00	100.000,00	159.300.000,00

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

0,000000	0,00	13,144444	19.979,55	164,811111	262.544,10
0,000000	0,00	2,497444	3.796,11	31,314111	49.883,38
0,000000	0,00	10,647000	16.183,44	133,497000	212.660,72

Amortización de Principal
Principal Redemption
(Euros)
Amortización / Redemption
A determinar / To be determined
0,00
0,00
0,00
0,00

* 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.