

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

20.12.2021

Período de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

20.09.2021 (incluido) / (included)
20.12.2021 (excluido) / (excluded)
91 días / days

Bonos Serie AG	Bonos Serie B (CA)	Bonos Serie B (CM)	Bonos Serie B (CP)	Bonos Serie B (CT)
Series AG Bonds	Series B (CA) Bonds	Series B (CM) Bonds	Series B (CP) Bonds	Series B (CT) Bonds
ES0341068007	ES0341068015	ES0341068023	ES0341068031	ES0341068049

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor
Margen / Margin

16.09.2021

-0,545%	-0,545%	-0,545%	-0,545%	-0,545%
0,500%	0,800%	0,800%	0,800%	0,800%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,045%	0,255%	0,255%	0,255%	0,255%
---------	--------	--------	--------	--------

Tipo de Interés Nominal aplicable
Applicable interest rate

0,000%*	0,255%	0,255%	0,255%	0,255%
---------	--------	--------	--------	--------

Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	3.316		98		33		27		20
5.015,96	16.632.923,36	100.000,00	9.800.000,00	100.000,00	3.300.000,00	55.304,02	1.493.208,54	84.343,51	1.686.870,20

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest

0,000000	0,00	64,458333	6.316,92	64,458333	2.127,12	35,648050	962,50	54,366421	1.087,33
----------	------	-----------	----------	-----------	----------	-----------	--------	-----------	----------

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000	0,00	12,247083	1.200,21	12,247083	404,15	6,773130	182,87	10,329620	206,59
----------	------	-----------	----------	-----------	--------	----------	--------	-----------	--------

Intereses Netos / Net Interest

0,000000	0,00	52,211250	5.116,71	52,211250	1.722,97	28,874920	779,63	44,036801	880,74
----------	------	-----------	----------	-----------	----------	-----------	--------	-----------	--------

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 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 4.8 de la Nota de Valores y 3.4.6. 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. 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.

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

20.12.2021

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From 20.09.2021 (incluido) / (included)
hasta / To 20.12.2021 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie C (CA)	Bonos Serie C (CM)	Bonos Serie C (CP)	Bonos Serie C (CT)
Series C (CA) Bonds	Series C (CM) Bonds	Series C (CP) Bonds	Series C (CT) Bonds
ES0341068056	ES0341068064	ES0341068072	ES0341068080

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor 16.09.2021 -0,545% -0,545% -0,545% -0,545%
Margen / Margin 2,000% 2,000% 2,000% 2,000%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate 1,455% 1,455% 1,455% 1,455%

Tipo de Interés Nominal aplicable

Applicable interest rate

1,455% 1,455% 1,455% 1,455%

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros) 100.000,00 3.200.000,00 100.000,00 2.300.000,00 100.000,00 1.500.000,00 100.000,00 1.500.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest 367,791667 11.769,33 367,791667 8.459,21 367,791667 5.516,88 367,791667 5.516,88
Retención / Withholding tax 19,00% 69,880417 2.236,17 69,880417 1.607,25 69,880417 1.048,21 69,880417 1.048,21
Intereses Netos / Net Interest 297,911250 9.533,16 297,911250 6.851,96 297,911250 4.468,67 297,911250 4.468,67

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros) A determinar / To be determined A determinar / To be determined A determinar / To be determined A determinar / To be determined

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 20.12.2021

Periodo de Interés / Interest accrual period desde / From 20.09.2021 (incluido) / (included)
hasta / To 20.12.2021 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie D (CA)	Bonos Serie D (CM)	Bonos Serie D (CP)	Bonos Serie D (CT)
Series D (CA) Bonds	Series D (CM) Bonds	Series D (CP) Bonds	Series D (CT) Bonds
ES0341068098	ES0341068106	ES0341068114	ES0341068122

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation									
Euribor 3 meses / 3 Months Euribor	16.09.2021	-0,545%	-0,545%	-0,545%	-0,545%	-0,545%	-0,545%	-0,545%	-0,545%
Margen / Margin		5,000%	5,000%	5,000%	5,000%	5,000%	5,000%	5,000%	5,000%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		4,455%	4,455%	4,455%	4,455%	4,455%	4,455%	4,455%	4,455%

Tipo de Interés Nominal aplicable

Applicable interest rate	4,455%	4,455%	4,455%	4,455%
--------------------------	---------------	---------------	---------------	---------------

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value	(Euros)	Bono Serie	Bono Serie	Bono Serie	Bono Serie	Bono Serie	Bono Serie	Bono Serie	Bono Serie
		61	25	16	14				
		51.936,20	86.926,49	56.200,51	72.914,96	3.168.108,20	2.173.162,25	899.208,16	1.020.809,44

Liquidación de Intereses

Interest Payment	(Euros)	Base / Day count fraction	Act /						
		360							
Intereses Brutos / Gross Interest		584,866532	35.676,86	978,900936	24.472,52	632,887993	10.126,21	821,113593	11.495,59
Retención / Withholding tax	19,00%	111,124641	6.778,60	185,991178	4.649,78	120,248719	1.923,98	156,011583	2.184,16
Intereses Netos / Net Interest		473,741891	28.898,26	792,909758	19.822,74	512,639274	8.202,23	665,102010	9.311,43

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	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 vencimiento / Maturity date		22.06.2020 / 20.09.2021	20.06.2019 / 20.09.2021	20.12.2018 / 20.09.2021	20.03.2020 / 20.09.2021				
Intereses Brutos / Gross Interest		3.574,366141	218.036,34	9.199,938178	229.998,46	7.558,892707	120.942,28	5.865,457620	82.116,40
Retención / Withholding tax	19,00%	679,129566	41.426,91	1.747,988253	43.699,70	1.436,189612	22.979,02	1.114,436949	15.602,10
Intereses Netos / Net Interest		2.895,236575	176.609,43	7.451,949925	186.298,76	6.122,703095	97.963,26	4.751,020671	66.514,30