

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
27.12.2021
Período de Interés / Interest accrual period

desde / From **27.09.2021** (incluido) / (included)
hasta / To **27.12.2021** (excluido) / (excluded)
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0312888011	ES0312888029	ES0312888037	ES0312888045	ES0312888052

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation
Euribor 3 meses / 3 Months Euribor
Margen / Margin
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

23.09.2021	-0,543%	-0,543%	-0,543%	-0,543%	-0,543%
	0,130%	0,280%	0,560%	2,500%	4,000%
	-0,413%	-0,263%	0,017%	1,957%	3,457%

Tipo de Interés Nominal aplicable
Applicable Interest Rate

0,000%*	0,000%*	0,017%	1,957%	3,457%
---------	---------	--------	--------	--------

Número de Bonos / N. Bonds
Nominal / Face value

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
(Euros)	17.000	520	250	230	226					
	13.315,99	226.371.830,00	100.000,00	52.000.000,00	100.000,00	25.000.000,00	100.000,00	23.000.000,00	100.000,00	22.600.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment
Base / Day count fraction **Act /**
(Euros)
360
Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax
Intereses Netos / Net Interest

	0,000000	0,00	0,000000	0,00	4,297222	1.074,31	494,686111	113.777,81	873,852778	197.490,73
19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,816472	204,12	93,990361	21.617,78	166,032028	37.523,24
	0,000000	0,00	0,000000	0,00	3,480750	870,19	400,695750	92.160,03	707,820750	159.967,49

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

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles
Intereses Impagados Periodos Anteriores
Payments outstanding due to insufficient Available Funds
Unpaid Interest from previous periods
(Euros)
Fecha de vencimiento / Maturity date
Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax
Intereses Netos / Net Interest
19,00%

25.06.2008 / 27.09.2021	
61.476,436013	13.893.674,54
11.680,522843	2.639.798,17
49.795,913170	11.253.876,37

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
Intereses Netos / Net Interest
19,00%

25.06.2008 / 27.09.2021	
18.517,248894	4.184.898,25
3.518,277290	795.130,67
14.998,971604	3.389.767,58

* 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.