

FECHA DE PAGO / Payment date
25.04.2022
**Periodo de Interés /
Interest accrual period**

 desde / From
hasta / To
plazo / Term

24.01.2022 (incluido) / (included)

25.04.2022 (excluido) / (excluded)
91 días / days

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation
Euribor 3 meses / 3 Months Euribor 20.01.2022 -0,553%
Margen / Margin 0,300%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,253%

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

Tipo de interes Nominal aplicable / Applicable interest rate
0,000%*
0,047%
0,647%
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
33.631,75	868.943.524,75	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	11,880556	18.058,45	163,547222	260.530,72
0,000000	0,00	2,257306	3.431,11	31,073972	49.500,84
0,000000	0,00	9,623250	14.627,34	132,473250	211.029,88

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.