

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

21.12.2021

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 21.09.2021 (incluido) / (included)
 hasta / To 21.12.2021 (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
ES0313529010	ES0313529028	ES0313529036	ES0313529044	ES0313529051

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	17.09.2021	-0,548%	-0,548%	-0,548%	-0,548%	-0,548%
Margen / Margin		0,160%	0,290%	0,700%	2,000%	3,900%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,388%	-0,258%	0,152%	1,452%	3,352%
Tipo de interes aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,152%	1,452%	3,352%

Número de Bonos / N.Bonds	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Nominal / Face value	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
		15.754		207		224		191		224
(Euros)	14.380,61	226.552.129,94	41.254,26	8.539.631,82	41.255,48	9.241.227,52	41.259,46	7.880.556,86	49.841,08	11.164.401,92

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction	Act /	360	Bono		Bono		Bono		Bono	
Intereses Brutos / Gross Interest		0,00	0,000000	0,00	15,851272	3.550,68	151,435971	28.924,27	422,309009	94.597,22
Retención / Withholding tax	19%	0,00	0,000000	0,00	3,011742	674,63	28,772834	5.495,61	80,238712	17.973,47
Intereses Netos / Net Interest		0,00	0,000000	0,00	12,839530	2.876,05	122,663137	23.428,66	342,070297	76.623,75

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar
	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	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 II.10 y V.4.2.1 del Folleto Informativo 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 II.10 and V.4.2.1 of the Prospectus do not provide for the possibility of a negative Nominal Interest Rate which might result in interest being payable by Bondholders to the Fund.