

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Amortisation

FECHA DE PAGO / Payment date

17.01.2022

Período de Interés / Interest accrual period desde / From hasta / To plazo / Term

18.10.2021 (incluido) / (included) 17.01.2022 (excluido) / (excluded) 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
ES0313270011	ES0313270029	ES0313270037	ES0313270045	ES0313270052

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

 Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 14.10.2021 -0,551%
 Margen / Margin 0,150%
 Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,401%

-0,551%	-0,551%	-0,551%	-0,551%	-0,551%
0,150%	0,270%	0,480%	2,250%	3,900%
-0,401%	-0,281%	-0,071%	1,699%	3,349%
0,000%*	0,000%*	0,000%*	1,699%	3,349%

Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	
	13.974		224		241		205		206	
Número de Bonos / N. Bonds										
Nominal / Face value (Euros)	22.675,55	316.868.135,70	46.570,24	10.431.733,76	46.579,13	11.225.570,33	46.574,09	9.547.688,45	53.689,37	11.060.010,22

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360

 Intereses Brutos / Gross Interest 0,000000
 Retención / Withholding tax 19,00% 0,000000
 Intereses Netos / Net Interest 0,000000

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	200,021486	41.004,40	454,508853	93.628,82
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	38,004082	7.790,84	86,356682	17.789,48
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	162,017404	33.213,56	368,152171	75.839,34

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption (Euros)

 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

Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles

Payments not made due to insufficient Available Funds

Fecha de Vencimiento / Maturity date Intereses Brutos / Gross Interest Retención / Withholding tax Intereses Netos / Net Interest

18.01.2021 - 18.10.2021	1.117,461893	230.197,15	212,317760	43.737,46	905,144133	186.459,69
-------------------------	--------------	------------	------------	-----------	------------	------------

* 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.