

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
22.11.2021
Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From **23.08.2021** (incluido) / (included)
hasta / To **22.11.2021** (excluido) / (excluded)
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie A3	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series A3 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0312872015	ES0312872023	ES0312872031	ES0312872049	ES0312872056	ES0312872064

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation
Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 19/08/2021 -0,550%
Margen / Margin 0,120%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate -0,430%

-0,550%	-0,550%	-0,550%	-0,550%	-0,550%	-0,550%
0,120%	0,190%	0,270%	0,500%	1,900%	4,000%
-0,430%	-0,360%	-0,280%	-0,050%	1,350%	3,450%

Tipo de Interés Nominal aplicable
Applicable interest rate

0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,000%*	1,350%	3,450%
---------	---------	---------	---------	--------	--------

Número de Bonos / N. Bonds
Nominal / Face value (Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	15.370		5.000		650		520		260		310
1.616,19	24.840.840,30	97.199,77	485.998.850,00	100.000,00	65.000.000,00	100.000,00	52.000.000,00	100.000,00	26.000.000,00	100.000,00	31.000.000,00

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	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	341,250000	88.725,00	872,083333	270.345,83
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	64,837500	16.857,75	165,695833	51.365,71
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	276,412500	71.867,25	706,387500	218.980,12

Amortización de Principal
Principal Redemption
Amortización / Redemption (Euros)

A determinar / To be determined	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
---------------------------------	------	------	------	------	------	------	------	------	------	------	------

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles
Payments outstanding due to insufficient Available Funds (Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date
Intereses Brutos / Gross Interest
Retención / Withholding tax 19,00%
Intereses Netos / Net Interest

	24.02.2014 / 23.08.2021	22.08.2013 / 23.08.2021	24.11.2008 / 23.08.2021
Intereses Brutos / Gross Interest	2.208,058333	1.148.190,34	14.267,899999
Retención / Withholding tax	419,531083	218.156,17	2.710,900999
Intereses Netos / Net Interest	1.788,527250	930.034,17	11.556,999000

* 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.