

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

19.10.2021

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / Fr 19.07.2021 (incluido) / (included)
hasta / To 19.10.2021 (excluido) / (excluded)
plazo / To 92 días / days

Bonos Serie A2a	Bonos Serie A2b	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2a Bonds	Series A2b Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0366367011	ES0366367029	ES0366367037	ES0366367045	ES0366367052	ES0366367060

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor

15/07/2021

-0,548%

-0,548%

-0,548%

-0,548%

-0,548%

-0,548%

Margen / Margin

0,130%

0,140%

0,250%

0,550%

2,000%

4,000%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate

-0,418%

-0,408%

-0,298%

0,002%

1,452%

3,452%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate

0,000%*

0,000%*

0,000%*

0,002%

1,452%

3,452%

Número de Bonos / N. Bonds

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	8,024		3,500		273		156		72		234

Nominal / Face value

(Euros)

13.745,73 110.295.737,52 13.745,73 48.110.055,00 27.278,18 7.446.943,14 27.278,18 4.255.396,08 100.000,00 7.200.000,00 25.000,00 5.850.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,139422

21,75

371,066667

26.716,80

220,544444

51.607,40

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,026490

4,13

70,502667

5.076,19

41,903444

9.805,41

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,112932

17,62

300,564000

21.640,61

178,641000

41.801,99

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar / To be determined

A determinar / To be determined

A determinar / To be determined

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.