

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
23.05.2022
Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

22.02.2022 (incluido) / (included)
23.05.2022 (excluido) / (excluded)
90 días / days

Bonos Serie A3	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
<i>Series A3 Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>	<i>Series D Bonds</i>	<i>Series E Bonds</i>
ES0312872023	ES0312872031	ES0312872049	ES0312872056	ES0312872064

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation
Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

18/02/2022

-0,528%

-0,528%

-0,528%

-0,528%

-0,528%

Margen / Margin

0,190%

0,270%

0,500%

1,900%

4,000%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,338%

-0,258%

-0,028%

1,372%

3,472%

Tipo de Interés Nominal aplicable
Applicable interest rate

0,000%*

0,000%*

0,000%*

1,372%

3,472%

Número de Bonos / N. Bonds
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>
	5.000		650		520		260		310
95.092,49	475.462.450,00	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

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

343,000000

89.180,00

868,000000

269.080,00

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

65,170000

16.944,20

164,920000

51.125,20

Intereses Netos / Net Interest

0,000000

0,00

0,000000

0,00

0,000000

0,00

277,830000

72.235,80

703,080000

217.954,80

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

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 / 22.02.2022
22.08.2013 / 22.02.2022
24.11.2008 / 22.02.2022

2.208,058333

1.148.190,34

14.950,572221

3.887.148,79

58.303,851881

18.074.194,05

419,531083

218.156,17

2.840,608721

738.558,27

11.077,731854

3.434.096,87

1.788,527250

930.034,17

12.109,963500

3.148.590,52

47.226,120027

14.640.097,18

* 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.