

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
26.07.2021
Periodo de Interés / Interest accrual period

 desde / From
 hasta / To
 plazo / Term

26.04.2021 (incluido) / (included)
26.07.2021 (excluido) / (excluded)
 91 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>	<i>Series D Bonds</i>	<i>Series E Bonds</i>
ES0312887005	ES0312887013	ES0312887021	ES0312887039	ES0312887047

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	22.04.2021	-0,539%	-0,539%	-0,539%	-0,539%	-0,539%
Margen / Margin		0,110%	0,230%	0,450%	1,750%	3,500%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,429%	-0,309%	-0,089%	1,211%	2,961%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate

	0,000%*	0,000%*	0,000%*	1,211%	2,961%
--	----------------	----------------	----------------	---------------	---------------

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>
	15.617	602		149		132		301	
8.095,16	126.422.113,72	100.000,00	60.200.000,00	100.000,00	14.900.000,00	100.000,00	13.200.000,00	93.355,49	28.100.002,49

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest		0,00	0,00	0,00	0,00	306,113889	40.407,03	698,742504	210.321,49
Retención / Withholding tax	19%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	58,161639	7.677,34	132,761076	39.961,08
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	247,952250	32.729,69	565,981428	170.360,41

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
---------------------------------	------	------	------	------	------	------	------	------	------

* 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.