

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*

22.11.2021

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / *From*
 hasta / *To*
 plazo / *Term*

23.08.2021 (incluido) / *(included)*
 22.11.2021 (excluido) / *(excluded)*
 91 días / *days*

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
<i>Series A2 Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>	<i>Series D Bonds</i>	<i>Series E Bonds</i>
ES0313714018	ES0313714026	ES0313714034	ES0313714042	ES0313714059

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / *3 Month Euribor* 19.08.2021 -0,550%
 Margen / *Margin* 0,140%
 Tipo de interés calculado / *Calculated interest rate* -0,410%
 Tipo de interés aplicable / *Applicable interest rate* 0,000%*

-0,550%	-0,550%	-0,550%	-0,550%	-0,550%
0,140%	0,300%	0,550%	2,250%	3,900%
-0,410%	-0,250%	0,000%	1,700%	3,350%
0,000%*	0,000%*	0,000%*	1,700%	3,350%

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

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>
	8.168		156		153		98		125
16.994,05	138.807.400,40	46.645,83	7.276.749,48	46.640,63	7.136.016,39	46.650,71	4.571.769,58	49.700,00	6.212.500,00

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	200,468468	19.645,91	420,862361	52.607,80
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	38,089009	3.732,72	79,963849	9.995,48
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	162,379459	15.913,19	340,898512	42.612,32

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / *Redemption*

A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar
<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>	<i>To be determined</i>

* 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.