

**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**
**22.08.2022**
**Periodo de Interés /**  
*Interest accrual period*

desde / From  
hasta / To  
plazo / Term

**23.05.2022** (incluido) / (included)  
**22.08.2022** (excluido) / (excluded)  
91 días / days

**Determinación Tipo Interés Nominal**  
*Nominal Interest Rate Calculation*
**Euribor 3 meses / 3 Month Euribor** 19/05/2022 -0,348%  
**Margen / Margin** 0,190%  
**Tipo de interés calculado / Calculated interest rate** -0,158%

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

**Tipo de Interés Nominal aplicable**  
*Applicable interest rate*

0,000%*	0,000%*	0,152%	1,552%	3,652%
---------	---------	--------	--------	--------

**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	
	91.246,82	456.234.100,00	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*
**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	38,422222	19.979,56	392,311111	102.000,89	923,144444	286.174,78
0,000000	0,00	0,000000	0,00	7,300222	3.796,12	74,539111	19.380,17	175,397444	54.373,21
0,000000	0,00	0,000000	0,00	31,122000	16.183,44	317,772000	82.620,72	747,747000	231.801,57

**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

**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 / 23.05.2022	22.08.2013 / 23.05.2022	24.11.2008 / 23.05.2022
Intereses Brutos / Gross Interest	2.208,058333	1.148.190,34	15.293,572221
Retención / Withholding tax	419,531083	218.156,17	2.905,778721
Intereses Netos / Net Interest	1.788,527250	930.034,17	12.387,793500

\* 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.