

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
25.05.2021
Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / *From*
hasta / *To*
plazo / *Term*
25.02.2021 (incluido) / *(included)*
25.05.2021 (excluido) / *(excluded)*
89 días / *days*

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D
<i>Series A2 Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>	<i>Series D Bonds</i>
ES0312886015	ES0312886023	ES0312886031	ES0312886049

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation
Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 23.02.2021 -0,540%

Margen / Margin 0,180%
Tipo de interés calculado -0,360%
Calculated interest rate

-0,540% -0,540% -0,540% -0,540%
0,180% 0,390% 0,780% 2,500%
-0,360% -0,150% 0,240% 1,960%

Tipo de Interés Nominal aplicable
Applicable interest rate
0,000%* **0,000%*** **0,240%** **1,960%**
Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value (Euros)

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>
	16.702		399		238		161
9.673,79	161.571.640,58	22.057,36	8.800.886,64	22.055,04	5.249.099,52	22.060,78	3.551.785,58

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / *Day count fraction* Act / **360** (Euros)

Intereses Brutos / Gross 0,000000 0,00 0,000000 0,00 13,085990 3.114,47 106,896735 17.210,37
Retención / Withholding tax 19,00% 0,000000 0,00 0,000000 0,00 2,486338 591,75 20,310380 3.269,97
Intereses Netos / Net Interest 0,000000 0,00 0,000000 0,00 10,599652 2.522,72 86,586355 13.940,40

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**

* 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.