

**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** 15.06.2021

**Periodo de Interés / Interest accrual period**  
desde / From 15.03.2021 (incluido) / (included)  
hasta / To 15.06.2021 (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 92 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
ES0313548002	ES0313548010	ES0313548028

**Determinación Interés Nominal**  
*Nominal Interest Calculation*

<b>Euribor 3 meses / 3 Month Euribor</b>	11/03/2021	-0,542%	-0,542%	-0,542%
<b>Margen / Margin</b>		0,170%	0,480%	1,000%
<b>Tipo de interés calculado / Calculated interest rate</b>		-0,372%	-0,062%	0,458%
<b>Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate</b>		<b>0,000%*</b>	<b>0,000%*</b>	<b>0,458%</b>

	Bono		Bono		Bono	
	Serie		Serie		Serie	
	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
<b>Número de Bonos / N. Bonds</b>		10.293		214		193
<b>Nominal / Face value</b> (Euros)	9.471,38	97.488.914,34	24.407,31	5.223.164,34	24.356,72	4.700.846,96

**Liquidación de Intereses**

*Interest Payment* (Euros)

<b>Base / Day count fraction</b>	Act /	360				
<b>Intereses Brutos / Gross Interest</b>		0,000000	0,00	0,000000	0,00	28,508188
<b>Retención / Withholding tax</b> 19,00%		0,000000	0,00	0,000000	0,00	5,416556
<b>Intereses Netos / Net Interest</b>		0,000000	0,00	0,000000	0,00	23,091632

**Amortización de Principal**

*Principal Redemption*

<b>Amortización / Redemption</b> (Euros)	<b>A determinar</b>	A determinar	<b>A determinar</b>	A determinar	<b>A determinar</b>	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>

\* 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.