

## 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

22.08.2022

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From  
hasta / To  
plazo / Term

23.05.2022  
22.08.2022  
91

(incluido) / (included)  
(excluido) / (excluded)  
días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0313714018	ES0313714026	ES0313714034	ES0313714042	ES0313714059

### Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	19.05.2022	-0,348%	-0,348%	-0,348%	-0,348%	-0,348%
Margen / Margin		0,140%	0,300%	0,550%	2,250%	3,900%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,208%	-0,048%	0,202%	1,902%	3,552%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		<b>0,000%</b>	<b>0,000%</b>	<b>0,202%</b>	<b>1,902%</b>	<b>3,552%</b>

Número de Bonos / N Bonds  
Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	8.168		156		153		98		125
14.795,30	120.848.010,40	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

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest  
Retención / Withholding tax  
Intereses Netos / Net Interest

19,00%

0,000000	0,00	0,000000	0,00	23,815224	3.643,73	224,288839	21.980,31	446,239733	55.779,97
0,000000	0,00	0,000000	0,00	4,524893	692,31	42,614879	4.176,26	84,785549	10.598,19
0,000000	0,00	0,000000	0,00	19,290331	2.951,42	181,673960	17.804,05	361,454184	45.181,78

### Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar
To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	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 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.