

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 A1	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Series A1 Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>
ES0366366005	ES0366366021	ES0366366039

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation
Euribor 3 Meses / 3 Months Euribor 11.03.2021 -0,542%
+ Margen / Margin 0,130%

-0,542%
0,210%

-0,542%
0,550%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate
Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate

-0,412%
0,000%*

-0,332%
0,000%*

0,008%
0,008%
Número de Bonos / N.Bonds
Nominal / Face value
(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>
	9.571		192		237
10.380,85	99.355.115,35	22.764,61	4.370.805,12	23.689,63	5.614.442,31

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 **0,484321** 114,78
0,000000 0,00 **0,000000** 0,00 **0,092021** 21,81
0,000000 0,00 **0,000000** 0,00 **0,392300** 92,97

Amortización de Principal
Principal Redemption
Amortización / Redemption
(Euros)
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.