

**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**
**25.03.2022**
**Período de Interés / Interest accrual period**

desde / From **27.12.2021** (incluido) / (included)  
hasta / To **25.03.2022** (excluido) / (excluded)  
plazo / Term **88** 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
ES0312888011	ES0312888029	ES0312888037	ES0312888045	ES0312888052

**Determinación Tipo Interés Nominal**
*Nominal Interest Rate Calculation*
**Euribor 3 meses / 3 Months Euribor**

23.12.2021

**Margen / Margin**
**Tipo de interés calculado / Calculated interest rate**

-0,588%	-0,588%	-0,588%	-0,588%	-0,588%
0,130%	0,280%	0,560%	2,500%	4,000%
-0,458%	-0,308%	-0,028%	1,912%	3,412%

**Tipo de Interés Nominal aplicable**
*Applicable Interest Rate*

0,000%*	0,000%*	0,000%*	1,912%	3,412%
---------	---------	---------	--------	--------

**Número de Bonos / N. Bonds**
*Nominal / Face value*

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
	17.000		520		250		230		226
12.635,75	214.807.750,00	100.000,00	52.000.000,00	100.000,00	25.000.000,00	100.000,00	23.000.000,00	100.000,00	22.600.000,00

**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	0,000000	0,00	467,377778	107.496,89	834,044444	188.494,04
	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	88,801778	20.424,41	158,468444	35.813,87
	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	378,576000	87.072,48	675,576000	152.680,17

**Amortización de Principal**
*Principal Redemption*

(Euros)

**Amortización / Redemption**
**A determinar / To be determined**

0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
------	------	------	------	------	------	------	------	------	------

**Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles**
**Intereses Impagados Periodos Anteriores**
*Payments outstanding due to insufficient Available Funds*

(Euros)

*Unpaid Interest from previous periods*
**Fecha de vencimiento / Maturity date**
**Intereses Brutos / Gross Interest**
**Retención / Withholding tax**
**Intereses Netos / Net Interest**

19,00%

**25.06.2008 / 27.12.2021**

62.350,288791	14.091.165,27
11.846,554871	2.677.321,41
50.503,733920	11.413.843,86

**Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles**
**Intereses por Aplazamiento de Intereses Impagados**
*Payments outstanding due to insufficient Available Funds*

(Euros)

*Interest Payment of deferred unpaid interest*
**Fecha de vencimiento / Maturity date**
**Intereses Brutos / Gross Interest**
**Retención / Withholding tax**
**Intereses Netos / Net Interest**

19,00%

**25.06.2008 / 27.12.2021**

19.054,462433	4.306.308,51
3.620,347862	818.198,62
15.434,114571	3.488.109,89

\* 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.