

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 15.09.2021

Periodo de Interés / Interest accrual period
desde / From 15.06.2021 (incluido) / (included)
hasta / To 15.09.2021 (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

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	11/06/2021	-0,548%	-0,548%	-0,548%
Margen / Margin		0,170%	0,480%	1,000%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,378%	-0,068%	0,452%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,452%

	Bono		Bono		Bono	
	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
Número de Bonos / N. Bonds		10.293		214		193
Nominal / Face value (Euros)	9.018,33	92.825.670,69	24.407,31	5.223.164,34	24.356,72	4.700.846,96

Liquidación de Intereses
Interest Payment

Base / Day count fraction	Act /	360					
Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	28,134718	5.430,00
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	5,345596	1.031,70
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	22,789122	4.398,30

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption (Euros)	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	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.