

**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

17.01.2022

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 15.10.2021 (incluido) / (included)  
 hasta / To 17.01.2022 (excluido) / (excluded)  
 plazo / Term 94 días / days

Bonos Serie A2a	Bonos Serie A2b	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2a Bonds	Series A2b Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0345721015	ES0345721023	ES0345721031	ES0345721049	ES0345721056	ES0345721064

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

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	13.10.2021	-0,548%	-0,548%	-0,548%	-0,548%	-0,548%	-0,548%
Margen / Margin		0,130%	0,130%	0,170%	0,290%	0,530%	4,500%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,418%	-0,418%	-0,378%	-0,258%	-0,018%	3,952%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,000%*	0,000%*	3,952%

Número de Bonos / N. Bonds  
 Nominal / Face value

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	
	5,000		2,362		220		183		235		160	
(Euros)	9.351,93	46.759.650,00	9.351,93	22.089.258,66	100.000,00	22.000.000,00	100.000,00	18.300.000,00	100.000,00	23.500.000,00	100.000,00	16.000.000,00

**Liquidación de Intereses**  
*Interest Payment*

Base / Day count fraction	Act /	360											
Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	1.031,911111	165.105,78
Retención / Withholding tax	19,00%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	196,063111	31.370,10
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	835,848000	133.735,68

**Amortización de Principal**  
*Principal Redemption*

Amortización / Redemption	(Euros)	A determinar / To be determined		A determinar / To be determined		0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
---------------------------	---------	---------------------------------	--	---------------------------------	--	------	------	------	------	------	------	------	------

**Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles**  
*Payments not made due to insufficient Available Funds*

Fecha de Vencimiento / Maturity date	<b>15.01.2009-15.10.2021</b>												
Intereses Brutos / Gross Interest												63.412,092222	10.145.934,74
Retención / Withholding tax	(Euros)											12.048,297522	1.927.727,59
Intereses Netos / Net Interest	19,00%											51.363,794700	8.218.207,15

**Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles**  
*Payments outstanding due to insufficient Available Funds*  
*Interest Payment of deferred unpaid interest*

Fecha de Vencimiento / Maturity Date	<b>15.01.2009-15.10.2021</b>												
Intereses Brutos / Gross Interest												19.702,462125	3.152.393,94
Retención / Withholding tax	(Euros)											3.743,467804	598.954,85
Intereses Netos / Net Interest	19,00%											15.958,994321	2.553.439,09

\* 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 3.4.6.1 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 3.4.6.1 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.