

**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**
**18.01.2022**
**Periodo de Interés / Interest accrual period**  
desde / From hasta / To plazo / Term

**18.10.2021** (incluido) / (included)  
**18.01.2022** (excluido) / (excluded)  
92 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>	<i>Series D Bonds</i>	<i>Series E Bonds</i>
ES0374273003	ES0374273011	ES0374273029	ES0374273037	ES0374273045

**Determinación Tipo Interés Nominal**  
*Nominal Interest Rate Calculation*

<b>Euribor 3 meses / 3 Month Euribor</b>	<b>14/10/2021</b>	-0,551%	-0,551%	-0,551%	-0,551%	-0,551%
<b>Margen / Margin</b>		0,170%	0,340%	0,550%	2,000%	4,000%
<b>Tipo de interés calculado / Calculated interest rate</b>		-0,381%	-0,211%	-0,001%	1,449%	3,449%
<b>Tipo de Interes Nominal aplicable / Applicable Interest Rate</b>		<b>0,000%*</b>	<b>0,000%*</b>	<b>0,000%*</b>	<b>1,449%</b>	<b>3,449%</b>

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	
	10.081		363		80		128		128	
<b>Número de Bonos / N. Bonds</b>										
<b>Nominal / Face value</b> (Euros)	10.159,55	102.418.423,55	21.540,30	7.819.128,90	21.538,17	1.723.053,60	21.536,38	2.756.656,64	49.931,25	6.391.200,00

**Liquidación de Intereses**  
*Interest Payment*  
Base / Day count fraction Act 360

<b>Intereses Brutos / Gross Interest</b>		0,00	0,00	0,00	0,00	79,749215	10.207,90	440,099585	56.332,75
<b>Retención / Withholding tax</b> 19,00%		0,00	0,00	0,00	0,00	15,152351	1.939,50	83,618921	10.703,22
<b>Intereses Netos / Net Interest</b>		0,00	0,00	0,00	0,00	64,596864	8.268,40	356,480664	45.629,53

**Amortización de Principal**  
*Principal Redemption*

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

\* 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