

**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

19.04.2022

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From  
hasta / To  
plazo / Term

17.01.2022 (incluido) / (included)  
19.04.2022 (excluido) / (excluded)  
92 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
ES0313270011	ES0313270029	ES0313270037	ES0313270045	ES0313270052

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

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	13.01.2022	-0,563%	-0,563%	-0,563%	-0,563%	-0,563%
Margen / Margin		0,150%	0,270%	0,480%	2,250%	3,900%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,413%	-0,293%	-0,083%	1,687%	3,337%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		<b>0,000%*</b>	<b>0,000%*</b>	<b>0,000%*</b>	<b>1,687%</b>	<b>3,337%</b>

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	13.974		224		241		205		206
21.817,01	304.870.897,74	46.570,24	10.431.733,76	46.579,13	11.225.570,33	46.574,09	9.547.688,45	53.689,37	11.060.010,22

**Liquidación de Intereses**  
*Interest Payment*

Base / Day count fraction

Act /

(Euros)

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	200,791252	41.162,21	457,856982	94.318,54
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	38,150338	7.820,82	86,992827	17.920,52
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	162,640914	33.341,39	370,864155	76.398,02

**Amortización de Principal**  
*Principal Redemption*

Amortización / Redemption

(Euros)

<b>A determinar</b>	A determinar	<b>A determinar</b>	A determinar	<b>A determinar</b>	A determinar	<b>A determinar</b>	A determinar	<b>A determinar</b>	A determinar
To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined	To be determined

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

(Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

19%

**18.01.2021 - 17.01.2022**

1.571,970746

323.825,97

298,674442

61.526,93

1.273,296304

262.299,04

\* 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.