

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

21.03.2022

Periodo de interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

21.12.2021 (incluido) / (included)
21.03.2022 (excluido) / (excluded)
90 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
ES0313529010	ES0313529028	ES0313529036	ES0313529044	ES0313529051

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	17.12.2021	-0,581%	-0,581%	-0,581%	-0,581%	-0,581%
Margen / Margin		0,160%	0,290%	0,700%	2,000%	3,900%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,421%	-0,291%	0,119%	1,419%	3,319%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,119%	1,419%	3,319%

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
	15.754	207	224	191	224				
13.705,98	215.924.008,92	41.254,26	8.539.631,82	41.255,48	9.241.227,52	41.259,46	7.880.556,86	49.841,08	11.164.401,92

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction Act / 360 (Euros)

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

Intereses Netos / Net Interest

19%

0,000000	0,00	0,000000	0,00	12,273505	2.749,27	146,367934	27.956,28	413,556361	92.636,62
0,000000	0,00	0,000000	0,00	2,331966	522,36	27,809907	5.311,69	78,575709	17.600,96
0,000000	0,00	0,000000	0,00	9,941539	2.226,91	118,558027	22.644,59	334,980652	75.035,66

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	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

* 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.