

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
21.06.2022
Periodo de Interés /
Interest accrual period

 desde / From **21.03.2022** (incluido) / (included)
 hasta / To **21.06.2022** (excluido) / (excluded)
 plazo / Term 92 días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
<i>Series A2 Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>	<i>Series D Bonds</i>	<i>Series E Bonds</i>
ES0313529010	ES0313529028	ES0313529036	ES0313529044	ES0313529051

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	17.03.2022	-0,493%	-0,493%	-0,493%	-0,493%	-0,493%
Margen / Margin		0,160%	0,290%	0,700%	2,000%	3,900%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,333%	-0,203%	0,207%	1,507%	3,407%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,000%*	0,207%	1,507%	3,407%

	Bono		Bono		Bono		Bono		Bono		
	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	
Número de Bonos / N.Bonds	15.754		207		224		191		224		
Nominal / Face value	(Euros)	13.094,08	206.284.136,32	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										
Intereses Brutos / Gross Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	21,824149	4.888,61	158,899349	30.349,78	433,955208	97.205,97	
Retención / Withholding tax	19%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	4,146588	928,84	30,190876	5.766,46	82,451490	18.469,13	
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	17,677561	3.959,77	128,708473	24.583,32	351,503718	78.736,84	

Amortización de Principal
Principal Redemption

Amortización / Redemption		A determinar	A determinar	A determinar	A determinar	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>	<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.