

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
25.01.2022
Periodo de Interés / Interest accrual period

 desde / From
 hasta / To
 plazo / Term

25.10.2021 (incluido) / (included)
25.01.2022 (excluido) / (excluded)
 92 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0312887005	ES0312887013	ES0312887021	ES0312887039	ES0312887047

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	21.10.2021	-0,548%	-0,548%	-0,548%	-0,548%	-0,548%
Margen / Margin		0,110%	0,230%	0,450%	1,750%	3,500%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,438%	-0,318%	-0,098%	1,202%	2,952%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate

0,000%*	0,000%*	0,000%*	1,202%	2,952%
----------------	----------------	----------------	---------------	---------------

Número de Bonos / N. Bonds
Nominal / Face value

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	
	15.617		602		149		132		301	
(Euros)	7.112,05	111.068.884,85	100.000,00	60.200.000,00	100.000,00	14.900.000,00	100.000,00	13.200.000,00	93.355,49	28.100.002,49

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

Intereses Brutos / Gross Interest		0,00	0,00	0,00	0,00	307,177778	40.547,47	704,273817	211.986,42
Retención / Withholding tax	19%	0,000000	0,00	0,000000	0,00	58,363778	7.704,02	133,812025	40.277,42
Intereses Netos / Net Interest		0,000000	0,00	0,000000	0,00	248,814000	32.843,45	570,461792	171.709,00

Amortización de Principal
Principal Redemption

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

* 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.