

## 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

21.06.2021

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From  
hasta / To  
plazo / Term

22.03.2021 (incluido) / (included)  
21.06.2021 (excluido) / (excluded)  
91 días / days

Bonos Serie AG	Bonos Serie B (CA)	Bonos Serie B (CM)	Bonos Serie B (CP)	Bonos Serie B (CT)
Series AG Bonds	Series B (CA) Bonds	Series B (CM) Bonds	Series B (CP) Bonds	Series B (CT) Bonds
ES0341068007	ES0341068015	ES0341068023	ES0341068031	ES0341068049

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor  
Margen / Margin

17.03.2021

-0,543% -0,543% -0,543% -0,543% -0,543%

0,500% 0,800% 0,800% 0,800% 0,800%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

-0,043% 0,257% 0,257% 0,257% 0,257%

Tipo de Interés Nominal aplicable

Applicable interest rate

0,000%\* 0,257% 0,257% 0,257% 0,257%

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
	3.316		98		33		27		20
6.938,31	23.007.435,96	100.000,00	9.800.000,00	100.000,00	3.300.000,00	85.262,03	2.302.074,81	100.000,00	2.000.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

0,000000 0,00 64,963889 6.366,46 64,963889 2.143,81 55,389530 1.495,52 64,963889 1.299,28

Retención / Withholding tax

19,00%

0,000000 0,00 12,343139 1.209,63 12,343139 407,32 10,524011 284,15 12,343139 246,86

Intereses Netos / Net Interest

0,000000 0,00 52,620750 5.156,83 52,620750 1.736,49 44,865519 1.211,37 52,620750 1.052,42

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined A determinar / To be determined A determinar / To be determined A determinar / To be determined A determinar / 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 4.8 de la Nota de Valores y 3.4.6. 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. 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.

## 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** 21.06.2021

**Periodo de Interés / Interest accrual period**

desde / From 22.03.2021 (incluido) / (included)  
hasta / To 21.06.2021 (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie C (CA)	Bonos Serie C (CM)	Bonos Serie C (CP)	Bonos Serie C (CT)
Series C (CA) Bonds	Series C (CM) Bonds	Series C (CP) Bonds	Series C (CT) Bonds
ES0341068056	ES0341068064	ES0341068072	ES0341068080

**Determinación Tipo Interés Nominal**

*Nominal Interest Rate Calculation*

**Euribor 3 meses / 3 Months Euribor** 17.03.2021 -0,543% -0,543% -0,543% -0,543%  
**Margen / Margin** 2,000% 2,000% 2,000% 2,000%

**Tipo de interés calculado / Calculated interest rate** 1,457% 1,457% 1,457% 1,457%

**Tipo de Interés Nominal aplicable**

*Applicable interest rate*

**1,457%** **1,457%** **1,457%** **1,457%**

**Número de Bonos / N. Bonds**

*Nominal / Face value*

(Euros) **100.000,00** **3.200.000,00** **100.000,00** **2.300.000,00** **100.000,00** **1.500.000,00** **100.000,00** **1.500.000,00**

**Liquidación de Intereses**

*Interest Payment*

(Euros) **Base / Day count fraction** Act / **360**

**Intereses Brutos / Gross Interest** 368,297222 11.785,51 368,297222 8.470,84 368,297222 5.524,46 368,297222 5.524,46  
**Retención / Withholding tax** 19,00% 69,976472 2.239,25 69,976472 1.609,46 69,976472 1.049,65 69,976472 1.049,65  
**Intereses Netos / Net Interest** 298,320750 9.546,26 298,320750 6.861,38 298,320750 4.474,81 298,320750 4.474,81

**Amortización de Principal**

*Principal Redemption*

(Euros)

**Amortización / Redemption** **A determinar / To be determined** **A determinar / To be determined** **A determinar / To be determined** **A determinar / To be determined**

## 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

21.06.2021

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 22.03.2021 (incluido) / (included)  
hasta / To 21.06.2021 (excluido) / (excluded)  
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie D (CA)	Bonos Serie D (CM)	Bonos Serie D (CP)	Bonos Serie D (CT)
Series D (CA) Bonds	Series D (CM) Bonds	Series D (CP) Bonds	Series D (CT) Bonds
ES0341068098	ES0341068106	ES0341068114	ES0341068122

### Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor	17.03.2021	-0,543%	-0,543%	-0,543%	-0,543%
Margen / Margin		5,000%	5,000%	5,000%	5,000%

Tipo de interés calculado / Calculated interest rate

4,457%      4,457%      4,457%      4,457%

### Tipo de Interés Nominal aplicable

Applicable interest rate

**4,457%**      **4,457%**      **4,457%**      **4,457%**

Número de Bonos / N. Bonds

Nominal / Face value (Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class
	61		25		16		14

### Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction	Act /	360							
Intereses Brutos / Gross Interest		585,129099	35.692,88	979,340397	24.483,51	633,172118	10.130,75	821,482219	11.500,75
Retención / Withholding tax	19,00%	111,174529	6.781,65	186,074675	4.651,87	120,302702	1.924,84	156,081622	2.185,14
Intereses Netos / Net Interest		473,954570	28.911,23	793,265722	19.831,64	512,869416	8.205,91	665,400597	9.315,61

### Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined      A determinar / To be determined      A determinar / To be determined      A determinar / To be determined

### Pagos no satisfechos por insuficiencia de Fondos Disponibles

Payments not made due to insufficient Available Funds

(Euros)

Fecha vencimiento / Maturity date	22.06.2020 / 22.03.2021	20.06.2019 / 22.03.2021	20.12.2018 / 22.03.2021	20.03.2020 / 22.03.2021				
Intereses Brutos / Gross Interest	2.404,107943	146.650,58	7.241,257384	181.031,44	6.292,548471	100.680,78	4.222,493182	59.114,90
Retención / Withholding tax	19,00%	456,780508	27.863,61	1.375,838903	34.395,96	1.195,584208	19.129,34	802,273705
Intereses Netos / Net Interest		1.947,327435	118.786,97	5.865,418481	146.635,48	5.096,964263	81.551,44	3.420,219477