

**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**
**25.10.2021**
**Periodo de Interés / Interest accrual period**

 desde / From  
 hasta / To  
 plazo / Term

**26.07.2021** (incluido) / (included)  
**25.10.2021** (excluido) / (excluded)  
 91 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>	<i>Series D Bonds</i>	<i>Series E Bonds</i>
ES0312887005	ES0312887013	ES0312887021	ES0312887039	ES0312887047

**Determinación Tipo Interés Nominal**  
*Nominal Interest Rate Calculation*

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	22.07.2021	-0,549%	-0,549%	-0,549%	-0,549%	-0,549%
Margen / Margin		0,110%	0,230%	0,450%	1,750%	3,500%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,439%	-0,319%	-0,099%	1,201%	2,951%

**Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable Interest Rate**

	<b>0,000%*</b>	<b>0,000%*</b>	<b>0,000%*</b>	<b>1,201%</b>	<b>2,951%</b>
--	----------------	----------------	----------------	---------------	---------------

**Número de Bonos / N. Bonds**  
**Nominal / Face value**

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>
	15.617		602		149		132		301
7.587,62	118.495.861,54	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*

(Euros)

**Base / Day count fraction** Act / 360

**Intereses Brutos / Gross Interest**  
**Retención / Withholding tax**  
**Intereses Netos / Net Interest**

19%

0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	303,586111	40.073,37	696,382684	209.611,19
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	57,681361	7.613,94	132,312710	39.826,13
0,000000	0,00	0,000000	0,00	0,000000	0,00	245,904750	32.459,43	564,069974	169.785,06

**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	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.