

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
21.09.2022
Periodo de interés / Interest accrual period

 desde / From
 hasta / To
 plazo / Term

21.06.2022 (incluido) / (included)
21.09.2022 (excluido) / (excluded)
 92 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	17.06.2022	-0,169%	-0,169%	-0,169%	-0,169%	-0,169%
Margen / Margin		0,160%	0,290%	0,700%	2,000%	3,900%
Tipo de interés calculado / Calculated interest rate		-0,009%	0,121%	0,531%	1,831%	3,731%
Tipo de interés aplicable / Applicable interest rate		0,000%*	0,121%	0,531%	1,831%	3,731%

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	
12.489,37	196.757.534,98	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 19%

Intereses Netos / Net Interest

0,000000	0,00	12,756734	2.640,64	55,983686	12.540,35	193,062182	36.874,88	475,223622	106.450,09
0,000000	0,00	2,423779	501,72	10,636900	2.382,67	36,681815	7.006,23	90,292488	20.225,52
0,000000	0,00	10,332955	2.138,92	45,346786	10.157,68	156,380367	29.868,65	384,931134	86.224,57

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.