

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Amortisation

FECHA DE PAGO / Payment date
19.10.2022
Periodo de Interés / Interest accrual period
desde / From 19.07.2022 (incluido) / (included)
hasta / To 19.10.2022 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 92 días / days

| Bonos Serie A2a | Bonos Serie A2b | Bonos Serie B | Bonos Serie C | Bonos Serie D | Bonos Serie E |
|-------------------------|-------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| <i>Series A2a Bonds</i> | <i>Series A2b Bonds</i> | <i>Series B Bonds</i> | <i>Series C Bonds</i> | <i>Series D Bonds</i> | <i>Series E Bonds</i> |
| ES0366367011 | ES0366367029 | ES0366367037 | ES0366367045 | ES0366367052 | ES0366367060 |

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation
Euribor 3 meses / 3 Months Euribor

15/07/2022

0,072%

0,072%

0,072%

0,072%

0,072%

0,072%

Margen / Margin

0,130%

0,140%

0,250%

0,550%

2,000%

4,000%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate

0,202%

0,212%

0,322%

0,622%

2,072%

4,072%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate

0,202%

0,212%

0,322%

0,622%

2,072%

4,072%

Número de Bonos / N. Bonds

| Bono | Serie | 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> | <i>Bond</i> | <i>Series</i> |
| | 8.024 | | 3.500 | | 273 | | 156 | | 72 | | 234 |

Nominal / Face value

(Euros)

12.010,77 96.374.418,48 12.010,77 42.037.695,00 23.072,61 6.298.822,53 23.072,61 3.599.327,16 23.079,02 1.661.689,44 25.000,00 5.850.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment (Euros)

Base / Day count fraction

Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest

6,200226 49.750,61 6,507168 22.775,09 18,986194 5.183,23 36,675195 5.721,33 122,205975 8.798,83 260,155556 60.876,40

Retención / Withholding tax

19,00%

1,178043 9.452,62 1,236362 4.327,27 3,607377 984,81 6,968287 1.087,05 23,219135 1.671,78 49,429556 11.566,52

Intereses Netos / Net Interest

5,022183 40.297,99 5,270806 18.447,82 15,378817 4.198,42 29,706908 4.634,28 98,986840 7.127,05 210,726000 49.309,88

Amortización de Principal
Principal Redemption
Amortización / Redemption

(Euros)

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 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 4.8 de la Nota de Valores y 3.4.6.2.1 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 3.4.6.2.1 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.