

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
19.04.2024
Periodo de Interés / Interest accrual period
desde / From 19.01.2024 **(incluido) / (included)**
hasta / To 19.04.2024 **(excluido) / (excluded)**
plazo / Term 91 **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

17/01/2024

3,903%

3,903%

3,903%

3,903%

3,903%

3,903%

Margen / Margin

0,130%

0,140%

0,250%

0,550%

2,000%

4,000%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate
4,033%
4,043%
4,153%
4,453%
5,903%
7,903%
Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate
4,033%
4,043%
4,153%
4,453%
5,903%
7,903%
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)

8.791,27

70.541.150,48

8.791,27

30.769.445,00

20.923,20

5.712.033,60

20.923,20

3.264.019,20

20.929,01

1.506.888,72

25.000,00

5.850.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction
Act /
360
Intereses Brutos / Gross Interest
89,622846

719.133,72

89,845070

314.457,75

219,648848

59.746,97

41,733281

11.393,19

235,515608

36.740,43

312,291641

22.485,00

499,425694

116.865,61

Retención / Withholding tax
19,00%
17,028341

136.635,41

17,070563

59.746,97

41,733281

11.393,19

44,747966

6.980,68

59,335412

4.272,15

94,890882

22.204,47

Intereses Netos / Net Interest
72,594505

582.498,31

72,774507

254.710,78

177,915567

48.570,95

190,767642

29.759,75

262,956229

18.212,85

404,534812

94.661,14

Amortización de Principal
Principal Redemption
Amortización / Redemption

(Euros)

A determinar / To be determined
A determinar / To be determined
0,00

0,00

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 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.