

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

21.10.2024

Período de Interés / Interest accrual period

 desde / From 19.07.2024 (incluido) / (included)
 hasta / To 21.10.2024 (excluido) / (excluded)
 plazo / Term 94 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

17/07/2024

3,678%

3,678%

3,678%

3,678%

3,678%

3,678%

Margen / Margin

0,130%

0,140%

0,250%

0,550%

2,000%

4,000%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate

3,808%

3,818%

3,928%

4,228%

5,678%

7,678%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate

3,808%

3,818%

3,928%

4,228%

5,678%

7,678%

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)

7.882,05

63.245.569,20

7.882,05

27.587.175,00

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

78,372099

628.857,72

78,577908

275.022,68

214,597638

58.585,16

230,987478

36.034,05

310,291177

22.340,96

501,202778

117.281,45

Retención / Withholding tax

19,00%

14,890699

119.482,97

14,929803

52.254,31

40,773551

11.131,18

43,887621

6.846,47

58,955324

4.244,78

95,228528

22.283,48

Intereses Netos / Net Interest

63,481400

509.374,75

63,648105

222.768,37

173,824087

47.453,98

187,099657

29.187,58

251,335853

18.096,18

405,974250

94.997,97

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

* 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.