

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
19.04.2023
Periodo de Interés / Interest accrual period
desde / From 19.01.2023 (incluido) / (included)
hasta / To 19.04.2023 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 90 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

17/01/2023

2,335%

2,335%

2,335%

2,335%

2,335%

2,335%

Margen / Margin

0,130%

0,140%

0,250%

0,550%

2,000%

4,000%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate
2,465%
2,475%
2,585%
2,885%
4,335%
6,335%
Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate
2,465%
2,475%
2,585%
2,885%
4,335%
6,335%
Número de Bonos / N. Bonds

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

Nominal / Face value

(Euros)

10.891,86 87.396.284,64 10.891,86 38.121.510,00 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
67,121087 538.579,60 67,393384 235.876,84 135,216180 36.914,02 150,908580 23.541,74 226,818146 16.330,91 395,937500 92.649,38
Retención / Withholding tax
19,00%
12,753007 102.330,13 12,804743 44.816,60 25,691074 7.013,66 28,672630 4.472,93 43,095448 3.102,87 75,228125 17.603,38
Intereses Netos / Net Interest
54,368080 436.249,47 54,588641 191.060,24 109,525106 29.900,36 122,235950 19.068,81 183,722698 13.228,04 320,709375 75.046,00
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.