

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
19.01.2024
Periodo de Interés / Interest accrual period
desde / From 19.10.2023 **(incluido) / (included)**
hasta / To 19.01.2024 **(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

17/10/2023

3,972%

3,972%

3,972%

3,972%

3,972%

3,972%

Margen / Margin

0,130%

0,140%

0,250%

0,550%

2,000%

4,000%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate
4,102%
4,112%
4,222%
4,522%
5,972%
7,972%
Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate
4,102%
4,112%
4,222%
4,522%
5,972%
7,972%
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)

9.342,86 74.967.108,64 9.342,86 32.700.010,00 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

97,940163 785.871,87 98,178925 343.626,24 225,752029 61.630,30 241,793149 37.719,73 319,413900 22.997,80 509,322222 119.181,40

Retención / Withholding tax

19,00%

18,608631 149.315,66 18,653996 65.288,99 42,892886 11.709,76 45,940698 7.166,75 60,688641 4.369,58 96,771222 22.644,47

Intereses Netos / Net Interest

79,331532 636.556,21 79,524929 278.337,25 182,859143 49.920,54 195,852451 30.552,98 258,725259 18.628,22 412,551000 96.536,93

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.