

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

19.01.2023

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From 19.10.2022 (incluido) / (included)
 hasta / To 19.01.2023 (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
Series A2a Bonds	Series A2b Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0366367011	ES0366367029	ES0366367037	ES0366367045	ES0366367052	ES0366367060

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor

17/10/2022

1,458%

1,458%

1,458%

1,458%

1,458%

1,458%

Margen / Margin

0,130%

0,140%

0,250%

0,550%

2,000%

4,000%

Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate

1,588%

1,598%

1,708%

2,008%

3,458%

5,458%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate

1,588%

1,598%

1,708%

2,008%

3,458%

5,458%

Número de Bonos / N. Bonds

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	8.024		3.500		273		156		72		234

Nominal / Face value

(Euros)

11.458,26 91.941.078,24 11.458,26 40.103.910,00 22.011,25 6.009.071,25 22.011,25 3.433.755,00 22.017,36 1.585.249,92 25.000,00 5.850.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross Interest

19,00%

46,500165 373.117,32 46,792988 163.775,46 96,076661 26.228,93 112,951952 17.620,50 194,569857 14.009,03 348,705556 81.597,10

Retención / Withholding tax

8,835031 70.892,29 8,890668 31.117,34 18,254566 4.983,50 21,460871 3.347,90 36,968273 2.661,72 66,254056 15.503,45

Intereses Netos / Net Interest

37,665134 302.225,03 37,902320 132.658,12 77,822095 21.245,43 91,491081 14.272,60 157,601584 11.347,31 282,451500 66.093,65

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.