

Información Trimestral y Nuevo Tipo de Interés. Pago de Cupón Próximo 26 de octubre, 2026

En cumplimiento de lo previsto en el Folleto Informativo de la citada emisión, verificado por la Comisión Nacional del Mercado de Valores el día 14 de julio, 2026, y formalizada mediante Escritura Pública otorgada el día 15 de julio, 2026, se pone en conocimiento de los tenedores de los Bonos de la misma, la siguiente información:

CONCEPTO	CLASE A1	CLASE A2	SERIE B	SERIE C	Serie D	Serie E	Serie F
	ES0306053002	ES0306053010	ES0306053028	ES0306053036	ES0306053044	ES0306053051	ES0306053069
1. Intereses resultantes por BONO entre el 21 de julio, 2026 (incluido) y el 26 de octubre, 2026 (excluido):							
• INTP (%):	0,8492900000%	0,7819300000%	0,9570700000%	1,0244300000%	1,0917900000%	1,6306800000%	2,7623400000%
• Número de días:	97	97	97	97	97	97	97
• Tipo de interés nominal actual (%):	3,152%	2,902%	3,552%	3,802%	4,052%	6,052%	10,252%
• Intereses brutos (€):	849,2900000000€	781,9300000000€	957,0700000000€	1.024,4300000000€	1.091,7900000000€	1.630,6800000000€	2.762,3400000000€
• Retención fiscal (€):	161,3651000000€	148,5667000000€	181,8433000000€	194,6417000000€	207,4401000000€	309,8292000000€	524,8446000000€
• Intereses netos (€):	687,9249000000€	633,3633000000€	775,2267000000€	829,7883000000€	884,3499000000€	1.320,8508000000€	2.237,4954000000€
2.1. Amortización resultante por BONO (€):	0,00€	0,00€	0,00€	0,00€	0,00€	0,00€	10.000,00€
2.2. Porcentaje de pago efectivo (%):	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%
3. Tasa de Prepago Real de los préstamos subyacentes a los Derechos de Crédito (%):	9,60%						
4. Vida Residual Media de los BONOS, calculada con la hipótesis de mantenimiento de dicha Tasa Real y de amortización anticipada (cuando quede pendiente de amortizar menos del 10% de Saldo Inicial de la Cartera de Derechos de Crédito):	3,42	3,42	3,42	3,42	3,42	3,42	0,77
5. Saldo Pendiente de Pago por BONO después de la amortización del apartado 2 (€):	100.000,00€	100.000,00€	100.000,00€	100.000,00€	100.000,00€	100.000,00€	90.000,00€
6. Porcentaje de Saldo Pendiente de Pago por BONO después de la amortización (%):	100,00000%	100,00000%	100,00000%	100,00000%	100,00000%	100,00000%	90,00000%
7. Principal Devengado por BONO en concepto de amortización y no satisfecho por insuficiencia de fondos de acuerdo con el Orden de Prelación de Pagos (€):	0,00€	0,00€	0,00€	0,00€	0,00€	0,00€	0,00€
8. Tipo de Interés aplicable a los BONOS, según los criterios contenidos en el mencionado Folleto Informativo, durante el siguiente Periodo de Devengo de Interés, que será el comprendido entre el 26 de octubre, 2026 (incluido) y el 25 de enero de 2027, (excluido), es el (%):	3,327%	3,077%	3,727%	3,977%	4,227%	6,227%	10,427%