

**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**
**19.10.2023**
**Periodo de Interés / Interest accrual period**
**desde / From** 19.07.2023 **(incluido) / (included)**  
**hasta / To** 19.10.2023 **(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
<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**

17/07/2023

3,685%

3,685%

3,685%

3,685%

3,685%

3,685%

**Margen / Margin**

0,130%

0,140%

0,250%

0,550%

2,000%

4,000%

**Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate**
**3,815%**
**3,825%**
**3,935%**
**4,235%**
**5,685%**
**7,685%**
**Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate**
**3,815%**
**3,825%**
**3,935%**
**4,235%**
**5,685%**
**7,685%**
**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)**
**9.826,33 78.846.471,92 9.826,33 34.392.155,00 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**
**95,801258 768.709,29 96,052376 336.183,32 210,406024 57.440,84 226,447144 35.325,75 304,063634 21.892,58 490,986111 114.890,75**
**Retención / Withholding tax**
**19,00%**
**18,202239 146.054,77 18,249951 63.874,83 39,977145 10.913,76 43,024957 6.711,89 57,772090 4.159,59 93,287361 21.829,24**
**Intereses Netos / Net Interest**
**77,599019 622.654,52 77,802425 272.308,49 170,428879 46.527,08 183,422187 28.613,86 246,291544 17.732,99 397,698750 93.061,51**
**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.