

**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**
**19.07.2024**
**Periodo de Interés / Interest accrual period**
**desde / From 19.04.2024 (incluido) / (included)**  
**hasta / To 19.07.2024 (excluido) / (excluded)**  
**plazo / Term 91 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**

17/04/2024

3,895%

3,895%

3,895%

3,895%

3,895%

3,895%

**Margen / Margin**

0,130%

0,140%

0,250%

0,550%

2,000%

4,000%

**Tipo de Interés Nominal calculado / Calculated interest rate**
**4,025%**
**4,035%**
**4,145%**
**4,445%**
**5,895%**
**7,895%**
**Tipo de Interés Nominal aplicable / Applicable interest rate**
**4,025%**
**4,035%**
**4,145%**
**4,445%**
**5,895%**
**7,895%**
**Número de Bonos / N. Bonds**

17/04/2024

3,895%

3,895%

3,895%

3,895%

3,895%

3,895%

**Nominal / Face value**

(Euros)

8.319,64

66.756.791,36

8.319,64

29.118.740,00

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**
**84,646559**

679.203,99

**84,856861**

296.999,01

**219,225734**

59.848,63

**235,092494**

36.674,43

**311,868410**

22.454,53

**498,920139**

116.747,31

**Retención / Withholding tax**
**19,00%**
**16,082846**

129.048,76

**16,122804**

56.429,81

**41,652889**

11.371,24

**44,667574**

6.968,14

**59,254998**

4.266,36

**94,794826**

22.181,99

**Intereses Netos / Net Interest**
**68,563713**

550.155,23

**68,734057**

240.569,20

**177,572845**

48.477,39

**190,424920**

29.706,29

**262,613412**

18.188,17

**404,125313**

94.565,32

**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

**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.