

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

FECHA DE PAGO / Payment date

23.01.2012

Periodo de Interés /

Interest accrual period

desde / From

22.07.2011

(incluido) / (included)

hasta / To

23.01.2012

(excluido) / (excluded)

plazo / Term

185

días / days

Bonos Serie A4	Bonos Serie B
<i>Class A4 Bonds</i>	<i>Class B Bonds</i>
ES0313800031	ES0313800049

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 6 meses / 6 Month Euribor

1,810%

1,810%

Margen / Spread

0,25%

0,50%

Transformación Base/

2,088611%

2,342083%

Tipo de interes aplicable / Interest rate

2,0886%

2,3421%

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>

Número de Bonos / N.Bonds

2.225

128

Nominal / Face value

19.009,91

42.297.049,75

26.435,66

3.383.764,48

Base / Day count fraction

Act / 365

Intereses Brutos / Gross

201,24

447.759,00

313,82

40.168,96

Interest Retención / Withholding tax 19%

38,24

85.084,00

59,63

7.632,64

Neto / Net

163,00

362.675,00

254,19

32.536,32

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

EUROPEA DE TITULIZACIÓN, S.A., S.G.F.T

C/ Lagasca, 120 -MADRID, SPAIN - Tel. (34) 91 411 84 67 - Fax (34) 91 411 84 68

info@eurotitulizacion.com

www.edt-sg.com