

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

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Amortisation

FECHA DE PAGO / Payment date

19.07.2011

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

19.04.2011
19.07.2011
91

(incluido) / (included)
(excluido) / (excluded)
días / days

Bonos Serie A1	Bonos Serie A2(G)	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Series A1 Bonds</i>	<i>Series A2 Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>
ES0328421005	ES0328421013	ES0328421021	ES0328421039

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

1,332%

1,332%

1,332%

1,332%

Margen / Margin

0,090%

0,030%

0,070%

2,500%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

1,422%

1,362%

1,402%

3,832%

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

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>
	3.659		1.000		387		154
1.410,03	5.159.299,77	4.113,79	4.113.790,00	89.535,20	34.650.122,40	100.000,00	15.400.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act / **360**

Intereses Brutos / Gross

5,068353

18.545,10

14,163093

14.163,09

317,307775

122.798,11

968,644444

149.171,24

Interés Retención / Withholding tax 19%

0,962987

3.523,57

2,690988

2.690,99

60,288477

23.331,64

184,042444

28.342,54

Intereses Neto / Net

4,105366

15.021,53

11,472105

11.472,10

257,019298

99.466,47

784,602000

120.828,70

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar

To be determined

A determinar

To be determined

0,00

0,00

0,00

0,00

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