

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

25.11.2011

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From **25.08.2011** (incluido) / (included)
hasta / To **25.11.2011** (excluido) / (excluded)
plazo / Term **92** días / days

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds
ES0312886015	ES0312886023	ES0312886031	ES0312886049

Determinación Interés Nomina *Nominal Interest Calculation*

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor 23.08.2011 1,536%

Margen / Margin 0,180%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

1,716% **1,926%** **2,316%** **4,036%**

Número de Bonos / N. Bonds

Nominal / Face value (Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	16.702		399		238		161
35.281,03	589.263.763,06	67.715,91	27.018.648,09	67.708,79	16.114.692,02	67.726,42	10.903.953,62

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act / **360**

Intereses Brutos / Gross

Interés Retención / Withholding tax 19%

Neto / Net

154,719077	2.584.118,02	333,297709	132.985,79	400,745758	95.377,49	698,545346	112.465,80
29,396625	490.982,43	63,326565	25.267,30	76,141694	18.121,72	132,723616	21.368,50
125,322452	2.093.135,59	269,971144	107.718,49	324,604064	77.255,77	565,821730	91.097,30

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar /to be determined A determinar /to be determined A determinar /to be determined A determinar /to be determined

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

http://www.edt-sg.com