

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

20.06.2011

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

18.03.2011
20.06.2011
94

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

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>
ES0313533004	ES0313533012	ES0313533020

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

1,170%

1,170%

1,170%

Margen / Margin

0,300%

0,500%

0,700%

Tipo de interes aplicable / Interest rate

1,470%

1,670%

1,870%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>
	15.979		207		314
Número de Bonos / N.Bonds					
Nominal / Face value (Euros)	84.786,27	1.354.799.808,33	100.000,00	20.700.000,00	100.000,00
			31.400.000,00		

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act / 360

Intereses Brutos / Gross

325,437966

5.200.173,26

436,055556

90.263,50

488,277778

153.319,22

Interés Retención / Withholding tax 19%

61,833214

988.032,93

82,850556

17.150,07

92,772778

29.130,65

Interés Neto / Net

263,604752

4.212.140,33

353,205000

73.113,43

395,505000

124.188,57

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