

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

16.12.2011

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

16.09.2011 (incluido) / (included)
16.12.2011 (excluido) / (excluded)
91 días / days

Determinación Interés Nominal Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

1,529%

1,529%

1,529%

1,529%

1,529%

Margen / Margin

0,300%

0,400%

0,500%

2,500%

3,900%

Tipo de interés aplicable / Interest rate

1,829%

1,929%

2,029%

4,029%

5,429%

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0313480008	ES0313480016	ES0313480024	ES0313480032	ES0313480040

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	18.820		460		380		340		430
76.039,65	1.431.066.213,00	100.000,00	46.000.000,00	100.000,00	38.000.000,00	100.000,00	34.000.000,00	100.000,00	43.000.000,00

Liquidación de Intereses Interest Payment

Base / Day count fraction

Act /

(Euros)

360

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

Neto / Net

19%

351,554536	6.616.256,37	487,608333	224.299,83	512,886111	194.896,72	1.018,441667	346.270,17	1.372,330556	590.102,14
66,795362	1.257.088,71	92,645583	42.616,97	97,448361	37.030,38	193,503917	65.791,33	260,742806	112.119,41
284,759174	5.359.167,66	394,962750	181.682,86	415,437750	157.866,34	824,937750	280.478,84	1.111,587750	477.982,73

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
----------------------------------	----------------------------------	------	------	------	------	------	------	------	------

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles Payments outstanding due to insufficient Available Funds

Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

Retención / Withholding tax

Neto / Net Interest

19%

16.12.2009 - 16.09.2011

9.200,739839	3.956.318,14
1.748,140569	751.700,46
7.452,599270	3.204.617,68

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