

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

16.01.2012

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

17.10.2011
16.01.2012
91

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

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
ES0314787005	ES0314787013	ES0314787021

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

1,572%

1,572%

1,572%

Margen / Margin

0,300%

0,500%

0,800%

Tipo de interes aplicable / Interest rate

1,872%

2,072%

2,372%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series

Número de Bonos / N.Bonds

3.666

214

120

Nominal / Face value

(Euros)

22.881,83

83.884.788,78

100.000,00

21.400.000,00

100.000,00

12.000.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act / 360

Intereses Brutos / Gross

108,276820

396.942,82

523,755556

112.083,69

599,588889

71.950,67

Interest Retención / Withholding tax 19%

20,572596

75.419,14

99,513556

21.295,90

113,921889

13.670,63

Neto / Net

87,704224

321.523,68

424,242000

90.787,79

485,667000

58.280,04

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