

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

25.05.2012

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

27.02.2012
25.05.2012
88

(incluido) / (included)
(excluido) / (excluded)
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 23.02.2012

1,014%

1,014%

1,014%

1,014%

Margen / Margin

0,180%

0,390%

0,780%

2,500%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

1,194%

1,404%

1,794%

3,514%

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

Número de Bonos / N. Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

16.702
33.529,34 560.007.036,68

399
64.353,84 25.677.182,16

238
64.347,08 15.314.605,04

161
64.363,83 10.362.576,63

Liquidación de Intereses *Interest Payment*

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross

Interés Retención / Withholding tax

Neto / Net

21%

97,860967 1.634.473,87
20,550803 343.239,51
77,310164 1.291.234,36

220,862379 88.124,09
46,381100 18.506,06
174,481279 69.618,03

282,183395 67.159,65
59,258513 14.103,53
222,924882 53.056,12

552,870997 89.012,23
116,102909 18.692,57
436,768088 70.319,66

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