

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Redemption

FECHA DE PAGO / Payment date

21.06.2012

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From **21.03.2012** (incluido) / (included)
hasta / To **21.06.2012** (excluido) / (excluded)
plazo / Term **92** días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
ES0310005006	ES0310005014	ES0310005022

Determinación Tipo Interés Nominal

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor

0,853%

0,853%

0,853%

Margen / Margin

0,300%

0,700%

1,100%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

1,153%

1,553%

1,953%

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

Número de Bonos / N.Bonds

82.110

1.360

1.530

Nominal / Face value (Euros)

67.293,48

5.525.467.642,80

100.000,00

136.000.000,00

100.000,00

153.000.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

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

Intereses Brutos / Gross (Euros)

198,283977

16.281.097,35

396,877778

539.753,78

499,100000

763.623,00

Intereses Retención / Withholding tax 21%

41,639635

3.419.030,43

83,344333

113.348,29

104,811000

160.360,83

Intereses Neto / Net

156,644342

12.862.066,92

313,533445

426.405,49

394,289000

603.262,17

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption (Euros)

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