

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

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Amortisation

FECHA DE PAGO:

13.12.2011

Payment date

Periodo de Devengo de Intereses

desde / from

13.09.2011 (incluido) / (included)

Interest accrual period

hasta / to

13.12.2011 (excluido) / (excluded)

plazo / Term

91 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>
ES0358282004	ES0358282012

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor

1,532%

1,532%

Margen / Spread

0,210%

0,500%

Tipo aplicable resultante

1,742%

2,032%

Interest Rate

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(euros)

Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>

Número de Bonos / N.Bonds

3.123

127

Nominal / Face Value

17.074,41

53.323.382,43

100.000,00

12.700.000,00

Base / Day Count Fraction

360

Intereses Brutos / Gross Interest

75,19

234.818,37

513,64

65.232,28

Retención / Withholding tax 19%

14,29

44.627,67

97,59

12.393,93

Neto / Net Interest

60,90

190.190,70

416,05

52.838,35

Amortización de Principal

Principal Redemption

(euros)

Amortización / Redemption

A determinar

to be determined

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