

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
18.01.2012
Periodo de Interés / Interest accrual period
desde / From
hasta / To
plazo / Term
18.10.2011 (incluido) / (included)
18.01.2012 (excluido) / (excluded)
 92 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>	<i>Series D Bonds</i>	<i>Series E Bonds</i>
ES0374273003	ES0374273011	ES0374273029	ES0374273037	ES0374273045

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation
Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

1,574% 1,574% 1,574% 1,574% 1,574%

Margen / Margin

0,170% 0,340% 0,550% 2,000% 4,000%

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

1,744%	1,914%	2,124%	3,574%	5,574%
--------	--------	--------	--------	--------

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	
	10.081		363		80		128		128	
Número de Bonos / N.Bonds										
Nominal / Face value	(Euros) 42.648,66	429.941.141,46	100.000,00	36.300.000,00	100.000,00	8.000.000,00	100.000,00	12.800.000,00	100.000,00	12.800.000,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest

190,080339 1.916.199,90 489,133333 177.555,40 542,800000 43.424,00 913,355556 116.909,51 1.424,466667 182.331,73

Retención / Withholding tax

19%

36,115264 364.077,98 92,935333 33.735,53 103,132000 8.250,56 173,537556 22.212,81 270,648667 34.643,03

Neto / Net

153,965075 1.552.121,92 396,198000 143.819,87 439,668000 35.173,44 739,818000 94.696,70 1.153,818000 147.688,70

Amortización de Principal
Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined 0,00 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 (Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date
Intereses
Retención / Withholding tax 19%

Neto / Net

18.10.2011	
1.432,644444	183.378,49
272,202444	34.841,91
1.160,442000	148.536,58

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