

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>Serie A Bonds</i>	<i>Serie B Bonds</i>	<i>Serie C Bonds</i>	<i>Serie D Bonds</i>	<i>Serie 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%
--------	--------	--------	--------	--------

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value (Euros)

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
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
Retención / Withholding tax
Neto / Net

19%

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
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
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

Pagos pendientes por insuficiencia de Fondos Disponibles
Payments outstanding due to insufficient Available Funds (Euros)

Fecha de Vencimiento / Maturity date
Intereses
Retención / Withholding tax
Neto / Net

19%

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