

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

18.10.2011

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

18.07.2011
18.10.2011
92

(incluido) / (included)
(excluido) / (excluded)
días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>
ES0313582001	ES0313582019	ES0313582027

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

1,606%

1,606%

1,606%

Margen / Margin

0,300%

0,500%

0,700%

Tipo de interes aplicable / Interest rate

1,906%

2,106%

2,306%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>
	9.525		340		135
Número de Bonos / N.Bonds					
Nominal / Face value (Euros)	77.247,32	735.780.723,00	100.000,00	34.000.000,00	100.000,00
					13.500.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act / 360

Intereses Brutos / Gross

376,263113

3.583.906,15

538,200000

182.988,00

589,311111

79.557,00

Interest Retención / Withholding tax **19%**

71,489991

680.942,16

102,258000

34.767,72

111,969111

15.115,83

Neto / Net

304,773122

2.902.963,99

435,942000

148.220,28

477,342000

64.441,17

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar
To be determined

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