

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

16.02.2011

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

16.11.2010 (incluido) / (included)
16.02.2011 (excluido) / (excluded)
92 días / days

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

1,049%

1,049%

1,049%

1,049%

1,049%

Margen / Margin

0,120%

0,220%

0,520%

2,100%

3,900%

Tipo de interes aplicable / Interest rate

1,169%

1,269%

1,569%

3,149%

4,949%

Bonos Serie A2	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2 Bonds	Series B Bonds	Series B Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0313716013	ES0313716021	ES0313716039	ES0313716047	ES0313716054

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	
	6.820		162		275		107		146	
Número de Bonos / N.Bonds										
Nominal / Face value	(Euros) 37.783,44	257.683.060,80	100.000,00	16.200.000,00	100.000,00	27.500.000,00	100.000,00	10.700.000,00	100.000,00	14.600.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross

112,875928

769.813,83

324,300000

52.536,60

400,966667

110.265,83

804,744444

86.107,66

1.264,744444

Interés Retención / Withholding tax 19%

Interés Neto / Net

21,446426

146.264,63

61,617000

9.981,95

76,183667

20.950,51

152,901444

16.360,45

240,301444

91,429502

623.549,20

262,683000

42.554,65

324,783000

89.315,32

651,843000

69.747,21

1.024,443000

149.568,68

184.652,69

35.084,01

149.568,68

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)

Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

16.11.2009

1.206,508333

176.150,22

Interés Retención / Withholding tax 19%

Interés Neto / Net Interest

229,236583

33.468,54

977,271750

142.681,68

Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

16.02.2010

1.179,133333

172.153,47

Interés Retención / Withholding tax 19%

Interés Neto / Net Interest

224,035333

32.709,16

955,098000

139.444,31

Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

17.05.2010

1.140,750000

166.549,50

Interés Retención / Withholding tax 19%

Interés Neto / Net Interest

216,742500

31.644,41

924,007500

134.905,09

Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

16.08.2010

1.158,480556

169.138,16

Interés Retención / Withholding tax 19%

Interés Neto / Net Interest

220,111306

32.136,25

938,369250

137.001,91

Vencimiento / Maturity date

Intereses Brutos / Gross Interest

16.11.2010

1.226,411111

179.056,02

Interés Retención / Withholding tax 19%

Interés Neto / Net Interest

233,018111

34.020,64

993,393000

145.035,38

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