

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 13.02.2012

Periodo de Interés / Interest accrual period
desde / From 14.11.2011 (incluido) / (included)
hasta / To 13.02.2012 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Class A Bonds</i>	<i>Class B Bonds</i>	<i>Class C Bonds</i>
ES0313920003	ES0313920011	ES0313920029

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

1,464%

1,464%

1,464%

Margen / Margin

0,240%

0,450%

1,250%

Tipo de interes aplicable / Interest rate

1,704%

1,914%

2,714%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>

Número de Bonos / N.Bonds

6.841

149

110

Nominal / Face value (Euros)

26.667,06

182.429.357,46

55.472,54

8.265.408,46

55.460,53

6.100.658,30

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross

114,86

785.757,26

268,39

39.990,11

380,48

41.852,80

Interés Retención / Withholding tax 19%

21,82

149.270,62

50,99

7.597,51

72,29

7.951,90

Neto / Net

93,04

636.486,64

217,40

32.392,60

308,19

33.900,90

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

**A determinar
To be determined**

A determinar
To be determined

**A determinar
To be determined**

A determinar
To be determined

**A determinar
To be determined**

A determinar
To be determined

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