

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining interest rate and redemption applicable to the bonds

FECHA DE PAGO / Payment date

17.10.2011

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

18.07.2011
17.10.2011
91

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

Bonos Serie A2(P)	Bonos Serie B(P)	Bonos Serie C(P)
Class A2(P) Bonds	Class B(P) Bonds	Class C(P) Bonds
ES0313814016	ES0313814024	ES0313814032

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

1,606%

1,606%

1,606%

Margen / Margin

0,110%

0,500%

0,950%

Tipo de interes aplicable / Interest rate

1,716%

2,106%

2,556%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Class	Bond	Class	Bond	Class

Número de Bonos / N.Bonds

6.560

153

71

Nominal / Face value (Euros)

48.870,71

320.591.857,60

91.562,58

14.009.074,74

91.569,17

6.501.411,07

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross

211,984850

1.390.620,62

487,433395

74.577,31

591,628407

42.005,62

Interés Retención / Withholding tax

19%

40,277122

264.217,92

92,612345

14.169,69

112,409397

7.981,07

Interés Neto / Net

171,707728

1.126.402,70

394,821050

60.407,62

479,219010

34.024,55

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

A determinar

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

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS

Determining interest rate and redemption applicable to the bonds

FECHA DE PAGO / Payment date

17.10.2011

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

18.07.2011

(incluido) / (included)

17.10.2011

(excluido) / (excluded)

91

días / days

Bonos Serie A2(T)	Bonos Serie B(T)	Bonos Serie C(T)
<i>Class A2(T) Bonds</i>	<i>Class B(T) Bonds</i>	<i>Class C(T) Bonds</i>
ES0313814057	ES0313814065	ES0313814073

Determinación Interés Nominal

Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

1,606%

1,606%

1,606%

Margen / Margin

0,110%

0,500%

0,950%

Tipo de interes aplicable / Interest rate

1,716%

2,106%

2,556%

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>	<i>Bond</i>	<i>Class</i>
	2.442		172		70
53.186,10	129.880.456,20	100.000,00	17.200.000,00	100.000,00	7.000.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act /

360

Intereses Brutos / Gross

230,703573

563.378,13

532,350000

91.564,20

646,100000

45.227,00

Interest

Retención / Withholding tax

19%

43,833679

107.041,84

101,146500

17.397,20

122,759000

8.593,13

Neto / Net

186,869894

456.336,29

431,203500

74.167,00

523,341000

36.633,87

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar

A determinar

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