

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 **18.10.2011** (incluido) / (included)
hasta / To **18.01.2012** (excluido) / (excluded)
plazo / Term 92 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>
ES0312884002	ES0312884010	ES0312884028

Determinación Interés Nominal
Nominal Interest Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

1,574%

1,574%

1,574%

Margen / Margin

0,270%

0,650%

1,250%

Tipo de interes aplicable / Interest rate

1,844%

2,224%

2,824%

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

9.605

245

150

Nominal / Face value

(Euros)

22.508,83

216.197.312,15

46.948,39

11.502.355,55

46.948,39

7.042.258,50

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction

Act / 360

Intereses Brutos / Gross

(Euros)

106,07

1.018.802,35

266,83

65.373,35

338,82

50.823,00

Interest

Retención / Withholding tax

19%

20,15

193.540,75

50,70

12.421,50

64,38

9.657,00

Neto / Net

85,92

825.261,60

216,13

52.951,85

274,44

41.166,00

Amortización de Principal

Principal Redemption

Amortización / Redemption

(Euros)

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