

PYME VALENCIA 2 Fondo de Titulización de Activos (C.I.F.: V85657690)

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

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Redemption

FECHA DE PAGO / Payment date

26.09.2011

Periodo de Interés /
Interest accrual period

desde / From 27.06.2011 (incluido) / (included)
hasta / To 26.09.2011 (excluido) / (excluded)
plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
Series A Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds
ES0372219008	ES0372219016	ES0372219024

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 mes / 3 Month Euribor

1,526%

1,526%

1,526%

Margen / Margin

0,300%

0,600%

0,900%

Tipo de Interes Nominal aplicable / Interest Rate

1,826%

2,126%

2,426%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	4.075		175		750
Número de Bonos / N.Bonds					
Nominal / Face value	(Euros)				
	41.129,20	167.601.490,00	100.000,00	17.500.000,00	100.000,00
			75.000.000,00		

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest

189,840962

773.601,92

537,405556

94.045,97

613,238889

459.929,17

Retención / Withholding tax 19%

36,069783

146.984,37

102,107056

17.868,73

116,515389

87.386,54

Neto / Net

153,771179

626.617,55

435,298500

76.177,24

496,723500

372.542,63

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar / To be determined

0,00

0,00

0,00

0,00