

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

Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Amortisation

FECHA DE PAGO / Payment date

19.01.2012

**Periodo de Interés /
Interest accrual period**

desde / From
hasta / To
plazo / Term

**19.10.2011
19.01.2012
92**

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

Bonos Serie A1	Bonos Serie A2(G)	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Series A1 Bonds</i>	<i>Series A2 Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>
ES0328421005	ES0328421013	ES0328421021	ES0328421039

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

1,578%

1,578%

1,578%

1,578%

Margen / Margin

0,090%

0,030%

0,070%

2,500%

Tipo de Interes Nominal aplicable / Interest Rate

1,668%

1,608%

1,648%

4,078%

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>
	3.659		1.000		387		154
198,25	725.396,75	578,36	578.360,00	89.535,20	34.650.122,40	100.000,00	15.400.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction

Act / 360

Intereses Brutos / Gross

0,845074

3.092,13

2,376674

2.376,67

377,082469

145.930,92

1.042,155556

160.491,96

Interés Retención / Withholding tax 19%

0,160564

587,50

0,451568

451,57

71,645669

27.726,87

198,009556

30.493,47

Interés Neto / Net

0,684510

2.504,63

1,925106

1.925,10

305,436800

118.204,05

844,146000

129.998,49

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar

To be determined

A determinar

To be determined

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