

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 **19.01.2012**

Periodo de Interés / Interest accrual period
desde / From **19.10.2011** (incluido) / (included)
hasta / To **19.01.2012** (excluido) / (excluded)
plazo / Term **92** días / days

Bonos Serie A2a	Bonos Serie A2b	Bonos Serie B	Bonos Serie C	Bonos Serie D	Bonos Serie E
Series A2a Bonds	Series A2b Bonds	Series B Bonds	Series C Bonds	Series D Bonds	Series E Bonds
ES0366367011	ES0366367029	ES0366367037	ES0366367045	ES0366367052	ES0366367060

Determinación Tipo Interés Nominal Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Months Euribor	1,578%	1,578%	1,578%	1,578%	1,578%	1,578%
Margen / Margin	0,130%	0,140%	0,250%	0,550%	2,000%	4,000%
Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate	1,708%	1,718%	1,828%	2,128%	3,578%	5,578%

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value

(Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series	Bond	Series
	8.024		3.500		273		156		72		234
56.607,99	454.222.511,76	56.607,99	198.127.965,00	100.000,00	27.300.000,00	100.000,00	15.600.000,00	100.000,00	7.200.000,00	50.000,00	11.700.000,00

Liquidación de Intereses Interest Payment

(Euros)

Base / Day count fraction Act / 360

Intereses Brutos / Gross Interest	247,087587	1.982.630,80	248,534235	869.869,82	467,155556	127.533,47	543,822222	84.836,27	914,377778	65.835,20	712,744444	166.782,20	
Retención / Withholding tax	19%	46,946642	376.699,86	47,221505	165.275,27	88,759556	24.231,36	103,326222	16.118,89	173,731778	12.508,69	135,421444	31.688,62
Neto / Net		200,140945	1.605.930,94	201,312730	704.594,55	378,396000	103.302,11	440,496000	68.717,38	740,646000	53.326,51	577,323000	135.093,58

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	0,00	0,00	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