

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

20.09.2011

Periodo de Interés / Interest accrual period

desde / From
hasta / To
plazo / Term

20.06.2011

(incluido) / (included)

20.09.2011

(excluido) / (excluded)

92

días / days

Determinación Tipo Interés Nominal

Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor

Margen / Margin

Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate

1,494%

1,494%

1,494%

0,130%

0,210%

0,300%

1,624%

1,704%

1,794%

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>
ES0314204001	ES0314204019	ES0314204027

Número de Bonos / N.Bonds

Nominal / Face value (Euros)

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>
	9.500		230		270
823,54	7.823.630,00	100.000,00	23.000.000,00	100.000,00	27.000.000,00

Liquidación de Intereses

Interest Payment

Base / Day count fraction Act / **(Euros) 360**

Intereses Brutos / Gross

Interés Retención / Withholding tax 19%

Neto / Net

3,417874

32.469,80

435,466667

100.157,33

458,466667

123.786,00

0,649396

6.169,26

82,738667

19.029,89

87,108667

23.519,34

2,768478

26.300,54

352,728000

81.127,44

371,358000

100.266,66

Amortización de Principal

Principal Redemption

(Euros)

Amortización / Redemption

A determinar

To be determined

A determinar

To be determined

A determinar

To be determined

A determinar

To be determined

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