F.T.H U.C.I. 12

ANA OBREGON MAZO
ANALISTA
SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.
CIUDAD GRUPO SANTANDER
28660 BOADILLA DEL MONTE
aobregon@gruposantander.com
Tel: 912893301

DENOMINACION DEL FONDO:	**F.T.H U.C.I. 12**			
INFORMACIÓN CORRESPONDIENTE AL:	**TRIMESTRE/SEMESTRE:**	**17/03/2014 - 16/06/2014**	**AÑO:**	**2014**

Personas que asumen la responsabilidad de esta información y cargos que ocupan:	**Firma:**
IGNACIO ORTEGA GAVARA - DIRECTOR GENERAL	

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	30 mayo 2005	**Agencia de pago de Bonos**	BANCO SANTANDER	
Fecha de Desembolso BT's	02 junio 2005	**Negociación Mercado**	AIAF	
Fecha Final Amortización	15 diciembre 2039	**Agencias de calificación**	STANDARD & POORS	
Sociedad Gestora	SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.	**Calificación**	**Inicial**	**Actual**
	UNIÓN DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, S.A	**B.T.H'S SERIE A**	AAA	AA
		B.T.H'S SERIE B	A	A -
		B.T.H'S SERIE C	BBB	BB

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO: BONOS DE TITULIZACION

SERIES PRELACIÓN / **CÓDIGO ISIN**	**Nº BONOS**	**NOMINAL EN CIRCULACIÓN**			
			Inicial	**Actual**	**%Act/In**
B.T.H'S SERIE A	8.672	**Nominal Unitario**	100.000,00	32.542,42	
ES0338147004		**Nominal Total**	867.200.000,00	282.207.866,24	32,54%
B.T.H'S SERIE B	90	**Nominal Unitario**	100.000,00	100.000,00	
ES0338147012		**Nominal Total**	9.000.000,00	9.000.000,00	100,00 %
B.T.H'S SERIE C	238	**Nominal Unitario**	100.000,00	100.000,00	
ES0338147020		**Nominal Total**	23.800.000,00	23.800.000,00	100,00 %

AMORTIZACION E INTERESES BONOS					
Actual			**Próximo**		
Fecha Amortización Periodo Actual 16 de junio de 2014			**Fecha Próximo Cupón 15 de septiembre de 2014**		
	Amortización de los Bonos	**Intereses Brutos Bonos**	**Tipo de Interés**	**Importe Bruto Próximo Cupón**	**Importe Neto Próximo Cupón**
B.T.H'S SERIE A	575,70 €	38,01 €	0,392%	32,25 €	25,47 €
B.T.H'S SERIE B	0,00 €	145,09 €	0,512%	129,42 €	102,24 €
B.T.H'S SERIE C	0,00 €	228,51 €	0,842%	212,84 €	168,14 €
Amortización devengada no pagada	0,00 €				
Amortización Calendario	NO				

III. ACTIVOS ADQUIRIDOS POR EL FONDO: DERECHOS DE CRÉDITO

DERECHOS DE CRÉDITO	**A LA EMISIÓN**	**SITUACIÓN ACTUAL**
Número de Derechos de Crédito	7.886	3.705
Saldo Pendiente de Amortizar Derechos	900.000.006,57 €	325.388.217,21 €
Importes Unitarios Derechos Vivos	114.126,30 €	87.824,08 €
Tipos de Interés	3,93 %	3,28%

TASAS DE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA	**SITUACIÓN ACTUAL**
Tasa mensual actual anualizada:	2,40%
Tasa últimos 12 meses anualizada:	2,04%
Tasa anualizada desde Constitución del Fondo	8,45%

MOROSIDAD ACTUAL	**Hasta 1 mes**	**De 1 a 6 meses**	**Mayor de 6 meses**
Deuda Vencida(Principal+Intereses)	55.270,12 €	124.713,88 €	1.891.558,81 €
Deuda Pendiente de vencimiento	0,00 €	0,00 €	324.557.777,27 €
Deuda Total	55.270,12 €	124.713,88 €	326.449.336,08 €

F.T.H U.C.I. 12

INFORME TRIMESTRAL BONOS DE TITULIZACIÓN

16 de junio de 2014

BONOS TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. PRINCIPAL	
Saldo anterior	320.000.336,64 €
Amortizaciones	4.992.470,40 €
Saldo actual	315.007.866,24 €
% sobre saldo inicial	35,00%
Amortización devengada no pagada	0,00 €

DATOS	
Fecha de determinación	09/06/2014
Fecha de Pago de Cupón Actual	16/06/2014
Fecha de Pago de Cupón Anterior	17/03/2014
Número de días	91
Tipo de referencia (%)	0,242%
Próxima Fecha de Pago	15/09/2014

BONOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. INTERESES	
Intereses pagados Serie A	329.622,72 €
Intereses pagados Serie B	13.058,10 €
Intereses pagados Serie C	54.385,38 €
Intereses devengados no pagados	0,00 €

VIDA RESIDUAL (AÑOS)		
	INICIAL	**16-jun-14**
B.T.H'S SERIE A	4,80	4,95
B.T.H'S SERIE B	8,04	9,25
B.T.H'S SERIE C	8,04	9,25

F.T.H U.C.I. 12

INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

16 de junio de 2014

DERECHOS DE CRÉDITO. PRINCIPAL	
Saldo anterior	330.185.859,13 €
Amortizaciones	4.797.641,92 €
Saldo actual	325.388.217,21 €
Número de derechos de credíto	3.705
LTV	48,69%

DERECHOS DE CRÉDITO. INTERESES	
Intereses cobrados en el trimestre	2.465.956,99 €
Intereses devengados en el trimestre	2.520.063,66 €

DERECHOS DE CRÉDITO CON RETRASOS EN EL PAGO					
	HASTA 30 DÍAS	30 A 60 DÍAS	60 A 90 DÍAS	90 A 180 DÍAS	MÁS DE 180 DÍAS
Principal	29.497,34 €	10.353,31 €	30.710,01 €	24.112,06 €	735.767,22 €
Intereses	25.772,78 €	11.277,88 €	29.697,33 €	18.563,29 €	1.155.791,59 €
Saldo de los derechos de credíto	5.719.367,68 €	2.671.868,03 €	3.438.562,62 €	1.926.437,37 €	9.331.663,52 €
Número de derechos de credíto	58	29	35	20	64
% sobre saldo de los derechos de crédito	1,76%	0,82%	1,06%	0,59%	2,87%

PRÉSTAMOS EN WRITE OFF	
Write Off acumulado Fecha Pago anterior	10.185.490,25 €
Write Off trimestre	194.882,66 €
Write Off acumulados actuales	10.380.372,91 €

F.T.H U.C.I. 12

INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

16 de junio de 2014

ADJUDICADOS	
Saldo anterior	4.571.978,78 €
Diferencia	357.142,14 €
Saldo actual	4.929.120,92 €
Número de adjudicados	99

PERDIDAS DE LAS CARTERAS	
Saldo anterior	2.883.254,52 €
Diferencia	582.075,23 €
Saldo actual	3.465.329,75 €

F.T.H U.C.I. 12

ESTADO DE ORIGEN Y APLICACIÓN DE FONDOS Y CUENTA DE TESORERÍA

16 de junio de 2014

ORIGEN	6.216.069,37 €
PRINCIPAL COBRADO	
Amortización derechos de crédito	3.188.426,90 €
INTERESES COBRADOS	
Intereses de derechos de crédito	2.465.956,99 €
Intereses de reinversión	-1.311,81
INGRESOS/GASTOS DE ADJUDICADOS	530.874,00 €
OTROS	32.123,29 €

APLICACIÓN	6.216.069,37 €
GASTOS ORDINARIOS	342,26 €
COMISIÓN S.G.F.T.	17.950,70 €
INTERESES B.T.H'S SERIE A	329.622,72 €
INTERESES B.T.H'S SERIE B	13.058,10 €
INTERESES B.T.H'S SERIE C	54.385,38 €
FONDOS DISPONIBLES AMORTIZACIÓN A	4.992.470,40 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO SANTANDER	11.171,40 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB	11.171,40 €
COMISIÓN ADMINISTRACIÓN	6.000,00 €
COMISIÓN VARIABLE	779.897,02 €

ESTADO CUENTA DE TESORERÍA	10.433.366,48 €
FONDO DE RESERVA	
Saldo anterior	10.350.000,00 €
Utilizado en el período	0,00 €
Saldo actual	10.350.000,00 €
RETENCIÓN A CUENTA DEL IRPF	83.366,48 €

F.T.H U.C.I. 12

MEJORA CREDITICIA Y PRÉSTAMO SUBORDINADO

16 de junio de 2014

MEJORA DE CRÉDITO		
CONCEPTOS	**INICIAL**	**16 de junio de 2014**
EMISIÓN SUBORDINADA	32.800.000,00 € (3,64%)	32.800.000,00 € (10,08%)
FONDO DE RESERVA	10.350.000,00 € (1,15 %)	10.350.000,00 € (3,18%)

PRÉSTAMOS SUBORDINADOS		
CONCEPTOS	**INICIAL**	**16 de junio de 2014**
PRÉSTAMO SUBORDINADO SCH		
Saldo vivo	5.612.500,00 €	5.175.003,26 €
Tipo de interés	2,682 %	0,792%
PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB		
Saldo vivo	5.612.500,00 €	5.175.003,26 €
Tipo de interés	2,682 %	0,792%

F.T.H U.C.I. 12

DEFINICIONES

16 de junio de 2014

FECHA DE DETERMINACIÓN Será la fecha en que la Sociedad Gestora, en nombre del Fondo, realizará las cálculos necesarios para distribuir los fondos disponibles existentes a dicha fecha, de acuerdo con el orden de prelación de pagos descrito en el Folleto Informativo.
Todos los datos de los Activos Titulizados (Saldo Vivo DC's, tablas de morosidad, propiedades transitorias, datos estadísticos, etc.) están referidos a dicha fecha.

WRITE OFF Préstamos con cuotas pendientes con antigüedad igual o superior a 12 ó 18 meses (según Folleto Informativo).

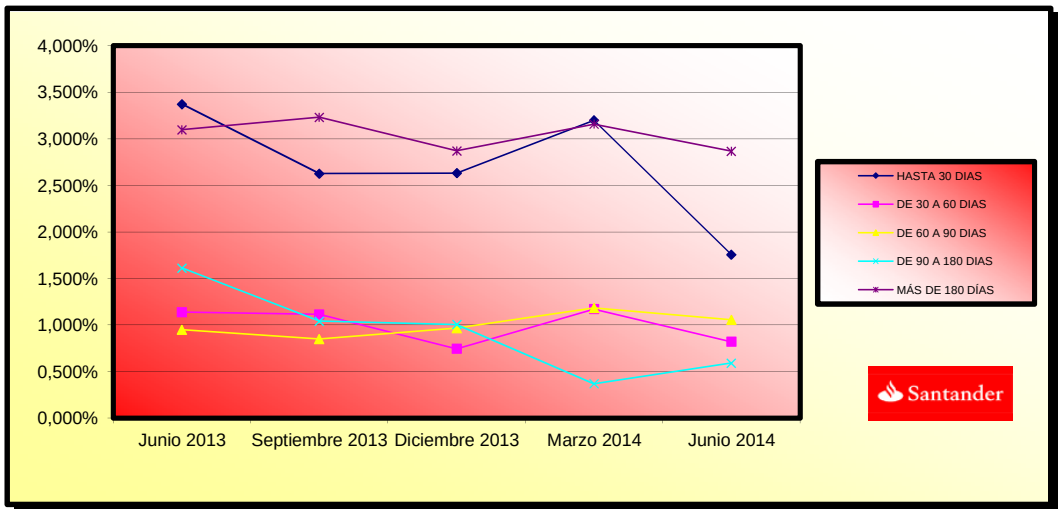
PÉRDIDAS DE LA CARTERA Aquellos préstamos cuya deuda el Cedente considera que no va a recuperar (neto de recuperaciones).

ADJUDICADOS Bienes en el activo del Fondo como consecuencia de un proceso judicial o extrajudicial.

FONDO DE TITULIZACIÓN HIPOTECARIA
UCI 12

INFORME HISTÓRICO DE MOROSIDAD

MOROSIDAD HISTÓRICA					
	Junio 2013	**Septiembre 2013**	**Diciembre 2013**	**Marzo 2014**	**Junio 2014**
HASTA 30 DIAS	3,373%	2,626%	2,632%	3,199%	1,758%
DE 30 A 60 DIAS	1,139%	1,114%	0,745%	1,171%	0,821%
DE 60 A 90 DIAS	0,949%	0,849%	0,967%	1,183%	1,057%
DE 90 A 180 DIAS	1,613%	1,042%	1,006%	0,370%	0,592%
MÁS DE 180 DÍAS	3,097%	3,232%	2,871%	3,157%	2,868%



FONDO DE TITULIZACIÓN HIPOTECARIA
UCI 12

INFORME RELATIVO A LOS TRIGGERS DEL FONDO

Fecha: 16 de junio de 2014

AMORTIZACIÓN BONOS SERIE B Y C	
SI 1) ES MAYOR QUE 2) NO SE AMORTIZAN LAS SERIES B y C	
1) PH´S EN MOROSIDAD > 90 DÍAS	21.638.473,80 €
2) 2% SALDO PH´S ACTUAL	6.507.764,34 €

MOROSIDAD ACTUAL (% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO)
6,65%

NO SE AMORTIZAN LAS SERIES B Y C

TRIGGERS FONDOS DE RESERVA	
SI 1) ES MAYOR QUE 2) NO SE AMORTIZA EL FONDO DE RESERVA	
1) TIPO MEDIO PONDERADO DE LOS BONOS + 0,40%	0,89%
2) TIPO MEDIO PONDERADO DE LAS PHS	3,28%

SE PUEDE AMORTIZAR EL FONDO DE RESERVA

NIVELES DEL FONDOS DE RESERVA SEGÚN LA MOROSIDAD		
MOROSIDAD ACTUAL < 0,75%	MAYOR DE 2,3% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO 0,40% DEL SALDO INICIAL BONOS	NA
MOROSIDAD ACTUAL ENTRE 0,75% Y 1,25%	MAYOR DE 2,3% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO 0,70% DEL SALDO INIICIAL BONOS	NA
MOROSIDAD ACTUAL > 1,25%	MAYOR DE 2,3% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO 0,80% DEL SALDO INIICIAL BONOS	10.350.000 €

POSTERGAMIENTO DE INTERESES DE LAS SERIES B Y C	
SI 1) ES MAYOR QUE 2)+3) LOS INTS DE LA SERIE B SE POSTERGAN AL 6 º LUGAR	
1) SALDO DE LA SERIE A	287.200.336,64 €
2) SALDO VIVO DERECHOS DE CRÉDITO (MOROSIDAD < 18 MESES)	312.224.062,64 €
3) REMANENTE F.DISPONIBLES DESPUÉS PAGO PUNTOS 1º - 3º	16.205.095,59 €
SI 1) ES MAYOR QUE 2)+3) LOS INTS DE LA SERIE C SE POSTERGAN AL 7 º LUGAR	
1) SALDOS DE LAS SERIES A Y B	296.200.336,64 €
2) SALDO VIVO DERECHOS DE CRÉDITO (MOROSIDAD < 18 MESES)	312.224.062,64 €
3) REMANENTE F.DISPONIBLES DESPUÉS PAGO PUNTOS 1º - 4º	16.150.710,21 €

NO SE POSTERGAN LOS INTERESES DE LA SERIE B

NO SE POSTERGAN LOS INTERESES DE LA SERIE C

CONTRATO	CONTRAPARTE	AGENCIA RATING	RATING MÍNIMO EXIGIDO	RATING ACTUAL
CUENTA TESORERÍA	BANCO SANTANDER	S&P	A-1 c/p	A-2 c/p

LA CONTRAPARTE NO TIENE EL RATING MÍNIMO EXIGIDO. SE HA TRASLADADO LA CUENTA DE TESORERÍA A UNA CONTRAPARTE CON EL RATING MÍNIMO EXIGIDO.

ESTADÍSTICO DE VALORES DE TASACIÓN SOBRE SALDOS VIVOS				
INTERVALO	**SALDO**	**% SALDOS VIVOS**	**Nº PRÉSTAMOS**	**% Nº PRÉSTAMOS**
0,17 - 39,99	59.894.213,52 €	18,41%	1.119	30,19%
40,00 - 49,99	55.867.232,35 €	17,17%	559	15,08%
50,00 - 59,99	77.688.748,64 €	23,88%	769	20,75%
60,00 - 69,99	87.735.115,80 €	26,96%	882	23,80%
70,00 - 79,95	44.203.423,87 €	13,58%	377	10,17%

F.T.H.: UCI 12

Fecha	Saldo antes de Pago	Saldo Real	Vector de Prepago	Permanencia final de mes	Mortalidad Mensual	CPR	Mortalidad Mensual	CPR
Date	**Outstanding before prepayment**	**Real outstanding**	**Prepayment vector**	**Remaining at the end of the month**	**Average single monthly mortality**	**CPR**	**Monthly single monthly mortality**	**CPR**
			0,73%					**2,04%**
	900.000.006,57		100,00%	100,00%				
01-07-05	898.420.072,18	862.418.638,74	99,27%	95,99%	4,01%	38,78%	4,01%	38,78%
01-08-05	896.834.963,50	842.920.105,66	98,54%	93,99%	3,05%	31,06%	2,09%	22,37%
01-09-05	895.244.663,59	830.590.005,35	97,82%	92,78%	2,47%	25,91%	1,29%	14,40%
01-10-05	893.649.155,45	815.668.621,72	97,10%	91,27%	2,26%	23,96%	1,62%	17,81%
01-11-05	892.048.422,02	800.443.136,60	96,39%	89,73%	2,14%	22,90%	1,69%	18,50%
01-12-05	890.442.446,19	780.802.538,17	95,68%	87,69%	2,17%	23,11%	2,28%	24,16%
01-01-06	888.831.210,78	766.417.710,00	94,98%	86,23%	2,09%	22,43%	1,66%	18,24%
01-02-06	887.214.698,58	748.930.811,56	94,28%	84,41%	2,10%	22,44%	2,10%	22,52%
01-03-06	885.592.892,31	732.611.319,81	93,59%	82,73%	2,09%	22,34%	2,00%	21,53%
01-04-06	883.965.774,61	715.140.659,01	92,91%	80,90%	2,10%	22,46%	2,21%	23,48%
01-05-06	882.333.328,11	702.340.622,52	92,22%	79,60%	2,05%	22,03%	1,61%	17,68%
01-06-06	880.695.535,35	683.270.618,78	91,55%	77,58%	2,09%	22,42%	2,53%	26,51%
01-07-06	879.053.328,73	665.733.712,32	90,88%	75,73%	2,12%	22,63%	2,38%	25,15%
01-08-06	877.405.743,88	652.435.660,82	90,21%	74,36%	2,09%	22,43%	1,81%	19,72%
01-09-06	875.752.763,19	644.032.394,94	89,55%	73,54%	2,03%	21,80%	1,10%	12,45%
01-10-06	874.094.368,99	633.389.918,98	88,89%	72,46%	1,99%	21,46%	1,47%	16,24%
01-11-06	872.430.543,55	622.756.261,81	88,24%	71,38%	1,96%	21,18%	1,49%	16,50%
01-12-06	870.761.269,08	610.946.659,07	87,59%	70,16%	1,95%	21,04%	1,71%	18,68%
01-01-07	869.086.527,74	600.539.188,15	86,95%	69,10%	1,93%	20,82%	1,51%	16,73%
01-02-07	867.406.301,62	588.547.375,03	86,31%	67,85%	1,92%	20,76%	1,81%	19,65%
01-03-07	865.720.572,76	580.095.763,80	85,68%	67,01%	1,89%	20,45%	1,24%	13,95%
01-04-07	864.029.323,14	567.331.426,62	85,05%	65,66%	1,89%	20,50%	2,01%	21,61%
01-05-07	862.332.534,67	557.167.045,84	84,43%	64,61%	1,88%	20,38%	1,60%	17,58%
01-06-07	860.630.189,23	546.333.111,62	83,81%	63,48%	1,88%	20,33%	1,75%	19,10%
01-07-07	858.922.773,27	536.864.985,43	83,20%	62,50%	1,86%	20,19%	1,54%	16,97%
01-08-07	857.209.765,52	528.501.626,96	82,59%	61,65%	1,84%	20,01%	1,36%	15,16%
01-09-07	855.491.147,67	521.886.614,41	81,98%	61,00%	1,81%	19,72%	1,05%	11,93%
01-10-07	853.766.901,35	516.662.298,11	81,38%	60,52%	1,78%	19,37%	0,80%	9,20%
01-11-07	852.037.008,13	510.149.805,96	80,78%	59,87%	1,75%	19,12%	1,06%	12,00%
01-12-07	850.301.449,50	502.998.030,23	80,19%	59,16%	1,73%	18,94%	1,20%	13,49%
01-01-08	848.560.206,92	497.504.653,70	79,60%	58,63%	1,71%	18,67%	0,89%	10,16%
01-02-08	846.813.261,76	490.912.230,27	79,02%	57,97%	1,69%	18,49%	1,12%	12,66%
01-03-08	845.060.595,37	484.242.603,91	78,44%	57,30%	1,67%	18,33%	1,15%	13,00%
01-04-08	843.302.188,99	478.044.211,52	77,86%	56,69%	1,66%	18,15%	1,07%	12,16%
01-05-08	841.538.023,83	473.846.369,31	77,29%	56,31%	1,63%	17,87%	0,67%	7,75%

01-06-08	839.768.081,03	469.562.236,81	76,73%	55,92%	1,60%	17,62%	0,70%	8,03%
01-07-08	837.992.341,66	465.651.578,90	76,16%	55,57%	1,58%	17,35%	0,62%	7,22%
01-08-08	836.210.786,75	462.193.589,20	75,61%	55,27%	1,55%	17,07%	0,53%	6,19%
01-09-08	834.423.397,25	457.699.224,53	75,05%	54,85%	1,53%	16,87%	0,76%	8,75%
01-10-08	832.630.154,05	453.378.221,46	74,50%	54,45%	1,51%	16,67%	0,73%	8,42%
01-11-08	830.831.037,97	450.213.991,37	73,95%	54,19%	1,48%	16,42%	0,48%	5,64%
01-12-08	829.026.029,80	448.819.444,57	73,41%	54,14%	1,45%	16,08%	0,09%	1,11%
01-01-09	827.216.517,07	446.923.168,73	72,87%	54,03%	1,42%	15,79%	0,20%	2,43%
01-02-09	825.401.078,18	444.555.988,38	72,34%	53,86%	1,40%	15,53%	0,31%	3,67%
01-03-09	823.579.693,74	442.146.115,24	71,81%	53,69%	1,37%	15,28%	0,32%	3,80%
01-04-09	821.752.344,26	438.713.142,06	71,28%	53,39%	1,36%	15,10%	0,56%	6,47%
01-05-09	819.919.010,21	434.939.492,06	70,76%	53,05%	1,34%	14,94%	0,64%	7,40%
01-06-09	818.079.671,99	432.253.929,96	70,24%	52,84%	1,32%	14,74%	0,39%	4,63%
01-07-09	816.236.838,22	428.612.444,35	69,73%	52,51%	1,31%	14,59%	0,62%	7,18%
01-08-09	814.387.969,17	425.464.329,77	69,21%	52,24%	1,29%	14,43%	0,51%	5,94%
01-09-09	812.533.045,07	422.749.203,24	68,71%	52,03%	1,27%	14,25%	0,41%	4,83%
01-10-09	810.672.046,10	420.081.553,57	68,20%	51,82%	1,26%	14,08%	0,40%	4,73%
01-11-09	808.804.952,35	415.995.137,78	67,70%	51,43%	1,25%	13,98%	0,74%	8,57%
01-12-09	806.931.743,87	413.076.769,02	67,21%	51,19%	1,23%	13,83%	0,47%	5,51%
01-01-10	805.054.414,17	410.772.614,91	66,71%	51,02%	1,22%	13,65%	0,33%	3,84%
01-02-10	803.170.936,21	408.262.064,12	66,23%	50,83%	1,20%	13,50%	0,38%	4,44%
01-03-10	801.281.289,87	406.425.253,97	65,74%	50,72%	1,18%	13,32%	0,22%	2,55%
01-04-10	799.385.454,93	404.231.139,63	65,26%	50,57%	1,17%	13,16%	0,30%	3,59%
01-05-10	797.483.411,13	400.994.622,38	64,78%	50,28%	1,16%	13,05%	0,56%	6,56%
01-06-10	795.575.138,14	398.334.972,04	64,30%	50,07%	1,15%	12,92%	0,42%	4,98%
01-07-10	793.661.819,21	394.358.952,15	63,83%	49,69%	1,14%	12,85%	0,76%	8,74%
01-08-10	791.742.234,17	390.698.493,21	63,36%	49,35%	1,13%	12,78%	0,69%	7,95%
01-09-10	789.816.362,48	388.203.648,97	62,90%	49,15%	1,12%	12,65%	0,40%	4,65%
01-10-10	787.884.183,57	386.880.993,17	62,44%	49,10%	1,11%	12,48%	0,10%	1,15%
01-11-10	785.945.676,77	385.034.637,31	61,98%	48,99%	1,09%	12,34%	0,23%	2,75%
01-12-10	784.000.821,36	380.486.480,83	61,53%	48,53%	1,09%	12,32%	0,94%	10,67%
01-01-11	782.053.911,56	377.880.118,35	61,08%	48,32%	1,08%	12,21%	0,44%	5,13%
01-02-11	780.100.625,64	376.513.421,11	60,63%	48,26%	1,07%	12,06%	0,11%	1,34%
01-03-11	778.140.942,70	373.504.344,27	60,18%	48,00%	1,06%	11,98%	0,55%	6,40%
01-04-11	776.174.841,80	371.856.632,62	59,74%	47,91%	1,05%	11,85%	0,19%	2,24%
01-05-11	774.202.301,92	370.848.716,84	59,30%	47,90%	1,03%	11,70%	0,02%	0,20%
01-06-11	772.223.301,97	368.174.693,44	58,87%	47,68%	1,02%	11,61%	0,47%	5,46%
01-07-11	770.241.975,35	366.303.866,58	58,44%	47,56%	1,01%	11,50%	0,25%	2,98%
01-08-11	768.254.159,88	366.470.234,97	58,01%	47,70%	1,00%	11,31%	-0,30%	-3,71%
01-09-11	766.259.834,31	363.149.058,21	57,58%	47,39%	0,99%	11,26%	0,65%	7,51%
01-10-11	764.258.977,32	362.076.703,25	57,16%	47,38%	0,98%	11,13%	0,03%	0,41%
01-11-11	762.251.567,53	360.089.858,32	56,74%	47,24%	0,97%	11,03%	0,29%	3,39%
01-12-11	760.237.583,48	358.200.157,06	56,33%	47,12%	0,96%	10,93%	0,26%	3,09%
01-01-12	758.226.394,26	356.670.279,41	55,91%	47,04%	0,95%	10,82%	0,16%	1,94%
01-02-12	756.208.618,39	355.475.304,40	55,50%	47,01%	0,94%	10,71%	0,07%	0,83%
01-03-12	754.184.234,31	353.366.817,10	55,10%	46,85%	0,93%	10,62%	0,33%	3,85%
01-04-12	752.153.220,37	352.843.094,46	54,69%	46,91%	0,92%	10,49%	-0,12%	-1,47%
01-05-12	750.115.554,86	350.960.157,35	54,29%	46,79%	0,91%	10,40%	0,26%	3,12%
01-06-12	748.071.215,99	349.309.051,11	53,89%	46,69%	0,90%	10,31%	0,20%	2,36%

01-07-12	746.028.531,07	348.487.505,91	53,50%	46,71%	0,89%	10,19%	-0,04%	-0,46%
01-08-12	743.979.156,35	346.553.096,70	53,11%	46,58%	0,88%	10,11%	0,28%	3,32%
01-09-12	741.923.069,93	345.608.681,25	52,72%	46,58%	0,87%	10,00%	0,00%	-0,05%
01-10-12	739.860.249,83	344.452.156,05	52,33%	46,56%	0,86%	9,90%	0,06%	0,68%
01-11-12	737.790.673,99	342.846.050,04	51,95%	46,47%	0,86%	9,82%	0,19%	2,22%
01-12-12	735.714.320,29	341.651.841,92	51,57%	46,44%	0,85%	9,72%	0,07%	0,80%
01-01-13	733.639.620,24	339.808.674,30	51,19%	46,32%	0,84%	9,65%	0,26%	3,05%
01-02-13	731.558.125,54	338.685.022,02	50,81%	46,30%	0,83%	9,56%	0,05%	0,56%
01-03-13	729.469.813,95	337.592.709,88	50,44%	46,28%	0,83%	9,46%	0,04%	0,45%
01-04-13	727.374.663,14	336.661.580,32	50,07%	46,28%	0,82%	9,37%	-0,01%	-0,14%
01-05-13	725.272.650,71	334.732.793,17	49,70%	46,15%	0,81%	9,31%	0,28%	3,36%
01-06-13	723.163.754,19	333.439.234,72	49,34%	46,11%	0,80%	9,22%	0,10%	1,15%
01-07-13	721.052.834,40	332.097.459,56	48,98%	46,06%	0,80%	9,15%	0,11%	1,32%
01-08-13	718.935.001,34	330.388.322,56	48,62%	45,96%	0,79%	9,08%	0,22%	2,63%
01-09-13	716.810.232,38	329.343.544,45	48,26%	45,95%	0,78%	9,00%	0,02%	0,25%
01-10-13	714.678.504,80	328.221.731,31	47,91%	45,93%	0,78%	8,92%	0,04%	0,52%
01-11-13	712.539.795,82	326.574.366,10	47,56%	45,83%	0,77%	8,85%	0,20%	2,41%
01-12-13	710.394.082,56	324.772.662,75	47,21%	45,72%	0,76%	8,80%	0,25%	2,97%
01-01-14	708.248.288,98	323.075.181,05	46,86%	45,62%	0,76%	8,74%	0,22%	2,62%
01-02-14	706.095.467,93	321.726.709,52	46,52%	45,56%	0,75%	8,67%	0,11%	1,36%
01-03-14	703.935.596,38	320.000.368,88	46,18%	45,46%	0,75%	8,62%	0,23%	2,74%
01-04-14	701.768.651,26	318.111.923,24	45,84%	45,33%	0,74%	8,57%	0,28%	3,35%
01-05-14	699.594.609,40	316.632.236,49	45,50%	45,26%	0,74%	8,51%	0,16%	1,85%
01-06-14	697.413.447,54	315.007.844,30	45,17%	45,17%	0,73%	8,45%	0,20%	2,40%

Fecha		Principal disponible antes prepago	Principal Disponible	Amortización de principal	Serie A	Serie B	Serie C	Amortización Serie A	Vida Media Serie A	Amortización Serie B	Vida Media Serie B	Amortización Serie C	Vida Media Serie C
									4,95		9,25		9,25
Date		Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	Average Life Class A	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C
		900.000.000,00											
					867.200.000	9.000.000	23.800.000						
03-06-05		900.000.000,00			867.200.000	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-05	0	891.832.792,93	0,00	0,00	867.200.000	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-05	0	883.731.862,44	0,00	0,00	867.200.000	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-05	0	875.696.702,99	875.696.696,42	24.303.303,58	867.200.000	9.000.000	23.800.000	24.303.303,58	-7764905495014,72%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-05	1	867.726.806,32	0,00	0,00	842.896.696	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-05	0	859.821.668,02	0,00	0,00	842.896.696	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-05	1	851.980.787,48	851.980.780,91	23.715.915,51	842.896.696	9.000.000	23.800.000	23.715.915,51	-7361420174032,36%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-06	0	844.203.667,84	0,00	0,00	819.180.781	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-06	0	836.489.816,02	0,00	0,00	819.180.781	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-06	1	828.838.742,66	828.838.736,09	23.142.044,82	819.180.781	9.000.000	23.800.000	23.142.044,82	-6975012309256,13%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-06	0	821.249.962,05	0,00	0,00	796.038.736	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-06	0	813.722.992,20	0,00	0,00	796.038.736	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-06	1	806.257.354,72	806.257.348,15	22.581.387,93	796.038.736	9.000.000	23.800.000	22.581.387,93	-6598281553802,20%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-06	0	798.853.438,10	0,00	0,00	773.457.348	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-06	0	791.509.898,05	0,00	0,00	773.457.348	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-06	1	784.226.267,02	784.226.260,45	22.031.087,70	773.457.348	9.000.000	23.800.000	22.031.087,70	-6234797819356,44%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-06	0	777.002.081,01	0,00	0,00	751.426.260	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-06	0	769.836.879,51	0,00	0,00	751.426.260	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-06	1	762.730.205,48	762.730.198,91	21.496.061,54	751.426.260	9.000.000	23.800.000	21.496.061,54	-5887771256295,27%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-07	0	755.681.605,35	0,00	0,00	729.930.199	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-07	0	748.690.628,96	0,00	0,00	729.930.199	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-07	1	741.756.829,55	741.756.822,98	20.973.375,93	729.930.199	9.000.000	23.800.000	20.973.375,93	-5555847284133,17%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-07	0	734.879.763,75	0,00	0,00	708.956.823	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-07	0	728.058.991,52	0,00	0,00	708.956.823	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-07	1	721.294.076,16	721.294.069,59	20.462.753,38	708.956.823	9.000.000	23.800.000	20.462.753,38	-5232326040441,32%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-07	0	714.585.004,13	0,00	0,00	688.494.070	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-07	0	707.930.920,64	0,00	0,00	688.494.070	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-07	1	701.331.398,84	701.331.392,27	19.962.677,32	688.494.070	9.000.000	23.800.000	19.962.677,32	-4920799959854,79%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-07	0	694.786.015,14	0,00	0,00	668.531.392	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-07	0	688.294.349,11	0,00	0,00	668.531.392	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-07	1	681.855.983,53	681.855.976,96	19.475.415,32	668.531.392	9.000.000	23.800.000	19.475.415,32	-4623463596425,72%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-08	0	675.470.504,31	0,00	0,00	649.055.977	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-08	0	669.137.500,52	0,00	0,00	649.055.977	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-08	1	662.856.564,31	662.856.557,74	18.999.419,22	649.055.977	9.000.000	23.800.000	18.999.419,22	-4337567407106,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-08	0	656.627.290,93	0,00	0,00	630.056.558	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-08	0	650.449.278,68	0,00	0,00	630.056.558	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-08	1	644.322.128,92	644.322.122,35	18.534.435,39	630.056.558	9.000.000	23.800.000	18.534.435,39	-4060894793002,85%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-08	0	638.245.446,01	0,00	0,00	611.522.122	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-08	0	632.218.837,29	0,00	0,00	611.522.122	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-08	1	626.241.913,10	626.241.906,53	18.080.215,82	611.522.122	9.000.000	23.800.000	18.080.215,82	-3795037301560,44%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-08	0	620.314.286,71	0,00	0,00	593.441.907	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-08	0	614.435.574,33	0,00	0,00	593.441.907	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-08	1	608.605.395,06	608.605.388,49	17.636.518,04	593.441.907	9.000.000	23.800.000	17.636.518,04	-3541412822223,40%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-09	0	602.824.396,12	0,00	0,00	575.805.388	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-09	0	597.091.165,45	0,00	0,00	575.805.388	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-09	1	591.405.330,82	591.405.324,25	17.200.064,24	575.805.388	9.000.000	23.800.000	17.200.064,24	-3298972320906,32%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-09	0	585.766.522,87	0,00	0,00	558.605.324	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-09	0	580.174.375,00	0,00	0,00	558.605.324	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-09	1	574.628.523,40	574.628.516,83	16.776.807,42	558.605.324	9.000.000	23.800.000	16.776.807,42	-3063445034419,59%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-09	0	569.130.369,90	0,00	0,00	541.828.517	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-09	0	563.677.773,18	0,00	0,00	541.828.517	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-09	1	558.270.377,81	558.270.371,24	16.358.145,59	541.828.517	9.000.000	23.800.000	16.358.145,59	-2836502445682,30%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-09	0	552.907.831,07	0,00	0,00	525.470.371	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-09	0	547.589.782,89	0,00	0,00	525.470.371	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-09	1	542.315.885,86	542.315.879,29	15.954.491,95	525.470.371	9.000.000	23.800.000	15.954.491,95	-2621323027470,17%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-10	0	537.087.138,54	0,00	0,00	509.515.879	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-10	0	531.901.840,10	0,00	0,00	509.515.879	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-10	1	526.759.651,13	526.759.644,56	15.556.234,73	509.515.879	9.000.000	23.800.000	15.556.234,73	-2415883253623,55%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-10	0	521.660.234,77	0,00	0,00	493.959.645	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-10	0	516.603.256,70	0,00	0,00	493.959.645	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-10	1	511.588.385,18	511.588.378,61	15.171.265,95	493.959.645	9.000.000	23.800.000	15.171.265,95	-2216521955479,96%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-10	0	506.616.059,27	0,00	0,00	478.788.379	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-10	0	501.685.175,14	0,00	0,00	478.788.379	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-10	1	496.795.408,57	496.795.402,00	14.792.976,61	478.788.379	9.000.000	23.800.000	14.792.976,61	-2025158497415,15%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-10	0	491.946.437,85	0,00	0,00	463.995.402	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-10	0	487.137.943,66	0,00	0,00	463.995.402	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-10	1	482.369.609,15	482.369.602,58	14.425.799,42	463.995.402	9.000.000	23.800.000	14.425.799,42	-1843617166429,43%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-11	0	477.643.755,26	0,00	0,00	449.569.603	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-11	0	472.957.404,43	0,00	0,00	449.569.603	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-11	1	468.310.247,21	468.310.240,64	14.059.361,94	449.569.603	9.000.000	23.800.000	14.059.361,94	-1670252198792,92%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-11	0	463.701.976,50	0,00	0,00	435.510.241	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-11	0	459.132.287,54	0,00	0,00	435.510.241	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-11	1	454.600.877,88	454.600.871,31	13.709.369,32	435.510.241	9.000.000	23.800.000	13.709.369,32	-1502546877636,73%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-11	0	450.109.875,20	0,00	0,00	421.800.871	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-11	0	445.656.526,09	0,00	0,00	421.800.871	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%

									4,95		9,25		9,25
Date		Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	Average Life Class A	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C
08-09-11	1	441.240.535,19	441.240.528,62	13.360.342,69	421.800.871	9.000.000	23.800.000	13.360.342,69	-1341378406176,89%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-11	0	436.861.609,39	0,00	0,00	408.440.529	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-11	0	432.519.457,80	0,00	0,00	408.440.529	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-11	1	428.213.791,73	428.213.785,16	13.026.743,46	408.440.529	9.000.000	23.800.000	13.026.743,46	-1189341678159,11%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-12	0	423.949.575,32	0,00	0,00	395.413.785	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-12	0	419.721.213,71	0,00	0,00	395.413.785	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-12	1	415.528.425,29	415.528.418,72	12.685.366,44	395.413.785	9.000.000	23.800.000	12.685.366,44	-1042737121694,84%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-12	0	411.370.930,57	0,00	0,00	382.728.419	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-12	0	407.248.452,22	0,00	0,00	382.728.419	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-12	1	403.160.714,97	403.160.708,40	12.367.710,31	382.728.419	9.000.000	23.800.000	12.367.710,31	-902842852953,62%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-12	0	399.111.912,34	0,00	0,00	370.360.708	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-12	0	395.097.255,61	0,00	0,00	370.360.708	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-12	1	391.116.476,24	391.116.469,67	12.044.238,73	370.360.708	9.000.000	23.800.000	12.044.238,73	-768422430852,05%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-12	0	387.169.307,71	0,00	0,00	358.316.470	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-12	0	383.255.485,52	0,00	0,00	358.316.470	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-12	1	379.374.747,19	379.374.740,62	11.741.729,05	358.316.470	9.000.000	23.800.000	11.741.729,05	-642272579077,37%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-13	0	375.531.159,49	0,00	0,00	346.574.741	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-13	0	371.720.087,30	0,00	0,00	346.574.741	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-13	1	367.941.274,52	367.941.267,95	11.433.472,68	346.574.741	9.000.000	23.800.000	11.433.472,68	-522509701390,79%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-13	0	364.194.467,00	0,00	0,00	335.141.268	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-13	0	360.479.412,55	0,00	0,00	335.141.268	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-13	1	356.795.860,87	356.795.854,30	11.145.413,65	335.141.268	9.000.000	23.800.000	11.145.413,65	-406807598157,05%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-13	0	353.145.955,27	0,00	0,00	323.995.854	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-13	0	349.527.030,29	0,00	0,00	323.995.854	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-13	1	345.938.841,53	345.938.834,96	10.857.019,33	323.995.854	9.000.000	23.800.000	10.857.019,33	-296396627786,80%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-13	0	342.381.146,51	0,00	0,00	313.138.835	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-13	0	338.853.704,54	0,00	0,00	313.138.835	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-13	1	335.356.276,82	335.356.270,25	10.582.564,71	313.138.835	9.000.000	23.800.000	10.582.564,71	-192602677804,81%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-14	0	331.891.881,71	0,00	0,00	302.556.270	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-14	0	328.456.991,47	0,00	0,00	302.556.270	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-14	1	325.051.373,03	325.051.366,46	10.304.903,79	302.556.270	9.000.000	23.800.000	10.304.903,79	-94805114846,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-14	0	321.674.795,09	0,00	0,00	292.251.366	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-14	0	318.327.028,11	0,00	0,00	292.251.366	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-14	1	315.007.844,30	315.007.837,73	10.043.528,73	292.251.366	9.000.000	23.800.000	10.043.528,73	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-14	0	311.723.196,74	0,00	0,00	282.207.838	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-14	0	308.466.611,45	0,00	0,00	282.207.838	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-14	1	305.237.866,43	305.237.859,86	9.769.977,87	282.207.838	9.000.000	23.800.000	9.769.977,87	89883796358,40%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-14	0	302.036.741,41	0,00	0,00	272.437.860	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-14	0	298.863.017,74	0,00	0,00	272.437.860	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-14	1	295.716.478,49	295.716.471,92	9.521.387,95	272.437.860	9.000.000	23.800.000	9.521.387,95	174241399431,78%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-15	0	292.613.535,73	0,00	0,00	262.916.472	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-15	0	289.537.158,66	0,00	0,00	262.916.472	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-15	1	286.487.136,95	286.487.130,38	9.229.341,54	262.916.472	9.000.000	23.800.000	9.229.341,54	251961023948,48%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-15	0	283.463.261,85	0,00	0,00	253.687.130	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-15	0	280.465.326,20	0,00	0,00	253.687.130	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-15	1	277.493.124,44	277.493.117,87	8.994.012,51	253.687.130	9.000.000	23.800.000	8.994.012,51	328281456729,87%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-15	0	274.547.653,30	0,00	0,00	244.693.118	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-15	0	271.627.495,92	0,00	0,00	244.693.118	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-15	1	268.732.451,50	268.732.444,93	8.760.672,94	244.693.118	9.000.000	23.800.000	8.760.672,94	400362753221,93%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-15	0	265.862.320,82	0,00	0,00	235.932.445	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-15	0	263.016.906,16	0,00	0,00	235.932.445	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-15	1	260.196.011,31	260.196.004,74	8.536.440,20	235.932.445	9.000.000	23.800.000	8.536.440,20	467796922688,72%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-16	0	257.401.137,67	0,00	0,00	227.396.005	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-16	0	254.630.376,56	0,00	0,00	227.396.005	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-16	1	251.883.536,41	251.883.529,84	8.312.474,89	227.396.005	9.000.000	23.800.000	8.312.474,89	531167145703,80%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-16	0	249.160.427,12	0,00	0,00	219.083.530	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-16	0	246.460.860,04	0,00	0,00	219.083.530	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-16	1	243.784.647,96	243.784.641,39	8.098.888,45	219.083.530	9.000.000	23.800.000	8.098.888,45	592028746054,20%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-16	0	241.136.198,89	0,00	0,00	210.984.641	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-16	0	238.510.682,26	0,00	0,00	210.984.641	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-16	1	235.907.915,59	235.907.909,02	7.876.732,37	210.984.641	9.000.000	23.800.000	7.876.732,37	648255073815,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-16	0	233.327.717,79	0,00	0,00	203.107.909	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-16	0	230.769.909,16	0,00	0,00	203.107.909	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-16	1	228.234.311,38	228.234.304,81	7.673.604,21	203.107.909	9.000.000	23.800.000	7.673.604,21	701367425163,13%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-17	0	225.725.027,59	0,00	0,00	195.434.305	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-17	0	223.237.553,23	0,00	0,00	195.434.305	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-17	1	220.771.714,48	220.771.707,91	7.462.596,89	195.434.305	9.000.000	23.800.000	7.462.596,89	749244728047,07%	0,00	0,00%	0,00	0,00%

									4,95		9,25		9,25
Date		Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	Average Life Class A	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C
08-04-17	0	218.327.338,84	0,00	0,00	187.971.708	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-17	0	215.904.255,12	0,00	0,00	187.971.708	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-17	1	213.502.293,47	213.502.286,90	7.269.421,01	187.971.708	9.000.000	23.800.000	7.269.421,01	796728542780,86%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-17	0	211.124.340,99	0,00	0,00	180.702.287	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-17	0	208.767.139,85	0,00	0,00	180.702.287	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-17	1	206.430.524,38	206.430.517,81	7.071.769,09	180.702.287	9.000.000	23.800.000	7.071.769,09	840126167645,32%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-17	0	204.114.330,18	0,00	0,00	173.630.518	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-17	0	201.818.394,07	0,00	0,00	173.630.518	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-17	1	199.542.554,16	199.542.547,59	6.887.970,22	173.630.518	9.000.000	23.800.000	6.887.970,22	880971391330,04%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
07-01-18	1	197.289.589,57	0,00	0,00	166.742.548	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-02-18	1	195.056.367,54	0,00	0,00	166.742.548	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-18	1	192.842.730,16	192.842.723,59	6.699.824,01	166.742.548	9.000.000	23.800.000	6.699.824,01	917205906544,73%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
07-04-18	1	190.648.520,73	0,00	0,00	160.042.724	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
07-05-18	1	188.473.583,76	0,00	0,00	160.042.724	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-06-18	1	186.317.764,94	186.317.758,37	6.524.965,22	160.042.724	9.000.000	23.800.000	6.524.965,22	951992425303,05%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-07-18	0	184.184.734,45	0,00	0,00	153.517.758	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-08-18	0	182.070.473,42	0,00	0,00	153.517.758	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-09-18	1	179.974.831,45	179.974.824,88	6.342.933,49	153.517.758	9.000.000	23.800.000	6.342.933,49	983788983745,55%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-10-18	0	177.897.659,31	0,00	0,00	147.174.825	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-11-18	0	175.838.808,91	0,00	0,00	147.174.825	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-12-18	1	173.798.133,29	173.798.126,72	6.176.698,17	147.174.825	9.000.000	23.800.000	6.176.698,17	1014213838789,70%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-01-19	0	171.780.100,26	0,00	0,00	140.998.127	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-02-19	0	169.779.898,83	0,00	0,00	140.998.127	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-03-19	1	167.797.385,86	167.797.379,29	6.000.747,42	140.998.127	9.000.000	23.800.000	6.000.747,42	1039329453753,18%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-04-19	0	165.832.419,33	0,00	0,00	134.997.379	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-05-19	0	163.884.858,31	0,00	0,00	134.997.379	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-06-19	1	161.954.562,92	161.954.556,35	5.842.822,94	134.997.379	9.000.000	23.800.000	5.842.822,94	1065730904756,78%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-07-19	0	160.053.712,00	0,00	0,00	129.154.556	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-08-19	0	158.169.709,66	0,00	0,00	129.154.556	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-09-19	1	156.302.420,47	156.302.413,90	5.652.142,45	129.154.556	9.000.000	23.800.000	5.652.142,45	1082950494036,42%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-10-19	0	154.451.710,06	0,00	0,00	123.502.414	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-11-19	0	152.617.445,08	0,00	0,00	123.502.414	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-12-19	1	150.799.493,23	150.799.486,66	5.502.927,24	123.502.414	9.000.000	23.800.000	5.502.927,24	1104437496655,51%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-01-20	0	149.020.501,07	0,00	0,00	117.999.487	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-02-20	0	147.257.300,48	0,00	0,00	117.999.487	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-03-20	1	145.509.764,46	145.509.757,89	5.289.728,77	117.999.487	9.000.000	23.800.000	5.289.728,77	1109785095679,93%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-04-20	0	143.777.766,99	0,00	0,00	112.709.758	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-05-20	0	142.061.183,01	0,00	0,00	112.709.758	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-06-20	1	140.359.888,44	140.359.881,87	5.149.876,02	112.709.758	9.000.000	23.800.000	5.149.876,02	1127822848748,92%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-07-20	0	138.675.305,24	0,00	0,00	107.559.882	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-08-20	0	137.005.748,49	0,00	0,00	107.559.882	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-09-20	1	135.351.097,10	135.351.090,53	5.008.791,34	107.559.882	9.000.000	23.800.000	5.008.791,34	1143006183741,44%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-10-20	0	133.711.230,90	0,00	0,00	102.551.091	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-11-20	0	132.086.030,67	0,00	0,00	102.551.091	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-12-20	1	130.475.378,08	130.475.371,51	4.875.719,02	102.551.091	9.000.000	23.800.000	4.875.719,02	1157008123725,38%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-01-21	0	128.880.651,60	0,00	0,00	97.675.372	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-02-21	0	127.300.221,80	0,00	0,00	97.675.372	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-03-21	1	125.733.973,22	125.733.966,65	4.741.404,86	97.675.372	9.000.000	23.800.000	4.741.404,86	1167808016466,63%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-04-21	0	124.181.791,29	0,00	0,00	92.933.967	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-05-21	0	122.643.562,35	0,00	0,00	92.933.967	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-06-21	1	121.119.173,58	121.119.167,01	4.614.799,64	92.933.967	9.000.000	23.800.000	4.614.799,64	1179081307591,17%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-07-21	0	121.119.173,58	0,00	0,00	88.319.167	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-08-21	0	121.119.173,58	0,00	0,00	88.319.167	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-09-21	1	121.119.173,58	116.630.601,85	4.488.565,16	88.319.167	9.000.000	23.800.000	4.488.565,16	1188123198004,96%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-10-21	0	121.119.173,58	0,00	0,00	83.830.602	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-11-21	0	121.119.173,58	0,00	0,00	83.830.602	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-12-21	1	121.119.173,58	112.262.529,16	4.368.072,69	83.830.602	9.000.000	23.800.000	4.368.072,69	1195978302980,36%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-01-22	0	110.835.545,92	0,00	0,00	79.462.529	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-02-22	0	109.421.483,35	0,00	0,00	79.462.529	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-03-22	1	108.020.243,19	108.020.236,62	4.242.292,54	79.462.529	9.000.000	23.800.000	4.242.292,54	1199720330428,49%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-04-22	0	106.631.721,40	0,00	0,00	75.220.237	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-05-22	0	105.255.814,76	0,00	0,00	75.220.237	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-06-22	1	103.892.420,83	103.892.414,26	4.127.822,36	75.220.237	9.000.000	23.800.000	4.127.822,36	1205324129300,79%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-07-22	0	102.543.087,21	0,00	0,00	71.092.414	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-08-22	0	101.206.045,00	0,00	0,00	71.092.414	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-09-22	1	99.881.194,28	99.881.187,71	4.011.226,55	71.092.414	9.000.000	23.800.000	4.011.226,55	1208181435819,19%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-10-22	0	98.568.435,92	0,00	0,00	67.081.188	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-11-22	0	97.267.671,55	0,00	0,00	67.081.188	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-12-22	1	95.978.803,55	95.978.796,98	3.902.390,73	67.081.188	9.000.000	23.800.000	3.902.390,73	1210911843258,73%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-01-23	0	94.704.617,41	0,00	0,00	63.178.797	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-02-23	0	93.442.101,79	0,00	0,00	63.178.797	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-03-23	1	92.191.161,64	92.191.155,07	3.787.641,91	63.178.797	9.000.000	23.800.000	3.787.641,91	1209394063192,95%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-04-23	0	90.951.702,61	0,00	0,00	59.391.155	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-05-23	0	89.723.631,09	0,00	0,00	59.391.155	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-06-23	1	88.506.854,22	88.506.847,65	3.684.307,42	59.391.155	9.000.000	23.800.000	3.684.307,42	1210294987117,76%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-07-23	0	87.302.570,58	0,00	0,00	55.706.848	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-08-23	0	86.109.383,24	0,00	0,00	55.706.848	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-09-23	1	84.927.201,59	-6,57	88.506.854,22	55.706.848	9.000.000	23.800.000	55.706.847,65	18812202451190,50%	9.000.000,00	3039300000000,00%	23.800.000,00	8037260000000,00%