



F.T.A. UCI 11

MARIA JOSE HERENCIAS

ANALISTA

SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.

CIUDAD GRUPO SANTANDER

28660 BOADILLA DEL MONTE

marjherencias@gruposantander.com

Tel: 912893300



DENOMINACION DEL FONDO:

F.T.A. UCI 11

INFORMACIÓN

CORRESPONDIENTE AL:

TRIMESTRE/SEMESTRE:

15/06/2015

-

15/09/2015

AÑO:

2015

Personas que asumen la responsabilidad de esta información y cargos que ocupan:

IGNACIO ORTEGA GAVARA - DIRECTOR GENERAL

Firma:

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	16 noviembre 2004	Agencia de pago de Bonos	BANCO SANTANDER	
Fecha de Desembolso BT's	22 noviembre 2004	Negociación Mercado	AIAF	
Fecha Final Amortización	15 septiembre 2041	Agencias de calificación	STANDARD & POORS	
Sociedad Gestora	SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.	Calificación	Inicial	Actual
Originador Derechos Crédito	UNION DE CREDITOS INMOBILIARIOS	B.T.A'S SERIE A	AAA	A
		B.T.A'S SERIE B	A	BB-
		B.T.A'S SERIE C	BBB	B-

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO: BONOS DE TITULIZACION

SERIES PRELACIÓN CÓDIGO ISIN	Nº BONOS	NOMINAL EN CIRCULACIÓN			
			Inicial	Actual	%Act/In
B.T.A'S SERIE A ES033834005	8.211	Nominal Unitario	100.000,00	22.011,76	
		Nominal Total	821.100.000,00	180.738.561,36	22,01%
B.T.A'S SERIE B ES0338340013	60	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	6.000.000,00	6.000.000,00	100,00 %
B.T.A'S SERIE C ES0338340021	229	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	22.900.000,00	22.900.000,00	100,00 %

AMORTIZACION E INTERESES BONOS					
Actual			Próximo		
Fecha Amortización Periodo Actual 15 septiembre 2015			Fecha Próximo Cupón 15 diciembre 2015		
	Amortización de los Bonos	Intereses Brutos Bonos	Tipo de Interés	Importe Bruto Próximo Cupón	Importe Neto Próximo Cupón
B.T.A'S SERIE A	511,35 €	7,25 €	0,102 %	5,68 €	4,57 €
B.T.A'S SERIE B	0,00 €	80,76 €	0,292 %	73,81 €	59,42 €
B.T.A'S SERIE C	0,00 €	188,09 €	0,712 %	179,98 €	144,89 €
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	11.356	3.953
Saldo Pendiente de Amortizar Derechos	850.000.156,93	215.380.251,30 €
Importes Unitarios Derechos Vivos	74.850,30	54.485,26 €
Tipos de Interés	4,23 %	2,14 %

TASAS DE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA	SITUACIÓN ACTUAL
Tasa mensual actual anualizada:	4,07 %
Tasa últimos 12 meses anualizada:	2,95 %
Tasa anualizada desde Constitución del Fondo	9,36 %

MOROSIDAD ACTUAL	Hasta 1 mes	De 1 a 6 meses	Mayor de 6 meses
Deuda Vencida(Principal+Intereses)	15.092,24	40.271,82	1.094.564,73
Deuda Pendiente de vencimiento	0,00	0,00	214.745.341,08
Deuda Total	15.092,24	40.271,82	215.839.905,81

F.T.A. UCI 11**INFORME TRIMESTRAL BONOS DE TITULIZACIÓN****15 de septiembre de 2015**

BONOS TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. PRINCIPAL	
Saldo anterior	213.837.256,21 €
Amortizaciones	4.198.694,85 €
Saldo actual	209.638.561,36 €
% sobre saldo inicial	24,66%
Amortización devengada no pagada	0,00 €

BONOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. INTERESES	
Intereses pagados Serie A	59.529,75 €
Intereses pagados Serie B	4.845,60 €
Intereses pagados Serie C	43.072,61 €
Intereses devengados no pagados	0

DATOS	
Fecha de determinación	08/09/2015
Fecha de Pago de Cupón Actual	15/09/2015
Fecha de Pago de Cupón Anterior	15/06/2015
Número de días	92
Tipo de referencia (%)	-0,038%
Próxima Fecha de Pago	15/12/2015

VIDA RESIDUAL (AÑOS)		
	INICIAL	15 de septiembre de 2015
B.T.A'S SERIE A	4,75	3,74
B.T.A'S SERIE B	7,93	6,01
B.T.A'S SERIE C	7,91	6,01

F.T.A. UCI 11

INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

15 de septiembre de 2015

DERECHOS DE CRÉDITO. PRINCIPAL	
Saldo anterior	218.893.927,63 €
Amortizaciones	3.513.676,33 €
Saldo actual	215.380.251,30 €
Número de derechos de crédito	3.953
LTV	49,84%

DERECHOS DE CRÉDITO. INTERESES	
Intereses cobrados en el trimestre	1.100.678,25 €
Intereses devengados en el trimestre	1.306.058,28 €

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	12.037,98 €	7.766,20 €	3.885,16 €	15.083,35 €	596.137,53 €
Intereses	3.054,26 €	3.375,76 €	2.920,01 €	7.241,34 €	498.427,20 €
Saldo de los derechos de crédito	3.256.001,36 €	1.218.683,93 €	527.896,66 €	762.216,58 €	6.580.764,69 €
Número de derechos de crédito	52	22	8	12	157
% sobre saldo de los derechos de crédito	1,51%	0,57%	0,25%	0,35%	3,06%

PRÉSTAMOS EN WRITE OFF	
Write Off acumulado Fecha Pago anterior	5.056.694,90 €
Write Off trimestre	684.982,84 €
Write Off acumulados actuales	5.741.677,74 €

F.T.A. UCI 11

INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

15 de septiembre de 2015

ADJUDICADOS	
Saldo anterior	1.748.214,29 €
Diferencia	-128.433,24 €
Saldo actual	1.619.781,05 €
Número de adjudicados	43

PERDIDAS DE LA CARTERA	
Saldo anterior	1.558.946,25 €
Diferencia	131.387,58 €
Saldo actual	1.690.333,83 €

F.T.A. UCI 11

ESTADO DE ORIGEN Y APLICACIÓN DE FONDOS Y CUENTA DE TESORERÍA

15 de septiembre de 2015

ORIGEN	4.870.476,98 €
PRINCIPAL COBRADO	
Amortización derechos de crédito	3.458.376,41 €
INTERESES COBRADOS	
Intereses de derechos de crédito	1.100.678,25 €
Intereses de reinversión	-3.792,46 €
INGRESOS/GASTOS DE ADJUDICADOS	264.448,67 €
INGRESOS IMPORTES ASEGURADOS	51.255,00 €
OTROS	-488,89 €

APLICACIÓN	4.870.476,98 €
GASTOS ORDINARIOS	4.285,82 €
COMISIÓN S.G.F.T	14.174,06 €
PAGO SWAP	0
COBRO SWAP	0
INTERESES B.T.A'S SERIE A	59.529,75 €
INTERESES B.T.A'S SERIE B	4.845,60 €
INTERESES B.T.A'S SERIE C	43.072,61 €
FONDOS DISPONIBLES AMORTIZACIÓN A	4.198.694,85 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO SANTANDER	9.547,50 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB	9.547,50 €
COMISIÓN ADMINISTRACIÓN UCI	6.000,00 €
COMISIÓN VARIABLE	520.779,29 €

ESTADO CUENTA DE TESORERÍA	12.750.000,00 €
FONDO DE RESERVA	
Saldo anterior	12.750.000,00 €
Utilizado en el periodo	0,00 €
Saldo actual	12.750.000,00 €

F.T.A. UCI 11

MEJORA CREDITICIA Y PRÉSTAMO SUBORDINADO

15 de septiembre de 2015

MEJORA DE CRÉDITO			
CONCEPTOS	INICIAL		15 de septiembre de 2015
EMISIÓN SUBORDINADA	28.900.000,00 €	3,40 %	28.900.000,00 € 13,79%
FONDO DE RESERVA	12.750.000,00 €	1,50%	12.750.000,00 € 6,08%

PRÉSTAMOS SUBORDINADOS		
CONCEPTOS	INICIAL	15 de septiembre de 2015
PRÉSTAMO SUBORDINADO SCH		
Saldo vivo	6.812.500,00 €	6.375.386,18 €
Tipo de interés	2,790 %	0,586%
PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB		
Saldo vivo	6.812.500,00 €	6.375.386,18 €
Tipo de interés	2,790 %	0,586%

F.T.A. UCI 11

DEFINICIONES

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).

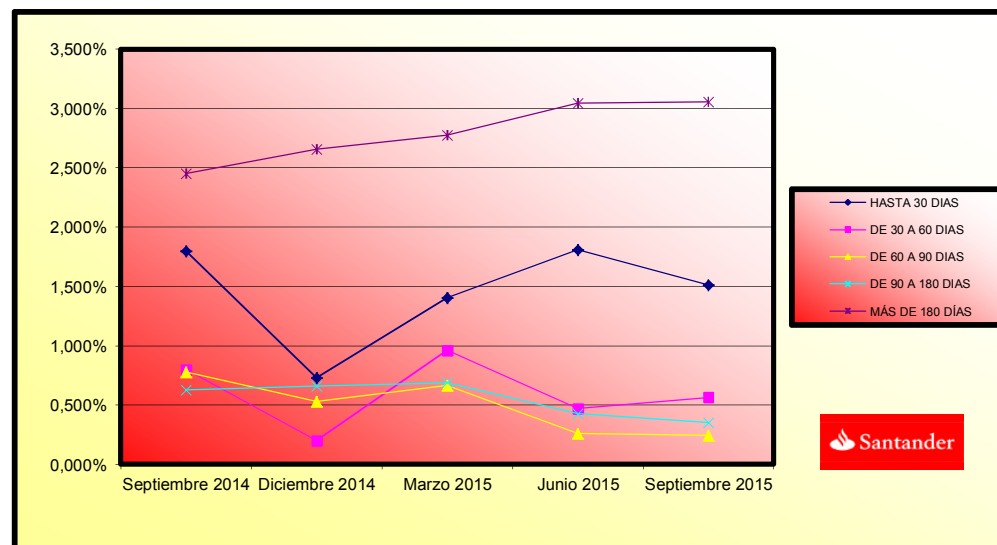
PÉRDIDAS DE LA CARTERA Aquellos préstamos cuya deuda el Cedente considera que no va a recuperar (neto de recuperaciones).

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

FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS UCI 11

INFORME HISTÓRICO DE MOROSIDAD

MOROSIDAD HISTÓRICA					
	Septiembre 2014	Diciembre 2014	Marzo 2015	Junio 2015	Septiembre 2015
HASTA 30 DÍAS	1,798%	0,730%	1,403%	1,807%	1,512%
DE 30 A 60 DÍAS	0,800%	0,200%	0,961%	0,472%	0,566%
DE 60 A 90 DÍAS	0,780%	0,532%	0,666%	0,263%	0,245%
DE 90 A 180 DÍAS	0,628%	0,658%	0,690%	0,430%	0,354%
MÁS DE 180 DÍAS	2,453%	2,656%	2,775%	3,045%	3,055%



**FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS
UCI 11**

INFORME RELATIVO A LOS TRIGGERS DEL FONDO

Fecha informe: 15/06/2015

AMORTIZACIÓN BONOS SERIE B y C	
SI 1) ES MAYOR QUE 2) NO SE AMORTIZAN LAS SERIES B y C	
1) DERECHOS EN MOROSIDAD > 90 DÍAS	13.084.659,01 €
2) 2% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO ACTUAL	4.307.605,03 €

MOROSIDAD > 90 DÍAS (% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO)
6,08%

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) DERECHOS EN MOROSIDAD > 90 DÍAS	13.084.659,01 €
2) 1,25% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO ACTUAL	2.692.253,14 €

NO SE AMORTIZA EL FONDO DE RESERVA

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 7 º LUGAR	
1) SALDO DE LA SERIE A	184.937.256,21 €
2) SALDO VIVO DERECHOS DE CRÉDITO (MOROSIDAD < 18 MESES)	207.373.541,42 €
3) REMANENTE F.DISPONIBLES DESPUÉS PAGO PUNTOS 1º - 4º	17.537.641,75 €
SI 1) ES MAYOR QUE 2)+3) LOS INTS DE LA SERIE C SE POSTERGAN AL 8 º LUGAR	
1) SALDOS DE LAS SERIES A Y B	190.937.256,21 €
2) SALDO VIVO DERECHOS DE CRÉDITO (MOROSIDAD < 18 MESES)	207.373.541,42 €
3) REMANENTE F.DISPONIBLES DESPUÉS PAGO PUNTOS 1º - 5º	17.494.569,14 €

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
0,01 - 9,99	1.146.909,80	0,5559%	104	3,4982%
10,00 - 19,99	4.092.663,15	1,9836%	132	4,4400%
20,00 - 29,99	8.657.225,33	4,1959%	176	5,9199%
30,00 - 39,99	23.886.938,28	11,5773%	328	11,0326%
40,00 - 49,99	29.923.351,32	14,5029%	400	13,4544%
50,00 - 59,99	74.513.411,79	36,1143%	1.040	34,9815%
60,00 - 69,99	44.015.900,87	21,3331%	580	19,5089%
70,00 - 79,99	16.900.945,55	8,1914%	183	6,1554%
80,00 - 89,99	2.919.970,42	1,4152%	28	0,9418%
90,00 - 93,57	269.190,88	0,1305%	2	0,0673%

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
			0,82%					2,95%
	850.000.000,00		100,00%	100,00%				
8-dic-04	848.447.342,89	833.517.603,20	99,18%	98,24%	1,76%	19,19%	1,76%	19,19%
8-ene-05	846.889.973,92	816.392.876,79	98,38%	96,40%	1,82%	19,75%	1,87%	20,31%
8-feb-05	845.328.036,68	802.341.378,75	97,57%	94,91%	1,72%	18,84%	1,54%	16,99%
8-mar-05	843.761.517,75	786.900.260,82	96,78%	93,26%	1,73%	18,89%	1,74%	19,02%
8-abr-05	842.190.403,70	768.001.629,57	95,99%	91,19%	1,83%	19,85%	2,22%	23,61%
8-may-05	840.614.681,05	751.784.924,91	95,20%	89,43%	1,84%	20,02%	1,93%	20,83%
8-jun-05	839.034.336,28	732.993.980,46	94,43%	87,36%	1,91%	20,68%	2,32%	24,51%
8-jul-05	837.449.355,83	713.527.819,67	93,66%	85,20%	1,98%	21,35%	2,47%	25,94%
8-ago-05	835.859.726,10	695.561.749,15	92,89%	83,22%	2,02%	21,73%	2,33%	24,66%
8-sep-05	834.265.433,46	682.206.195,00	92,13%	81,77%	1,99%	21,45%	1,73%	18,92%
8-oct-05	832.666.464,23	670.301.480,81	91,38%	80,50%	1,95%	21,07%	1,56%	17,16%
8-nov-05	831.062.804,69	654.364.086,82	90,64%	78,74%	1,97%	21,26%	2,19%	23,33%
8-dic-05	829.454.441,08	633.873.172,63	89,90%	76,42%	2,05%	21,98%	2,94%	30,13%
8-ene-06	827.841.359,61	619.627.389,01	89,16%	74,85%	2,05%	21,99%	2,06%	22,07%
8-feb-06	826.223.546,43	601.383.750,24	88,44%	72,79%	2,10%	22,44%	2,75%	28,48%
8-mar-06	824.600.987,66	584.239.740,88	87,72%	70,85%	2,13%	22,77%	2,66%	27,64%
8-abr-06	822.973.669,39	566.483.863,76	87,00%	68,83%	2,17%	23,17%	2,85%	29,29%
8-may-06	821.341.577,65	551.680.941,47	86,29%	67,17%	2,19%	23,30%	2,42%	25,47%
8-jun-06	819.704.698,44	536.851.732,28	85,59%	65,49%	2,20%	23,46%	2,49%	26,14%
8-jul-06	818.063.017,72	518.335.537,79	84,89%	63,36%	2,26%	23,95%	3,26%	32,78%
8-ago-06	816.416.521,41	505.514.356,78	84,20%	61,92%	2,26%	23,96%	2,28%	24,15%
8-sep-06	814.765.195,37	497.832.455,51	83,51%	61,10%	2,21%	23,56%	1,32%	14,74%
8-oct-06	813.109.025,44	489.785.181,54	82,83%	60,24%	2,18%	23,24%	1,42%	15,73%
8-nov-06	811.447.997,41	480.954.788,91	82,15%	59,27%	2,16%	23,01%	1,60%	17,62%
8-dic-06	809.782.097,03	470.277.417,04	81,48%	58,07%	2,15%	22,96%	2,02%	21,71%
8-ene-07	808.111.707,58	460.043.992,15	80,82%	56,93%	2,14%	22,90%	1,97%	21,28%
8-feb-07	806.436.418,33	450.559.931,77	80,16%	55,87%	2,13%	22,80%	1,86%	20,15%
8-mar-07	804.756.214,89	440.907.144,06	79,50%	54,79%	2,13%	22,73%	1,94%	20,93%
8-abr-07	803.071.082,85	431.073.415,47	78,86%	53,68%	2,12%	22,70%	2,03%	21,77%
8-may-07	801.381.007,76	421.968.045,26	78,21%	52,66%	2,12%	22,63%	1,91%	20,62%
8-jun-07	799.685.975,11	412.121.707,46	77,57%	51,54%	2,12%	22,63%	2,13%	22,73%

Fecha	Saldo antes de Pago	Saldo Real	vector de Prepago	Remanencia 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
			0,82%					2,95%
8-jul-07	797.986.907,49	404.454.167,85	76,94%	50,68%	2,10%	22,50%	1,65%	18,11%
8-ago-07	796.282.855,93	396.791.374,83	76,31%	49,83%	2,09%	22,38%	1,68%	18,44%
8-sep-07	794.573.805,82	391.376.030,13	75,69%	49,26%	2,06%	22,11%	1,15%	12,99%
8-oct-07	792.859.742,50	386.989.073,29	75,07%	48,81%	2,03%	21,80%	0,91%	10,36%
8-nov-07	791.140.651,25	381.540.150,55	74,46%	48,23%	2,01%	21,58%	1,19%	13,42%
8-dic-07	789.416.517,34	374.085.117,49	73,85%	47,39%	2,00%	21,51%	1,74%	18,99%
8-ene-08	787.694.525,33	368.864.560,67	73,25%	46,83%	1,98%	21,30%	1,18%	13,28%
8-feb-08	785.967.482,14	365.347.329,01	72,65%	46,48%	1,95%	21,00%	0,74%	8,48%
8-mar-08	784.235.372,95	361.954.516,26	72,06%	46,15%	1,91%	20,70%	0,71%	8,19%
8-abr-08	782.498.182,91	356.988.908,13	71,47%	45,62%	1,90%	20,52%	1,15%	12,99%
8-may-08	780.755.897,12	351.895.556,23	70,89%	45,07%	1,88%	20,36%	1,21%	13,56%
8-jun-08	779.008.500,62	348.169.826,92	70,31%	44,69%	1,86%	20,13%	0,84%	9,59%
8-jul-08	777.259.527,22	347.228.513,39	69,74%	44,67%	1,81%	19,73%	0,05%	0,55%
8-ago-08	775.505.423,51	346.077.498,92	69,17%	44,63%	1,78%	19,36%	0,11%	1,27%
8-sep-08	773.746.174,42	341.634.083,80	68,60%	44,15%	1,76%	19,21%	1,06%	12,00%
8-oct-08	771.981.764,88	338.356.595,89	68,04%	43,83%	1,74%	18,99%	0,73%	8,45%
8-nov-08	770.212.179,73	335.395.338,94	67,49%	43,55%	1,72%	18,77%	0,65%	7,50%
8-dic-08	768.437.403,79	333.970.278,42	66,94%	43,46%	1,69%	18,46%	0,19%	2,31%
8-ene-09	766.659.103,76	331.962.327,38	66,39%	43,30%	1,66%	18,20%	0,37%	4,36%
8-feb-09	764.875.587,37	329.978.849,13	65,85%	43,14%	1,63%	17,95%	0,37%	4,30%
8-mar-09	763.086.839,34	328.476.806,46	65,31%	43,05%	1,61%	17,68%	0,22%	2,63%
8-abr-09	761.292.844,32	326.273.336,82	64,78%	42,86%	1,59%	17,46%	0,44%	5,12%
8-may-09	759.493.586,90	323.503.228,38	64,25%	42,59%	1,57%	17,28%	0,61%	7,13%
8-jun-09	757.689.051,67	321.386.971,51	63,73%	42,42%	1,55%	17,07%	0,42%	4,90%
8-jul-09	755.881.308,93	319.112.570,09	63,21%	42,22%	1,53%	16,87%	0,47%	5,50%
8-ago-09	754.068.263,48	317.841.095,04	62,69%	42,15%	1,50%	16,63%	0,16%	1,89%
8-sep-09	752.249.899,76	314.354.974,81	62,18%	41,79%	1,49%	16,52%	0,86%	9,82%
8-oct-09	750.426.202,17	312.492.643,31	61,67%	41,64%	1,47%	16,32%	0,35%	4,13%
8-nov-09	748.597.155,07	309.793.127,81	61,17%	41,38%	1,46%	16,18%	0,62%	7,21%
8-dic-09	746.762.742,76	307.081.055,36	60,67%	41,12%	1,45%	16,04%	0,63%	7,33%
8-ene-10	744.925.018,92	304.171.922,35	60,18%	40,83%	1,43%	15,92%	0,70%	8,12%
8-feb-10	743.081.904,42	302.891.409,39	59,69%	40,76%	1,41%	15,71%	0,17%	2,07%
8-mar-10	741.233.383,45	300.122.393,54	59,20%	40,49%	1,40%	15,59%	0,67%	7,72%
8-abr-10	739.379.440,15	297.807.053,26	58,72%	40,28%	1,39%	15,45%	0,52%	6,09%
8-may-10	737.520.058,62	295.608.835,47	58,24%	40,08%	1,38%	15,31%	0,49%	5,70%
8-jun-10	735.655.222,91	293.760.620,91	57,76%	39,93%	1,36%	15,16%	0,37%	4,39%
8-jul-10	733.787.447,69	291.341.154,99	57,29%	39,70%	1,35%	15,04%	0,57%	6,64%
8-ago-10	731.914.193,66	289.072.708,07	56,82%	39,50%	1,34%	14,92%	0,52%	6,12%
8-sep-10	730.035.444,76	287.255.851,54	56,36%	39,35%	1,32%	14,78%	0,37%	4,38%
8-oct-10	728.151.184,86	286.099.404,91	55,90%	39,29%	1,31%	14,61%	0,14%	1,72%
8-nov-10	726.261.397,79	284.751.082,83	55,44%	39,21%	1,29%	14,45%	0,21%	2,52%
8-dic-10	724.366.067,35	281.674.551,27	54,99%	38,89%	1,29%	14,38%	0,82%	9,43%
8-ene-11	722.468.266,09	278.838.334,02	54,54%	38,60%	1,28%	14,31%	0,75%	8,60%
8-feb-11	720.564.897,95	277.785.066,79	54,10%	38,55%	1,26%	14,14%	0,11%	1,37%
8-mar-11	718.655.946,59	275.983.701,22	53,66%	38,40%	1,25%	14,02%	0,38%	4,52%
8-abr-11	716.741.395,64	274.448.612,53	53,22%	38,29%	1,24%	13,90%	0,29%	3,43%
8-may-11	714.821.228,68	273.778.936,22	52,78%	38,30%	1,22%	13,73%	-0,02%	-0,29%
8-jun-11	712.895.429,22	271.621.942,31	52,35%	38,10%	1,21%	13,63%	0,52%	6,06%
8-jul-11	710.965.191,30	270.217.689,41	51,93%	38,01%	1,20%	13,51%	0,25%	2,92%
8-ago-11	709.029.291,35	269.318.086,88	51,50%	37,98%	1,19%	13,36%	0,06%	0,73%
8-sep-11	707.087.712,76	268.147.150,38	51,08%	37,92%	1,18%	13,23%	0,16%	1,92%
8-oct-11	705.140.438,88	267.183.876,05	50,67%	37,89%	1,16%	13,09%	0,08%	1,00%

Fecha	Saldo antes de Pago	Saldo Real	vector de Prepago	Remanencia 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
			0,82%					2,95%
8-nov-11	703.187.452,99	265.696.089,52	50,25%	37,78%	1,15%	12,98%	0,28%	3,32%
8-dic-11	701.228.738,34	264.288.500,39	49,84%	37,69%	1,14%	12,87%	0,25%	2,98%
8-ene-12	699.269.967,10	263.261.093,09	49,44%	37,65%	1,13%	12,74%	0,11%	1,31%
8-feb-12	697.305.450,14	261.893.291,79	49,03%	37,56%	1,12%	12,63%	0,24%	2,83%
8-mar-12	695.335.170,59	260.588.400,21	48,63%	37,48%	1,11%	12,53%	0,22%	2,57%
8-abr-12	693.359.111,56	258.867.875,32	48,24%	37,34%	1,10%	12,44%	0,38%	4,43%
8-may-12	691.377.256,08	258.896.709,85	47,84%	37,45%	1,09%	12,28%	-0,30%	-3,63%
8-jun-12	689.389.587,16	257.436.239,31	47,45%	37,34%	1,08%	12,18%	0,28%	3,28%
8-jul-12	687.399.418,55	256.481.587,36	47,07%	37,31%	1,07%	12,07%	0,08%	0,98%
8-ago-12	685.403.412,10	254.970.529,27	46,68%	37,20%	1,06%	11,98%	0,30%	3,54%
8-sep-12	683.401.550,70	254.189.633,03	46,30%	37,19%	1,05%	11,86%	0,01%	0,17%
8-oct-12	681.393.817,18	253.392.724,66	45,92%	37,19%	1,04%	11,75%	0,02%	0,24%
8-nov-12	679.380.194,30	252.365.440,68	45,55%	37,15%	1,03%	11,64%	0,11%	1,31%
8-dic-12	677.360.664,80	251.163.845,27	45,18%	37,08%	1,02%	11,55%	0,18%	2,13%
8-ene-13	675.341.971,78	249.665.572,52	44,81%	36,97%	1,01%	11,47%	0,30%	3,53%
8-feb-13	673.317.357,26	248.481.194,60	44,44%	36,90%	1,00%	11,38%	0,18%	2,08%
8-mar-13	671.286.803,87	247.478.924,29	44,08%	36,87%	0,99%	11,29%	0,10%	1,22%
8-abr-13	669.250.294,19	246.515.375,54	43,72%	36,83%	0,98%	11,19%	0,09%	1,03%
8-may-13	667.207.810,75	245.328.736,88	43,36%	36,77%	0,98%	11,10%	0,18%	2,10%
8-jun-13	665.159.336,02	243.923.229,33	43,01%	36,67%	0,97%	11,03%	0,27%	3,15%
8-jul-13	663.111.616,14	242.816.536,85	42,66%	36,62%	0,96%	10,95%	0,15%	1,74%
8-ago-13	661.057.889,62	241.563.340,00	42,31%	36,54%	0,95%	10,87%	0,21%	2,46%
8-sep-13	658.998.138,83	240.513.483,02	41,97%	36,50%	0,95%	10,78%	0,12%	1,47%
8-oct-13	656.932.346,11	239.510.480,13	41,62%	36,46%	0,94%	10,70%	0,10%	1,24%
8-nov-13	654.860.493,73	238.293.492,12	41,28%	36,39%	0,93%	10,62%	0,19%	2,30%
8-dic-13	652.782.563,92	236.956.654,81	40,95%	36,30%	0,93%	10,56%	0,24%	2,89%
8-ene-14	650.703.792,43	235.767.057,78	40,61%	36,23%	0,92%	10,48%	0,18%	2,19%
8-feb-14	648.618.923,21	234.640.850,19	40,28%	36,18%	0,91%	10,41%	0,16%	1,88%
8-mar-14	646.527.938,38	233.088.807,16	39,95%	36,05%	0,91%	10,35%	0,34%	4,01%
8-abr-14	644.430.819,99	231.810.963,21	39,63%	35,97%	0,90%	10,29%	0,22%	2,66%
8-may-14	642.327.550,05	230.695.545,90	39,30%	35,92%	0,89%	10,22%	0,16%	1,85%
8-jun-14	640.218.110,52	229.708.916,49	38,98%	35,88%	0,89%	10,14%	0,10%	1,19%
8-jul-14	638.109.627,99	228.113.352,62	38,66%	35,75%	0,88%	10,09%	0,37%	4,31%
8-ago-14	635.994.960,57	226.673.132,50	38,35%	35,64%	0,88%	10,04%	0,30%	3,55%
8-sep-14	633.874.090,14	225.192.852,10	38,04%	35,53%	0,87%	9,99%	0,32%	3,78%
8-oct-14	631.746.998,48	223.972.429,77	37,73%	35,45%	0,87%	9,93%	0,21%	2,46%
8-nov-14	629.613.667,35	222.674.737,24	37,42%	35,37%	0,86%	9,87%	0,24%	2,87%
8-dic-14	627.474.078,45	221.379.343,87	37,11%	35,28%	0,86%	9,82%	0,24%	2,87%
8-ene-15	625.339.624,04	219.758.096,05	36,81%	35,14%	0,85%	9,77%	0,39%	4,62%
8-feb-15	623.198.908,55	218.662.726,28	36,51%	35,09%	0,85%	9,71%	0,16%	1,86%
8-mar-15	621.051.913,64	217.271.524,92	36,21%	34,98%	0,84%	9,66%	0,29%	3,46%
8-abr-15	618.898.620,87	216.019.650,16	35,92%	34,90%	0,84%	9,61%	0,23%	2,73%
8-may-15	616.739.011,78	214.967.591,23	35,62%	34,86%	0,83%	9,55%	0,14%	1,65%
8-jun-15	614.573.067,83	213.837.232,73	35,33%	34,79%	0,83%	9,49%	0,18%	2,08%
8-jul-15	612.414.873,02	212.477.020,97	35,05%	34,69%	0,82%	9,45%	0,29%	3,38%
8-ago-15	610.250.347,50	211.117.313,01	34,76%	34,60%	0,82%	9,40%	0,29%	3,40%
8-sep-15	608.079.472,71	209.638.573,56	34,48%	34,48%	0,82%	9,36%	0,35%	4,07%

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
									3.74		6.01		6.01
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
		850.000.000,00											
8-dic-04		848.447.342,89			821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00						
8-ene-05	0	846.889.973,92	0,00	0,00	821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-05	0	845.328.036,68	0,00	0,00	821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-05	1	843.761.517,75	816.562.213,29	33.437.786,71	821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00	33.437.786,71	-12626734982743,80%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-05	0	842.190.403,73	0,00	0,00	787.662.213,29	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-05	0	840.614.681,05	0,00	0,00	787.662.213,29	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-05	1	839.034.336,28	792.275.949,00	24.286.264,29	787.662.213,29	6.000.000,00	22.900.000,00	24.286.264,29	-9092777351166,37%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-05	0	837.449.355,83	0,00	0,00	763.375.949,00	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-05	0	835.859.726,10	0,00	0,00	763.375.949,00	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-05	1	834.265.433,46	768.649.167,93	23.626.781,07	763.375.949,00	6.000.000,00	22.900.000,00	23.626.781,07	-8628500445207,29%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-05	0	832.666.464,23	0,00	0,00	739.749.167,93	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-05	0	831.062.804,69	0,00	0,00	739.749.167,93	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-05	1	829.454.441,08	745.664.765,52	22.984.402,41	739.749.167,93	6.000.000,00	22.900.000,00	22.984.402,41	-8184745696424,73%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-06	0	827.841.359,61	0,00	0,00	716.764.765,52	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-06	0	826.223.546,43	0,00	0,00	716.764.765,52	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-06	1	824.600.987,66	723.306.069,59	22.358.695,93	716.764.765,52	6.000.000,00	22.900.000,00	22.358.695,93	-7760703357836,42%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-06	0	822.973.669,39	0,00	0,00	694.406.069,59	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-06	0	821.341.577,65	0,00	0,00	694.406.069,59	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-06	1	819.704.698,44	701.556.829,56	21.749.240,03	694.406.069,59	6.000.000,00	22.900.000,00	21.749.240,03	-7349068206595,95%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-06	0	818.063.017,72	0,00	0,00	672.656.829,56	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-06	0	816.416.521,41	0,00	0,00	672.656.829,56	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-06	1	814.765.195,37	680.401.205,97	21.155.623,59	672.656.829,56	6.000.000,00	22.900.000,00	21.155.623,59	-6953853474020,04%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-06	0	813.109.025,44	0,00	0,00	651.501.205,97	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-06	0	811.447.997,41	0,00	0,00	651.501.205,97	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-06	1	809.782.097,03	659.823.760,24	20.577.445,73	651.501.205,97	6.000.000,00	22.900.000,00	20.577.445,73	-6576551656345,68%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-07	0	808.111.707,58	0,00	0,00	630.923.760,24	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-07	0	806.436.418,33	0,00	0,00	630.923.760,24	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-07	1	804.755.214,89	639.810.395,69	20.013.364,55	630.923.760,24	6.000.000,00	22.900.000,00	20.013.364,55	-6216151028171,47%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-07	0	803.071.082,85	0,00	0,00	610.910.395,69	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-07	0	801.381.007,76	0,00	0,00	610.910.395,69	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-07	1	799.685.975,11	620.345.456,77	19.464.938,93	610.910.395,69	6.000.000,00	22.900.000,00	19.464.938,93	-5866732592035,87%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-07	0	797.986.907,49	0,00	0,00	591.445.456,77	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-07	0	796.282.855,93	0,00	0,00	591.445.456,77	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-07	1	794.573.805,82	601.416.783,87	18.928.672,89	591.445.456,77	6.000.000,00	22.900.000,00	18.928.672,89	-5530958219025,98%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-07	0	792.859.742,50	0,00	0,00	572.516.783,87	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-07	0	791.140.651,25	0,00	0,00	572.516.783,87	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-07	1	789.416.517,34	583.008.226,21	18.408.557,67	572.516.783,87	6.000.000,00	22.900.000,00	18.408.557,67	-5211462676136,73%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-08	0	787.694.525,33	0,00	0,00	554.108.226,21	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-08	0	785.967.482,14	0,00	0,00	554.108.226,21	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-08	1	784.235.372,95	565.121.817,57	17.886.408,64	554.108.226,21	6.000.000,00	22.900.000,00	17.886.408,64	-4900875967153,53%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-08	0	782.498.182,91	0,00	0,00	536.221.817,57	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-08	0	780.755.897,12	0,00	0,00	536.221.817,57	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-08	1	779.008.500,62	547.728.094,14	17.393.723,43	536.221.817,57	6.000.000,00	22.900.000,00	17.393.723,43	-4605857964573,69%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-08	0	777.259.527,22	0,00	0,00	518.828.094,14	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-08	0	775.505.423,51	0,00	0,00	518.828.094,14	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-08	1	773.746.174,42	530.821.504,95	16.906.589,19	518.828.094,14	6.000.000,00	22.900.000,00	16.906.589,19	-4321324196142,50%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-08	0	771.981.764,88	0,00	0,00	501.921.504,95	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-08	0	770.212.179,73	0,00	0,00	501.921.504,95	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-08	1	768.437.403,79	514.381.882,76	16.439.622,19	501.921.504,95	6.000.000,00	22.900.000,00	16.439.622,19	-4052366870215,45%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-09	0	766.659.103,79	0,00	0,00	485.481.882,76	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-09	0	764.875.587,37	0,00	0,00	485.481.882,76	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-09	1	763.086.839,34	498.400.311,09	15.981.571,66	485.481.882,76	6.000.000,00	22.900.000,00	15.981.571,66	-3795623270040,02%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-09	0	761.292.844,32	0,00	0,00	469.500.311,09	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-09	0	759.493.586,90	0,00	0,00	469.500.311,09	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-09	1	757.689.051,67	482.861.441,60	15.538.869,49	469.500.311,09	6.000.000,00	22.900.000,00	15.538.869,49	-3547523905345,08%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-09	0	755.881.308,93	0,00	0,00	453.961.441,60	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-09	0	754.068.263,48	0,00	0,00	453.961.441,60	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%

										3.74		6.01		6.01	
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	
8-sep-09	1	752.249.899,76	467.757.572,31	15.103.869,29	453.961.441,60	6.000.000,00	22.900.000,00	15.103.869,29	-3309257761543,81	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-oct-09	0	750.426.202,17	0,00	0,00	438.857.572,31	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-nov-09	0	748.597.155,07	0,00	0,00	438.857.572,31	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-dic-09	1	746.762.742,76	453.073.335,86	14.684.236,45	438.857.572,31	6.000.000,00	22.900.000,00	14.684.236,45	-3083689655055,23	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-ene-10	0	744.925.018,92	0,00	0,00	424.173.335,86	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-feb-10	0	743.081.904,42	0,00	0,00	424.173.335,86	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-mar-10	1	741.233.383,45	438.801.401,55	14.271.934,31	424.173.335,86	6.000.000,00	22.900.000,00	14.271.934,31	-2868658795526,19	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-abr-10	0	739.379.440,15	0,00	0,00	409.901.401,55	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-may-10	0	737.520.058,62	0,00	0,00	409.901.401,55	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jun-10	1	735.655.222,91	424.927.199,96	13.874.201,60	409.901.401,55	6.000.000,00	22.900.000,00	13.874.201,60	-2661071865968,17	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jul-10	0	733.787.447,69	0,00	0,00	396.027.199,96	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-ago-10	0	731.914.193,06	0,00	0,00	396.027.199,96	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-sep-10	1	730.035.444,76	411.444.564,14	13.482.635,82	396.027.199,96	6.000.000,00	22.900.000,00	13.482.635,82	-2461929299978,77	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-oct-10	0	728.151.184,86	0,00	0,00	382.544.564,14	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-nov-10	0	726.261.397,79	0,00	0,00	382.544.564,14	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-dic-10	1	724.366.067,35	398.338.839,43	13.105.724,71	382.544.564,14	6.000.000,00	22.900.000,00	13.105.724,71	-2273843237488,35	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-ene-11	0	722.468.266,09	0,00	0,00	369.438.839,43	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-feb-11	0	720.564.897,95	0,00	0,00	369.438.839,43	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-mar-11	1	718.655.946,59	385.605.085,60	12.733.753,83	369.438.839,43	6.000.000,00	22.900.000,00	12.733.753,83	-2094702504778,61	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-abr-11	0	716.741.395,64	0,00	0,00	356.705.085,60	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-may-11	0	714.821.228,68	0,00	0,00	356.705.085,60	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jun-11	1	712.895.429,22	373.228.443,14	12.376.642,46	356.705.085,60	6.000.000,00	22.900.000,00	12.376.642,46	-1922092574215,45	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jul-11	0	710.965.191,30	0,00	0,00	344.328.443,14	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-ago-11	0	709.029.291,35	0,00	0,00	344.328.443,14	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-sep-11	1	707.087.712,76	361.201.351,81	12.027.091,33	344.328.443,14	6.000.000,00	22.900.000,00	12.027.091,33	-1757158043485,79	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-oct-11	0	705.140.439,88	0,00	0,00	332.301.351,81	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-nov-11	0	703.187.452,99	0,00	0,00	332.301.351,81	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-dic-11	1	701.228.738,34	349.512.696,34	11.688.655,47	332.301.351,81	6.000.000,00	22.900.000,00	11.688.655,47	-1601345799645,23	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-ene-12	0	699.269.967,10	0,00	0,00	320.612.696,34	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-feb-12	0	697.305.450,14	0,00	0,00	320.612.696,34	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-mar-12	1	695.335.170,59	338.161.857,59	11.350.838,75	320.612.696,34	6.000.000,00	22.900.000,00	11.350.838,75	-1451772275680,13	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-abr-12	0	693.359.111,56	0,00	0,00	309.261.857,59	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-may-12	0	691.377.256,08	0,00	0,00	309.261.857,59	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jun-12	1	689.380.587,16	327.131.463,16	11.030.394,16	309.261.857,59	6.000.000,00	22.900.000,00	11.030.394,16	-1309307786225,10	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jul-12	0	687.399.418,55	0,00	0,00	298.231.463,43	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-ago-12	0	685.403.412,10	0,00	0,00	298.231.463,43	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-sep-12	1	683.401.550,70	316.417.671,73	10.713.791,70	298.231.463,43	6.000.000,00	22.900.000,00	10.713.791,70	-1173160191331,81	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-oct-12	0	681.393.817,18	0,00	0,00	287.517.671,73	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-nov-12	0	679.380.194,30	0,00	0,00	287.517.671,73	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-dic-12	1	677.360.664,80	306.007.391,75	10.410.279,98	287.517.671,73	6.000.000,00	22.900.000,00	10.410.279,98	-1045192109798,83	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-ene-13	0	675.341.971,78	0,00	0,00	277.107.391,75	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-feb-13	1	673.317.357,26	0,00	0,00	277.107.391,75	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-mar-13	1	671.286.803,87	295.901.541,52	10.105.850,24	277.107.391,75	6.000.000,00	22.900.000,00	10.105.850,24	-923674711660,45	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-abr-13	0	669.250.294,19	0,00	0,00	267.001.541,52	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-may-13	0	667.207.810,75	0,00	0,00	267.001.541,52	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jun-13	1	665.159.336,02	286.082.954,56	9.818.586,96	267.001.541,52	6.000.000,00	22.900.000,00	9.818.586,96	-807087847731,45	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jul-13	0	663.111.616,14	0,00	0,00	257.182.954,56	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-ago-13	0	661.057.889,62	0,00	0,00	257.182.954,56	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-sep-13	1	658.998.138,83	276.552.540,78	9.530.413,78	257.182.954,56	6.000.000,00	22.900.000,00	9.530.413,78	-695720205753,74	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-oct-13	0	656.932.346,11	0,00	0,00	247.652.540,78	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-nov-13	0	654.860.493,73	0,00	0,00	247.652.540,78	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-dic-13	1	652.782.563,92	267.293.983,92	9.258.556,87	247.652.540,78	6.000.000,00	22.900.000,00	9.258.556,87	-591621783722,74	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-ene-14	0	650.703.792,43	0,00	0,00	238.393.983,92	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-feb-14	0	648.618.923,21	0,00	0,00	238.393.983,92	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-mar-14	1	646.527.938,38	258.306.365,44	8.987.618,48	238.393.983,92	6.000.000,00	22.900.000,00	8.987.618,48	-493420254392,24	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-abr-14	0	644.430.819,99	0,00	0,00	229.406.365,44	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-may-14	0	642.327.550,05	0,00	0,00	229.406.365,44	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jun-14	1	640.218.110,52	249.576.069,42	8.730.296,03	229.406.365,44	6.000.000,00	22.900.000,00	8.730.296,03	-398974528358,74	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jul-14	0	638.109.627,99	0,00	0,00	220.676.069,42	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-ago-14	0	635.994.960,57	0,00	0,00	220.676.069,42	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-sep-14	1	633.874.090,14	241.104.412,79	8.471.656,62	220.676.069,42	6.000.000,00	22.900.000,00	8.471.656,62	-309215466739,85	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-oct-14	0	631.746.998,48	0,00	0,00	212.204.412,79	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-nov-14	0	629.613.667,35	0,00	0,00	212.204.412,79	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-dic-14	1	627.474.078,45	232.876.208,61	8.228.204,19	212.204.412,79	6.000.000,00	22.900.000,00	8.228.							

									3.74		6.01		6.01
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
8-sep-17	1	554.278.130,68	156.984.214,74	5.906.503,32	133.990.718,07	6.000.000,00	22.900.000,00	5.906.503,32	431765392962,87%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-17	0	551.966.993,18	0,00	0,00	128.084.214,74	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-17	0	549.649.076,35	0,00	0,00	128.084.214,74	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-17	1	547.324.360,30	151.251.675,05	5.732.539,70	128.084.214,74	6.000.000,00	22.900.000,00	5.732.539,70	471214762986,58%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-18	0	545.002.656,18	0,00	0,00	122.351.675,05	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-18	0	542.674.141,74	0,00	0,00	122.351.675,05	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-18	1	540.338.796,98	145.696.372,81	5.555.302,24	122.351.675,05	6.000.000,00	22.900.000,00	5.555.302,24	506643564348,77%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-18	0	537.996.601,88	0,00	0,00	116.796.372,81	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-18	0	535.647.536,34	0,00	0,00	116.796.372,81	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-18	1	533.291.580,21	140.305.433,15	5.390.939,66	116.796.372,81	6.000.000,00	22.900.000,00	5.390.939,66	541250341775,70%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-18	0	530.937.947,54	0,00	0,00	111.405.433,15	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-18	0	528.577.410,87	0,00	0,00	111.405.433,15	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-18	1	526.209.949,96	135.081.536,28	5.223.896,87	111.405.433,15	6.000.000,00	22.900.000,00	5.223.896,87	572539096747,40%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-18	0	523.835.544,50	0,00	0,00	106.181.536,28	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-18	0	521.454.174,11	0,00	0,00	106.181.536,28	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-18	1	519.065.818,38	130.012.928,14	5.068.608,14	106.181.536,28	6.000.000,00	22.900.000,00	5.068.608,14	601643786237,34%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-19	0	516.677.835,93	0,00	0,00	101.112.928,14	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-19	0	514.282.848,73	0,00	0,00	101.112.928,14	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-19	1	511.880.836,23	125.100.819,10	4.912.109,04	101.112.928,14	6.000.000,00	22.900.000,00	4.912.109,04	627276324187,58%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-19	0	509.471.777,84	0,00	0,00	96.200.819,10	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-19	0	507.055.652,87	0,00	0,00	96.200.819,10	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-19	1	504.632.440,80	120.335.459,87	4.765.359,23	96.200.819,10	6.000.000,00	22.900.000,00	4.765.359,23	652377878952,33%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-19	0	502.221.183,66	0,00	0,00	91.435.459,87	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-19	0	499.802.853,70	0,00	0,00	91.435.459,87	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-19	1	497.377.429,98	115.726.202,85	4.609.257,02	91.435.459,87	6.000.000,00	22.900.000,00	4.609.257,02	673412450458,57%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-19	0	494.944.891,68	0,00	0,00	86.826.202,85	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-19	0	492.505.217,93	0,00	0,00	86.826.202,85	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-19	1	490.058.387,81	111.255.279,74	4.470.923,11	86.826.202,85	6.000.000,00	22.900.000,00	4.470.923,11	693887267055,57%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-20	0	487.648.819,99	0,00	0,00	82.355.279,74	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-20	0	485.232.184,09	0,00	0,00	82.355.279,74	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-20	1	482.808.459,40	106.948.536,87	4.306.742,87	82.355.279,74	6.000.000,00	22.900.000,00	4.306.742,87	707597853267,34%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-20	0	480.377.625,12	0,00	0,00	78.048.536,87	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-20	0	477.939.660,39	0,00	0,00	78.048.536,87	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-20	1	475.494.544,30	102.771.498,38	4.177.038,49	78.048.536,87	6.000.000,00	22.900.000,00	4.177.038,49	724716177522,14%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-20	0	473.072.712,19	0,00	0,00	73.871.498,38	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-20	0	470.643.776,03	0,00	0,00	73.871.498,38	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-20	1	468.207.715,00	98.739.946,86	4.031.551,46	73.871.498,38	6.000.000,00	22.900.000,00	4.031.551,46	736564457088,05%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-20	0	465.764.508,19	0,00	0,00	69.839.946,89	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-20	0	463.314.134,64	0,00	0,00	69.839.946,89	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-20	1	460.856.573,33	94.830.334,74	3.909.612,16	69.839.946,89	6.000.000,00	22.900.000,00	3.909.612,16	749863611435,56%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-21	0	458.394.156,08	0,00	0,00	65.930.334,74	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-21	0	455.924.515,75	0,00	0,00	65.930.334,74	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-21	1	453.447.631,13	91.040.746,09	3.789.588,64	65.930.334,74	6.000.000,00	22.900.000,00	3.789.588,64	760949399413,28%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-21	0	450.963.480,99	0,00	0,00	62.140.746,09	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-21	0	448.472.044,01	0,00	0,00	62.140.746,09	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-21	1	445.973.298,81	87.366.452,54	3.674.293,55	62.140.746,09	6.000.000,00	22.900.000,00	3.674.293,55	771601646446,77%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-21	0	443.470.820,37	0,00	0,00	58.466.452,54	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-21	0	440.961.001,33	0,00	0,00	58.466.452,54	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-21	1	438.443.820,15	83.806.358,60	3.560.093,94	58.466.452,54	6.000.000,00	22.900.000,00	58.466.452,54	12815846396446,90%	6.000.000,00	13.152.000.000,00	22.900.000,00	501968000000,00%