

F.T.A UCI 16

SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.
AVENIDA GRAN VÍA DE HORTALEZA, 3
28033 MADRID
santanderdetitulizacion@gruposantander.com

DENOMINACIÓN DEL FONDO:	F.T.A UCI 16		
INFORMACIÓN CORRESPONDIENTE AL:	TRIMESTRE/SEMESTRE:	17/09/2018 - 17/12/2018	AÑO: 2018
Personas que asumen la responsabilidad de esta información y cargos que ocupan:		Firma:	
INAKI REYERO ARREGUI - DIRECTOR GENERAL			

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	18 octubre 2006	Agencia de pago de Bonos	BANCO SANTANDER	
Fecha de Desembolso BT's	23 octubre 2006	Negociación Mercado	AIAF	
Fecha Final Amortización	16 junio 2049	Agencias de calificación	FITCH RATINGS	
			STANDARD & POORS	
Sociedad Gestora	SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.	Calificación	Inicial	Actual
	UNIÓN DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, S.A.	B.T.A'S SERIE A1	---	---
		B.T.A'S SERIE A2	AAA/AAA	BBB / BBB
		B.T.A'S SERIE B	A/A-	B / B
		B.T.A'S SERIE C	BBB/BBB	CC / CCC
		B.T.A'S SERIE D	BB+/BB	CC / CCC -
		B.T.A'S SERIE E	CCC/CCC-	CC / D

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 A1 ES0338186002	4.300	Nominal Unitario	100.000,00	0,00	
		Nominal Total	430.000.000,00	0,00	0,00 %
B.T.A'S SERIE A2 ES0338186010	12.476	Nominal Unitario	100.000,00	41.180,59	
		Nominal Total	1.247.600.000,00	513.769.040,84	41,18%
B.T.A'S SERIE B ES0338186028	720	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	72.000.000,00	72.000.000,00	100,00 %
B.T.A'S SERIE C ES0338186036	414	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	41.400.000,00	41.400.000,00	100,00 %
B.T.A'S SERIE D ES0338186044	90	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	9.000.000,00	9.000.000,00	100,00 %
B.T.A'S SERIE E ES0338186051	198	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	19.800.000,00	19.800.000,00	100,00 %

AMORTIZACION E INTERESES BONOS					
Actual			Próximo		
Fecha Amortización Período Actual			Fecha Próximo Cupón		
17 de diciembre de 2018			18 de marzo de 2019		
	Amortización de los Bonos	Intereses Brutos Bonos	Tipo de Interés	Importe Bruto Próximo Cupón	Importe Neto Próximo Cupón
B.T.A'S SERIE A1	---	---	---	---	---
B.T.A'S SERIE A2	1.307,12 €	0,00 €	0,000%	0,00 €	0,00 €
B.T.A'S SERIE B	0,00 €	0,00 €	0,000%	0,00 €	0,00 €
B.T.A'S SERIE C	0,00 €	58,39 €	0,239%	60,41 €	48,94 €
B.T.A'S SERIE D	0,00 €	488,11 €	1,939%	490,14 €	397,01 €
B.T.A'S SERIE E	0,00 €	0,00 €	1,989%	502,78 €	407,25 €
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	16.195	9.419
Saldo Pendiente de Amortizar Derechos	1.800.000,051,25 €	725.865.978,30 €
Importes Unitarios Derechos Vivos	111.145,42 €	77.064,02 €
Tipos de Interés	4,24 %	2,26%

TASAS DE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA	SITUACIÓN ACTUAL
Tasa mensual actual anualizada:	2,47%
Tasa últimos 12 meses anualizada:	4,27%
Tasa anualizada desde Constitución del Fondo	5,91%

MOROSIDAD ACTUAL	Hasta 1 mes	De 1 a 6 meses	Mayor de 6 meses
Deuda Vencida(Principal+Intereses)	52.083,37 €	202.859,73 €	11.737.474,74 €
Deuda Pendiente de vencimiento	0,00 €	0,00 €	720.499.040,06 €
Deuda Total	52.083,37 €	202.859,73 €	732.236.514,80 €

F.T.A UCI 16

INFORME TRIMESTRAL BONOS DE TITULIZACIÓN

17 de diciembre de 2018

BONOS TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. PRINCIPAL	
Saldo anterior	672.276.669,96 €
Amortizaciones	16.307.629,12 €
Saldo actual	655.969.040,84 €
% sobre saldo inicial	36,05%
Amortización devengada no pagada	0,00 €

BONOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. INTERESES	
Intereses pagados Serie A1	0,00 €
Intereses pagados Serie A2	0,00 €
Intereses pagados Serie B	0,00 €
Intereses pagados Serie C	24.173,46 €
Intereses pagados Serie D	43.929,90 €
Intereses pagados Serie E	0,00 €
Intereses devengados no pagados	7.081.727,40 €

DATOS	
Fecha de determinación	10/12/2018
Fecha de Pago de Cupón Actual	17/12/2018
Fecha de Pago de Cupón Anterior	17/09/2018
Número de días	91
Tipo de referencia (%)	-0,311%
Próxima Fecha de Pago	18/03/2019

VIDA RESIDUAL (AÑOS)		
	INICIAL	17-dic-18
B.T.A'S SERIE A1	0,70	0,00
B.T.A'S SERIE A2	4,71	5,54
B.T.A'S SERIE B	6,29	11,25
B.T.A'S SERIE C	6,29	11,25
B.T.A'S SERIE D	6,29	11,25
B.T.A'S SERIE E	6,53	11,25

F.T.A UCI 16

INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

17 de diciembre de 2018

DERECHOS DE CRÉDITO. PRINCIPAL	
Saldo anterior	741.362.815,76€
Amortizaciones	15.496.837,46€
Saldo actual	725.865.978,30€
Número de derechos de crédito	9.419
LTV	51,40%

DERECHOS DE CRÉDITO. INTERESES	
Intereses cobrados en el trimestre	2.717.333,89€
Intereses devengados en el trimestre	2.616.769,67€

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	35.747,38 €	47.179,43 €	23.517,55 €	51.109,71 €	5.209.384,17 €
Intereses	16.335,99 €	30.553,83 €	17.293,66 €	33.205,55 €	6.528.090,57 €
Saldo de los derechos de crédito	15.167.806,47 €	11.004.230,11 €	3.423.717,88 €	4.969.319,84 €	23.335.751,70 €
Número de derechos de crédito	157	104	33	52	334
% sobre saldo de los derechos de crédito	2,09%	1,52%	0,47%	0,68%	3,21%

PRÉSTAMOS EN WRITE OFF	
Write Off acumulado Fecha Pago anterior	90.836.112,39€
Write Off trimestre	-1.139.159,91€
Write Off acumulados actuales	89.696.952,48€

F.T.A UCI 16

INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

17 de diciembre de 2018

ADJUDICADOS	
Saldo anterior	38.092.940,70 €
Diferencia	-1.260.698,58 €
Saldo actual	36.832.242,12 €
Número de adjudicados	705

PERDIDAS DE LA CARTERA	
Saldo anterior	115.894.413,73 €
Diferencia	2.656.822,45 €
Saldo actual	118.551.236,18 €

F.T.A UCI 16

ESTADO DE ORIGEN Y APLICACIÓN DE FONDOS Y CUENTA DE TESORERÍA

17 de diciembre de 2018

ORIGEN	17.120.112,51 €
PRINCIPAL COBRADO	
Amortización derechos de crédito	11.195.559,05 €
INTERESES COBRADOS	
Intereses de derechos de crédito	2.717.333,89 €
Intereses de reinversión	-2.987,68 €
INGRESOS/GASTOS DE ADJUDICADOS	2.885.195,18 €
INGRESOS/GASTOS DE IMPORTES ASEGURADOS	325.440,00 €
OTROS	-427,93 €

ESTADO CUENTA DE TESORERÍA	700.671,95 €
FONDO DE RESERVA	
Saldo anterior	0,00 €
Diferencia	687.734,09 €
Saldo actual	687.734,09 €
RETENCIÓN A CUENTA DEL IRPF	12.937,86 €

APLICACIÓN	17.120.112,51 €
GASTOS ORDINARIOS	23.124,20 €
COMISIÓN S.G.F.T.	33.521,74 €
INTERESES B.T.A'S SERIE A1	0,00 €
INTERESES B.T.A'S SERIE A2	0,00 €
INTERESES B.T.A'S SERIE B	0,00 €
INTERESES B.T.A'S SERIE C	24.173,46 €
INTERESES B.T.A'S SERIE D	43.929,90 €
FONDOS DISPONIBLES AMORTIZACIÓN A2	16.307.629,12 €
INTERESES B.T.A'S SERIE E	0,00 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO SANTANDER	0,00 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB	0,00 €
AMORTIZACION PRÉSTAMO SUBORDINADO SANTANDER	0,00 €
AMORTIZACION PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB	0,00 €
COMISIÓN FIJA	0,00 €
COMISIÓN VARIABLE	0,00 €
DOTACIÓN FONDO DE RESERVA	687.734,09 €
REMANENTE	0,00 €

F.T.A UCI 16**MEJORA CREDITICIA Y PRÉSTAMO SUBORDINADO****17 de diciembre de 2018**

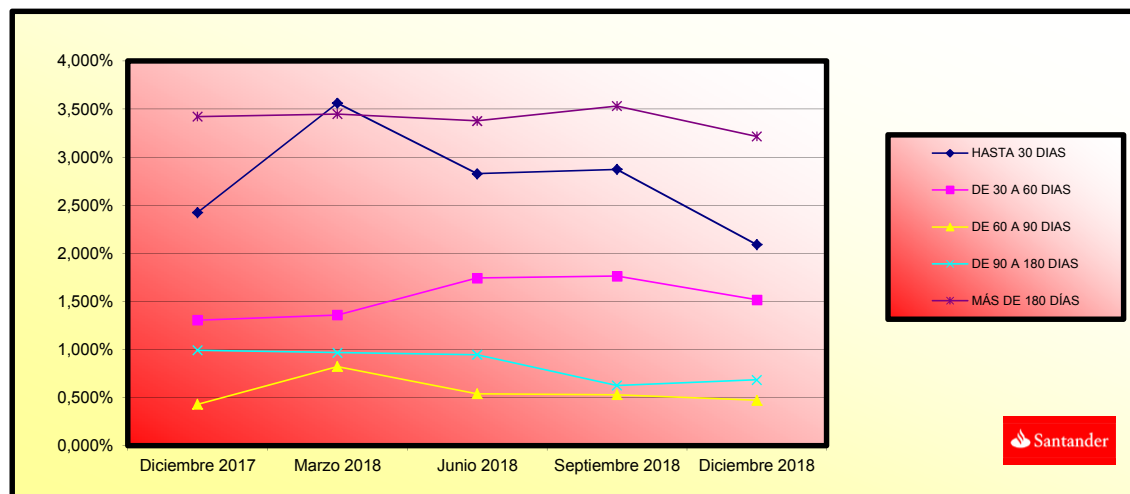
MEJORA DE CRÉDITO		
CONCEPTOS	INICIAL	17 de diciembre de 2018
EMISIÓN SUBORDINADA	122.400.000,00 € (6,80%)	122.400.000,00 € (16,86%)
FONDO DE RESERVA	19.800.000,00 € (1,10 %)	687.734,09 € 0,09%

PRÉSTAMOS SUBORDINADOS		
CONCEPTOS	INICIAL	17 de diciembre de 2018
PRÉSTAMO SUBORDINADO SCH		
Saldo vivo	950.000,00 €	325.091,26 €
Tipo de interés	5,900 %	1,989%
PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB		
Saldo vivo	950.000,00 €	325.091,26 €
Tipo de interés	5,900 %	1,989%

**FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS
UCI 16**

**INFORME DE MOROSIDAD
17 DE DICIEMBRE DE 2018**

MOROSIDAD HISTÓRICA					
	Diciembre 2017	Marzo 2018	Junio 2018	Septiembre 2018	Diciembre 2018
HASTA 30 DIAS	2,424%	3,560%	2,828%	2,873%	2,090%
DE 30 A 60 DIAS	1,305%	1,359%	1,743%	1,762%	1,516%
DE 60 A 90 DIAS	0,430%	0,822%	0,539%	0,530%	0,472%
DE 90 A 180 DIAS	0,993%	0,967%	0,945%	0,625%	0,685%
MÁS DE 180 DIAS	3,423%	3,449%	3,377%	3,531%	3,215%



**FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS
UCI 16**

**INFORMACIÓN RELATIVA A LOS TRIGGERS DEL FONDO
17 DE DICIEMBRE DE 2018**

TRIGGERS BONOS		
1. SI 1.a) ES MAYOR QUE 1.b) NO SE AMORTIZA LA SERIE B, C y D:		
1.a) MOROSIDAD SUPERIOR A 90 DÍAS		118.002.024,02 €
1.b) 2% SALDO VIVO DERECHOS DE CREDITO		14.517.319,57 €
NO SE AMORTIZAN LAS SERIES B, C y D.		

TRIGGERS FONDO DE RESERVA		
1. SI 1.a) ES INFERIOR QUE 1.b) NO SE AMORTIZA EL FONDO DE RESERVA:		
1.a) SALDO VIVO DE LOS ACTIVOS		725.865.978,30 €
1.b) 10% SALDO INICIAL DE LOS ACTIVOS		180.000.005,13 €
2. SI 2.a) ES INFERIOR QUE 2.b) NO SE AMORTIZA EL FONDO DE RESERVA:		
2.a) TIPO DE INTERÉS MEDIO PONDERADO DE LOS ACTIVOS		2,26%
2.b) TIPO DE INTERÉS MEDIO PONDERADO DE LOS BONOS + 0,40%		0,36%
3. SI EXISTE DÉFICIT DE AMORTIZACIÓN, NO SE AMORTIZA EL FONDO DE RESERVA		NO

NO SE HAN ALCANZADO LOS TRIGGERS.

NIVELES DEL FONDOS DE RESERVA SEGÚN LA MOROSIDAD		
MOROSIDAD ACTUAL < 0,75%	MAYOR DE	
	2,2% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO	NA
	0,40% DEL SALDO INICIAL BONOS	
MOROSIDAD ACTUAL ENTRE 0,75% Y 1,25%	MAYOR DE	
	2,2% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO	NA
	0,70% DEL SALDO INICIAL BONOS	
MOROSIDAD ACTUAL > 1,25%	MAYOR DE	
	2,2% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO	19.800.000,00 €
	0,80% DEL SALDO INICIAL BONOS	

MOROSIDAD SUPERIOR A 90 DÍAS SUPERA EL LÍMITE DEL 1,25%, POR TANTO, EL FONDO DE RESERVA NO PUEDE DISMINUIR

**FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS
UCI 16**

**INFORMACIÓN RELATIVA A LOS TRIGGERS DEL FONDO
17 DE DICIEMBRE DE 2018**

POSTERGAMIENTO DE INTERESES DE LOS BONOS	
SI 1.a) ES MAYOR QUE 1.b)+1.c) LOS INTERESES DE LA SERIE B SE POSTERGARÁN:	
1.a) SALDO DE LA SERIE A1 y A2	530.076.669,96 €
1.b) SALDO VIVO DC's - MORA >18 MESES	627.337.837,82 €
1.c) REMANENTE FONDOS DISPONIBLES	17.063.466,57 €
SI 2.a) ES MAYOR QUE 2.b)+2.c) LOS INTERESES DE LA SERIE C SE POSTERGARÁN:	
2.a) SALDOS DE LAS SERIES A1, A2 y B	602.076.669,96 €
2.b) SALDO VIVO DC's - MORA >18 MESES	627.337.837,82 €
2.c) REMANENTE FONDOS DISPONIBLES	17.039.293,11 €
SI 3.a) ES MAYOR QUE 3.b)+3.c) LOS INTERESES DE LA SERIE D SE POSTERGARÁN:	
3.a) SALDOS DE LAS SERIES A1, A2, B y C	643.476.669,96 €
3.b) SALDO VIVO DC's - MORA >18 MESES	627.337.837,82 €
3.c) REMANENTE FONDOS DISPONIBLES	16.995.363,21 €

**NO SE POSTERGARÁN LOS INTERESES DE LA SERIE B.
AUNQUE EL TRIGGER SE ALCANZA, LOS INTERESES DE LA SERIE DE BONOS C y D NO SE POSTERGARÁN DEBIDO A QUE EL FONDO TIENE LIQUIDEZ REMANENTE
PROVENIENTE DEL COBRO DE INTERESES.**

REMANENTE INTERESES	Importe
Saldo actual	2.589.596,91 €

SI 1.a) ES MAYOR QUE 9,60% SALDO INICIAL DC's, SE POSTERGARÁN LOS INTERESES DE LAS SERIES B, C ó D, EN SU CASO	NO
1.a) SALDO ACUMULADO DE PRÉSTAMOS FALLIDOS ES LA SUMA DE i) + ii)	99.692.747,73 €
i). SALDO DC's MOROSIDAD > 18 MESES	98.528.140,48 €
ii). SALDO DC's JUDICIALES CON MOROSIDAD < 18 MESES	1.164.607,25 €
PORCENTAJE ACTUAL	5,54%

CONTRATO	CONTRAPARTE	AGENCIA RATING	RATING MÍNIMO EXIGIDO	RATING ACTUAL
CUENTA TESORERÍA	BANCO SANTANDER	S&P FITCH	A-1 c/p F-1 c/p	A-1 c/p F-1 c/p*
AGENTE DE PAGOS	BANCO SANTANDER	S&P FITCH	A-1 c/p F-1 c/p	A-1 c/p F-1 c/p*

(*) Rating Deposit

LA CUENTA DE TESORERÍA SE HA TRANSFERIDO A BANCO SANTANDER ESPAÑA, POR TENER EL RATING MÍNIMO EXIGIDO.

ESTADÍSTICO DE VALORES DE TASACIÓN SOBRE SALDOS VIVOS				
INTERVALO	SALDO	% SALDOS VIVOS	Nº PRÉSTAMOS	% Nº PRÉSTAMOS
0,00 - 39,99	121.146.103,81 €	17,56%	1.935	29,46%
40,00 - 49,99	93.900.537,35 €	13,61%	805	12,26%
50,00 - 59,99	120.988.073,86 €	17,54%	997	15,18%
60,00 - 69,99	187.742.781,63 €	27,21%	1.592	24,24%
70,00 - 79,99	122.578.278,18 €	17,77%	943	14,36%
80,00 - 99,84	43.521.324,35 €	6,31%	296	4,51%
	689.877.099,18 €	100,00%	6.568	100,00%

F.T.A UCI 16

DEFINICIONES

17 de diciembre de 2018

FECHA DE DETERMINACIÓN Será la fecha en que la Sociedad Gestora, en nombre del Fondo, realizará los 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).

SALDO ACUMULADO DE FALLIDOS Será el saldo de los préstamos que se encuentren con cuotas pendientes con antigüedad superior a 18 meses, o que hayan empezado el proceso de ejecución de garantías (si dicho proceso acaeciera con anterioridad a los 18 meses desde el primer impago), descontadas las cantidades recuperadas.

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

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	CPR	Monthly single monthly mortality	CPR
			0,51%					4,27%
	1.800.000.000,00		100,00%	100,00%				
01-11-06	1.797.536.963,07	1.777.699.259,42	99,49%	98,90%	1,10%	12,47%	1,10%	12,47%
01-12-06	1.795.065.685,52	1.757.039.469,70	98,99%	97,88%	1,06%	12,06%	1,03%	11,64%
01-01-07	1.792.585.676,60	1.732.965.597,00	98,49%	96,67%	1,12%	12,65%	1,23%	13,84%
01-02-07	1.790.096.905,48	1.714.233.119,07	97,99%	95,76%	1,08%	12,18%	0,94%	10,75%
01-03-07	1.787.599.341,18	1.693.175.506,25	97,49%	94,72%	1,08%	12,21%	1,09%	12,33%
01-04-07	1.785.092.952,65	1.669.557.506,70	97,00%	93,53%	1,11%	12,53%	1,26%	14,08%
01-05-07	1.782.577.708,70	1.644.647.424,39	96,51%	92,26%	1,14%	12,90%	1,35%	15,08%
01-06-07	1.780.053.578,06	1.619.770.876,00	96,02%	91,00%	1,17%	13,20%	1,37%	15,29%
01-07-07	1.777.520.529,31	1.597.030.852,52	95,53%	89,85%	1,18%	13,30%	1,26%	14,15%
01-08-07	1.774.978.530,95	1.573.264.177,93	95,05%	88,64%	1,20%	13,48%	1,35%	15,02%
01-09-07	1.772.427.551,37	1.557.247.781,41	94,57%	87,86%	1,17%	13,17%	0,88%	10,02%
01-10-07	1.769.867.558,82	1.542.130.741,40	94,09%	87,13%	1,14%	12,87%	0,83%	9,49%
01-11-07	1.767.298.521,48	1.526.259.522,92	93,61%	86,36%	1,12%	12,66%	0,89%	10,12%
01-12-07	1.764.720.407,36	1.513.748.046,10	93,14%	85,78%	1,09%	12,32%	0,67%	7,80%
01-01-08	1.762.133.184,42	1.500.412.336,34	92,66%	85,15%	1,07%	12,07%	0,74%	8,48%
01-02-08	1.759.536.820,47	1.490.635.006,66	92,20%	84,72%	1,03%	11,70%	0,51%	5,89%
01-03-08	1.756.931.283,21	1.479.372.093,27	91,73%	84,20%	1,01%	11,43%	0,61%	7,06%
01-04-08	1.754.316.540,22	1.467.484.114,61	91,26%	83,65%	0,99%	11,22%	0,66%	7,59%
01-05-08	1.751.692.558,99	1.457.076.346,68	90,80%	83,18%	0,96%	10,98%	0,56%	6,52%
01-06-08	1.749.059.306,88	1.444.195.638,00	90,34%	82,57%	0,95%	10,86%	0,73%	8,47%
01-07-08	1.746.416.751,13	1.437.175.797,87	89,88%	82,29%	0,92%	10,54%	0,34%	3,95%
01-08-08	1.743.764.858,86	1.428.177.167,06	89,43%	81,90%	0,90%	10,32%	0,48%	5,55%
01-09-08	1.741.103.597,09	1.422.246.882,23	88,98%	81,69%	0,88%	10,02%	0,26%	3,11%
01-10-08	1.738.432.932,73	1.416.945.713,59	88,52%	81,51%	0,85%	9,72%	0,22%	2,60%
01-11-08	1.735.752.832,53	1.409.587.568,59	88,08%	81,21%	0,83%	9,51%	0,37%	4,30%
01-12-08	1.733.063.263,18	1.398.661.902,48	87,63%	80,70%	0,82%	9,42%	0,62%	7,20%
01-01-09	1.730.364.191,21	1.390.828.713,27	87,19%	80,38%	0,81%	9,25%	0,40%	4,75%
01-02-09	1.727.655.583,05	1.384.826.013,16	86,74%	80,16%	0,79%	9,04%	0,28%	3,26%
01-03-09	1.724.937.405,01	1.379.419.487,16	86,30%	79,97%	0,77%	8,83%	0,23%	2,77%
01-04-09	1.722.209.623,27	1.369.775.747,92	85,87%	79,54%	0,76%	8,75%	0,54%	6,31%
01-05-09	1.719.472.203,90	1.362.063.427,51	85,43%	79,21%	0,75%	8,63%	0,40%	4,75%
01-06-09	1.716.725.112,86	1.352.710.697,56	85,00%	78,80%	0,74%	8,55%	0,53%	6,15%
01-07-09	1.713.969.126,04	1.339.913.528,64	84,57%	78,18%	0,74%	8,56%	0,79%	9,04%
01-08-09	1.711.203.401,95	1.327.695.598,99	84,14%	77,59%	0,74%	8,57%	0,75%	8,66%
01-09-09	1.708.427.906,17	1.320.161.213,28	83,71%	77,27%	0,73%	8,46%	0,41%	4,76%
01-10-09	1.705.642.604,19	1.308.815.507,86	83,29%	76,73%	0,73%	8,45%	0,70%	8,06%
01-11-09	1.702.847.461,35	1.300.273.065,81	82,87%	76,36%	0,73%	8,38%	0,49%	5,72%
01-12-09	1.700.042.442,89	1.289.324.377,33	82,45%	75,84%	0,73%	8,36%	0,68%	7,84%
01-01-10	1.697.227.513,92	1.278.664.026,17	82,03%	75,34%	0,72%	8,34%	0,66%	7,66%
01-02-10	1.694.402.639,41	1.271.395.856,83	81,62%	75,04%	0,72%	8,26%	0,40%	4,73%
01-03-10	1.691.567.784,24	1.264.686.031,25	81,20%	74,76%	0,71%	8,16%	0,36%	4,25%
01-04-10	1.688.722.913,14	1.248.843.961,75	80,79%	73,95%	0,72%	8,26%	1,09%	12,28%
01-05-10	1.685.867.990,71	1.236.380.323,19	80,38%	73,34%	0,72%	8,29%	0,83%	9,52%
01-06-10	1.683.002.981,46	1.228.541.388,81	79,97%	73,00%	0,71%	8,23%	0,46%	5,44%
01-07-10	1.680.127.849,73	1.209.189.765,06	79,57%	71,97%	0,73%	8,40%	1,41%	15,63%
01-08-10	1.677.242.559,77	1.202.832.512,28	79,17%	71,71%	0,72%	8,31%	0,35%	4,17%
01-09-10	1.674.347.075,68	1.187.058.995,86	78,76%	70,90%	0,73%	8,41%	1,14%	12,86%
01-10-10	1.671.441.361,45	1.175.020.793,62	78,37%	70,30%	0,73%	8,43%	0,84%	9,65%
01-11-10	1.668.525.380,94	1.165.504.933,13	77,97%	69,85%	0,73%	8,41%	0,64%	7,38%
01-12-10	1.665.599.097,87	1.153.257.462,21	77,57%	69,24%	0,73%	8,44%	0,88%	10,03%
01-01-11	1.662.662.475,83	1.143.706.008,51	77,18%	68,79%	0,73%	8,43%	0,65%	7,56%
01-02-11	1.659.715.478,31	1.136.550.672,31	76,79%	68,48%	0,73%	8,37%	0,45%	5,26%
01-03-11	1.656.758.068,65	1.123.157.897,90	76,40%	67,79%	0,73%	8,42%	1,00%	11,38%
01-04-11	1.653.790.210,05	1.115.169.307,36	76,01%	67,43%	0,73%	8,38%	0,53%	6,21%
01-05-11	1.650.811.865,60	1.117.682.492,96	75,63%	67,11%	0,71%	8,16%	-0,41%	-4,98%
01-06-11	1.647.822.998,25	1.098.625.671,00	75,25%	66,67%	0,72%	8,32%	1,53%	16,86%
01-07-11	1.644.823.570,82	1.092.863.228,82	74,86%	66,44%	0,71%	8,25%	0,34%	4,04%
01-08-11	1.641.813.546,00	1.087.711.635,38	74,48%	66,25%	0,71%	8,17%	0,29%	3,41%
01-09-11	1.638.792.886,35	1.080.141.995,53	74,11%	65,91%	0,70%	8,13%	0,51%	5,98%
01-10-11	1.635.761.554,30	1.077.632.058,10	73,73%	65,88%	0,69%	8,01%	0,05%	0,57%
01-11-11	1.632.719.512,14	1.070.123.160,18	73,36%	65,54%	0,69%	7,97%	0,51%	5,97%
01-12-11	1.629.666.722,03	1.061.577.410,97	72,99%	65,14%	0,69%	7,96%	0,61%	7,11%
01-01-12	1.626.603.145,98	1.056.652.464,50	72,62%	64,96%	0,68%	7,89%	0,28%	3,27%
01-02-12	1.623.528.745,91	1.049.323.460,76	72,25%	64,63%	0,68%	7,86%	0,51%	5,90%
01-03-12	1.620.443.483,56	1.041.843.583,13	71,88%	64,29%	0,68%	7,83%	0,52%	6,11%
01-04-12	1.617.347.320,55	1.040.836.102,90	71,52%	64,35%	0,67%	7,70%	-0,09%	-1,14%
01-05-12	1.614.240.218,38	1.034.132.758,93	71,16%	64,06%	0,66%	7,67%	0,50%	5,30%
01-06-12	1.611.122.138,39	1.027.232.201,08	70,80%	63,76%	0,66%	7,64%	0,48%	5,55%
01-07-12	1.607.993.041,79	1.024.163.852,71	70,44%	63,69%	0,65%	7,55%	0,10%	1,25%
01-08-12	1.604.852.889,67	1.014.506.366,22	70,08%	63,21%	0,65%	7,56%	0,75%	8,63%
01-09-12	1.601.701.642,96	1.012.132.494,64	69,73%	63,19%	0,64%	7,46%	0,45%	0,45%
01-10-12	1.598.539.262,46	1.007.343.000,13	69,37%	63,02%	0,64%	7,41%	0,28%	3,27%
01-11-12	1.595.365.708,84	1.000.784.251,93	69,02%	62,73%	0,64%	7,38%	0,45%	5,31%
01-12-12	1.592.180.942,62	997.376.460,22	68,67%	62,64%	0,63%	7,30%	0,14%	1,68%
01-01-13	1.588.989.928,60	991.793.463,56	68,32%	62,42%	0,63%	7,26%	0,36%	4,24%
01-02-13	1.585.787.640,29	988.065.886,94	67,98%	62,31%	0,62%	7,20%	0,17%	2,08%
01-03-13	1.582.574.037,86	984.452.936,68	67,63%	62,21%	0,61%	7,13%	0,16%	1,94%
01-04-13	1.579.349.081,33	979.413.543,88	67,29%	62,01%	0,61%	7,09%	0,31%	3,64%
01-05-13	1.576.112.730,59	972.937.209,19	66,95%	61,73%	0,61%	7,07%	0,46%	5,35%
01-06-13	1.572.864.945,37	970.178.180,52	66,61%	61,68%	0,60%	6,99%	0,08%	0,93%
01-07-13	1.569.619.119,57	964.586.862,10	66,27%	61,45%	0,60%	6,96%	0,37%	4,36%
01-08-13	1.566.361.825,83	959.934.619,17	65,94%	61,28%	0,60%	6,91%	0,28%	3,25%
01-09-13	1.563.093.023,62	956.865.212,62	65,60%	61,22%	0,59%	6,85%	0,11%	1,33%
01-10-13	1.559.812.672,28	950.578.693,78	65,27%	60,94%	0,59%	6,83%	0,45%	5,25%
01-11-13	1.556.520.731,01	943.779.413,05	64,94%	60,63%	0,59%	6,82%	0,51%	5,90%
01-12-13	1.553.217.158,86	939.297.945,30	64,61%	60,47%	0,58%	6,78%	0,26%	3,11%
01-01-14	1.549.901.914,74	932.390.084,82	64,28%	60,16%	0,58%	6,77%	0,52%	6,10%
01-02-14	1.546.574.957,41	925.862.058,74	63,96%	59,87%	0,58%	6,76%	0,49%	5,68%
01-03-14	1.543.236.245,48	919.570.899,07	63,63%	59,59%	0,58%	6,74%	0,46%	5,44%
01-04-14	1.539.885.737,42	910.936.400,50	63,31%	59,16%	0,58%	6,76%	0,72%	8,34%
01-05-14	1.536.523.391,56	904.163.710,22	62,99%	58,84%	0,58%	6,75%	0,53%	6,14%
01-06-14	1.533.149.166,07	899.420.137,32	62,67%	58,66%	0,58%	6,72%	0,31%	3,61%
01-07-14	1.529.767.320,56	890.092.174,91	62,35%	58,18%	0,58%	6,75%	0,82%	9,39%
01-08-14	1.526.373.526,52	883.939.028,12	62,04%	57,91%	0,58%	6,74%	0,47%	5,50%
01-09-14	1.522.967.741,74	878.304.871,33	61,72%	57,67%	0,58%	6,72%	0,42%	4,87%
01-10-14	1.519.549.923,86	871.793.421,25	61,41%	57,37%	0,58%	6,71%	0,52%	6,04%
01-11-14	1.516.120.030,35	866.214.886,64	61,10%	57,13%	0,58%	6,69%	0,42%	4,87%

01-12-14	1.512.678.018,57	862.231.349,40	60,79%	57,00%	0,57%	6,65%	0,23%	2,76%
01-01-15	1.509.225.107,78	854.950.231,91	60,48%	56,65%	0,57%	6,66%	0,62%	7,16%
01-02-15	1.505.759.997,38	850.236.061,70	60,18%	56,47%	0,57%	6,63%	0,32%	3,80%
01-03-15	1.502.282.644,28	845.890.396,47	59,87%	56,31%	0,57%	6,60%	0,28%	3,32%
01-04-15	1.498.793.005,21	840.300.191,42	59,57%	56,07%	0,57%	6,58%	0,43%	5,03%
01-05-15	1.495.291.036,77	835.864.102,65	59,27%	55,90%	0,56%	6,55%	0,29%	3,48%
01-06-15	1.491.776.695,39	831.663.560,25	58,97%	55,75%	0,56%	6,52%	0,27%	3,17%
01-07-15	1.488.253.014,95	824.722.224,33	58,67%	55,42%	0,56%	6,52%	0,60%	6,97%
01-08-15	1.484.716.884,85	819.336.830,57	58,37%	55,18%	0,56%	6,51%	0,42%	4,88%
01-09-15	1.481.168.261,13	814.017.462,24	58,07%	54,96%	0,56%	6,49%	0,41%	4,82%
01-10-15	1.477.607.099,62	809.422.168,69	57,78%	54,78%	0,56%	6,47%	0,32%	3,83%
01-11-15	1.474.033.356,05	805.147.258,33	57,49%	54,62%	0,55%	6,44%	0,29%	3,39%
01-12-15	1.470.446.985,95	799.975.426,97	57,20%	54,40%	0,55%	6,43%	0,40%	4,70%
01-01-16	1.466.857.616,88	794.987.504,50	56,91%	54,20%	0,55%	6,41%	0,38%	4,47%
01-02-16	1.463.255.566,07	789.286.978,37	56,62%	53,94%	0,55%	6,40%	0,47%	5,53%
01-03-16	1.459.640.788,72	784.146.465,20	56,33%	53,72%	0,55%	6,39%	0,41%	4,76%
01-04-16	1.456.013.239,87	777.989.021,12	56,05%	53,43%	0,55%	6,38%	0,54%	6,27%
01-05-16	1.452.372.874,39	771.935.839,49	55,76%	53,15%	0,55%	6,38%	0,53%	6,17%
01-06-16	1.448.719.647,00	767.340.361,65	55,48%	52,97%	0,55%	6,36%	0,34%	4,06%
01-07-16	1.445.111.439,81	761.375.647,66	55,20%	52,69%	0,55%	6,36%	0,53%	6,17%
01-08-16	1.441.490.484,32	757.251.879,37	54,92%	52,53%	0,54%	6,34%	0,29%	3,45%
01-09-16	1.437.856.735,50	753.733.209,99	54,64%	52,42%	0,54%	6,31%	0,21%	2,53%
01-10-16	1.434.210.148,15	748.889.945,52	54,36%	52,22%	0,54%	6,29%	0,39%	4,58%
01-11-16	1.430.550.676,91	744.160.293,90	54,09%	52,02%	0,54%	6,28%	0,38%	4,44%
01-12-16	1.426.878.276,25	740.056.485,67	53,81%	51,87%	0,54%	6,25%	0,30%	3,49%
01-01-17	1.423.200.587,27	735.323.017,52	53,54%	51,67%	0,54%	6,24%	0,38%	4,50%
01-02-17	1.419.509.904,50	730.281.059,63	53,27%	51,45%	0,53%	6,23%	0,43%	5,01%
01-03-17	1.415.806.182,05	725.593.324,60	53,00%	51,25%	0,53%	6,22%	0,38%	4,49%
01-04-17	1.412.089.373,83	725.513.017,88	52,73%	51,38%	0,53%	6,15%	-0,25%	-3,07%
01-05-17	1.408.359.433,63	716.308.257,57	52,47%	50,86%	0,53%	6,19%	1,01%	11,44%
01-06-17	1.404.616.315,03	711.898.221,76	52,20%	50,68%	0,53%	6,17%	0,35%	4,13%
01-07-17	1.400.868.619,93	708.016.371,92	51,94%	50,54%	0,53%	6,15%	0,28%	3,30%
01-08-17	1.397.107.683,71	702.743.375,67	51,67%	50,30%	0,53%	6,15%	0,48%	5,58%
01-09-17	1.393.333.459,58	698.186.836,93	51,41%	50,11%	0,53%	6,13%	0,38%	4,46%
01-10-17	1.389.545.900,60	694.860.827,31	51,15%	50,01%	0,52%	6,11%	0,21%	2,43%
01-11-17	1.385.744.959,66	690.689.192,70	50,89%	49,84%	0,52%	6,09%	0,33%	3,86%
01-12-17	1.381.930.589,48	687.837.035,15	50,63%	49,77%	0,52%	6,06%	0,14%	1,64%
01-01-18	1.378.115.907,51	683.273.297,22	50,38%	49,58%	0,52%	6,05%	0,39%	4,56%
01-02-18	1.374.287.747,76	679.912.268,59	50,12%	49,47%	0,52%	6,02%	0,21%	2,55%
01-03-18	1.370.446.062,58	677.108.413,23	49,87%	49,41%	0,51%	5,99%	0,13%	1,59%
01-04-18	1.366.590.804,21	671.923.095,47	49,61%	49,17%	0,51%	5,99%	0,49%	5,68%
01-05-18	1.362.721.924,69	667.013.668,96	49,36%	48,95%	0,51%	5,98%	0,45%	5,25%
01-06-18	1.358.839.375,88	663.409.724,06	49,11%	48,82%	0,51%	5,96%	0,26%	3,03%
01-07-18	1.354.965.111,33	658.087.274,85	48,86%	48,57%	0,51%	5,96%	0,52%	6,05%
01-08-18	1.351.077.158,47	653.151.314,02	48,62%	48,34%	0,51%	5,96%	0,46%	5,43%
01-09-18	1.347.175.468,95	650.526.703,37	48,37%	48,29%	0,51%	5,93%	0,11%	1,35%
01-10-18	1.343.259.994,22	644.850.299,30	48,13%	48,01%	0,51%	5,93%	0,58%	6,78%
01-11-18	1.339.330.685,58	639.376.979,17	47,88%	47,74%	0,51%	5,94%	0,56%	6,49%
01-12-18	1.335.387.494,16	636.169.025,82	47,64%	47,64%	0,51%	5,91%	0,21%	2,47%

Fecha	Principal Disponible	Amortización de Principal	Serie A1	Serie A2	Serie B	Serie C	Serie D	Serie E	Suma de todas las clases	% Serie B	% Serie C	% Serie D	Amortización Serie A1	Vida Media Serie A2	Amortización Serie B	Vida Media Serie C	Amortización Serie C	Vida Media Serie D	Amortización Serie D	Vida Media Serie E	Amortización Serie E	Vida Media Serie E		
Date	Principal available	Principal Redemption	Class A1	Class A2	Class B	Class C	Class D	Class E	Sum of all classes	% Class B	% Class C	% Class D	Redemption Class A1	Average Life Class A1	Redemption Class A2	Average Life Class A2	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C	Redemption Class D	Average Life Class D	Redemption Class E	Average Life Class E
	1.819.800.000	1.799.999.984,38												0,00	5,34		11,35		11,35		11,29		11,29	
24-10-00	1.800.000.000,00	0,00	430.000.000,00	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.800.000.000,00	4,000000%	2,300000%	0,500000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
01-11-00	1.788.430.681,91	0,00	430.000.000,00	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.800.000.000,00	4,000000%	2,300000%	0,500000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
01-12-00	1.776.924.236,86	0,00	430.000.000,00	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.800.000.000,00	4,000000%	2,300000%	0,500000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
01-01-01	1.765.479.864,80	0,00	430.000.000,00	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.800.000.000,00	4,000000%	2,300000%	0,500000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
02-02-01	1.754.097.263,34	0,00	430.000.000,00	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.800.000.000,00	4,000000%	2,300000%	0,500000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
03-03-01	1.742.716.107,69	57.223.892,31	430.000.000,00	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.800.000.000,00	4,000000%	2,300000%	0,500000%	57.223.892,31	-245.862.169.696	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00
04-04-01	1.731.516.086,71	0,00	430.000.000,00	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.800.000.000,00	4,000000%	2,300000%	0,500000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
05-05-01	1.720.316.886,87	0,00	430.000.000,00	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.800.000.000,00	4,000000%	2,300000%	0,500000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
06-06-01	1.709.115.152,24	33.597.586,45	430.000.000,00	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.800.000.000,00	4,000000%	2,300000%	0,500000%	33.597.586,45	-141.145.010.825	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00
07-07-01	1.698.009.624,51	0,00	339.178.152,24	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.709.115.152,24	4,21251%	2,422217%	0,526969%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
08-08-01	1.687.080.972,92	0,00	339.178.152,24	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.709.115.152,24	4,21251%	2,422217%	0,526969%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
09-09-01	1.676.121.886,35	33.597.586,45	339.178.152,24	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.709.115.152,24	4,21251%	2,422217%	0,526969%	33.597.586,45	-135.828.188.363	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00
10-10-01	1.665.222.063,20	0,00	306.121.886,35	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.676.121.886,35	4,225630%	2,469967%	0,539564%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
11-11-01	1.654.361.191,47	0,00	306.121.886,35	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.676.121.886,35	4,225630%	2,469967%	0,539564%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
12-12-01	1.643.598.963,72	32.522.919,63	306.121.886,35	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.676.121.886,35	4,225630%	2,469967%	0,539564%	32.522.919,63	-130.677.091.073	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00
01-01-02	1.632.875.062,04	0,00	273.598.968,72	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.643.598.963,72	4,380831%	2,518933%	0,547579%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
02-02-02	1.622.206.260,08	0,00	273.598.968,72	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.643.598.963,72	4,380831%	2,518933%	0,547579%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
03-03-02	1.611.601.173,02	31.997.795,70	273.598.968,72	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.643.598.963,72	4,380831%	2,518933%	0,547579%	31.997.795,70	-125.655.343.705	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00
04-04-02	1.601.050.532,57	0,00	241.601.173,02	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.611.601.173,02	4,467607%	2,568874%	0,558451%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
05-05-02	1.590.557.041.97	0,00	241.601.173,02	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.611.601.173,02	4,467607%	2,568874%	0,558451%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
06-06-02	1.580.120.405,94	0,00	241.601.173,02	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.611.601.173,02	4,467607%	2,568874%	0,558451%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
07-07-02	1.569.740.330,75	0,00	210.120.405,94	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.580.120.405,94	4,556615%	2,620053%	0,569577%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
08-08-02	1.559.416.524,12	0,00	210.120.405,94	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.580.120.405,94	4,556615%	2,620053%	0,569577%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
09-09-02	1.548.146.695,30	30.971.710,64	210.120.405,94	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.580.120.405,94	4,556615%	2,620053%	0,569577%	30.971.710,64	-115.927.112.924	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00
10-10-02	1.538.958.590,59	0,00	179.148.695,30	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.548.146.695,30	4,647714%	2,672436%	0,580964%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
11-11-02	1.528.776.815,41	0,00	179.148.695,30	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.548.146.695,30	4,647714%	2,672436%	0,580964%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
12-12-02	1.518.678.190,18	0,00	148.678.190,18	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.518.678.190,18	4,740695%	2,726055%	0,592621%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
01-01-03	1.508.631.384.43	0,00	148.678.190,18	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.518.678.190,18	4,740695%	2,726055%	0,592621%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
02-02-03	1.498.633.144,73	0,00	148.678.190,18	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.518.678.190,18	4,740695%	2,726055%	0,592621%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
03-03-03	1.488.701.159,09	29.977.031,09	148.678.190,18	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.518.678.190,18	4,740695%	2,726055%	0,592621%	29.977.031,09	-106.778.184.756	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00
04-04-03	1.478.817.155,95	0,00	148.678.190,18	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.518.678.190,18	4,740695%	2,726055%	0,592621%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
05-05-03	1.469.986.859,21	0,00	118.701.159,09	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.488.701.159,09	4,836431%	2,780484%	0,604545%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
06-06-03	1.459.209.845,15	29.491.417,00	118.701.159,09	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.488.701.159,09	4,836431%	2,780484%	0,604545%	29.491.417,00	-102.334.363.171	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00
07-07-03	1.449.486.952,57	0,00	89.209.988,15	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.459.209.845,15	4,934177%	2,837152%	0,616772%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,000000%	0,00	0,00	0,000000%	0,00	0,00	0,00	
08-08-03	1.439.816.788,00	0,00	89.209.988,15	1.247.600.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.459.209.845,15	4,934177%	2,8													

PRECIS	Principal disponible	Principal	DÉTER A1	DÉTER A2	DÉTER B	DÉTER L	DÉTER U	DÉTER E	classes	% DÉTER B	% DÉTER L	% DÉTER U	A1	A2	A2	Serie B	B	Serie C	C	Serie D	D	Serie E	VOIR MÉTHODE DÉTER E			
Date	Principal available	Principal Redemption	Class A1	Class A2	Class B	Class C	Class D	Class E	Sum of all classes	% Class B	% Class C	% Class D	Redemption Class A1	Average Life Class A1	Redemption Class A2	Average Life Class A2	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C	Redemption Class D	Average Life Class D	Redemption Class E	Average Life Class E		
09-10-27	1	239 492 016,82	0,00	0,00	119 686 526,37	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	242 086 526,37	29,741383%	17,101295%	3,717873%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-11-27	1	239 915 586,17	0,00	0,00	119 686 526,37	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	242 086 526,37	29,741383%	17,101295%	3,717873%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-12-27	1	234 349 738,77	7,737 172,58	0,00	119 686 526,37	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	242 086 526,37	29,741383%	17,101295%	3,717873%	0,00	0	7 737 172,58	0	25 432 086,274	0,00	0	0,00	0	0,00			
09-01-28	1	231 902 689,71	0,00	0,00	111 949 753,79	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	234 349 753,79	30,723309%	17,665903%	3,840414%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-02-28	1	229 272 646,08	0,00	0,00	111 949 753,79	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	234 349 753,79	30,723309%	17,665903%	3,840414%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-03-28	1	226 756 528,60	7,593 210,17	0,00	111 949 753,79	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	234 349 753,79	30,723309%	17,665903%	3,840414%	0,00	0	7 593 210,17	0	25 649 863,944	0,00	0	0,00	0	0,00			
09-04-28	1	224 256 258,39	0,00	0,00	104 356 543,62	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	226 756 543,62	31,752116%	18,257467%	3,969014%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-05-28	1	221 768 756,97	0,00	0,00	104 356 543,62	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	226 756 543,62	31,752116%	18,257467%	3,969014%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-06-28	1	219 296 946,27	7,459 582,33	0,00	104 356 543,62	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	226 756 543,62	31,752116%	18,257467%	3,969014%	0,00	0	7 459 582,33	0	25 884 750,700	0,00	0	0,00	0	0,00			
09-07-28	1	216 843 628,91	0,00	0,00	96 896 961,29	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	219 296 961,29	32,832192%	18,878511%	4,104024%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-08-28	1	214 404 821,65	0,00	0,00	96 896 961,29	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	219 296 961,29	32,832192%	18,878511%	4,104024%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-09-28	1	211 980 447,77	7,316 498,50	0,00	96 896 961,29	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	219 296 961,29	32,832192%	18,878511%	4,104024%	0,00	0	7 316 498,50	0	26 061 367,657	0,00	0	0,00	0	0,00			
09-10-28	1	209 570 430,91	0,00	0,00	89 580 462,79	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	211 980 462,79	33,965394%	19,530102%	4,245674%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-11-28	1	207 174 695,13	0,00	0,00	89 580 462,79	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	211 980 462,79	33,965394%	19,530102%	4,245674%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-12-28	1	204 793 164,87	7,187 282,90	0,00	89 580 462,79	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	211 980 462,79	33,965394%	19,530102%	4,245674%	0,00	0	7 187 282,90	0	26 255 144,436	0,00	0	0,00	0	0,00			
09-01-29	1	202 426 617,41	0,00	0,00	82 393 179,89	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	204 793 179,89	35,157421%	20,215517%	4,394678%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-02-29	1	200 076 106,63	0,00	0,00	82 393 179,89	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	204 793 179,89	35,157421%	20,215517%	4,394678%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-03-29	1	197 741 559,24	7,051 606,63	0,00	82 393 179,89	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	204 793 179,89	35,157421%	20,215517%	4,394678%	0,00	0	7 051 606,63	0	26 394 163 596	0,00	0	0,00	0	0,00			
09-04-29	1	195 418 898,31	0,00	0,00	75 341 573,26	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	197 741 573,26	36,411606%	20,936417%	4,551395%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-05-29	1	193 110 053,30	0,00	0,00	75 341 573,26	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	197 741 573,26	36,411606%	20,936417%	4,551395%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-06-29	1	190 814 950,05	6,926 608,19	0,00	75 341 573,26	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	197 741 573,26	36,411606%	20,936417%	4,551395%	0,00	0	6 926 608,19	0	26 563 542 410	0,00	0	0,00	0	0,00			
09-07-29	1	188 539 527,86	0,00	0,00	68 414 965,07	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	190 814 965,07	37,732890%	21,696411%	4,716611%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-08-29	1	186 277 662,45	0,00	0,00	68 414 965,07	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	190 814 965,07	37,732890%	21,696411%	4,716611%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-09-29	1	184 029 281,99	6,785 668,06	0,00	68 414 965,07	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	190 814 965,07	37,732890%	21,696411%	4,716611%	0,00	0	6 785 668,06	0	26 847 318 483	0,00	0	0,00	0	0,00			
09-10-29	1	181 794 316,02	0,00	0,00	61 629 297,01	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	184 029 297,01	39,124205%	22,496418%	4,890528%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-11-29	1	179 572 890,47	0,00	0,00	61 629 297,01	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	184 029 297,01	39,124205%	22,496418%	4,890528%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-12-29	1	177 364 337,59	6,664 944,40	0,00	61 629 297,01	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	184 029 297,01	39,124205%	22,496418%	4,890528%	0,00	0	6 664 944 40	0	26 779 746 581	0,00	0	0,00	0	0,00			
09-01-30	1	175 171 446,75	0,00	0,00	54 964 352,61	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	177 364 352,61	40,594403%	23,341762%	5,074300%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-02-30	1	172 991 672,28	0,00	0,00	54 964 352,61	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	177 364 352,61	40,594403%	23,341762%	5,074300%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00		
09-03-30	1	170 824 944,60	177 364 337,59	0,00	54 964 352,61	72 000 000,00	41 400 000,00	9 000 000,00	19 800 000,00	177 364 352,61	40,594403%	23,341762%	5,074300%	0,00	0	54 964 352,61	0	225 793 560 528	72,000 000,00	295 776 000 000	41 400 000,00	170 071 200 000	9 000 000,00	36 972 000 000	19 800 000,00	81 338 400 000