

F.T.A. UCI 11

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

NAME OF THE FUND: **F.T.A. UCI 11**

INFORMATION AT: **QUARTER/SEMESTER:** December 16th, 2013 - March 17th, 2014 **YEAR:** 2014

Acting on behalf of Santander de Titulización S.G.F.T., S.A. as General Manager: **Signature:**
IGNACIO ORTEGA GAVARA - GENERAL MANAGER

I. DATA OF THE FUND

Constitution Date	November 16th, 2004	Paying Agent	BANCO SANTANDER	
Disbursement Date	November 22nd, 2004	Negotiation Market	AIAF	
Final Date of Redemption	September 15th, 2041	Ratings Agencies	STANDARD & POORS	
Management Company	SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.	Rating	Initial	Current
	UNIÓN DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, S.	CLASS A	AAA	AA -
		CLASS B	A	BBB
		CLASS C	BBB	BB

II. SECURITIES ISSUED CHARGED TO THE FUND: SECURITISATION BONDS

CLASS PRIORITY ISIN CODE	NUM BONDS	NOMINAL			
			Initial	Current	%Act/In
CLASS A ES0338340005	8.211	Nominal per Bond	100.000,00	24.867,71	
		Total Nominal	821.100.000,00	204.188.766,81	24,87%
CLASS B ES0338340013	60	Nominal per Bond	100.000,00	100.000,00	
		Total Nominal	6.000.000,00	6.000.000,00	100,00 %
CLASS C ES0338340021	229	Nominal per Bond	100.000,00	100.000,00	
		Total Nominal	22.900.000,00	22.900.000,00	100,00 %

REDEMPTION AND INTEREST OF THE BONDS					
Current			Next		
Payment Date of the Current Period March 17th, 2014			Next Payment Date June 16th, 2014		
	Redemption of the Bonds	Gross Interest	Interest Rate	Gross Interest Next Coupon	Net Interest Next Coupon
CLASS A	471,06 €	26,71 €	0,444%	27,91 €	22,05 €
CLASS B	0,00 €	153,44 €	0,634%	160,26 €	126,61 €
CLASS C	0,00 €	259,60 €	1,054%	266,43 €	210,48 €
Accrued amortisation due not payed	0,00 €				
Scheduled Amortisation	NO				

III. ASSET PURCHASED BY THE FUND: CREDIT RIGHTS

CREDIT RIGHTS	ISSUE DATE	CURRENT DATE
Numbre of CR's	11.356	3.988
CR's Outstanding to be amortised	850.000.156,93 €	236.530.392,59 €
CR's Outstanding per Loan to be amortised	74.850,30 €	59.310,53 €
Interest Rate	4,23 %	2,62%

PREPAYMENT RATE	CURRENT SITUATION
Monthly Single Rate	4,01%
Average Monthly Single Rate	2,20%
Constant Prepayment Rate from Constitution	10,35%

F.T.A. UCI 11**QUARTERLY BONDS PAYOUT REPORT****March 17th, 2014**

BONDS. PRINCIPAL	
Previous Balance	236.956.640,47 €
Principal Amortised	3.867.873,66 €
Outstanding Balance	233.088.766,81 €
% of Initial Balance	27,42%
Principal accrued and unpaid	0,00 €

INTEREST PAID	
CLASS A	219.315,81 €
CLASS B	9.206,40 €
CLASS C	59.448,40 €
Interest accrued and unpaid	0,00 €

DATA	
Determination Date	March 10th, 2014
Payment Date	March 17th, 2014
Last Payment Date	December 16th, 2013
Number of Days (Act/360)	91
Reference Interest Rate (%)	0,304%
Next Payment Date	June 16th, 2014

RESIDUAL LIFE (YEARS)		
	INITIAL	March 17th, 2014
CLASS A	4,75	3,93
CLASS B	7,93	6,76
CLASS C	7,91	6,76

F.T.A. UCI 11

QUARTERLY COLLATERAL REPORT

March 17th, 2014

PRINCIPAL	
Previous Balance	240.266.175,38 €
Principal Amortised	3.735.782,79 €
Outstanding Balance	236.530.392,59 €
Number of Credit Rights	3.988
LTV	52,58%

INTEREST	
Interest received during relevant period	1.484.127,49 €
Interest accrued during relevant period	1.692.899,59 €

PRINCIPAL BALANCE IN ARREARS					
	UP to 30 DAYS	30 to 60 DAYS	60 to 90 DAYS	90 to 180 DAYS	MORE THAN 180 DAYS
Principal Balance in Arrears	15.827,81 €	12.432,06 €	20.137,49 €	15.670,82 €	353.078,01 €
Interest accrued on Credit Rights in Arrears	8.489,77 €	10.173,80 €	12.938,10 €	10.883,74 €	384.545,84 €
Outstanding Balance	6.648.885,82 €	2.487.709,46 €	2.195.601,15 €	1.157.046,24 €	5.526.932,17 €
Number of Credit Rights	92	38	36	27	53
% of Outstanding Balance	2,81%	1,05%	0,93%	0,49%	2,34%

WRITE OFF	
Cumulative WRITE OFF as of previous balance	3.309.520,57 €
Difference in Actual Period	132.064,86 €
Cumulative WRITE OFF up to date	3.441.585,43 €

F.T.A. UCI 11

QUARTERLY COLLATERAL REPORT

March 17th, 2014

TRANSITORY PROPERTIES	
Last balance	1.520.031,87 €
Difference in Actual Period	418.027,08 €
Current balance	1.938.058,95 €
Number of transitory properties	45

NET LOSSES	
Last balance	1.067.914,93 €
Difference in Actual Period	123.283,24 €
Current balance	1.191.198,17 €

F.T.A. UCI 11

QUARTERLY REPORT - ALLOCATION OF CASH

March 17th, 2014

TOTAL CASH RECEIVED END OF PERIOD	4.452.569,81 €
CASH RECEIVED - PRINCIPAL	
Amortisation of Credit Rights	2.920.515,40 €
CASH RECEIVED - INTEREST	
Interest received from Credit Rights	1.484.127,49 €
Interest received under GIC	117,32 €
INCOMES/EXPENSES OF TRANSTORY PROPERTIES	2.963,86 €
INCOMES/EXPENSES OF INSURED PROPERTIES	52.600,00 €
OTHERS	-7.754,26 €

TREASURY ACCOUNT STATEMENT	12.810.481,99 €
PRINCIPAL RESERVE FUND	
Previous Balance	12.750.000,00 €
Period utilization	0,00 €
Outstanding Balance	12.750.000,00 €
WITHHOLDING TAXES	60.481,99 €

TOTAL CASH PAID END OF PERIOD	4.452.569,81 €
ORDINARY EXPENSES	15.580,77 €
MANAGEMENT FEE	15.359,98 €
SWAP PAYMENT	0,00 €
SWAP COLLECTION	0,00 €
INTEREST ON CLASS A BONDS	219.315,81 €
INTEREST ON CLASS B BONDS	9.206,40 €
INTEREST ON CLASS C BONDS	59.448,40 €
REDEMPTION ON CLASS A BONDS	3.867.873,66 €
INTEREST ON SUBORDINATED LOAN SANTANDER	14.133,35 €
INTEREST ON SUBORDINATED LOAN UCB	14.133,35 €
FIXED FEE	6.000,00 €
VARIABLE FEE	231.518,09 €

F.T.A. UCI 11

CREDIT ENHANCEMENT AND SUBORDINATED LOAN

March 17th, 2014

CREDIT ENHANCEMENT		
CONCEPTS	INITIAL	March 17th, 2014
SUBORDINATED ISSUE	28.900.000,00 € (3,40%)	28.900.000,00 € (12,22%)
PRINCIPAL RESERVE FUND	12.750.000,00 € (1,50 %)	12.750.000,00 € (5,39%)

SUBORDINATED LOANS		
CONCEPTS	INITIAL	March 17th, 2014
SUBORDINATED LOAN SCH		
Total Outstanding Subordinated Loan	6.812.500,00 €	6.375.386,18 €
Interest Rate	2,790 %	0,904%
SUBORDINATED LOAN UCB		
Total Outstanding Subordinated Loan	6.812.500,00 €	6.375.386,18 €
Interest Rate	2,790 %	0,904%

F.T.A. UCI 11

DEFINITIONS

March 17th, 2014

DETERMINATION DATE Means the date in which the Gestora will carry out the necessary calculations, on behalf of the Fund, for the distribution of the available funds at this date, according with the Order of Priority of Payments.
All the information regarding the Assets (Outstanding Balance of the Credit Rights, arrears' tables, transitory properties, stratification tables, etc.) are referred to this mentioned date.

WRITE OFF Those loans that at a given date are unpaid for a period equal or higher to 12 or 18 months (according to Prospectus) of arrears in due payments.

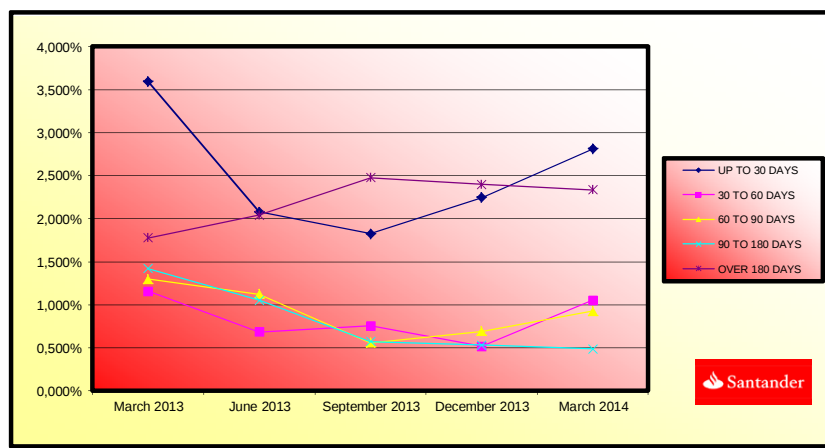
NET LOSSES Those loans which the Originator considers that will not recover (net of recoveries).

TRANSITORY PROPERTIES Those assets in the balance of the Fund as a consequence of a judicial or non-judicial process.

**FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS
UCI 11**

Report date: March 17th, 2014

ARREARS PERFORMANCE					
	March 2013	June 2013	September 2013	December 2013	March 2014
UP TO 30 DAYS	3,591%	2,077%	1,825%	2,246%	2,811%
30 TO 60 DAYS	1,160%	0,685%	0,756%	0,519%	1,052%
60 TO 90 DAYS	1,300%	1,125%	0,559%	0,692%	0,928%
90 TO 180 DAYS	1,421%	1,052%	0,573%	0,535%	0,489%
OVER 180 DAYS	1,779%	2,045%	2,478%	2,401%	2,337%



**FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
UCI 11**

TRIGGERS

Report date: March 17th, 2014

CLASS B AND CLASS C REDEMPTION	
IF 1) IS HIGHER THAN 2) CLASS B AND CLASS C ARE NOT REDEEMED	
1) CREDIT RIGHTS IN ARREARS OVER 90 DAYS	10.125.563,84 €
2) 2% CREDIT RIGHTS OUTSTANDING BALANCE	4.730.607,85 €

CURRENT ARREARS > 90 DAYS PERCENTAGE
4,28%

CLASSES B & C CANNOT BE REDEEMED

RESERVE FUNDS TRIGGERS:	
IF 1) IS HIGHER THAN 2) RESERVE FUNDS WILL NOT BE REDEEMED	
1) CREDIT RIGHTS IN ARREARS OVER 90 DAYS	10.125.563,84 €
2) 1,25% CREDIT RIGHTS OUTSTANDING BALANCE	2.956.629,91 €

RESERVE FUND IS NOT REDEEMED

INTEREST DEFERRAL FOR CLASS B AND C	
IF 1) IS HIGHER THAN 2)+3) CLASS B INTERESTS ARE DEFERRED TO POSITION 7º	
1) CLASS A OUTSTANDING BALANCE	208.056.640,47 €
2) CR OUTSTANDING BALANCE (EXCLUDING ARREARS > 18 MONTHS)	231.826.278,71 €
3) REMAINING FUNDS AFTER PAYMENTS POINTS 1º TO 4º	16.943.106,85 €
IF 1) IS HIGHER THAN 2)+3) CLASS C INTERESTS ARE DEFERRED TO POSITION 8º	
1) CLASS A AND CLASS B OUTSTANDING BALANCE	214.056.640,47 €
2) CR OUTSTANDING BALANCE (EXCLUDING ARREARS > 18 MONTHS)	231.826.278,71 €
3) REMAINING FUNDS AFTER PAYMENTS POINTS 1º TO 5º	16.883.658,45 €

CLASS B INTEREST ARE NOT DEFERRED

CLASS C INTEREST ARE NOT DEFERRED

AGREEMENT	COUNTERPARTY	RATING AGENCY	MINIMUM RATING REQUIRED	CURRENT RATING
TREASURY ACCOUNT	BANCO SANTANDER	S&P	A-1 s/t	A-2 s/t

COUNTERPARTY DOES NOT HAVE THE MINIMUM RATING REQUIRED. TREASURY ACCOUNT HAS BEEN TRANSFERRED TO A COUNTERPARTY WITH MINIMUM RATING REQUIRED.

LTV				
INTERVAL	OUTSTANDING	% OUTSTANDING	NUM.OF LOANS	% NUM.OF LOANS
0,25 - 39,99	35.162.966,23 €	15,51%	677	21,97%
40,00 - 49,99	30.358.988,28 €	13,39%	392	12,72%
50,00 - 59,99	51.119.574,16 €	22,55%	630	20,45%
60,00 - 69,99	79.831.238,79 €	35,22%	1.054	34,21%
70,00 - 79,99	25.756.408,52 €	11,36%	287	9,32%
80,00 - 89,99	4.036.499,84 €	1,78%	38	1,23%
90,00 - 94,25	419.230,57 €	0,18%	3	0,10%
TOTAL	226.684.906,39 €	100,00%	3.081	100,00%

UCI 11

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
			0,91%					2,20%
	850.000.000,00		100,00%	100,00%				
8-dic-04	848.447.342,89	833.517.603,20	99,09%	98,24%	1,76%	19,19%	1,76%	19,19%
8-ene-05	846.889.973,92	816.392.876,79	98,19%	96,40%	1,82%	19,75%	1,87%	20,31%
8-feb-05	845.328.036,68	802.341.378,75	97,30%	94,91%	1,72%	18,84%	1,54%	16,99%
8-mar-05	843.761.517,75	786.900.260,82	96,42%	93,26%	1,73%	18,89%	1,74%	19,02%
8-abr-05	842.190.403,70	768.001.629,57	95,55%	91,19%	1,83%	19,85%	2,22%	23,61%
8-may-05	840.614.681,05	751.784.924,91	94,68%	89,43%	1,84%	20,02%	1,93%	20,83%
8-jun-05	839.034.336,28	732.993.980,46	93,82%	87,36%	1,91%	20,68%	2,32%	24,51%
8-jul-05	837.449.355,83	713.527.819,67	92,97%	85,20%	1,98%	21,35%	2,47%	25,94%
8-ago-05	835.859.726,10	695.561.749,15	92,13%	83,22%	2,02%	21,73%	2,33%	24,66%
8-sep-05	834.265.433,46	682.206.195,00	91,29%	81,77%	1,99%	21,45%	1,73%	18,92%
8-oct-05	832.666.464,23	670.301.480,81	90,47%	80,50%	1,95%	21,07%	1,56%	17,16%
8-nov-05	831.062.804,69	654.364.086,82	89,65%	78,74%	1,97%	21,26%	2,19%	23,33%
8-dic-05	829.454.441,08	633.873.172,63	88,83%	76,42%	2,05%	21,98%	2,94%	30,13%
8-ene-06	827.841.359,61	619.627.389,01	88,03%	74,85%	2,05%	21,99%	2,06%	22,07%
8-feb-06	826.223.546,43	601.383.750,24	87,23%	72,79%	2,10%	22,44%	2,75%	28,48%
8-mar-06	824.600.987,66	584.239.740,88	86,44%	70,85%	2,13%	22,77%	2,66%	27,64%
8-abr-06	822.973.669,39	566.483.863,76	85,65%	68,83%	2,17%	23,17%	2,85%	29,29%
8-may-06	821.341.577,65	551.680.941,47	84,88%	67,17%	2,19%	23,30%	2,42%	25,47%
8-jun-06	819.704.698,44	536.851.732,28	84,11%	65,49%	2,20%	23,46%	2,49%	26,14%
8-jul-06	818.063.017,72	518.335.537,79	83,35%	63,36%	2,26%	23,95%	3,26%	32,78%
8-ago-06	816.416.521,41	505.514.356,78	82,59%	61,92%	2,26%	23,96%	2,28%	24,15%
8-sep-06	814.765.195,37	497.832.455,51	81,84%	61,10%	2,21%	23,56%	1,32%	14,74%
8-oct-06	813.109.025,44	489.785.181,54	81,10%	60,24%	2,18%	23,24%	1,42%	15,73%
8-nov-06	811.447.997,41	480.954.788,91	80,36%	59,27%	2,16%	23,01%	1,60%	17,62%
8-dic-06	809.782.097,03	470.277.417,04	79,63%	58,07%	2,15%	22,96%	2,02%	21,71%
8-ene-07	808.111.707,58	460.043.992,15	78,91%	56,93%	2,14%	22,90%	1,97%	21,28%
8-feb-07	806.436.418,33	450.559.931,77	78,20%	55,87%	2,13%	22,80%	1,86%	20,15%
8-mar-07	804.756.214,89	440.907.144,06	77,49%	54,79%	2,13%	22,73%	1,94%	20,93%
8-abr-07	803.071.082,85	431.073.415,47	76,79%	53,68%	2,12%	22,70%	2,03%	21,77%
8-may-07	801.381.007,76	421.968.045,26	76,09%	52,66%	2,12%	22,63%	1,91%	20,62%
8-jun-07	799.685.975,11	412.121.707,46	75,40%	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
			0,91%					2,20%
8-jul-07	797.986.907,49	404.454.167,85	74,72%	50,68%	2,10%	22,50%	1,65%	18,11%
8-ago-07	796.282.855,93	396.791.374,83	74,04%	49,83%	2,09%	22,38%	1,68%	18,44%
8-sep-07	794.573.805,82	391.376.030,13	73,37%	49,26%	2,06%	22,11%	1,15%	12,99%
8-oct-07	792.859.742,50	386.989.073,29	72,70%	48,81%	2,03%	21,80%	0,91%	10,36%
8-nov-07	791.140.651,25	381.540.150,55	72,04%	48,23%	2,01%	21,58%	1,19%	13,42%
8-dic-07	789.416.517,34	374.085.117,49	71,39%	47,39%	2,00%	21,51%	1,74%	18,99%
8-ene-08	787.694.525,33	368.864.560,67	70,74%	46,83%	1,98%	21,30%	1,18%	13,28%
8-feb-08	785.967.482,14	365.347.329,01	70,10%	46,48%	1,95%	21,00%	0,74%	8,48%
8-mar-08	784.235.372,95	361.954.516,26	69,46%	46,15%	1,91%	20,70%	0,71%	8,19%
8-abr-08	782.498.182,91	356.988.908,13	68,83%	45,62%	1,90%	20,52%	1,15%	12,99%
8-may-08	780.755.897,12	351.895.556,23	68,21%	45,07%	1,88%	20,36%	1,21%	13,56%
8-jun-08	779.008.500,62	348.169.826,92	67,59%	44,69%	1,86%	20,13%	0,84%	9,59%
8-jul-08	777.259.527,22	347.228.513,39	66,98%	44,67%	1,81%	19,73%	0,05%	0,55%
8-ago-08	775.505.423,51	346.077.498,92	66,37%	44,63%	1,78%	19,36%	0,11%	1,27%
8-sep-08	773.746.174,42	341.634.083,80	65,77%	44,15%	1,76%	19,21%	1,06%	12,00%
8-oct-08	771.981.764,88	338.356.595,89	65,17%	43,83%	1,74%	18,99%	0,73%	8,45%
8-nov-08	770.212.179,73	335.395.338,94	64,58%	43,55%	1,72%	18,77%	0,65%	7,50%
8-dic-08	768.437.403,79	333.970.278,42	64,00%	43,46%	1,69%	18,46%	0,19%	2,31%
8-ene-09	766.659.103,76	331.962.327,38	63,42%	43,30%	1,66%	18,20%	0,37%	4,36%
8-feb-09	764.875.587,37	329.978.849,13	62,84%	43,14%	1,63%	17,95%	0,37%	4,30%
8-mar-09	763.086.839,34	328.476.806,46	62,27%	43,05%	1,61%	17,68%	0,22%	2,63%
8-abr-09	761.292.844,32	326.273.336,82	61,71%	42,86%	1,59%	17,46%	0,44%	5,12%
8-may-09	759.493.586,90	323.503.228,38	61,15%	42,59%	1,57%	17,28%	0,61%	7,13%
8-jun-09	757.689.051,67	321.386.971,51	60,59%	42,42%	1,55%	17,07%	0,42%	4,90%
8-jul-09	755.881.308,93	319.112.570,09	60,04%	42,22%	1,53%	16,87%	0,47%	5,50%
8-ago-09	754.068.263,48	317.841.095,04	59,50%	42,15%	1,50%	16,63%	0,16%	1,89%
8-sep-09	752.249.899,76	314.354.974,81	58,96%	41,79%	1,49%	16,52%	0,86%	9,82%
8-oct-09	750.426.202,17	312.492.643,31	58,43%	41,64%	1,47%	16,32%	0,35%	4,13%
8-nov-09	748.597.155,07	309.793.127,81	57,90%	41,38%	1,46%	16,18%	0,62%	7,21%
8-dic-09	746.762.742,76	307.081.055,36	57,37%	41,12%	1,45%	16,04%	0,63%	7,33%
8-ene-10	744.925.018,92	304.171.922,35	56,85%	40,83%	1,43%	15,92%	0,70%	8,12%
8-feb-10	743.081.904,42	302.891.409,39	56,33%	40,76%	1,41%	15,71%	0,17%	2,07%
8-mar-10	741.233.383,45	300.122.393,54	55,82%	40,49%	1,40%	15,59%	0,67%	7,72%
8-abr-10	739.379.440,15	297.807.053,26	55,32%	40,28%	1,39%	15,45%	0,52%	6,09%
8-may-10	737.520.058,62	295.608.835,47	54,82%	40,08%	1,38%	15,31%	0,49%	5,70%
8-jun-10	735.655.222,91	293.760.620,91	54,32%	39,93%	1,36%	15,16%	0,37%	4,39%
8-jul-10	733.787.447,69	291.341.154,99	53,83%	39,70%	1,35%	15,04%	0,57%	6,64%
8-ago-10	731.914.193,66	289.072.708,07	53,34%	39,50%	1,34%	14,92%	0,52%	6,12%
8-sep-10	730.035.444,76	287.255.851,54	52,85%	39,35%	1,32%	14,78%	0,37%	4,38%
8-oct-10	728.151.184,86	286.099.404,91	52,38%	39,29%	1,31%	14,61%	0,14%	1,72%
8-nov-10	726.261.397,79	284.751.082,83	51,90%	39,21%	1,29%	14,45%	0,21%	2,52%
8-dic-10	724.366.067,35	281.674.551,27	51,43%	38,89%	1,29%	14,38%	0,82%	9,43%
8-ene-11	722.468.266,09	278.838.334,02	50,96%	38,60%	1,28%	14,31%	0,75%	8,60%
8-feb-11	720.564.897,95	277.785.066,79	50,50%	38,55%	1,26%	14,14%	0,11%	1,37%
8-mar-11	718.655.946,59	275.983.701,22	50,04%	38,40%	1,25%	14,02%	0,38%	4,52%
8-abr-11	716.741.395,64	274.448.612,53	49,59%	38,29%	1,24%	13,90%	0,29%	3,43%
8-may-11	714.821.228,68	273.778.936,22	49,14%	38,30%	1,22%	13,73%	-0,02%	-0,29%
8-jun-11	712.895.429,22	271.621.942,31	48,69%	38,10%	1,21%	13,63%	0,52%	6,06%
8-jul-11	710.965.191,30	270.217.689,41	48,25%	38,01%	1,20%	13,51%	0,25%	2,92%
8-ago-11	709.029.291,35	269.318.086,88	47,82%	37,98%	1,19%	13,36%	0,06%	0,73%
8-sep-11	707.087.712,76	268.147.150,38	47,38%	37,92%	1,18%	13,23%	0,16%	1,92%
8-oct-11	705.140.438,88	267.183.876,05	46,95%	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
			0,91%					2,20%
8-nov-11	703.187.452,99	265.696.089,52	46,53%	37,78%	1,15%	12,98%	0,28%	3,32%
8-dic-11	701.228.738,34	264.288.500,39	46,10%	37,69%	1,14%	12,87%	0,25%	2,98%
8-ene-12	699.269.967,10	263.261.093,09	45,69%	37,65%	1,13%	12,74%	0,11%	1,31%
8-feb-12	697.305.450,14	261.893.291,79	45,27%	37,56%	1,12%	12,63%	0,24%	2,83%
8-mar-12	695.335.170,59	260.588.400,21	44,86%	37,48%	1,11%	12,53%	0,22%	2,57%
8-abr-12	693.359.111,56	258.867.875,32	44,46%	37,34%	1,10%	12,44%	0,38%	4,43%
8-may-12	691.377.256,08	258.896.709,85	44,05%	37,45%	1,09%	12,28%	-0,30%	-3,63%
8-jun-12	689.389.587,16	257.436.239,31	43,65%	37,34%	1,08%	12,18%	0,28%	3,28%
8-jul-12	687.399.418,55	256.481.587,36	43,26%	37,31%	1,07%	12,07%	0,08%	0,98%
8-ago-12	685.403.412,10	254.970.529,27	42,86%	37,20%	1,06%	11,98%	0,30%	3,54%
8-sep-12	683.401.550,70	254.189.633,03	42,48%	37,19%	1,05%	11,86%	0,01%	0,17%
8-oct-12	681.393.817,18	253.392.724,66	42,09%	37,19%	1,04%	11,75%	0,02%	0,24%
8-nov-12	679.380.194,30	252.365.440,68	41,71%	37,15%	1,03%	11,64%	0,11%	1,31%
8-dic-12	677.360.664,80	251.163.845,27	41,33%	37,08%	1,02%	11,55%	0,18%	2,13%
8-ene-13	675.341.971,78	249.665.572,52	40,96%	36,97%	1,01%	11,47%	0,30%	3,53%
8-feb-13	673.317.357,26	248.481.194,60	40,58%	36,90%	1,00%	11,38%	0,18%	2,08%
8-mar-13	671.286.803,87	247.478.924,29	40,22%	36,87%	0,99%	11,29%	0,10%	1,22%
8-abr-13	669.250.294,19	246.515.375,54	39,85%	36,83%	0,98%	11,19%	0,09%	1,03%
8-may-13	667.207.810,75	245.328.736,88	39,49%	36,77%	0,98%	11,10%	0,18%	2,10%
8-jun-13	665.159.336,02	243.923.229,33	39,13%	36,67%	0,97%	11,03%	0,27%	3,15%
8-jul-13	663.111.616,14	242.816.536,85	38,78%	36,62%	0,96%	10,95%	0,15%	1,74%
8-ago-13	661.057.889,62	241.563.340,00	38,43%	36,54%	0,95%	10,87%	0,21%	2,46%
8-sep-13	658.998.138,83	240.513.483,02	38,08%	36,50%	0,95%	10,78%	0,12%	1,47%
8-oct-13	656.932.346,11	239.510.480,13	37,73%	36,46%	0,94%	10,70%	0,10%	1,24%
8-nov-13	654.860.493,73	238.293.492,12	37,39%	36,39%	0,93%	10,62%	0,19%	2,30%
8-dic-13	652.782.563,92	236.956.654,81	37,05%	36,30%	0,93%	10,56%	0,24%	2,89%
8-ene-14	650.703.792,43	235.767.057,78	36,72%	36,23%	0,92%	10,48%	0,18%	2,19%
8-feb-14	648.618.923,21	234.640.850,19	36,38%	36,18%	0,91%	10,41%	0,16%	1,88%
8-mar-14	646.527.938,38	233.088.807,16	36,05%	36,05%	0,91%	10,35%	0,34%	4,01%

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
								3,93		6,76		6,76
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	813.571.886,54	36.428.113,46	821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00	36.428.113,46	-11973920892808,40%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-05 0	842.190.403,70	0,00	0,00	784.671.886,54	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	784.671.886,54	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	787.205.494,56	26.366.391,99	784.671.886,54	6.000.000,00	22.900.000,00	26.366.391,99	-8424062239795,27%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-05 0	837.449.355,83	0,00	0,00	758.305.494,56	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	758.305.494,56	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	761.631.322,39	25.574.172,17	758.305.494,56	6.000.000,00	22.900.000,00	25.574.172,17	-7935665623273,49%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-05 0	832.666.464,23	0,00	0,00	732.731.322,39	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	732.731.322,39	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	736.826.517,93	24.804.804,46	732.731.322,39	6.000.000,00	22.900.000,00	24.804.804,46	-7471207104739,49%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-06 0	827.841.359,61	0,00	0,00	707.926.517,93	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	707.926.517,93	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	712.768.872,55	24.057.645,37	707.926.517,93	6.000.000,00	22.900.000,00	24.057.645,37	-7029643978485,62%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-06 0	822.973.669,39	0,00	0,00	683.868.872,55	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	683.868.872,55	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	689.436.803,31	23.332.069,24	683.868.872,55	6.000.000,00	22.900.000,00	23.332.069,24	-6602975595529,55%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-06 0	818.063.017,72	0,00	0,00	660.536.803,31	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	660.536.803,31	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	666.809.335,54	22.627.467,77	660.536.803,31	6.000.000,00	22.900.000,00	22.627.467,77	-6195400676409,19%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-06 0	813.109.025,44	0,00	0,00	637.909.335,54	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	637.909.335,54	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	644.866.085,98	21.943.249,56	637.909.335,54	6.000.000,00	22.900.000,00	21.943.249,56	-5808378158465,66%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-07 0	808.111.707,58	0,00	0,00	615.966.085,98	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	615.966.085,98	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-07 1	804.756.214,89	623.588.173,28	21.277.912,70	615.966.085,98	6.000.000,00	22.900.000,00	21.277.912,70	-5440762276425,45%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-07 0	803.071.082,85	0,00	0,00	594.688.173,28	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	594.688.173,28	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	602.955.379,27	20.632.794,01	594.688.173,28	6.000.000,00	22.900.000,00	20.632.794,01	-5085983722424,94%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-07 0	797.986.907,49	0,00	0,00	574.055.379,27	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	574.055.379,27	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	582.951.068,29	20.004.310,99	574.055.379,27	6.000.000,00	22.900.000,00	20.004.310,99	-4747022996857,19%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-07 0	792.859.742,50	0,00	0,00	554.051.068,29	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	554.051.068,29	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	563.554.901,96	19.396.166,33	554.051.068,29	6.000.000,00	22.900.000,00	19.396.166,33	-4426205156695,86%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-08 0	787.694.525,33	0,00	0,00	534.654.901,96	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	534.654.901,96	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	544.764.268,21	18.790.633,74	534.654.901,96	6.000.000,00	22.900.000,00	18.790.633,74	-4117027853385,77%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-08 0	782.498.182,91	0,00	0,00	515.864.268,21	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	515.864.268,21	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	526.546.278,22	18.217.989,99	515.864.268,21	6.000.000,00	22.900.000,00	18.217.989,99	-3823956098794,93%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-08 0	777.259.527,22	0,00	0,00	497.646.278,22	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	497.646.278,22	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	508.891.303,72	17.654.974,50	497.646.278,22	6.000.000,00	22.900.000,00	17.654.974,50	-3543353382453,23%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-08 0	771.981.764,88	0,00	0,00	479.991.303,72	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	479.991.303,72	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	491.775.823,93	17.115.479,80	479.991.303,72	6.000.000,00	22.900.000,00	17.115.479,80	-3279325929158,53%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-09 0	766.695.103,76	0,00	0,00	462.875.823,93	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	462.875.823,93	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	475.187.279,32	16.588.544,60	462.875.823,93	6.000.000,00	22.900.000,00	16.588.544,60	-3029068244321,95%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-09 0	761.292.844,32	0,00	0,00	446.287.279,32	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	446.287.279,32	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	459.107.109,97	16.080.169,35	446.287.279,32	6.000.000,00	22.900.000,00	16.080.169,35	-2788301365415,79%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-09 0	755.881.308,93	0,00	0,00	430.207.109,97	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	430.207.109,97	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%

		Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	3.93 Average Life Class A	Redemption Class B	6.76 Average Life Class B	Redemption Class C	6.76 Average Life Class C
8-sep-09	1	752.249.899,76	443.524.187,70	15.582.922,28	430.207.109,97	6.000.000,00	22.900.000,00	15.582.922,28	-2558715837637,95%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-09	0	750.426.202,17	0,00	0,00	414.624.187,70	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-09	0	748.597.155,07	0,00	0,00	414.624.187,70	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-09	1	746.762.742,76	428.420.236,65	15.103.951,05	414.624.187,70	6.000.000,00	22.900.000,00	15.103.951,05	-2342622807227,11%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-10	0	744.925.018,92	0,00	0,00	399.520.236,65	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-10	0	743.081.904,42	0,00	0,00	399.520.236,65	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-10	1	741.233.383,45	413.784.739,14	14.635.497,51	399.520.236,65	6.000.000,00	22.900.000,00	14.635.497,51	-2138246186780,15%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-10	0	739.379.440,15	0,00	0,00	384.884.739,14	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-10	0	737.520.058,62	0,00	0,00	384.884.739,14	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-10	1	735.655.222,91	399.600.465,33	14.184.273,80	384.884.739,14	6.000.000,00	22.900.000,00	14.184.273,80	-1941827083891,07%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-10	0	733.787.447,69	0,00	0,00	370.700.465,33	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-10	0	731.914.193,66	0,00	0,00	370.700.465,33	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-10	1	730.035.444,76	385.858.234,78	13.742.230,55	370.700.465,33	6.000.000,00	22.900.000,00	13.742.230,55	-1754882841701,16%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-10	0	728.151.184,86	0,00	0,00	356.958.234,78	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-10	0	726.261.397,79	0,00	0,00	356.958.234,78	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-10	1	724.366.067,35	372.541.010,62	13.317.224,15	356.958.234,78	6.000.000,00	22.900.000,00	13.317.224,15	-1579422784680,17%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-11	0	722.468.266,09	0,00	0,00	343.641.010,62	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-11	0	720.564.897,95	0,00	0,00	343.641.010,62	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-11	1	718.655.946,59	359.640.984,75	12.900.655,87	343.641.010,62	6.000.000,00	22.900.000,00	12.900.655,87	-1413842835814,70%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-11	0	716.741.395,64	0,00	0,00	330.740.984,75	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-11	0	714.821.228,68	0,00	0,00	330.740.984,75	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-11	1	712.895.429,22	347.141.190,75	12.499.794,00	330.740.984,75	6.000.000,00	22.900.000,00	12.499.794,00	-1254973917903,61%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-11	0	710.965.191,30	0,00	0,00	318.241.190,75	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-11	0	709.029.291,35	0,00	0,00	318.241.190,75	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-11	1	707.087.712,76	335.031.601,30	12.109.589,44	318.241.190,75	6.000.000,00	22.900.000,00	12.109.589,44	-1104394557214,59%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-11	0	705.140.438,68	0,00	0,00	306.131.601,30	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-11	0	703.697.452,99	0,00	0,00	306.131.601,30	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-11	1	701.228.738,34	323.298.993,84	11.732.607,47	306.131.601,30	6.000.000,00	22.900.000,00	11.732.607,47	-963247073041,15%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-12	0	699.269.967,10	0,00	0,00	294.398.993,84	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-12	0	697.305.450,14	0,00	0,00	294.398.993,84	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-12	1	695.335.170,59	311.939.956,68	11.359.037,16	294.398.993,84	6.000.000,00	22.900.000,00	11.359.037,16	-829209712774,73%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-12	0	693.359.111,56	0,00	0,00	283.039.956,68	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-12	0	691.377.256,08	0,00	0,00	283.039.956,68	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-12	1	689.389.587,16	300.935.688,57	11.004.268,58	283.039.956,68	6.000.000,00	22.900.000,00	11.004.268,58	-702072335814,70%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-12	0	687.399.418,55	0,00	0,00	272.035.688,09	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-12	0	685.403.412,10	0,00	0,00	272.035.688,09	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-12	1	683.401.550,70	290.279.989,38	10.655.698,71	272.035.688,09	6.000.000,00	22.900.000,00	10.655.698,71	-581801149420,65%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-12	0	681.393.817,18	0,00	0,00	261.379.989,38	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-12	0	679.380.194,30	0,00	0,00	261.379.989,38	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-12	1	677.360.664,80	279.958.253,55	10.321.735,84	261.379.989,38	6.000.000,00	22.900.000,00	10.321.735,84	-469638980534,94%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-13	0	675.341.971,78	0,00	0,00	251.058.253,55	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-13	0	673.317.357,66	0,00	0,00	251.058.253,55	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-13	1	671.286.803,87	269.968.800,25	9.989.453,29	251.058.253,55	6.000.000,00	22.900.000,00	9.989.453,29	-364615045248,73%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-13	0	669.250.294,19	0,00	0,00	241.068.800,25	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-13	0	667.207.810,75	0,00	0,00	241.068.800,25	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-13	1	665.159.336,02	260.293.499,15	9.675.301,10	241.068.800,25	6.000.000,00	22.900.000,00	9.675.301,10	-264135719925,35%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-13	0	663.111.616,14	0,00	0,00	231.393.499,15	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-13	0	661.057.889,62	0,00	0,00	231.393.499,15	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-13	1	658.998.138,63	250.930.806,61	9.362.692,54	231.393.499,15	6.000.000,00	22.900.000,00	9.362.692,54	-169464734984,24%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-13	0	656.932.346,11	0,00	0,00	222.030.806,61	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-13	0	654.860.493,73	0,00	0,00	222.030.806,61	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-13	1	652.782.563,92	241.863.595,27	9.067.211,34	222.030.806,61	6.000.000,00	22.900.000,00	9.067.211,34	-81604902087,34%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-14	0	650.703.792,43	0,00	0,00	212.963.595,27	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-14	0	648.618.923,21	0,00	0,00	212.963.595,27	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-14	1	646.527.938,38	233.088.807,16	8.774.788,11	212.963.595,27	6.000.000,00	22.900.000,00	8.774.788,11	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00%
8-abr-14	0	644.430.439,99	0,00	0,00	204.188.807,16	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-14	0	642.327.550,05	0,00	0,00	204.188.807,16	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-14	1	640.218.110,52	224.591.978,98	8.496.828,18	204.188.807,16	6.000.000,00	22.900.000,00	8.496.828,18	78170819288,53%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-14	0	638.109.627,99	0,00	0,00	195.691.978,98	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-14	0	635.994.960,57	0,00	0,00	195.691.978,98	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-14	1	633.874.090,14	216.372.194,97	8.219.784,01	195.691.978,98	6.000.000,00	22.900.000,00	8.219.784,01	151244025779,98%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-14	0	631.746.998,48	0,00	0,00	187.472.194,97	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-14	0	629.613.667,35	0,00	0,00	187.472.194,97	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-14	1	627.474.078,45	208.413.767,30	7.958.427,67	187.472.194,97	6.000.000,00	22.900.000,00	7.958.427,67	218856760876,52%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-15	0	625.339.624,04	0,00	0,00	179.513.767,30	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-15	0	623.198.908,55	0,00	0,00	179.513.767,30	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-15	1	621.051.913,64	200.720.015,98	7.693.751,31	179.513.767,30	6.000.000,00	22.900.000,00	7.693.751,31	280821922973,20%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-15	0	618.898.620,87	0,00	0,00	171.820.015,98	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	

									3,93			6,76			6,76
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	136.305.117,72	5.518.162,07	112.923.279,79	6.000.000,00	22.900.000,00	5.518.162,07	706324744336,93%	0,00	0,00	0,00	0,00%		
8-oct-17	0	551.966.993,18	0,00	0,00	107.405.117,72	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	107.405.117,72	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	130.966.843,57	5.338.274,15	107.405.117,72	6.000.000,00	22.900.000,00	5.338.274,15	731877386531,36%	0,00	0,00	0,00	0,00%		
8-ene-18	0	545.002.656,18	0,00	0,00	102.066.843,57	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	102.066.843,57	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	125.809.923,45	5.156.920,12	102.066.843,57	6.000.000,00	22.900.000,00	5.156.920,12	753426029394,86%	0,00	0,00	0,00	0,00%		
8-abr-18	0	537.996.601,88	0,00	0,00	96.909.923,45	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	96.909.923,45	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	120.821.893,46	4.988.029,98	96.909.923,45	6.000.000,00	22.900.000,00	4.988.029,98	774641056278,76%	0,00	0,00	0,00	0,00%		
8-jul-18	0	530.937.947,54	0,00	0,00	91.921.893,46	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	91.921.893,46	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	116.003.777,15	4.818.116,31	91.921.893,46	6.000.000,00	22.900.000,00	4.818.116,31	792580133681,97%	0,00	0,00	0,00	0,00%		
8-oct-18	0	523.835.544,50	0,00	0,00	87.103.777,15	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	87.103.777,15	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	111.344.217,92	4.659.559,23	87.103.777,15	6.000.000,00	22.900.000,00	4.659.559,23	808899482865,44%	0,00	0,00	0,00	0,00%		
8-ene-19	0	516.677.835,93	0,00	0,00	82.444.217,92	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	82.444.217,92	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	106.843.049,06	4.501.168,86	82.444.217,92	6.000.000,00	22.900.000,00	4.501.168,86	821913433277,19%	0,00	0,00	0,00	0,00%		
8-abr-19	0	509.471.777,84	0,00	0,00	77.943.049,06	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	77.943.049,06	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%		
8-jun-19	1	504.632.440,60	102.490.764,47	4.352.284,59	77.943.049,06	6.000.000,00	22.900.000,00	4.352.284,59	834768184485,69%	0,00	0,00	0,00	0,00%		
8-jul-19	0	502.221.183,66	0,00	0,00	73.590.764,47	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	73.590.764,47	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	98.294.180,11	4.196.584,36	73.590.764,47	6.000.000,00	22.900.000,00	4.196.584,36	843513456535,30%	0,00	0,00	0,00	0,00%		
8-oct-19	0	494.944.891,68	0,00	0,00	69.394.180,11	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	69.394.180,11	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	94.237.058,47	4.057.121,64	69.394.180,11	6.000.000,00	22.900.000,00	4.057.121,64	852401257213,59%	0,00	0,00	0,00	0,00%		
8-ene-20	0	487.648.819,99	0,00	0,00	65.337.058,47	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	65.337.058,47	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	90.340.175,40	3.896.883,07	65.337.058,47	6.000.000,00	22.900.000,00	3.896.883,07	854196768780,24%	0,00	0,00	0,00	0,00%		
8-abr-20	0	480.377.625,12	0,00	0,00	61.440.175,40	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	61.440.175,40	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	86.573.257,86	3.766.917,54	61.440.175,40	6.000.000,00	22.900.000,00	3.766.917,54	860363965776,98%	0,00	0,00	0,00	0,00%		
8-jul-20	0	473.072.712,19	0,00	0,00	57.673.257,86	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	57.673.257,86	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	82.948.579,32	3.624.678,54	57.673.257,86	6.000.000,00	22.900.000,00	3.624.678,54	861223621149,18%	0,00	0,00	0,00	0,00%		
8-oct-20	0	465.764.508,19	0,00	0,00	54.048.579,32	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	54.048.579,32	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	0,00	82.948.579,32	54.048.579,32	6.000.000,00	22.900.000,00	54.048.579,32	13333784517795,90%	6.000.000,00	14.802.000.000,00	22.900.000,00	564943000000,00%		