

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

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.H.U.C.I. 12		
INFORMATION AT:	QUARTER/SEMESTER:	June 15th, 2015 - September 15th, 2015	YEAR: 2015
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	May 30, 2005	Paying Agent	BANCO SANTANDER	
Disbursement Date	June 02, 2005	Negotiation Market	AIAF	
Final Date of Redemption	December 15, 2039	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	A +
		CLASS B	A	B +
		CLASS C	BBB	B -

II. SECURITIES ISSUED CHARGED TO THE FUND: SECURITISATION BONDS

CLASS PRIORITY	NUM BONDS	NOMINAL			
ISIN CODE			Initial	Current	%Act/In
CLASS A	8.672	Nominal per Bond	100.000,00	29.773,93	
ES0338147004		Total Nominal	867.200.000,00	258.199.520,96	29,77%
CLASS B	90	Nominal per Bond	100.000,00	100.000,00	
ES0338147012		Total Nominal	9.000.000,00	9.000.000,00	100,00 %
CLASS C	238	Nominal per Bond	100.000,00	100.000,00	
ES0338147020		Total Nominal	23.800.000,00	23.800.000,00	100,00 %

REDEMPTION AND INTEREST OF THE BONDS					
Current			Next		
Payment Date of the Current Period September 15th, 2015			Next Payment Date December 15th, 2015		
	Redemption of the Bonds	Gross Interest	Interest Rate	Gross Interest Next Coupon	Net Interest Next Coupon
CLASS A	679,17 €	10,58 €	0,112%	8,43 €	6,79 €
CLASS B	0,00 €	65,42 €	0,232%	58,64 €	47,21 €
CLASS C	0,00 €	149,76 €	0,562%	142,06 €	114,36 €
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	7.886	3.552
CR's Outstanding to be amortised	900.000.006,57 €	301.980.946,30 €
CR's Outstanding per Loan to be amortised	114.126,30 €	85.017,16 €
Interest Rate	3,93 %	2,47%

PREPAYMENT RATE	CURRENT SITUATION
Monthly Single Rate	3,77%
Average Monthly Single Rate	2,51%
Constant Prepayment Rate from Constitution	7,74%

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

QUARTERLY BONDS PAYOUT REPORT

September 15th, 2015

BONDS. PRINCIPAL	
Previous Balance	296.889.283,20 €
Principal Amortised	5.889.762,24 €
Outstanding Balance	290.999.520,96 €
% of Initial Balance	32,33%
Principal accrued and unpaid	0,00 €

INTEREST PAID	
CLASS A	91.749,76 €
CLASS B	5.887,80 €
CLASS C	35.642,88 €
Interest accrued and unpaid	0,00 €

DATA	
Pool Cut-Off Date	September 8th, 2015
Payment Date	September 15th, 2015
Last Payment Date	June 15th, 2015
Number of Days (Act/360)	92
Reference Interest Rate (%)	-0,038%
Next Payment Date	December 15th, 2015

RESIDUAL LIFE (YEARS)		
	INITIAL	September 15th, 2015
CLASS A	4,80	4,92
CLASS B	8,04	9,00
CLASS C	8,04	9,00

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

QUARTERLY COLLATERAL REPORT

September 15th, 2015

PRINCIPAL	
Previous Balance	307.679.426,88 €
Principal Amortised	5.698.480,58 €
Outstanding Balance	301.980.946,30 €
Number of Credit Rights	3.552
LTV	47,07%

INTEREST	
Interest received during relevant period	1.792.868,18 €
Interest accrued during relevant period	2.278.215,53 €

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	7.697,69 €	11.105,05 €	6.751,04 €	14.275,14 €	912.832,26 €
Interest accrued on Credit Rights in Arrears	9.850,13 €	7.681,71 €	3.096,05 €	14.698,71 €	1.091.342,12 €
Outstanding Balance	4.852.717,04 €	2.245.147,42 €	748.797,97 €	1.360.385,74 €	9.724.015,76 €
Number of Credit Rights	52	25	10	10	78
% of Outstanding Balance	1,61%	0,74%	0,25%	0,45%	3,22%

WRITE OFF	
Cumulative WRITE OFF as of previous balance	10.790.102,88 €
Difference in Actual Period	191.292,33 €
Cumulative WRITE OFF up to date	10.981.395,21 €

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

QUARTERLY COLLATERAL REPORT

September 15th, 2015

TRANSITORY PROPERTIES

Last balance	5.577.056,15 €
Difference in Actual Period	199.380,93 €
Current balance	5.776.437,08 €
Number of Transitory properties	122

NET LOSSES

Last balance	4.572.108,67 €
Difference in Actual Period	233.455,42 €
Current balance	4.805.564,09 €

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

QUARTERLY REPORT - ALLOCATION OF CASH

September 15th, 2015

TOTAL CASH RECEIVED END OF PERIOD	6.973.110,80 €
CASH RECEIVED - PRINCIPAL	
Amortisation of Credit Rights	5.000.124,40 €
CASH RECEIVED - INTEREST	
Interest received from Credit Rights	1.792.868,18 €
Interest received under GIC	-3.437,99
INCOMES/EXPENSES OF TRANSTORY PROPERTIES	183.556,21 €
OTHERS	0,00 €

TOTAL CASH PAID END OF PERIOD	6.973.110,80 €
ORDINARY EXPENSES	11.616,00 €
MANAGEMENT FEE	16.837,28 €
INTEREST ON CLASS A BONDS	91.749,76 €
INTEREST ON CLASS B BONDS	5.887,80 €
INTEREST ON CLASS C BONDS	35.642,88 €
REDEMPTION ON CLASS A BONDS	5.889.762,24 €
INTEREST ON SUBORDINATED LOAN SANTANDER	7.088,60 €
INTEREST ON SUBORDINATED LOAN UCB	7.088,60 €
FIXED FEE	6.000,00 €
VARIABLE FEE	901.437,64 €

TREASURY ACCOUNT STATEMENT	10.375.962,32 €
PRINCIPAL RESERVE FUND	
Previous Balance	10.350.000,00 €
Period utilization	0,00 €
Outstanding Balance	10.350.000,00 €
WITHHOLDING TAXES	25.962,32 €

F.T.H U.C.I. 12**CREDIT ENHACEMENT AND SUBORDINATED LOAN****September 15th, 2015****CREDIT ENHACEMENT**

CONCEPTS	INITIAL	September 15th, 2015
SUBORDINATED ISSUE	32.800.000,00 € (3,64%)	32.800.000,00 € (10,86%)
PRINCIPAL RESERVE FUND	10.350.000,00 € (1,15 %)	10.350.000,00 € (3,43%)

SUBORDINATED LOANS

CONCEPTS	INITIAL	September 15th, 2015
SUBORDINATED LOAN SCH		
Total Outstanding Subordinated Loan	5.612.500,00 €	5.175.003,26 €
Interest Rate	2,682 %	0,512%
SUBORDINATED LOAN UCB		
Total Outstanding Subordinated Loan	5.612.500,00 €	5.175.003,26 €
Interest Rate	2,682 %	0,512%

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

DEFINITIONS

September 15th, 2015

POOL CUT-OFF 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.

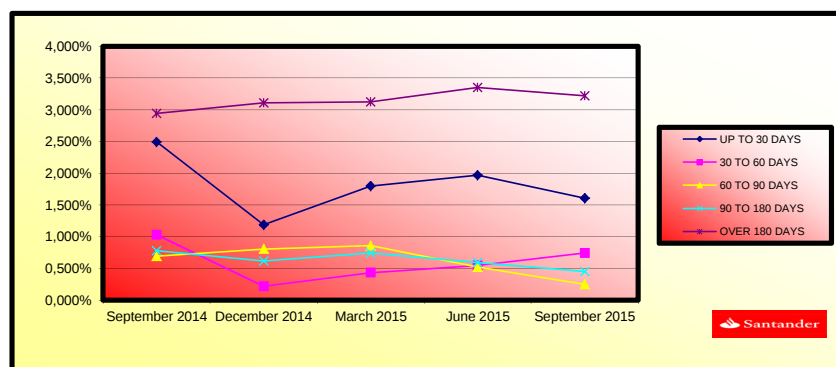
NET LOSSES Those loans which the Originator considers that will not recover (net of recoveries).

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

**FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA
UCI 12**

Report date: September 15th, 2015

ARREARS PERFORMANCE					
	September 2014	December 2014	March 2015	June 2015	September 2015
UP TO 30 DAYS	2,494%	1,187%	1,798%	1,969%	1,607%
30 TO 60 DAYS	1,031%	0,219%	0,433%	0,546%	0,743%
60 TO 90 DAYS	0,692%	0,807%	0,860%	0,522%	0,248%
90 TO 180 DAYS	0,780%	0,620%	0,745%	0,592%	0,450%
OVER 180 DAYS	2,943%	3,106%	3,124%	3,351%	3,220%



**FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA
UCI 12**

TRIGGERS

Report date: September 15th, 2015

CLASS B AND CLASS C REDEMPTION	
IF 1) IS HIGHER THAN 2) CLASS B AND CLASS C ARE NOT REDEEMED	
1) CR'S IN ARREARS OVER 90 DAYS	22.065.796,71 €
2) 2% CR'S OUTSTANDING BALANCE	6.039.618,93 €

CURRENT ARREARS PERCENTAGE
7,31%

CLASSES B & C CANNOT BE REDEEMED

RESERVE FUNDS TRIGGERS	
IF 1) IS HIGHER THAN 2) RESERVE FUNDS WILL NOT BE REDUCED	
1) BONDS WEIGHTED AVERAGE RATE + 0,40%	0,58%
1) MP'S WEIGHTED AVERAGE RATE	2,47%

RESERVE FUND CAN BE REDEEMED

RESERVE FUND LEVELS		
CURRENT ARREARS PERCENTAGE < 0,75%	HIGHER OF 2,3% CR OUTSTANDING BALANCE 0,40% INITIAL BALANCE OF THE BONDS	NA
CURRENT ARREARS PERCENTAGE BETWEEN 0,75% AND 1,25%	HIGHER OF 2,3% CR OUTSTANDING BALANCE 0,70% INITIAL BALANCE OF THE BONDS	NA
CURRENT ARREARS PERCENTAGE > 1,25%	HIGHER OF 2,3% CR OUTSTANDING BALANCE 0,80% INITIAL BALANCE OF THE BONDS	10.350.000 €

INTEREST DEFERRAL FOR CLASS B AND C		
IF 1) IS HIGHER THAN 2)+3) CLASS B INTERESTS ARE DEFERRED TO POSITION 6		
1) CLASS A OUTSTANDING BALANCE		264.089.283,20 €
2) CR OUTSTANDING BALANCE (EXCLUDING ARREARS > 18 MONTHS)		288.026.581,06 €
3) REMAINING FUNDS AFTER PAYMENTS OF POINT 1º TO 3º		17.197.019,96 €
IF 1) IS HIGHER THAN 2)+3) CLASS C INTERESTS ARE DEFERRED TO POSITION 7		
1) CLASS A AND CLASS B OUTSTANDING BALANCE		273.089.283,20 €
2) CR OUTSTANDING BALANCE (EXCLUDING ARREARS > 18 MONTHS)		288.026.581,06 €
3) REMAINING FUNDS AFTER PAYMENTS OF POINT 1º TO 4º		17.161.377,08 €

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
0,17 - 39,99	62.796.230,15 €	20,79%	1.148	32,32%
40,00 - 49,99	55.788.330,87 €	18,47%	588	16,55%
50,00 - 59,99	79.415.423,73 €	26,30%	830	23,37%
60,00 - 69,99	74.721.699,75 €	24,74%	751	21,14%
70,00 - 79,95	29.259.849,54 €	9,69%	235	6,62%

F.T.H.: UCI 12

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

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

01-07-12	746.028.531,07	348.487.505,91	56,52%	46,71%	0,89%	10,19%	-0,04%	-0,46%
01-08-12	743.979.156,35	346.553.096,70	56,15%	46,58%	0,88%	10,11%	0,28%	3,32%
01-09-12	741.923.069,93	345.608.681,25	55,77%	46,58%	0,87%	10,00%	0,00%	-0,05%
01-10-12	739.860.249,83	344.452.156,05	55,40%	46,56%	0,86%	9,90%	0,06%	0,68%
01-11-12	737.790.673,99	342.846.050,04	55,03%	46,47%	0,86%	9,82%	0,19%	2,22%
01-12-12	735.714.320,29	341.651.841,92	54,66%	46,44%	0,85%	9,72%	0,07%	0,80%
01-01-13	733.639.620,24	339.808.674,30	54,29%	46,32%	0,84%	9,65%	0,26%	3,05%
01-02-13	731.558.125,54	338.685.022,02	53,93%	46,30%	0,83%	9,56%	0,05%	0,56%
01-03-13	729.469.813,95	337.592.709,88	53,57%	46,28%	0,83%	9,46%	0,04%	0,45%
01-04-13	727.374.663,14	336.661.580,32	53,21%	46,28%	0,82%	9,37%	-0,01%	-0,14%
01-05-13	725.272.650,71	334.732.793,17	52,85%	46,15%	0,81%	9,31%	0,28%	3,36%
01-06-13	723.163.754,19	333.439.234,72	52,50%	46,11%	0,80%	9,22%	0,10%	1,15%
01-07-13	721.052.834,40	332.097.459,56	52,15%	46,06%	0,80%	9,15%	0,11%	1,32%
01-08-13	718.935.001,34	330.388.322,56	51,80%	45,96%	0,79%	9,08%	0,22%	2,63%
01-09-13	716.810.232,38	329.343.544,45	51,45%	45,95%	0,78%	9,00%	0,02%	0,25%
01-10-13	714.678.504,80	328.221.731,31	51,11%	45,93%	0,78%	8,92%	0,04%	0,52%
01-11-13	712.539.795,82	326.574.366,10	50,77%	45,83%	0,77%	8,85%	0,20%	2,41%
01-12-13	710.394.082,56	324.772.662,75	50,43%	45,72%	0,76%	8,80%	0,25%	2,97%
01-01-14	708.248.288,98	323.075.181,05	50,09%	45,62%	0,76%	8,74%	0,22%	2,62%
01-02-14	706.095.467,93	321.726.709,52	49,76%	45,56%	0,75%	8,67%	0,11%	1,36%
01-03-14	703.935.596,38	320.000.368,88	49,42%	45,46%	0,75%	8,62%	0,23%	2,74%
01-04-14	701.768.651,26	318.111.923,24	49,09%	45,33%	0,74%	8,57%	0,28%	3,35%
01-05-14	699.594.609,40	316.632.236,49	48,76%	45,26%	0,74%	8,51%	0,16%	1,85%
01-06-14	697.413.447,54	315.007.844,30	48,44%	45,17%	0,73%	8,45%	0,20%	2,40%
01-07-14	695.238.923,74	313.592.274,11	48,11%	45,11%	0,73%	8,39%	0,14%	1,64%
01-08-14	693.057.278,37	311.744.642,03	47,79%	44,98%	0,72%	8,35%	0,28%	3,27%
01-09-14	690.868.488,11	310.421.098,90	47,47%	44,93%	0,72%	8,29%	0,11%	1,30%
01-10-14	688.672.529,56	309.283.048,19	47,15%	44,91%	0,71%	8,22%	0,05%	0,59%
01-11-14	686.469.379,25	307.789.395,30	46,84%	44,84%	0,71%	8,17%	0,16%	1,95%
01-12-14	684.259.013,62	306.183.212,57	46,53%	44,75%	0,70%	8,12%	0,20%	2,38%
01-01-15	682.080.167,33	304.099.561,19	46,21%	44,58%	0,70%	8,08%	0,36%	4,27%
01-02-15	679.894.185,31	302.468.663,72	45,91%	44,49%	0,70%	8,04%	0,22%	2,57%
01-03-15	677.701.044,21	301.282.256,52	45,60%	44,46%	0,69%	7,98%	0,07%	0,84%
01-04-15	675.500.720,57	300.037.216,53	45,29%	44,42%	0,69%	7,92%	0,09%	1,06%
01-05-15	673.293.190,87	298.300.877,19	44,99%	44,30%	0,68%	7,88%	0,25%	2,99%
01-06-15	671.078.431,51	296.889.324,00	44,69%	44,24%	0,68%	7,83%	0,14%	1,72%
01-07-15	668.859.344,07	294.780.954,64	44,39%	44,07%	0,67%	7,80%	0,38%	4,47%
01-08-15	666.632.989,12	292.914.638,84	44,09%	43,94%	0,67%	7,77%	0,30%	3,56%
01-09-15	664.399.342,86	290.999.551,09	43,80%	43,80%	0,67%	7,74%	0,32%	3,77%

Fecha		Principal disponible antes prepago	Principal Disponible	Amortización de principal	Serie A	Serie B	Serie C	Amortización Serie A	Vida Media Serie A	Amortización Serie B	Vida Media Serie B	Amortización Serie C	Vida Media Serie C
									4,92		9,00		9,00
Date		Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	Average Life Class A	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C
		900.000.000,00											
03-06-05		900.000.000,00			867.200.000	9.000.000	23.800.000						
08-07-05	0	892.410.172,80	0,00	0,00	867.200.000	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-05	0	884.876.503,37	0,00	0,00	867.200.000	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-05	0	877.398.604,04	877.398.597,47	22.601.402,53	867.200.000	9.000.000	23.800.000	22.601.402,53	-8254032204136,71%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-05	1	869.876.083,23	0,00	0,00	844.598.597	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-05	0	862.608.552,23	0,00	0,00	844.598.597	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-05	1	855.295.624,70	855.295.618,13	22.102.979,34	844.598.597	9.000.000	23.800.000	22.102.979,34	-7870870944336,08%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-06	0	848.036.917,14	0,00	0,00	822.495.618	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-06	0	840.832.048,66	0,00	0,00	822.495.618	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-06	1	833.680.640,93	833.680.634,36	21.614.983,77	822.495.618	9.000.000	23.800.000	21.614.983,77	-7502560866059,12%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-06	0	826.582.318,25	0,00	0,00	800.880.634	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-06	0	819.536.707,48	0,00	0,00	800.880.634	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-06	1	812.543.438,04	812.543.431,47	21.137.202,88	800.880.634	9.000.000	23.800.000	21.137.202,88	-7142260854533,43%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-06	0	805.603.012,45	0,00	0,00	779.743.431	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-06	0	798.714.185,83	0,00	0,00	779.743.431	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-06	1	791.876.595,24	791.876.588,67	20.666.842,81	779.743.431	9.000.000	23.800.000	20.666.842,81	-6793191230851,47%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-06	0	785.089.880,23	0,00	0,00	759.076.589	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-06	0	778.353.682,42	0,00	0,00	759.076.589	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-06	1	771.667.647,50	771.667.640,93	20.208.947,74	759.076.589	9.000.000	23.800.000	20.208.947,74	-6458779696888,41%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-07	0	765.031.421,18	0,00	0,00	738.867.641	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-07	0	758.444.653,19	0,00	0,00	738.867.641	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-07	1	751.906.995,30	751.906.988,73	19.760.652,20	738.867.641	9.000.000	23.800.000	19.760.652,20	-6137658573916,51%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-07	0	745.418.101,62	0,00	0,00	719.106.989	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-07	0	738.977.628,66	0,00	0,00	719.106.989	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-07	1	732.585.235,30	732.585.228,73	19.321.759,99	719.106.989	9.000.000	23.800.000	19.321.759,99	-5823578462453,48%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-07	0	726.241.009,45	0,00	0,00	699.785.229	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-07	0	719.944.183,60	0,00	0,00	699.785.229	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-07	1	713.694.423,63	713.694.417,06	18.890.811,67	699.785.229	9.000.000	23.800.000	18.890.811,67	-5519895169009,22%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-07	0	707.491.397,72	0,00	0,00	680.894.417	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-07	0	701.334.776,30	0,00	0,00	680.894.417	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-07	1	695.224.232,09	695.224.225,52	18.470.191,54	680.894.417	9.000.000	23.800.000	18.470.191,54	-5228911225632,75%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-08	0	689.159.440,04	0,00	0,00	662.424.226	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-08	0	683.140.077,35	0,00	0,00	662.424.226	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-08	1	677.165.823,41	677.165.816,84	18.058.408,68	662.424.226	9.000.000	23.800.000	18.058.408,68	-4948003978600,99%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-08	0	671.236.359,84	0,00	0,00	644.365.817	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-08	0	665.351.370,43	0,00	0,00	644.365.817	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-08	1	659.510.541,14	659.510.534,57	17.655.282,27	644.365.817	9.000.000	23.800.000	17.655.282,27	-4675118744958,59%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-08	0	653.713.560,11	0,00	0,00	626.710.535	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-08	0	647.960.117,59	0,00	0,00	626.710.535	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-08	1	642.249.906,00	642.249.899,43	17.260.635,15	626.710.535	9.000.000	23.800.000	17.260.635,15	-4411818343451,92%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-08	0	636.582.619,82	0,00	0,00	609.449.899	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-08	0	630.957.955,68	0,00	0,00	609.449.899	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-08	1	625.375.612,27	625.375.605,70	16.874.293,73	609.449.899	9.000.000	23.800.000	16.874.293,73	-4159513404405,28%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-09	0	619.836.344,51	0,00	0,00	592.575.606	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-09	0	614.338.790,39	0,00	0,00	592.575.606	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-09	1	608.882.654,86	608.882.648,29	16.492.957,40	592.575.606	9.000.000	23.800.000	16.492.957,40	-3917077383107,35%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-09	0	603.467.644,91	0,00	0,00	576.082.648	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-09	0	598.093.469,52	0,00	0,00	576.082.648	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-09	1	592.759.839,69	592.759.833,12	16.122.815,18	576.082.648	9.000.000	23.800.000	16.122.815,18	-3680838704698,33%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-09	0	587.468.288,07	0,00	0,00	559.959.833	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-09	0	582.216.691,53	0,00	0,00	559.959.833	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-09	1	577.004.767,12	577.004.760,55	15.755.072,57	559.959.833	9.000.000	23.800.000	15.755.072,57	-3451936400207,47%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-09	0	571.832.233,85	0,00	0,00	544.204.761	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-09	0	566.698.812,67	0,00	0,00	544.204.761	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-09	1	561.604.226,44	561.604.219,87	15.400.540,67	544.204.761	9.000.000	23.800.000	15.400.540,67	-3234113541098,83%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-10	0	556.549.591,93	0,00	0,00	528.804.220	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-10	0	551.533.229,70	0,00	0,00	528.804.220	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-10	1	546.554.868,41	546.554.861,84	15.049.358,03	528.804.220	9.000.000	23.800.000	15.049.358,03	-3024920964179,87%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-10	0	541.614.238,59	0,00	0,00	513.754.862	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-10	0	536.711.072,62	0,00	0,00	513.754.862	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-10	1	531.845.104,71	531.845.098,14	14.709.763,70	513.754.862	9.000.000	23.800.000	14.709.763,70	-2821332677593,78%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-10	0	527.016.870,20	0,00	0,00	499.045.098	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-10	0	522.225.299,57	0,00	0,00	499.045.098	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-10	1	517.470.132,58	517.470.126,01	14.374.972,14	499.045.098	9.000.000	23.800.000	14.374.972,14	-2624869912048,48%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-10	0	512.751.110,75	0,00	0,00	484.670.126	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-10	0	508.067.977,39	0,00	0,00	484.670.126	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-10	1	503.420.477,58	503.420.471,01	14.049.655,00	484.670.126	9.000.000	23.800.000	14.049.655,00	-2437615142101,01%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-11	0	498.811.110,37	0,00	0,00	470.620.471	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-11	0	494.236.844,26	0,00	0,00	470.620.471	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%</

									4,92			9,00			9,00
Date		Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	Average Life Class A	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C		
08-06-12	1	425.685.143,12	425.685.136,55	12.207.652,45	405.092.789	9.000.000	23.800.000	12.207.652,45	-1449048345556,84%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-07-12	0	421.682.959,88	0,00	0,00	392.885.137	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-08-12	0	417.711.516,45	0,00	0,00	392.885.137	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-09-12	1	413.770.593,58	413.770.587,01	11.914.549,54	392.885.137	9.000.000	23.800.000	11.914.549,54	-1304643174317,86%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-10-12	0	409.859.973,51	0,00	0,00	380.970.587	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-11-12	0	405.979.439,99	0,00	0,00	380.970.587	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-12-12	1	402.128.778,26	402.128.771,69	11.641.815,32	380.970.587	9.000.000	23.800.000	11.641.815,32	-1168838257934,38%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-01-13	0	398.312.364,80	0,00	0,00	369.328.772	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-02-13	0	394.525.351,60	0,00	0,00	369.328.772	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-03-13	1	390.767.528,67	390.767.522,10	11.361.249,60	369.328.772	9.000.000	23.800.000	11.361.249,60	-1038418213084,61%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-04-13	0	387.038.687,50	0,00	0,00	357.967.522	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-05-13	0	383.338.621,01	0,00	0,00	357.967.522	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-06-13	1	379.667.123,54	379.667.116,97	11.100.405,12	357.967.522	9.000.000	23.800.000	11.100.405,12	-912453301231,07%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-07-13	0	376.026.537,53	0,00	0,00	346.867.117	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-08-13	0	372.414.087,72	0,00	0,00	346.867.117	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-09-13	1	368.829.572,89	368.829.566,32	10.837.550,65	346.867.117	9.000.000	23.800.000	10.837.550,65	-791141197554,07%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-10-13	0	365.272.793,22	0,00	0,00	336.029.566	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-11-13	0	361.743.550,26	0,00	0,00	336.029.566	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-12-13	1	358.241.646,95	358.241.640,38	10.587.925,94	336.029.566	9.000.000	23.800.000	10.587.925,94	-676568467389,89%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-01-14	0	354.770.367,37	0,00	0,00	325.441.640	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-02-14	0	351.326.002,13	0,00	0,00	325.441.640	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-03-14	1	347.908.358,52	347.908.351,95	10.333.288,44	325.441.640	9.000.000	23.800.000	10.333.288,44	-567297535245,11%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-04-14	0	344.517.245,11	0,00	0,00	315.108.352	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-05-14	0	341.152.471,85	0,00	0,00	315.108.352	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-06-14	1	337.813.849,97	337.813.843,40	10.094.508,54	315.108.352	9.000.000	23.800.000	10.094.508,54	-461319040494,84%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-07-14	0	334.507.822,78	0,00	0,00	305.013.843	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-08-14	0	331.227.506,22	0,00	0,00	305.013.843	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-09-14	1	327.972.715,93	327.972.709,36	9.841.134,04	305.013.843	9.000.000	23.800.000	9.841.134,04	-359201392542,87%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-10-14	0	324.743.268,85	0,00	0,00	295.172.709	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-11-14	0	321.538.983,19	0,00	0,00	295.172.709	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-12-14	1	318.359.678,39	318.359.671,82	9.613.037,54	295.172.709	9.000.000	23.800.000	9.613.037,54	-263397228591,12%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-01-15	0	315.223.087,29	0,00	0,00	285.559.672	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-02-15	0	312.110.938,35	0,00	0,00	285.559.672	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-03-15	1	309.023.056,16	309.023.049,59	9.336.622,23	285.559.672	9.000.000	23.800.000	9.336.622,23	-171793849061,92%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-04-15	0	305.959.266,54	0,00	0,00	276.223.050	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-05-15	0	302.919.396,53	0,00	0,00	276.223.050	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-06-15	1	299.903.274,35	299.903.267,78	9.119.781,81	276.223.050	9.000.000	23.800.000	9.119.781,81	-83901992611,82%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-07-15	0	296.912.027,95	0,00	0,00	267.103.268	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-08-15	0	293.944.176,24	0,00	0,00	267.103.268	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-09-15	1	290.999.551,09	290.999.544,52	8.903.723,26	267.103.268	9.000.000	23.800.000	8.903.723,26	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-10-15	0	288.077.985,53	0,00	0,00	258.199.545	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-11-15	0	285.179.313,76	0,00	0,00	258.199.545	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-12-15	1	282.303.371,11	282.303.364,54	8.696.179,98	258.199.545	9.000.000	23.800.000	8.696.179,98	79135237829,73%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-01-16	0	279.451.835,48	0,00	0,00	249.503.365	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-02-16	0	276.622.684,43	0,00	0,00	249.503.365	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-03-16	1	273.815.756,84	273.815.750,27	8.487.614,27	249.503.365	9.000.000	23.800.000	8.487.614,27	154474579628,07%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-04-16	0	271.030.892,73	0,00	0,00	241.015.750	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-05-16	0	268.267.933,21	0,00	0,00	241.015.750	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-06-16	1	265.526.720,49	265.526.713,92	8.289.036,35	241.015.750	9.000.000	23.800.000	8.289.036,35	227119595978,48%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-07-16	0	262.812.104,62	0,00	0,00	232.726.714	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-08-16	0	260.118.872,56	0,00	0,00	232.726.714	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-09-16	1	257.446.870,19	257.446.863,62	8.079.850,31	232.726.714	9.000.000	23.800.000	8.079.850,31	295722521303,23%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-10-16	0	254.795.944,44	0,00	0,00	224.646.864	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-11-16	0	252.165.943,33	0,00	0,00	224.646.864	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-12-16	1	249.556.715,91	249.556.709,34	7.890.154,27	224.646.864	9.000.000	23.800.000	7.890.154,27	360580050190,01%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-01-17	0	246.972.795,30	0,00	0,00	216.756.709	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-02-17	0	244.409.302,21	0,00	0,00	216.756.709	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-03-17	1	241.866.089,21	241.866.082,64	7.690.626,71	216.756.709	9.000.000	23.800.000	7.690.626,71	420677280826,86%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		

Date		Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	4,92		Redemption Class B	9,00		Redemption Class C	9,00	
									Average Life Class A			Average Life Class B			Average Life Class C	
08-04-17	0	239.343.009,86	0,00	0,00	209.066.083	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
08-05-17	0	236.839.918,77	0,00	0,00	209.066.083	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
08-06-17	1	234.356.671,53	234.356.664,96	7.509.417,68	209.066.083	9.000.000	23.800.000	7.509.417,68	479851789767,93%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
08-07-17	0	231.896.481,05	0,00	0,00	201.556.665	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
08-08-17	0	229.455.814,65	0,00	0,00	201.556.665	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
08-09-17	1	227.034.531,18	227.034.524,61	7.322.140,35	201.556.665	9.000.000	23.800.000	7.322.140,35	535248459532,39%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
08-10-17	0	224.632.490,48	0,00	0,00	194.234.525	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
08-11-17	0	222.249.553,35	0,00	0,00	194.234.525	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
08-12-17	1	219.885.581,59	219.885.575,02	7.148.949,59	194.234.525	9.000.000	23.800.000	7.148.949,59	587643656503,45%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
07-01-18	1	217.543.679,49	0,00	0,00	187.085.575	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-02-18	1	215.220.436,35	0,00	0,00	187.085.575	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
08-03-18	1	212.915.717,08	212.915.710,51	6.969.864,50	187.085.575	9.000.000	23.800.000	6.969.864,50	635651642636,78%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
07-04-18	1	210.629.387,51	0,00	0,00	180.115.711	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
07-05-18	1	208.361.314,41	0,00	0,00	180.115.711	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-06-18	1	206.111.365,47	206.111.358,90	6.804.351,62	180.115.711	9.000.000	23.800.000	6.804.351,62	681796032062,22%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-07-18	0	203.883.641,51	0,00	0,00	173.311.359	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-08-18	0	201.673.737,00	0,00	0,00	173.311.359	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-09-18	1	199.481.522,73	199.481.516,16	6.629.842,74	173.311.359	9.000.000	23.800.000	6.629.842,74	725304795655,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-10-18	0	197.306.870,35	0,00	0,00	166.881.516	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-11-18	0	195.149.652,44	0,00	0,00	166.881.516	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-12-18	1	193.009.742,45	193.009.735,88	6.471.780,27	166.881.516	9.000.000	23.800.000	6.471.780,27	766905962355,63%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-01-19	0	190.892.141,66	0,00	0,00	160.209.736	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-02-19	0	188.791.546,41	0,00	0,00	160.209.736	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-03-19	1	186.707.833,19	186.707.826,62	6.301.909,26	160.209.736	9.000.000	23.800.000	6.301.909,26	803493431055,65%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-04-19	0	184.640.879,34	0,00	0,00	153.907.827	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-05-19	0	182.590.563,06	0,00	0,00	153.907.827	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-06-19	1	180.556.763,39	180.556.756,82	6.151.069,80	153.907.827	9.000.000	23.800.000	6.151.069,80	840851241612,96%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-07-19	0	178.553.101,53	0,00	0,00	147.756.757	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-08-19	0	176.565.577,75	0,00	0,00	147.756.757	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-09-19	1	174.594.074,70	174.594.068,13	5.962.688,69	147.756.757	9.000.000	23.800.000	5.962.688,69	869956280115,83%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-10-19	0	172.638.475,85	0,00	0,00	141.794.068	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-11-19	0	170.698.665,48	0,00	0,00	141.794.068	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-12-19	1	168.774.528,67	168.774.522,10	5.819.546,03	141.794.068	9.000.000	23.800.000	5.819.546,03	902029634546,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-01-20	0	166.891.460,76	0,00	0,00	135.974.522	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-02-20	0	165.023.580,67	0,00	0,00	135.974.522	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-03-20	1	163.170.777,90	163.170.771,33	5.603.750,77	135.974.522	9.000.000	23.800.000	5.603.750,77	919575501689,59%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-04-20	0	161.332.942,72	0,00	0,00	130.370.771	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-05-20	0	159.509.966,15	0,00	0,00	130.370.771	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-06-20	1	157.701.740,00	157.701.733,43	5.469.037,90	130.370.771	9.000.000	23.800.000	5.469.037,90	947784267270,96%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-07-20	0	155.909.893,94	0,00	0,00	124.901.733	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-08-20	0	154.132.566,55	0,00	0,00	124.901.733	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-09-20	1	152.369.651,99	152.369.645,42	5.332.088,01	124.901.733	9.000.000	23.800.000	5.332.088,01	973106062100,84%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-10-20	0	150.621.045,19	0,00	0,00	119.569.645	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-11-20	0	148.886.641,79	0,00	0,00	119.569.645	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-12-20	1	147.166.338,17	147.166.331,60	5.203.313,82	119.569.645	9.000.000	23.800.000	5.203.313,82	996954927461,06%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-01-21	0	145.461.719,75	0,00	0,00	114.366.332	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-02-21	0	143.770.978,93	0,00	0,00	114.366.332	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-03-21	1	142.094.014,37	142.094.007,80	5.072.323,81	114.366.332	9.000.000	23.800.000	5.072.323,81	1017508155502,61%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-04-21	0	140.430.725,43	0,00	0,00	109.294.008	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-05-21	0	138.781.012,20	0,00	0,00	109.294.008	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-06-21	1	137.144.775,45	137.144.768,88	4.949.238,92	109.294.008	9.000.000	23.800.000	4.949.238,92	1038350325420,17%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-07-21	0	137.144.775,45	0,00	0,00	104.344.769	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-08-21	0	137.144.775,45	0,00	0,00	104.344.769	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-09-21	1	137.144.775,45	132.318.970,43	4.825.798,45	104.344.769	9.000.000	23.800.000	4.825.798,45	1056849860274,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-10-21	0	137.144.775,45	0,00	0,00	99.518.970	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-11-21	0	137.144.775,45	0,00	0,00	99.518.970	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-12-21	1	137.144.775,45	127.610.862,24	4.708.108,19	99.518.970	9.000.000	23.800.000	4.708.108,19	1073919477139,95%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-01-22	0	126.070.349,68	0,00	0,00	94.810.862	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-02-22	0	124.542.496,04	0,00	0,00	94.810.862	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-03-22	1	123.027.215,05	123.027.208,48	4.583.653,76	94.810.862	9.000.000	23.800.000	4.583.653,76	1086784306417,99%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-04-22	0	121.524.414,54	0,00	0,00	90.227.208	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-05-22	0	120.034.002,95	0,00	0,00	90.227.208	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-06-22	1	118.555.889,39	118.555.882,82	4.471.325,66	90.227.208	9.000.000	23.800.000	4.471.325,66	1101287509822,29%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-07-22	0	117.091.866,83	0,00	0,00	85.755.883	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-08-22	0	115.639.943,31	0,00	0,00	85.755.883	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%</	

Date		Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	4,92	Redemption Class B	9,00	Redemption Class C	9,00
									Average Life Class A		Average Life Class B		Average Life Class C
06-04-23	0	104.462.604,28	0,00	0,00	73.017.672	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-05-23	0	103.118.819,16	0,00	0,00	73.017.672	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-06-23	1	101.786.239,57	101.786.233,00	4.031.438,50	73.017.672	9.000.000	23.800.000	4.031.438,50	1140090807334,60%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-07-23	0	100.466.268,31	0,00	0,00	68.986.233	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-08-23	0	99.157.322,96	0,00	0,00	68.986.233	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-09-23	1	97.859.322,22	97.859.315,65	3.926.917,36	68.986.233	9.000.000	23.800.000	3.926.917,36	1146659868048,98%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-10-23	0	96.572.185,35	0,00	0,00	65.059.316	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-11-23	0	95.295.832,20	0,00	0,00	65.059.316	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-12-23	1	94.030.183,15	94.030.176,58	3.829.139,06	65.059.316	9.000.000	23.800.000	3.829.139,06	1152953772244,94%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-01-24	0	92.780.120,78	0,00	0,00	61.230.177	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-02-24	0	91.540.554,73	0,00	0,00	61.230.177	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-03-24	1	90.311.407,45	90.311.400,88	3.718.775,70	61.230.177	9.000.000	23.800.000	3.718.775,70	1153564222148,22%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-04-24	0	89.092.601,95	0,00	0,00	57.511.401	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-05-24	0	87.884.061,76	0,00	0,00	57.511.401	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-06-24	1	86.685.710,94	86.685.704,37	3.625.696,51	57.511.401	9.000.000	23.800.000	3.625.696,51	1158047464939,31%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-07-24	0	85.518.944,93	0,00	0,00	53.885.704	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-08-24	0	84.362.000,63	0,00	0,00	53.885.704	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-09-24	1	83.214.805,41	-6,57	86.685.710,94	53.885.704	9.000.000	23.800.000	53.885.704,37	17706842457082,60%	9.000.000,00	2957400000000,00%	23.800.000,00	7820680000000,00%