

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

ANA OBREGON MAZO
ANALISTA
SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.
AVENIDA GRAN VÍA DE HORTALEZA, 3
28033 MADRID
aobregon@gruposantander.com
Tel: 912893301

DENOMINACION DEL FONDO:	F.T.H U.C.I. 12		
INFORMACIÓN CORRESPONDIENTE AL:	TRIMESTRE/SEMESTRE:	15/06/2016 - 15/09/2016	AÑO: 2016
Personas que asumen la responsabilidad de esta información y cargos que ocupan:	Firma:		
IGNACIO ORTEGA GAVARA - DIRECTOR GENERAL			

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

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

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO: BONOS DE TITULIZACION

SÉRIES PRELACIÓN CÓDIGO ISIN	Nº BONOS	NOMINAL EN CIRCULACIÓN			
			Inicial	Actual	%Act/In
B.T.H'S SERIE A ES0338147004	8.672	Nominal Unitario	100.000,00	27.163,95	
		Nominal Total	867.200.000,00	235.565.774,40	27,16%
B.T.H'S SERIE B ES0338147012	90	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	9.000.000,00	9.000.000,00	100,00 %
B.T.H'S SERIE C ES0338147020	238	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	23.800.000,00	23.800.000,00	100,00 %

AMORTIZACION E INTERESES BONOS					
Actual			Próximo		
Fecha Amortización Período Actual 15 de septiembre de 2016			Fecha Próximo Cupón 15 de diciembre de 2016		
	Amortización de los Bonos	Intereses Brutos Bonos	Tipo de Interés	Importe Bruto Próximo Cupón	Importe Neto Próximo Cupón
B.T.H'S SERIE A	610,22 €	0,00 €	0,000%	0,00 €	0,00 €
B.T.H'S SERIE B	0,00 €	1,79 €	0,000%	0,00 €	0,00 €
B.T.H'S SERIE C	0,00 €	86,12 €	0,298%	75,33 €	61,02 €
Amortización devengada no pagada	0,00 €				
Amortización Calendario	NO				

III. ACTIVOS ADQUIRIDOS POR EL FONDO: DERECHOS DE CRÉDITO

DERECHOS DE CRÉDITO	A LA EMISIÓN	SITUACIÓN ACTUAL
Número de Derechos de Crédito	7.886	3.418
Saldo Pendiente de Amortizar Derechos	900.000.006,57 €	280.566.862,44 €
Importes Unitarios Derechos Vivos	114.126,30 €	82.085,10 €
Tipos de Interés	3,93 %	2,11%

TASAS DE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA	SITUACIÓN ACTUAL
Tasa mensual actual anualizada:	2,56%
Tasa últimos 12 meses anualizada:	3,82%
Tasa anualizada desde Constitución del Fondo	7,40%

MOROSIDAD ACTUAL	Hasta 1 mes	De 1 a 6 meses	Mayor de 6 meses
Deuda Vencida(Principal+Intereses)	24.044,45 €	64.843,00 €	1.699.198,87 €
Deuda Pendiente de vencimiento	0,00 €	0,00 €	279.658.187,20 €
Deuda Total	24.044,45 €	64.843,00 €	281.357.386,07 €

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

INFORME TRIMESTRAL BONOS DE TITULIZACIÓN

15 de septiembre de 2016

BONOS TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. PRINCIPAL	
Saldo anterior	273.657.602,24 €
Amortizaciones	5.291.827,84 €
Saldo actual	268.365.774,40 €
% sobre saldo inicial	29,82%
Amortización devengada no pagada	0,00 €

BONOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. INTERESES	
Intereses pagados Serie A	0,00 €
Intereses pagados Serie B	161,10 €
Intereses pagados Serie C	20.496,56 €
Intereses devengados no pagados	0,00 €

DATOS	
Fecha de determinación	08/09/2016
Fecha de Pago de Cupón Actual	15/09/2016
Fecha de Pago de Cupón Anterior	15/06/2016
Número de días	92
Tipo de referencia (%)	-0,302%
Próxima Fecha de Pago	15/12/2016

VIDA RESIDUAL (AÑOS)		
	INICIAL	15-sep-16
B.T.H'S SERIE A	4,80	4,71
B.T.H'S SERIE B	8,04	8,25
B.T.H'S SERIE C	8,04	8,25

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

INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

15 de septiembre de 2016

DERECHOS DE CRÉDITO. PRINCIPAL	
Saldo anterior	285.607.348,72 €
Amortizaciones	5.040.486,28 €
Saldo actual	280.566.862,44 €
Número de derechos de crédito	3.418
LTV	45,60%

DERECHOS DE CRÉDITO. INTERESES	
Intereses cobrados en el trimestre	1.410.564,49 €
Intereses devengados en el trimestre	1.339.053,83 €

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	14.006,18 €	13.104,68 €	10.482,02 €	16.513,55 €	854.568,81 €
Intereses	10.038,27 €	9.192,68 €	6.072,08 €	9.477,99 €	844.630,06 €
Saldo de los derechos de crédito	6.480.326,20 €	2.651.651,18 €	1.310.994,42 €	1.128.794,30 €	5.220.579,93 €
Número de derechos de crédito	71	28	13	9	103
% sobre saldo de los derechos de crédito	2,31%	0,95%	0,47%	0,40%	1,86%

PRÉSTAMOS EN WRITE OFF	
Write Off acumulado Fecha Pago anterior	11.949.720,13 €
Write Off trimestre	251.325,38 €
Write Off acumulados actuales	12.201.045,51 €

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

INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

15 de septiembre de 2016

ADJUDICADOS	
Saldo anterior	6.016.270,91 €
Diferencia	-503.809,51 €
Saldo actual	5.512.461,40 €
Número de adjudicados	115

PERDIDAS DE LAS CARTERAS	
Saldo anterior	5.321.229,57 €
Diferencia	318.514,02 €
Saldo actual	5.639.743,59 €

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

ESTADO DE ORIGEN Y APLICACIÓN DE FONDOS Y CUENTA DE TESORERÍA

15 de septiembre de 2016

ORIGEN	7.459.142,91 €
PRINCIPAL COBRADO	
Amortización derechos de crédito	4.571.514,27 €
INTERESES COBRADOS	
Intereses de derechos de crédito	1.410.564,49 €
Intereses de reinversión	-10.769,46
INGRESOS/GASTOS DE ADJUDICADOS	1.487.912,37 €
OTROS	-78,76 €

APLICACIÓN	7.459.142,91 €
GASTOS ORDINARIOS	11.616,00 €
COMISIÓN S.G.F.T.	15.519,76 €
INTERESES B.T.H'S SERIE A	0,00 €
INTERESES B.T.H'S SERIE B	161,10 €
INTERESES B.T.H'S SERIE C	20.496,56 €
FONDOS DISPONIBLES AMORTIZACIÓN A	5.291.827,84 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO SANTANDER	3.795,58 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB	3.795,58 €
COMISIÓN ADMINISTRACIÓN	6.000,00 €
COMISIÓN VARIABLE	2.105.930,49 €

ESTADO CUENTA DE TESORERÍA	10.353.924,28 €
FONDO DE RESERVA	
Saldo anterior	10.350.000,00 €
Utilizado en el período	0,00 €
Saldo actual	10.350.000,00 €
RETENCIÓN A CUENTA DEL IRPF	3.924,28 €

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

MEJORA CREDITICIA Y PRÉSTAMO SUBORDINADO

15 de septiembre de 2016

MEJORA DE CRÉDITO		
CONCEPTOS	INICIAL	15 de septiembre de 2016
EMISIÓN SUBORDINADA	32.800.000,00 € (3,64%)	32.800.000,00 € (11,69%)
FONDO DE RESERVA	10.350.000,00 € (1,15 %)	10.350.000,00 € (3,69%)

PRÉSTAMOS SUBORDINADOS		
CONCEPTOS	INICIAL	15 de septiembre de 2016
PRÉSTAMO SUBORDINADO SCH		
Saldo vivo	5.612.500,00 €	5.175.003,26 €
Tipo de interés	2,682 %	0,248%
PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB		
Saldo vivo	5.612.500,00 €	5.175.003,26 €
Tipo de interés	2,682 %	0,248%

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

DEFINICIONES

15 de septiembre de 2016

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).

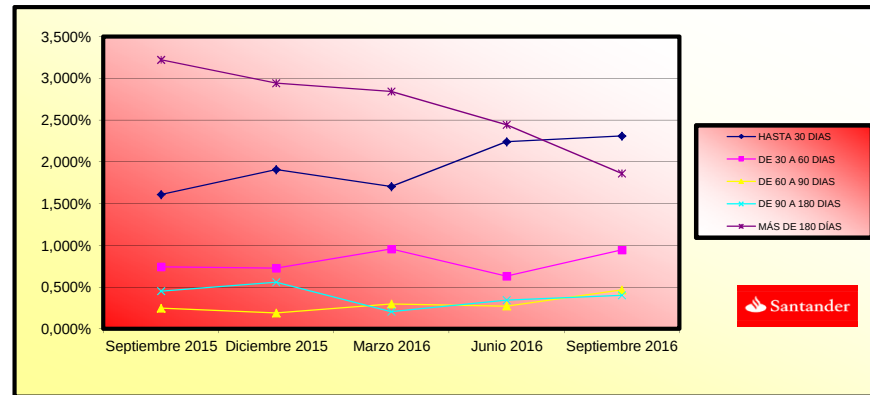
PÉRDIDAS DE LA CARTERA Aquellos préstamos cuya deuda el Cedente considera que no va a recuperar (neto de recuperaciones).

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

**FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA
UCI 12**

INFORME HISTÓRICO DE MOROSIDAD

MOROSIDAD HISTÓRICA					
	Septiembre 2015	Diciembre 2015	Marzo 2016	Junio 2016	Septiembre 2016
HASTA 30 DIAS	1,607%	1,907%	1,702%	2,241%	2,310%
DE 30 A 60 DIAS	0,743%	0,725%	0,956%	0,631%	0,945%
DE 60 A 90 DIAS	0,248%	0,191%	0,297%	0,273%	0,467%
DE 90 A 180 DIAS	0,450%	0,559%	0,205%	0,345%	0,402%
MÁS DE 180 DIAS	3,220%	2,940%	2,841%	2,444%	1,861%



**FONDO DE TITULIZACIÓN HIPOTECARIA
UCI 12**

INFORME RELATIVO A LOS TRIGGERS DEL FONDO

Fecha: 15 de septiembre de 2016

AMORTIZACIÓN BONOS SERIE B Y C	
SI 1) ES MAYOR QUE 2) NO SE AMORTIZAN LAS SERIES B y C	
1) PH'S EN MOROSIDAD > 90 DÍAS	18.550.419,74 €
2) 2% SALDO PH'S ACTUAL	5.611.337,25 €

MOROSIDAD ACTUAL (% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO)
6,61%

NO SE AMORTIZAN LAS SERIES B Y C

TRIGGERS FONDOS DE RESERVA	
SI 1) ES MAYOR QUE 2) NO SE AMORTIZA EL FONDO DE RESERVA	
1) TIPO MEDIO PONDERADO DE LOS BONOS + 0,40%	0,43%
2) TIPO MEDIO PONDERADO DE LAS PHS	2,11%

SE PUEDE AMORTIZAR EL FONDO DE RESERVA

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

POSTERGAMIENTO DE INTERESES DE LAS SERIES B Y C	
SI 1) ES MAYOR QUE 2)+3) LOS INTS DE LA SERIE B SE POSTERGAN AL 6 º LUGAR	
1) SALDO DE LA SERIE A	240.857.602,24 €
2) SALDO VIVO DERECHOS DE CRÉDITO (MOROSIDAD < 18 MESES)	265.205.264,98 €
3) REMANENTE F.DISPONIBLES DESPUÉS PAGO PUNTOS 1º - 3º	17.781.846,05 €
SI 1) ES MAYOR QUE 2)+3) LOS INTS DE LA SERIE C SE POSTERGAN AL 7 º LUGAR	
1) SALDOS DE LAS SERIES A Y B	249.857.602,24 €
2) SALDO VIVO DERECHOS DE CRÉDITO (MOROSIDAD < 18 MESES)	265.205.264,98 €
3) REMANENTE F.DISPONIBLES DESPUÉS PAGO PUNTOS 1º - 4º	17.761.349,49 €

NO SE POSTERGAN LOS INTERESES DE LA SERIE B

NO SE POSTERGAN LOS INTERESES DE LA SERIE C

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

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

ESTADÍSTICO DE VALORES DE TASACIÓN SOBRE SALDOS VIVOS				
INTERVALO	SALDO	% SALDOS VIVOS	Nº PRÉSTAMOS	% Nº PRÉSTAMOS
0,17 - 39,99	63.317.913,33 €	22,57%	1.183	34,61%
40,00 - 49,99	56.759.983,21 €	20,23%	617	18,05%
50,00 - 59,99	76.257.472,93 €	27,18%	834	24,40%
60,00 - 69,99	59.030.431,22 €	21,04%	585	17,12%
70,00 - 79,95	25.201.200,12 €	8,98%	199	5,82%

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

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

01-07-12	746.028.531,07	348.487.505,91	58,02%	46,71%	0,89%	10,19%	-0,04%	-0,46%
01-08-12	743.979.156,35	346.553.096,70	57,65%	46,58%	0,88%	10,11%	0,28%	3,32%
01-09-12	741.923.069,93	345.608.681,25	57,28%	46,58%	0,87%	10,00%	0,00%	-0,05%
01-10-12	739.860.249,83	344.452.156,05	56,92%	46,56%	0,86%	9,90%	0,06%	0,68%
01-11-12	737.790.673,99	342.846.050,04	56,55%	46,47%	0,86%	9,82%	0,19%	2,22%
01-12-12	735.714.320,29	341.651.841,92	56,19%	46,44%	0,85%	9,72%	0,07%	0,80%
01-01-13	733.639.620,24	339.808.674,30	55,83%	46,32%	0,84%	9,65%	0,26%	3,05%
01-02-13	731.558.125,54	338.685.022,02	55,48%	46,30%	0,83%	9,56%	0,05%	0,56%
01-03-13	729.469.813,95	337.592.709,88	55,12%	46,28%	0,83%	9,46%	0,04%	0,45%
01-04-13	727.374.663,14	336.661.580,32	54,77%	46,28%	0,82%	9,37%	-0,01%	-0,14%
01-05-13	725.272.650,71	334.732.793,17	54,42%	46,15%	0,81%	9,31%	0,28%	3,36%
01-06-13	723.163.754,19	333.439.234,72	54,07%	46,11%	0,80%	9,22%	0,10%	1,15%
01-07-13	721.052.834,40	332.097.459,56	53,73%	46,06%	0,80%	9,15%	0,11%	1,32%
01-08-13	718.935.001,34	330.388.322,56	53,39%	45,96%	0,79%	9,08%	0,22%	2,63%
01-09-13	716.810.232,38	329.343.544,45	53,05%	45,95%	0,78%	9,00%	0,02%	0,25%
01-10-13	714.678.504,80	328.221.731,31	52,71%	45,93%	0,78%	8,92%	0,04%	0,52%
01-11-13	712.539.795,82	326.574.366,10	52,37%	45,83%	0,77%	8,85%	0,20%	2,41%
01-12-13	710.394.082,56	324.772.662,75	52,04%	45,72%	0,76%	8,80%	0,25%	2,97%
01-01-14	708.248.288,98	323.075.181,05	51,70%	45,62%	0,76%	8,74%	0,22%	2,62%
01-02-14	706.095.467,93	321.726.709,52	51,37%	45,56%	0,75%	8,67%	0,11%	1,36%
01-03-14	703.935.596,38	320.000.368,88	51,05%	45,46%	0,75%	8,62%	0,23%	2,74%
01-04-14	701.768.651,26	318.111.923,24	50,72%	45,33%	0,74%	8,57%	0,28%	3,35%
01-05-14	699.594.609,40	316.632.236,49	50,40%	45,26%	0,74%	8,51%	0,16%	1,85%
01-06-14	697.413.447,54	315.007.844,30	50,07%	45,17%	0,73%	8,45%	0,20%	2,40%
01-07-14	695.238.923,74	313.592.274,11	49,76%	45,11%	0,73%	8,39%	0,14%	1,64%
01-08-14	693.057.278,37	311.744.642,03	49,44%	44,98%	0,72%	8,35%	0,28%	3,27%
01-09-14	690.868.488,11	310.421.098,90	49,12%	44,93%	0,72%	8,29%	0,11%	1,30%
01-10-14	688.672.529,56	309.283.048,19	48,81%	44,91%	0,71%	8,22%	0,05%	0,59%
01-11-14	686.469.379,25	307.789.395,30	48,50%	44,84%	0,71%	8,17%	0,16%	1,95%
01-12-14	684.259.013,62	306.183.212,57	48,19%	44,75%	0,70%	8,12%	0,20%	2,38%
01-01-15	682.080.167,33	304.099.561,19	47,88%	44,58%	0,70%	8,08%	0,36%	4,27%
01-02-15	679.894.185,31	302.468.663,72	47,57%	44,49%	0,70%	8,04%	0,22%	2,57%
01-03-15	677.701.044,21	301.282.256,52	47,27%	44,46%	0,69%	7,98%	0,07%	0,84%
01-04-15	675.500.720,57	300.037.216,53	46,97%	44,42%	0,69%	7,92%	0,09%	1,06%
01-05-15	673.293.190,87	298.300.877,19	46,67%	44,30%	0,68%	7,88%	0,25%	2,99%
01-06-15	671.078.431,51	296.889.324,00	46,37%	44,24%	0,68%	7,83%	0,14%	1,72%
01-07-15	668.859.344,07	294.780.954,64	46,07%	44,07%	0,67%	7,80%	0,38%	4,47%
01-08-15	666.632.989,12	292.914.638,84	45,78%	43,94%	0,67%	7,77%	0,30%	3,56%
01-09-15	664.399.342,86	290.999.551,09	45,49%	43,80%	0,67%	7,74%	0,32%	3,77%
01-10-15	662.158.381,40	289.171.414,49	45,20%	43,67%	0,67%	7,70%	0,29%	3,45%
01-11-15	659.910.080,80	287.238.885,27	44,91%	43,53%	0,66%	7,67%	0,33%	3,89%
01-12-15	657.654.417,01	285.255.155,43	44,62%	43,37%	0,66%	7,65%	0,35%	4,12%
01-01-16	655.395.684,56	283.652.213,84	44,34%	43,28%	0,66%	7,61%	0,22%	2,60%
01-02-16	653.129.554,75	281.782.417,97	44,05%	43,14%	0,65%	7,58%	0,31%	3,71%
01-03-16	650.856.003,37	279.744.352,79	43,77%	42,98%	0,65%	7,55%	0,38%	4,43%
01-04-16	648.575.006,10	278.051.660,77	43,49%	42,87%	0,65%	7,52%	0,26%	3,02%
01-05-16	646.286.538,58	276.251.661,62	43,22%	42,74%	0,65%	7,49%	0,30%	3,49%
01-06-16	643.990.576,32	273.657.628,59	42,94%	42,49%	0,65%	7,49%	0,59%	6,81%
01-07-16	641.699.319,55	271.460.205,67	42,67%	42,30%	0,64%	7,47%	0,45%	5,25%
01-08-16	639.400.558,91	269.920.488,18	42,39%	42,21%	0,64%	7,43%	0,21%	2,49%
01-09-16	637.094.269,84	268.365.816,93	42,12%	42,12%	0,64%	7,40%	0,22%	2,56%

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
									4,71		8,25		8,25
Date		Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	Average Life Class A	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C
		900.000.000,00											
03-06-05		900.000.000,00			867.200.000	9.000.000	23.800.000						
08-07-05	0	892.684.797,55	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	885.421.199,94	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	878.208.868,89	878.208.862,32	21.791.137,68	867.200.000	9.000.000	23.800.000	21.791.137,68	-8755679119142,67%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-05	1	871.047.461,80	0,00	0,00	845.408.862	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-05	0	863.936.638,30	0,00	0,00	845.408.862	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-05	1	856.876.060,26	856.876.053,69	21.332.808,63	845.408.862	9.000.000	23.800.000	21.332.808,63	-8377393950507,97%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-06	0	849.865.391,72	0,00	0,00	824.076.054	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-06	0	842.904.298,95	0,00	0,00	824.076.054	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-06	1	835.992.450,38	835.992.443,81	20.883.609,88	824.076.054	9.000.000	23.800.000	20.883.609,88	-8013041109090,24%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-06	0	829.129.516,60	0,00	0,00	803.192.444	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-06	0	822.315.170,37	0,00	0,00	803.192.444	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-06	1	815.549.086,55	815.549.079,98	20.443.363,84	803.192.444	9.000.000	23.800.000	20.443.363,84	-7656039756338,81%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-06	0	808.831.816,19	0,00	0,00	782.749.080	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-06	0	802.162.156,05	0,00	0,00	782.749.080	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-06	1	795.539.787,40	795.539.780,83	20.009.299,14	782.749.080	9.000.000	23.800.000	20.009.299,14	-7309396977439,26%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-06	0	788.964.393,60	0,00	0,00	762.739.781	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-06	0	782.435.660,05	0,00	0,00	762.739.781	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-06	1	775.953.274,24	775.953.267,67	19.586.513,17	762.739.781	9.000.000	23.800.000	19.586.513,17	-6976715990221,98%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-07	0	769.516.925,66	0,00	0,00	743.153.268	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-07	0	763.126.305,88	0,00	0,00	743.153.268	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-07	1	756.781.108,43	756.781.101,86	19.172.165,81	743.153.268	9.000.000	23.800.000	19.172.165,81	-6656575968077,38%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-07	0	750.481.028,88	0,00	0,00	723.981.102	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-07	0	744.225.764,77	0,00	0,00	723.981.102	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-07	1	738.015.015,63	738.015.009,06	18.766.092,80	723.981.102	9.000.000	23.800.000	18.766.092,80	-6342939366615,63%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-07	0	731.848.912,94	0,00	0,00	705.215.009	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-07	0	725.726.726,05	0,00	0,00	705.215.009	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-07	1	719.648.160,36	719.648.153,79	18.366.855,27	705.215.009	9.000.000	23.800.000	18.366.855,27	-6039022013503,20%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-07	0	713.612.923,19	0,00	0,00	686.848.154	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-07	0	707.620.723,79	0,00	0,00	686.848.154	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-07	1	701.671.273,31	701.671.266,74	17.976.887,05	686.848.154	9.000.000	23.800.000	17.976.887,05	-5747210788482,42%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-08	0	695.764.284,77	0,00	0,00	668.871.267	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-08	0	689.899.473,08	0,00	0,00	668.871.267	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-08	1	684.076.555,00	684.076.548,43	17.594.718,31	668.871.267	9.000.000	23.800.000	17.594.718,31	-5464919506251,04%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-08	0	678.295.249,17	0,00	0,00	651.276.548	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-08	0	672.555.276,04	0,00	0,00	651.276.548	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-08	1	666.856.357,91	666.856.351,34	17.220.197,09	651.276.548	9.000.000	23.800.000	17.220.197,09	-5190167404357,05%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-08	0	661.198.218,87	0,00	0,00	634.056.351	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-08	0	655.580.584,85	0,00	0,00	634.056.351	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-08	1	650.003.183,54	650.003.176,97	16.853.174,37	634.056.351	9.000.000	23.800.000	16.853.174,37	-4924497550991,09%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-08	0	644.465.744,43	0,00	0,00	617.203.177	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-08	0	638.967.998,77	0,00	0,00	617.203.177	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-08	1	633.509.679,57	633.509.673,00	16.493.503,97	617.203.177	9.000.000	23.800.000	16.493.503,97	-4669310972529,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-09	0	628.091.589,80	0,00	0,00	600.709.673	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-09	0	622.712.387,59	0,00	0,00	600.709.673	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-09	1	617.371.811,24	617.371.804,67	16.137.868,34	600.709.673	9.000.000	23.800.000	16.137.868,34	-4423389711032,87%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-09	0	612.069.600,74	0,00	0,00	584.571.805	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-09	0	606.805.497,81	0,00	0,00	584.571.805	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-09	1	601.579.245,86	601.579.239,29	15.792.565,38	584.571.805	9.000.000	23.800.000	15.792.565,38	-4183450568492,98%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-09	0	596.392.437,27	0,00	0,00	568.779.239	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-09	0	591.242.953,90	0,00	0,00	568.779.239	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-09	1	586.130.544,30	586.130.537,73	15.448.701,56	568.779.239	9.000.000	23.800.000	15.448.701,56	-3950232988176,45%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-09	0	581.054.958,65	0,00	0,00	553.330.538	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-09	0	576.015.948,76	0,00	0,00	553.330.538	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-09	1	571.013.268,08	571.013.261,51	15.117.276,22	553.330.538	9.000.000	23.800.000	15.117.276,22	-3727920316683,18%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-10	0	566.048.087,42	0,00	0,00	538.213.262	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-10	0	561.118.734,23	0,00	0,00	538.213.262	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-03-10	1	556.224.966,87	556.224.960,30	14.788.301,21	538.213.262	9.000.000	23.800.000	14.788.301,21	-3513700366665,57%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-04-10	0	551.366.545,28	0,00	0,00	523.424.960	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-05-10	0	546.543.230,96	0,00	0,00	523.424.960	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-06-10	1	541.754.787,00	541.754.780,43	14.470.179,87	523.424.960	9.000.000	23.800.000	14.470.179,87	-3304989082502,76%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-07-10	0	537.001.792,44	0,00	0,00	508.954.780	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-08-10	0	532.283.191,29	0,00	0,00	508.954.780	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-09-10	1	527.598.751,32	527.598.744,75	14.156.035,68	508.954.780	9.000.000	23.800.000	14.156.035,68	-3103003021583,51%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-10-10	0	522.948.241,80	0,00	0,00	494.798.745	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-11-10	0	518.331.433,53	0,00	0,00	494.798.745	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-12-10	1	513.748.098,82	513.748.092,25	13.850.652,50	494.798.745	9.000.000	23.800.000	13.850.652,50	-2910022091006,12%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-01-11	0	509.200.820,98	0,00	0,00	480.948.092	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
08-02-11	0	504.686.539,03	0,00	0,00	480.948.092	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%</

									4,71			8,25			8,25
Date		Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	Average Life Class A	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C		
08-06-12	1	436.830.668,17	436.830.661,60	12.112.687,33	416.143.349	9.000.000	23.800.000	12.112.687,33	-1881100342302,71%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-07-12	0	432.856.861,24	0,00	0,00	404.030.662	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-08-12	0	428.912.131,27	0,00	0,00	404.030.662	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-09-12	1	424.996.281,04	424.996.274,47	11.834.387,12	404.030.662	9.000.000	23.800.000	11.834.387,12	-1729003958806,94%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-10-12	0	421.109.114,62	0,00	0,00	392.196.274	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-11-12	0	417.250.437,35	0,00	0,00	392.196.274	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-12-12	1	413.420.055,87	413.420.049,30	11.576.225,18	392.196.274	9.000.000	23.800.000	11.576.225,18	-1585942849002,45%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-01-13	0	409.622.498,15	0,00	0,00	380.620.049	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-02-13	0	405.852.808,38	0,00	0,00	380.620.049	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-03-13	1	402.110.797,33	402.110.790,76	11.309.258,54	380.620.049	9.000.000	23.800.000	11.309.258,54	-1447585093233,69%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-04-13	0	398.396.276,97	0,00	0,00	369.310.791	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-05-13	0	394.709.060,55	0,00	0,00	369.310.791	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-06-13	1	391.048.962,53	391.048.955,96	11.061.834,80	369.310.791	9.000.000	23.800.000	11.061.834,80	-1314145974020,21%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-07-13	0	387.418.422,38	0,00	0,00	358.248.956	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-08-13	0	383.814.608,24	0,00	0,00	358.248.956	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-09-13	1	380.237.338,38	380.237.331,81	10.811.624,15	358.248.956	9.000.000	23.800.000	10.811.624,15	-1184954006691,88%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-10-13	0	376.686.432,27	0,00	0,00	347.437.332	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-11-13	0	373.161.710,58	0,00	0,00	347.437.332	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-12-13	1	369.662.995,15	369.662.988,58	10.574.343,23	347.437.332	9.000.000	23.800.000	10.574.343,23	-1062721494536,66%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-01-14	0	366.193.700,82	0,00	0,00	336.862.989	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-02-14	0	362.750.025,76	0,00	0,00	336.862.989	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-03-14	1	359.331.795,56	359.331.788,99	10.331.199,59	336.862.989	9.000.000	23.800.000	10.331.199,59	-945304762132,09%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-04-14	0	355.938.836,96	0,00	0,00	326.531.789	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-05-14	0	352.570.977,84	0,00	0,00	326.531.789	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-06-14	1	349.228.047,18	349.228.040,61	10.103.748,38	326.531.789	9.000.000	23.800.000	10.103.748,38	-831538491679,52%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-07-14	0	345.916.732,06	0,00	0,00	316.428.041	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-08-14	0	342.629.941,57	0,00	0,00	316.428.041	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-09-14	1	339.367.508,55	339.367.501,98	9.860.538,64	316.428.041	9.000.000	23.800.000	9.860.538,64	-720805374270,27%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-10-14	0	336.129.266,94	0,00	0,00	306.567.502	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-11-14	0	332.915.051,78	0,00	0,00	306.567.502	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-12-14	1	329.724.699,20	329.724.692,63	9.642.809,35	306.567.502	9.000.000	23.800.000	9.642.809,35	-617139798237,77%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-01-15	0	326.576.603,67	0,00	0,00	296.924.693	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-02-15	0	323.451.869,65	0,00	0,00	296.924.693	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-03-15	1	320.350.337,79	320.350.331,22	9.374.361,41	296.924.693	9.000.000	23.800.000	9.374.361,41	-515589877476,81%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-04-15	0	317.271.849,79	0,00	0,00	287.550.331	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-05-15	0	314.216.248,38	0,00	0,00	287.550.331	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-06-15	1	311.183.377,34	311.183.370,77	9.166.960,45	287.550.331	9.000.000	23.800.000	9.166.960,45	-419846788568,05%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-07-15	0	308.174.429,29	0,00	0,00	278.383.371	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-08-15	0	305.187.889,41	0,00	0,00	278.383.371	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-09-15	1	302.223.604,65	302.223.598,08	8.959.772,69	278.383.371	9.000.000	23.800.000	8.959.772,69	-327927680461,50%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-10-15	0	299.281.422,96	0,00	0,00	269.423.598	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-11-15	0	296.361.193,28	0,00	0,00	269.423.598	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-12-15	1	293.462.765,56	293.462.758,99	8.760.839,09	269.423.598	9.000.000	23.800.000	8.760.839,09	-240923075005,20%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-01-16	0	290.587.905,51	0,00	0,00	260.662.759	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-02-16	0	287.734.532,05	0,00	0,00	260.662.759	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-03-16	1	284.902.498,21	284.902.491,64	8.560.267,35	260.662.759	9.000.000	23.800.000	8.560.267,35	-157508919292,99%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-04-16	0	282.091.657,97	0,00	0,00	252.102.492	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-05-16	0	279.301.866,31	0,00	0,00	252.102.492	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-06-16	1	276.532.979,12	276.532.972,55	8.369.519,09	252.102.492	9.000.000	23.800.000	8.369.519,09	-76999575611,87%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-07-16	0	273.790.069,15	0,00	0,00	243.732.973	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-08-16	0	271.067.728,72	0,00	0,00	243.732.973	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-09-16	1	268.365.816,93	268.365.810,36	8.167.162,19	243.732.973	9.000.000	23.800.000	8.167.162,19	0,00	0,00%	0,00%	0,00	0,00%		
08-10-16	0	265.684.193,84	0,00	0,00	235.565.810	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-11-16	0	263.022.720,40	0,00	0,00	235.565.810	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-12-16	1	260.381.258,51	260.381.251,94	7.984.558,42	235.565.810	9.000.000	23.800.000	7.984.558,42	72659481593,95%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-01-17	0	257.764.558,59	0,00	0,00	227.581.252	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-02-17	0	255.167.550,21	0,00	0,00	227.581.252	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%		
08-03-17	1	252.590.098,32	252.590.091,75	7.791.160,19	227.581.252	9.000.000	23.800.000	7.791.160,19	141019999457,73%	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	4,71		Redemption Class B	8,25		Redemption Class C	8,25	
									Average Life Class A			Average Life Class B			Average Life Class C	
08-04-17	0	250.032.068,76	0,00	0,00	219.790.092	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
08-05-17	0	247.493.328,24	0,00	0,00	219.790.092	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
08-06-17	1	244.973.744,37	244.973.737,80	7.616.353,95	219.790.092	9.000.000	23.800.000	7.616.353,95	207926462806,32%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
08-07-17	0	242.476.695,07	0,00	0,00	212.173.738	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
08-08-17	0	239.998.506,85	0,00	0,00	212.173.738	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
08-09-17	1	237.539.050,17	237.539.043,60	7.434.694,20	212.173.738	9.000.000	23.800.000	7.434.694,20	271366338283,61%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
08-10-17	0	235.098.196,35	0,00	0,00	204.739.044	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
08-11-17	0	232.675.817,54	0,00	0,00	204.739.044	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
08-12-17	1	230.271.786,74	230.271.780,17	7.267.263,43	204.739.044	9.000.000	23.800.000	7.267.263,43	331387212512,14%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
07-01-18	1	227.889.373,54	0,00	0,00	197.471.780	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-02-18	1	225.525.024,58	0,00	0,00	197.471.780	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
08-03-18	1	223.178.615,60	223.178.609,03	7.093.171,14	197.471.780	9.000.000	23.800.000	7.093.171,14	387287144297,86%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
07-04-18	1	220.850.023,17	0,00	0,00	190.378.609	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
07-05-18	1	218.539.124,67	0,00	0,00	190.378.609	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-06-18	1	216.245.798,30	216.245.791,73	6.932.817,30	190.378.609	9.000.000	23.800.000	6.932.817,30	440927180295,36%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-07-18	0	213.974.364,72	0,00	0,00	183.445.792	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-08-18	0	211.720.219,80	0,00	0,00	183.445.792	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-09-18	1	209.483.244,46	209.483.237,89	6.762.553,84	183.445.792	9.000.000	23.800.000	6.762.553,84	492313919379,03%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-10-18	0	207.263.320,39	0,00	0,00	176.883.238	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-11-18	0	205.060.330,07	0,00	0,00	176.883.238	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-12-18	1	202.874.156,75	202.874.150,18	6.609.087,72	176.883.238	9.000.000	23.800.000	6.609.087,72	541284283938,51%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-01-19	0	200.710.075,09	0,00	0,00	170.074.150	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-02-19	0	198.562.527,96	0,00	0,00	170.074.150	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-03-19	1	196.431.401,32	196.431.394,75	6.442.755,43	170.074.150	9.000.000	23.800.000	6.442.755,43	585646468525,38%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-04-19	0	194.316.581,84	0,00	0,00	163.631.395	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-05-19	0	192.217.956,96	0,00	0,00	163.631.395	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-06-19	1	190.135.414,88	190.135.408,31	6.295.986,43	163.631.395	9.000.000	23.800.000	6.295.986,43	630228242059,22%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-07-19	0	188.083.319,26	0,00	0,00	157.335.408	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-08-19	0	186.046.947,32	0,00	0,00	157.335.408	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-09-19	1	184.026.190,47	184.026.183,90	6.109.224,42	157.335.408	9.000.000	23.800.000	6.109.224,42	667738228827,89%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-10-19	0	182.020.940,84	0,00	0,00	151.226.184	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-11-19	0	180.031.091,28	0,00	0,00	151.226.184	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-12-19	1	178.056.535,34	178.056.528,77	5.969.655,12	151.226.184	9.000.000	23.800.000	5.969.655,12	706807166592,55%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-01-20	0	176.124.087,96	0,00	0,00	145.256.529	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-02-20	0	174.206.467,32	0,00	0,00	145.256.529	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-03-20	1	172.303.570,98	172.303.564,41	5.752.964,36	145.256.529	9.000.000	23.800.000	5.752.964,36	733502956175,14%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-04-20	0	170.415.297,17	0,00	0,00	139.503.564	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-05-20	0	168.541.544,79	0,00	0,00	139.503.564	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-06-20	1	166.682.213,44	166.682.206,87	5.621.357,54	139.503.564	9.000.000	23.800.000	5.621.357,54	768439576191,25%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-07-20	0	164.839.039,96	0,00	0,00	133.882.207	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-08-20	0	163.010.071,17	0,00	0,00	133.882.207	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-09-20	1	161.195.208,76	161.195.202,19	5.487.004,68	133.882.207	9.000.000	23.800.000	5.487.004,68	800553982164,42%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-10-20	0	159.394.355,07	0,00	0,00	128.395.202	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-11-20	0	157.607.413,10	0,00	0,00	128.395.202	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-12-20	1	155.834.286,46	155.834.279,89	5.360.922,30	128.395.202	9.000.000	23.800.000	5.360.922,30	830942956649,72%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-01-21	0	154.076.667,75	0,00	0,00	123.034.280	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-02-21	0	152.332.656,54	0,00	0,00	123.034.280	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-03-21	1	150.602.158,50	150.602.151,93	5.232.127,96	123.034.280	9.000.000	23.800.000	5.232.127,96	858068984964,96%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-04-21	0	148.985.079,92	0,00	0,00	117.802.152	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-05-21	0	147.181.327,69	0,00	0,00	117.802.152	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-06-21	1	145.490.809,35	145.490.802,78	5.111.349,15	117.802.152	9.000.000	23.800.000	5.111.349,15	885285672499,33%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-07-21	0	145.490.809,35	0,00	0,00	112.690.803	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-08-21	0	145.490.809,35	0,00	0,00	112.690.803	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-09-21	1	145.490.809,35	140.500.958,14	4.989.844,65	112.690.803	9.000.000	23.800.000	4.989.844,65	910147663301,89%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-10-21	0	145.490.809,35	0,00	0,00	107.700.958	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-11-21	0	145.490.809,35	0,00	0,00	107.700.958	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-12-21	1	145.490.809,35	135.626.856,40	4.874.101,74	107.700.958	9.000.000	23.800.000	4.874.101,74	933390482480,21%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-01-22	0	134.030.807,83	0,00	0,00	102.826.856	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-02-22	0	132.447.226,90	0,00	0,00	102.826.856	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-03-22	1	130.876.033,39	130.876.026,82	4.750.829,59	102.826.856	9.000.000	23.800.000	4.750.829,59	952541332090,07%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-04-22	0	129.317.141,09	0,00	0,00	98.076.027	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-05-22	0	127.770.464,38	0,00	0,00	98.076.027	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-06-22	1	126.235.918,18	126.235.911,61	4.640.115,20	98.076.027	9.000.000	23.800.000	4.640.115,20	973032157899,63%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-07-22	0	124.715.423,84	0,00	0,00	93.435.912	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%		0,00	0,00%		0,00	0,00%	
06-08-22	0	123.206.872,49	0,00	0,00	93.435.912	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	4,71	Redemption Class B	8,25	Redemption Class C	8,25
									Average Life Class A		Average Life Class B		Average Life Class C
06-04-23	0	111.572.438,30	0,00	0,00	80.184.964	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-05-23	0	110.171.086,71	0,00	0,00	80.184.964	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-06-23	1	108.780.837,61	108.780.831,04	4.204.132,94	80.184.964	9.000.000	23.800.000	4.204.132,94	1035057529967,45%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-07-23	0	107.403.201,32	0,00	0,00	75.980.831	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-08-23	0	106.036.497,69	0,00	0,00	75.980.831	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-09-23	1	104.680.650,23	104.680.643,66	4.100.187,37	75.980.831	9.000.000	23.800.000	4.100.187,37	1047187855091,93%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-10-23	0	103.335.582,98	0,00	0,00	71.880.644	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-11-23	0	102.001.220,47	0,00	0,00	71.880.644	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-12-23	1	100.677.487,73	100.677.481,16	4.003.162,51	71.880.644	9.000.000	23.800.000	4.003.162,51	1058836483400,10%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-01-24	0	99.369.624,29	0,00	0,00	67.877.481	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-02-24	0	98.072.191,64	0,00	0,00	67.877.481	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-03-24	1	96.785.116,66	96.785.110,09	3.892.371,07	67.877.481	9.000.000	23.800.000	3.892.371,07	1064952724163,93%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-04-24	0	95.508.326,74	0,00	0,00	63.985.110	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-05-24	0	94.241.749,76	0,00	0,00	63.985.110	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-06-24	1	92.985.314,05	92.985.307,48	3.799.802,60	63.985.110	9.000.000	23.800.000	3.799.802,60	1074584176589,07%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-07-24	0	91.761.986,67	0,00	0,00	60.185.307	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-08-24	0	90.548.439,53	0,00	0,00	60.185.307	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-09-24	1	89.344.604,02	89.344.597,45	3.640.710,03	60.185.307	9.000.000	23.800.000	3.640.710,03	1063087328887,41%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-10-24	0	88.150.412,00	0,00	0,00	56.544.597	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-11-24	0	86.965.795,78	0,00	0,00	56.544.597	9.000.000	23.800.000	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
06-12-24	1	85.790.688,12	-6,57	89.344.604,02	56.544.597	9.000.000	23.800.000	56.544.597,45	17025578293257,20%	9.000.000,00	2709900000000,00%	23.800.000,00	7166180000000,00%