

F.T.A. U.C.I. 14

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.A. U.C.I. 14	
INFORMACIÓN CORRESPONDIENTE AL:		TRIMESTRE/SEMESTRE:	AÑO:
		21/03/2016 - 20/06/2016	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	28 noviembre 2005	Agencia de pago de Bonos	BANCO SANTANDER	
Fecha de Desembolso BT's	30 noviembre 2005	Negociación Mercado	AIAF	
Fecha Final Amortización	20 junio 2043	Agencias de calificación	FITCH RATINGS	
			STANDARD & POORS	
Sociedad Gestora	SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.	Calificación	Inicial	Actual
	UNIÓN DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, S.A	B.T.A'S SERIE A	AAA/AAA	BB / BBB
		B.T.A'S SERIE B	A+/A-	B / B +
		B.T.A'S SERIE C	BBB+/BBB	CCC / B -

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO: BONOS DE TITULIZACION

SERIES PRELACIÓN CÓDIGO ISIN	Nº BONOS	NOMINAL EN CIRCULACIÓN			
			Inicial	Actual	%Act/In
B.T.A'S SERIE A ES0338341003	13.775	Nominal Unitario	100.000,00	29.211,91	
		Nominal Total	1.377.500.000,00	402.394.060,25	29,21%
B.T.A'S SERIE B ES0338341011	341	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	34.100.000,00	34.100.000,00	100,00 %
B.T.A'S SERIE C ES0338341029	384	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	38.400.000,00	38.400.000,00	100,00 %

AMORTIZACION E INTERESES BONOS					
Actual			Próximo		
Fecha Amortización Período Actual 20 de junio de 2016			Fecha Próximo Cupón 20 de septiembre de 2016		
	Amortización de los Bonos	Intereses Brutos Bonos	Tipo de Interés	Importe Bruto Próximo Cupón	Importe Neto Próximo Cupón
B.T.A'S SERIE A	715,87 €	0,00 €	0,000%	0,00 €	0,00 €
B.T.A'S SERIE B	0,00 €	14,16 €	0,026%	6,64 €	5,38 €
B.T.A'S SERIE C	0,00 €	87,46 €	0,316%	80,76 €	65,41 €
Amortización devengada no pagada	0,00 €				
Amortización Calendario	NO				

III. ACTIVOS ADQUIRIDOS POR EL FONDO: DERECHOS DE CRÉDITO

DERECHOS DE CRÉDITO	A LA EMISIÓN	SITUACIÓN ACTUAL
Número de Derechos de Crédito	16.742	7.554
Saldo Pendiente de Amortizar Derechos	1.450.000.117,58 €	520.970.897,03 €
Importes Unitarios Derechos Vivos	86.608,54 €	68.966,23 €
Tipos de Interés	4,08 %	2,35%

TASAS DE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA	SITUACIÓN ACTUAL
Tasa mensual actual anualizada:	3,01%
Tasa últimos 12 meses anualizada:	4,50%
Tasa anualizada desde Constitución del Fondo	7,57%

MOROSIDAD ACTUAL	Hasta 1 mes	De 1 a 6 meses	Mayor de 6 meses
Deuda Vencida(Principal+Intereses)	38.060,64 €	135.706,73 €	5.988.074,65 €
Deuda Pendiente de vencimiento	0,00 €	0,00 €	518.337.101,70 €
Deuda Total	38.060,64 €	135.706,73 €	524.325.176,35 €

F.T.A. U.C.I. 14**INFORME TRIMESTRAL BONOS DE TITULIZACIÓN****20 de junio de 2016****BONOS TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. PRINCIPAL**

Saldo anterior	484.755.169,50 €
Amortizaciones	9.861.109,25 €
Saldo actual	474.894.060,25 €
% sobre saldo inicial	32,75%
Amortización devengada no pagada	0,00 €

BONOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. INTERESES

Intereses pagados Serie A	0,00 €
Intereses pagados Serie B	4.828,56 €
Intereses pagados Serie C	33.584,64 €
Intereses devengados no pagados	0,00 €

DATOS

Fecha de determinación	13/06/2016
Fecha de Pago de Cupón Actual	20/06/2016
Fecha de Pago de Cupón Anterior	21/03/2016
Número de días	91
Tipo de referencia (%)	-0,264%
Próxima Fecha de Pago	20/09/2016

VIDA RESIDUAL (AÑOS)

	INICIAL	20/06/2016
B.T.A'S SERIE A	4,81	4,97
B.T.A'S SERIE B	8,13	9,51
B.T.A'S SERIE C	8,13	9,51

F.T.A. U.C.I. 14

INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

20 de junio de 2016

DERECHOS DE CRÉDITO. PRINCIPAL	
Saldo anterior	530.699.380,70 €
Amortizaciones	9.728.483,67 €
Saldo actual	520.970.897,03 €
Número de derechos de crédito	7.554
LTV	55,75%

DERECHOS DE CRÉDITO. INTERESES	
Intereses cobrados en el trimestre	2.570.069,14 €
Intereses devengados en el trimestre	2.546.041,99 €

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	21.406,98 €	14.871,38 €	21.871,50 €	41.463,40 €	2.534.182,07 €
Intereses	16.653,66 €	14.972,33 €	14.051,08 €	28.477,04 €	3.453.892,58 €
Saldo de los derechos de crédito	11.959.102,71 €	4.748.250,52 €	3.127.903,82 €	3.654.120,20 €	19.037.826,29 €
Número de derechos de crédito	127	51	34	51	554
% sobre saldo de los derechos de crédito	2,30%	0,91%	0,60%	0,70%	3,65%

PRÉSTAMOS EN WRITE OFF	
Write Off acumulado Fecha Pago anterior	45.944.176,61 €
Write Off trimestre	132.714,48 €
Write Off acumulados actuales	46.076.891,09 €

F.T.A. U.C.I. 14

INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

20 de junio de 2016

ADJUDICADOS

Saldo anterior	22.462.440,64 €
Diferencia	-212.407,38 €
Saldo actual	22.250.033,26 €
Número derechos de credito adjudicados	463

PERDIDAS DE LA CARTERA

Saldo anterior	27.956.009,21 €
Diferencia	1.725.629,83 €
Saldo actual	29.681.639,04 €

F.T.A. U.C.I. 14

ESTADO DE ORIGEN Y APLICACIÓN DE FONDOS Y CUENTA DE TESORERÍA

20 de junio de 2016

ORIGEN	10.739.137,26 €
PRINCIPAL COBRADO	
Amortización derechos de crédito	6.604.214,54 €
INTERESES COBRADOS	
Intereses de derechos de crédito	2.570.069,14 €
Intereses de reinversión	-19.183,53 €
INGRESOS/GASTOS DE ADJUDICADOS	1.302.802,11 €
INGRESOS/GASTOS DE CANTIDADES ASEGURADAS	281.735,00 €
OTROS	-500,00 €

ESTADO CUENTA DE TESORERÍA	21.757.299,37 €
FONDO DE RESERVA	
Saldo anterior	21.750.000,00 €
Reposición en el período	0,00 €
Saldo actual	21.750.000,00 €
RETENCIÓN A CUENTA DEL IRPF	7.299,37 €

APLICACIÓN	10.739.137,26 €
GASTOS ORDINARIOS	13.535,02 €
COMISIÓN S.G.F.T.	22.962,79 €
PAGO SWAP	0,00 €
COBRO SWAP	0,00 €
INTERESES B.T.A'S SERIE A	0,00 €
INTERESES B.T.A'S SERIE B	4.828,56 €
INTERESES B.T.A'S SERIE C	33.584,64 €
FONDOS DISPONIBLES AMORTIZACIÓN A	9.861.109,25 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO SANTANDER	10.887,51 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB	10.887,51 €
AMORTIZACIÓN PRÉSTAMO SUBORDINADO SANTANDER	0,00 €
AMORTIZACIÓN PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB	0,00 €
COMISIONES A FAVOR DE UCI	781.341,98 €

F.T.A. U.C.I. 14

MEJORA CREDITICIA Y PRÉSTAMO SUBORDINADO

20 de junio de 2016

MEJORA DE CRÉDITO		
CONCEPTOS	INICIAL	20 de junio de 2016
EMISIÓN SUBORDINADA	72.500.000,00 € (5,00%)	72.500.000,00 € (13,92%)
FONDO DE RESERVA	21.750.000,00 € (1,50 %)	21.750.000,00 € (4,17%)

PRÉSTAMOS SUBORDINADOS		
CONCEPTOS	INICIAL	20 de junio de 2016
PRÉSTAMO SUBORDINADO SCH		
Saldo vivo	11.460.000,00 €	10.876.629,31 €
Tipo de interés	3,132 %	0,366%
PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB		
Saldo vivo	11.460.000,00 €	10.876.629,31 €
Tipo de interés	3,132 %	0,366%

F.T.A. U.C.I. 14

DEFINICIONES

20 de junio 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.

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

WRITE OFF Préstamos con cuotas pendientes con antigüedad igual o superior a 12 ó 18 meses (según Folleto Informativo).

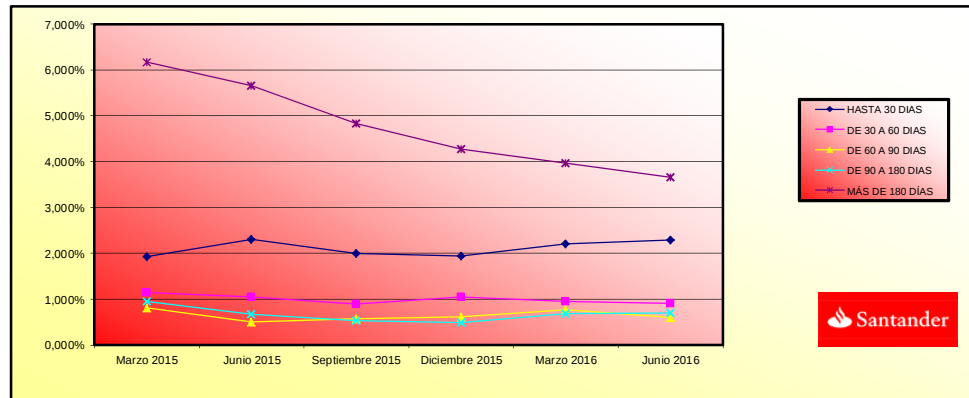
PÉRDIDAS DE LA CARTERA Aquellos préstamos cuya deuda el Cedente considera que no va a recuperar (neto de recuperaciones).

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

FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS
UCI 14

INFORME HISTÓRICO DE MOROSIDAD

MOROSIDAD HISTÓRICA						
	Marzo 2015	Junio 2015	Septiembre 2015	Diciembre 2015	Marzo 2016	Junio 2016
HASTA 30 DIAS	1,929%	2,300%	2,001%	1,936%	2,210%	2,296%
DE 30 A 60 DIAS	1,146%	1,045%	0,891%	1,046%	0,955%	0,911%
DE 60 A 90 DIAS	0,816%	0,507%	0,573%	0,618%	0,773%	0,600%
DE 90 A 180 DIAS	0,950%	0,668%	0,528%	0,492%	0,681%	0,701%
MÁS DE 180 DIAS	6,176%	5,650%	4,829%	4,271%	3,971%	3,654%



**FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
UCI 14**

Fecha: 20 de junio de 2016

INFORME RELATIVO A LOS TRIGGERS DEL FONDO

AMORTIZACIÓN BONOS SERIE B Y C	
SI 1) ES MAYOR QUE 2) NO SE AMORTIZAN LAS SERIES B y C	
1) DC'S EN MOROSIDAD > 90 DÍAS	68.768.837,58 €
2) 2% SALDO DC'S ACTUAL	10.419.417,94 €
SI 3) ES MAYOR O IGUAL QUE 4) SE AMORTIZA LA SERIE B	
3) SALDO VIVO SERIE B	34.100.000,00 €
4) 4,70% * SALDO TODAS LAS SERIES	22.320.020,83 €
SI 5) ES MAYOR O IGUAL QUE 6) SE AMORTIZA LA SERIE C	
5) SALDO VIVO SERIE C	38.400.000,00 €
6) 5,30% * SALDO TODAS LAS SERIES	25.169.385,19 €

MOROSIDAD ACTUAL (%SALDO DERECHOS DE CRÉDITO)
13,20%

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%	0,431%
2) TIPO MEDIO PONDERADO DE LAS PHS	2,35%

SE PUEDE AMORTIZAR EL FONDO DE RESERVA

NIVELES DEL FONDOS DE RESERVA SEGÚN LA MOROSIDAD		
MOROSIDAD ACTUAL < 0,75%	MAYOR DE 3% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO 0,40% DEL SALDO INICIAL DE BONOS	NA
MOROSIDAD ACTUAL ENTRE 0,75% Y 1,25%	MAYOR DE 3% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO 0,70% DEL SALDO INICIAL DE BONOS	NA
MOROSIDAD ACTUAL > 1,25%	MAYOR DE 3% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO 0,80% DEL SALDO INICIAL DE BONOS	21.750.000,00 €

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

POSTERGACIÓN DE INTERESES DE LAS SERIES B Y C	
SI 1) ES MAYOR QUE 2)+3) LOS INTS DE LA SERIE B SE POSTERGAN AL 7 º LUGAR	
1) SALDO DE LA SERIE A	412.255.169,50 €
2) SALDO VIVO DERECHOS DE CRÉDITO (SIN MOROSIDAD > 18 MESES)	465.735.962,46 €
3) REMANENTE F.DISPONIBLES DESPUÉS PAGO PUNTOS 1º - 4º	32.447.810,89 €
SI 1) ES MAYOR QUE 2)+3) LOS INTS DE LA SERIE C SE POSTERGAN AL 8 º LUGAR	
1) SALDOS DE LAS SERIES A Y B	446.355.169,50 €
2) SALDO VIVO DERECHOS DE CRÉDITO (SIN MOROSIDAD > 18 MESES)	465.735.962,46 €
3) REMANENTE F.DISPONIBLES DESPUÉS PAGO PUNTOS 1º - 5º	32.414.226,25 €

NO SE POSTERGAN LOS INTERESES DE LA SERIE B

NO SE POSTERGAN LOS INTERESES DE LA SERIE C

REMANENTE INTERESES	Importe
Saldo actual	2.475.974,60 €

SI 1.a) ES MAYOR QUE 9,60% SALDO INICIAL DC's. SE POSTERGARÁN LOS INTERESES DE LAS SERIES B ó C, EN SU CASO	NO
1.a) SALDO ACUMULADO DE PRÉSTAMOS FALLIDOS ES LA SUMA DE i) + ii)	57.414.921,31 €
i). SALDO DC's MOROSIDAD > 18 MESES	55.234.934,57 €
ii). SALDO DC's JUDICIALES CON MOROSIDAD < 18 MESES	2.179.986,74 €
PORCENTAJE ACTUAL	3,96%

CONTRATO	CONTRAPARTE	AGENCIA RATING	RATING MÍNIMO EXIGIDO	RATING ACTUAL
CUENTA TESORERÍA	BANCO SANTANDER	S&P FITCH	A-1 c/p F-1 c/p	A-2 c/p F-2 c/p
AGENTE DE PAGOS	BANCO SANTANDER	S&P FITCH	A-1 c/p F-1 c/p	A-2 c/p F-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 ACTUALES SOBRE SALDOS VIVOS				
	SALDO VIVO (MILES)	% Saldos vivos	Nº PRÉSTAMOS	% Nº de préstamos
0,35-39,99	63.802.218,76 €	13,23%	1.001	19,20%
40,00-49,99	62.330.909,28 €	12,93%	584	11,20%
50,00-59,99	94.094.536,49 €	19,52%	966	18,53%
60,00-69,99	151.404.974,34 €	31,40%	1.613	30,94%
70,00-79,99	89.970.227,36 €	18,66%	875	16,78%
80,00-96,02	20.503.256,61 €	4,25%	175	3,36%
	482.106.122,84 €	100,00%	5.214	100,00%

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	average single monthly mortality	CPR
			0.65%					4.50%
			100.00%	100.00%				
13-dic-05	1.450.000.117,58	1.412.859.697,57	99,35%	97,59%	2,41%	25,33%	2,41%	25,33%
13-ene-06	1.445.351.001,85	1.383.703.472,04	98,70%	95,73%	2,16%	23,01%	1,91%	20,62%
13-feb-06	1.443.014.992,90	1.358.330.558,42	98,05%	94,13%	2,00%	21,49%	1,67%	18,35%
13-mar-06	1.440.671.041,53	1.335.918.108,88	97,41%	92,73%	1,87%	20,27%	1,49%	16,48%
13-abr-06	1.438.319.120,72	1.304.871.180,18	96,77%	90,72%	1,93%	20,84%	2,16%	23,09%
13-may-06	1.435.959.203,38	1.277.085.439,49	96,14%	88,94%	1,94%	20,90%	1,97%	21,23%
13-jun-06	1.433.591.262,32	1.249.875.785,04	95,51%	87,18%	1,94%	20,95%	1,97%	21,23%
13-jul-06	1.431.217.099,17	1.226.356.145,95	94,88%	85,69%	1,91%	20,68%	1,72%	18,79%
13-ago-06	1.428.834.863,87	1.200.300.098,88	94,26%	84,01%	1,92%	20,74%	1,96%	21,16%
13-sep-06	1.426.444.528,96	1.186.453.304,68	93,63%	83,17%	1,83%	19,83%	0,99%	11,26%
13-oct-06	1.424.064.066,02	1.169.720.299,10	93,03%	82,14%	1,77%	19,32%	1,24%	13,93%
13-nov-06	1.421.639.450,10	1.154.361.390,51	92,43%	81,20%	1,72%	18,80%	1,15%	12,92%
13-dic-06	1.419.224.650,79	1.131.478.048,20	91,82%	79,73%	1,73%	18,87%	1,82%	19,74%
13-ene-07	1.416.803.527,62	1.110.445.302,06	91,22%	78,38%	1,73%	18,85%	1,69%	18,51%
13-feb-07	1.414.374.172,62	1.093.184.364,90	90,62%	77,29%	1,70%	18,62%	1,39%	15,41%
13-mar-07	1.411.936.357,82	1.071.935.957,92	90,03%	76,17%	1,71%	18,70%	1,83%	19,65%
13-abr-07	1.409.490.655,12	1.049.481.349,87	89,44%	74,46%	1,72%	18,79%	1,87%	20,28%
13-may-07	1.407.036.436,36	1.029.860.504,83	88,86%	73,19%	1,72%	18,78%	1,70%	18,58%
13-jun-07	1.404.573.873,25	1.008.315.091,23	88,27%	71,79%	1,73%	18,89%	1,92%	20,76%
13-jul-07	1.402.107.406,90	990.389.234,38	87,70%	70,64%	1,72%	18,83%	1,61%	17,65%
13-ago-07	1.399.632.554,56	971.827.886,48	87,12%	69,44%	1,72%	18,82%	1,70%	18,59%
13-sep-07	1.397.149.287,72	959.370.565,65	86,55%	68,67%	1,69%	18,54%	1,11%	12,51%
13-oct-07	1.394.657.577,77	948.456.114,74	85,99%	68,01%	1,66%	18,22%	0,96%	10,94%
13-nov-07	1.392.157.396,01	938.102.552,29	85,42%	67,38%	1,63%	17,91%	0,91%	10,43%
13-dic-07	1.389.648.713,63	927.600.026,82	84,87%	66,75%	1,60%	17,64%	0,94%	10,73%
13-ene-08	1.387.137.132,96	918.183.429,37	84,31%	66,19%	1,57%	17,34%	0,84%	9,58%
13-feb-08	1.384.617.133,13	909.019.361,00	83,76%	65,65%	1,55%	17,06%	0,82%	9,38%
13-mar-08	1.382.085.505,09	899.984.988,08	83,21%	65,12%	1,52%	16,79%	0,81%	9,33%
13-abr-08	1.379.551.279,72	889.941.870,48	82,67%	64,51%	1,50%	16,59%	0,93%	10,65%
13-may-08	1.377.005.427,78	883.416.847,95	82,13%	64,15%	1,47%	16,27%	0,55%	6,40%
13-jun-08	1.374.450.919,94	874.610.003,26	81,59%	63,63%	1,45%	16,05%	0,81%	9,33%
13-jul-08	1.371.895.084,42	866.773.579,98	81,05%	63,18%	1,42%	15,82%	0,71%	8,21%
13-ago-08	1.369.330.559,06	861.898.915,20	80,50%	62,94%	1,39%	15,49%	0,38%	4,42%
13-sep-08	1.366.757.314,32	860.348.893,55	80,00%	62,95%	1,35%	15,07%	-0,01%	-0,10%
13-oct-08	1.364.175.320,54	859.274.462,83	79,47%	62,99%	1,31%	14,66%	-0,06%	-0,77%
13-nov-08	1.361.584.547,98	848.467.920,19	78,95%	62,31%	1,31%	14,59%	1,07%	12,11%
13-dic-08	1.358.984.966,80	843.106.288,68	78,44%	62,04%	1,28%	14,34%	0,44%	5,18%
13-ene-09	1.356.395.192,20	837.519.966,47	77,92%	61,75%	1,26%	14,12%	0,47%	5,53%
13-feb-09	1.353.796.612,37	834.295.210,99	77,41%	61,63%	1,23%	13,84%	0,19%	2,30%
13-mar-09	1.351.189.197,37	830.432.921,08	76,91%	61,46%	1,21%	13,59%	0,27%	3,20%
13-abr-09	1.348.572.917,16	824.580.462,75	76,40%	61,14%	1,19%	13,41%	0,51%	5,98%
13-may-09	1.345.947.741,59	819.388.205,71	75,90%	60,88%	1,17%	13,22%	0,44%	5,11%
13-jun-09	1.343.313.640,43	815.413.640,43	75,41%	60,54%	1,16%	13,07%	0,47%	6,47%
13-jul-09	1.340.685.983,63	806.370.015,99	74,91%	60,15%	1,15%	12,95%	0,65%	7,53%
13-ago-09	1.338.049.392,79	799.943.040,24	74,42%	59,78%	1,14%	12,82%	0,60%	6,98%
13-sep-09	1.335.403.837,54	794.298.258,77	73,94%	59,48%	1,12%	12,67%	0,51%	5,94%
13-oct-09	1.332.749.287,41	788.665.224,64	73,45%	59,18%	1,11%	12,54%	0,51%	5,97%
13-nov-09	1.330.085.711,81	781.862.986,76	72,97%	58,78%	1,10%	12,44%	0,66%	7,88%
13-dic-09	1.327.413.080,05	777.773.784,68	72,50%	58,59%	1,09%	12,27%	0,39%	3,66%
13-ene-10	1.324.735.607,16	772.765.049,70	72,02%	58,33%	1,07%	12,13%	0,44%	5,13%
13-feb-10	1.322.049.030,87	766.527.247,34	71,55%	57,98%	1,06%	12,04%	0,61%	7,03%
13-mar-10	1.319.353.320,21	760.578.549,33	71,08%	57,65%	1,05%	11,94%	0,57%	6,67%
13-abr-10	1.316.648.444,14	753.507.029,24	70,62%	57,23%	1,05%	11,87%	0,73%	8,37%
13-may-10	1.313.934.371,49	746.087.411,88	70,15%	56,78%	1,04%	11,82%	0,79%	8,96%
13-jun-10	1.311.211.071,00	741.485.330,72	69,70%	56,55%	1,03%	11,70%	0,41%	4,86%
13-jul-10	1.308.482.797,29	732.469.793,73	69,24%	56,38%	1,03%	11,69%	1,01%	11,44%
13-ago-10	1.305.745.247,45	725.003.588,79	68,79%	55,52%	1,03%	11,65%	0,81%	9,32%
13-sep-10	1.302.998.389,95	722.192.567,12	68,34%	55,43%	1,01%	11,49%	0,18%	2,11%
13-oct-10	1.300.242.193,12	715.076.816,00	67,89%	55,00%	1,01%	11,45%	0,78%	8,92%
13-nov-10	1.297.476.625,23	710.271.040,95	67,45%	54,73%	1,00%	11,40%	0,52%	5,62%
13-dic-10	1.294.701.654,41	705.548.183,05	67,00%	54,50%	0,99%	11,35%	0,43%	5,06%
13-ene-11	1.291.918.822,88	698.797.512,36	66,57%	54,09%	0,99%	11,21%	0,74%	8,57%
13-feb-11	1.289.126.529,73	693.841.621,90	66,13%	53,82%	0,98%	11,13%	0,49%	5,77%
13-mar-11	1.286.324.742,78	689.284.335,73	65,70%	53,59%	0,97%	11,04%	0,44%	5,16%
13-abr-11	1.283.513.429,76	684.214.424,26	65,26%	53,31%	0,96%	10,96%	0,52%	6,04%
13-may-11	1.280.692.558,27	680.044.094,12	64,84%	53,10%	0,95%	10,87%	0,39%	4,59%
13-jun-11	1.277.862.095,82	675.952.257,97	64,42%	52,90%	0,95%	10,78%	0,38%	4,48%
13-jul-11	1.275.024.120,75	672.260.309,64	64,00%	52,73%	0,94%	10,68%	0,32%	3,83%
13-ago-11	1.272.176.496,56	666.715.570,28	63,58%	52,41%	0,93%	10,63%	0,60%	7,00%
13-sep-11	1.269.319.190,45	663.530.914,78	63,16%	52,27%	0,92%	10,52%	0,25%	3,00%
13-oct-11	1.266.452.169,50	662.349.937,89	62,75%	52,30%	0,91%	10,38%	-0,05%	-0,58%
13-nov-11	1.263.575.400,68	656.761.324,95	62,34%	51,98%	0,90%	10,33%	0,62%	7,17%
13-dic-11	1.260.688.850,84	651.462.798,48	61,93%	51,68%	0,90%	10,28%	0,58%	6,74%
13-ene-12	1.257.794.568,09	649.080.351,95	61,52%	51,60%	0,89%	10,17%	0,14%	1,63%
13-feb-12	1.254.890.444,78	646.482.519,21	61,12%	51,44%	0,88%	10,09%	0,32%	3,82%
13-mar-12	1.251.974.447,46	640.911.165,94	60,72%	51,18%	0,88%	10,03%	0,57%	5,75%
13-abr-12	1.249.052.542,53	639.444.675,11	60,32%	51,19%	0,87%	9,91%	-0,02%	-0,24%
13-may-12	1.246.118.696,33	635.421.343,72	59,93%	50,99%	0,86%	9,84%	0,40%	4,64%
13-jun-12	1.243.174.875,05	631.525.490,52	59,54%	50,80%	0,85%	9,78%	0,38%	4,44%
13-jul-12	1.240.236.310,21	630.093.187,15	59,15%	50,80%	0,84%	9,66%	-0,01%	-0,12%
13-ago-12	1.237.287.754,24	623.348.876,30	58,76%	50,38%	0,84%	9,66%	0,83%	9,57%
13-sep-12	1.234.329.173,18	623.211.800,45	58,39%	50,50%	0,83%	9,51%	0,92%	9,54%
13-oct-12	1.231.360.532,95	619.159.759,76	57,99%	50,31%	0,82%	9,45%	0,36%	4,28%
13-nov-12	1.228.381.799,34	617.260.008,04	57,61%	50,25%	0,82%	9,36%	0,13%	1,53%
13-dic-12	1.225.392.938,04	615.339.831,56	57,24%	50,22%	0,81%	9,27%	0,07%	0,81%
13-ene-13	1.222.396.048,18	611.642.824,87	56,86%	50,04%	0,80%	9,21%	0,36%	4,20%
13-feb-13	1.219.388.968,90	608.679.979,31	56,49%	49,92%	0,80%	9,14%	0,24%	2,83%
13-mar-13	1.216.371.665,56	606.876.055,60	56,12%	49,85%	0,79%	9,05%	0,05%	0,50%
13-abr-13	1.213.344.103,37	603.331.887,04	55,75%	49,72%	0,78%	8,99%	0,34%	3,96%
13-may-13	1.210.306.247,47	599.803.885,31	55,39%	49,56%	0,78%	8,94%	0,34%	3,95%
13-jun-13	1.207.258.062,87	597.260.037,12	55,03%	49,47%	0,77%	8,86%	0,17%	2,05%
13-jul-13	1.204.214.068,30	593.734.619,59	54,67%	49,30%	0,77%	8,81%	0,34%	3,99%
13-ago-13	1.201.159.724,16	591.361.531,48	54,31%	49,23%	0,76%	8,74%	0,15%	1,74%
13-sep-13	1.198.094.995,24	589.233.972,70	53,95%	49,18%	0,75%	8,66%	0,10%	1,25%
13-oct-13	1.195.019.846,24	585.349.405,35	53,60%	48,98%	0,75%	8,62%	0,40%	4,74%
13-nov-13	1.191.934.241,74	581.815.147,75	53,25%	48,81%	0,74%	8,57%	0,35%	4,08%
13-dic-13	1.188.838.146,18	579.161.273,38	52,90%	48,72%	0,74%	8,51%	0,20%	2,34%
13-ene-14	1.185.762.699,45	574.503.853,19	52,56%	48,45%	0,74%	8,49%	0,55%	6,36%
13-feb-14	1.182.656.762,19	571.868.995,66	52,21%	48,35%	0,73%	8,43%	0,20%	2,35%
13-mar-14	1.179.550.298,75	569.025.672,89	51,87%	48,24%	0,73%	8,38%	0,24%	2,79%
13-abr-14	1.176.433.273,33	563.383.630,51	51,53%	47,89%	0,73%	8,38%	0,73%	8,41%
13-may-14	1.173.305.650,02	558.969.821,49	51,19%	47,64%	0,72%	8,35%	0,52%	6,05%
13-jun-14	1.170.157.392,80	557.057.130,45	50,86%	47,60%	0,72%	8,28%	0,07%	0,90%
13-jul-14	1.167.043.023,56	552.651.199,40	50,52%	47,35%	0,72%	8,25%	0,07%	0,90%
13-ago-14	1.163.908.031,47	548.730.910,55	5					

Fecha		Principal disponible antes prepag	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
									4.97		9.51		9.51
Date	0	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
		1.450.000.117,58											
13-dic-05		1.447.679.095,27			1.377.500.000,00	34.100.000,00	38.400.000,00						
13-ene-06	0	1.445.351.001,85	0,00	0,00	1.377.500.000,00	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-feb-06	0	1.443.014.992,90	0,00	0,00	1.377.500.000,00	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-mar-06	1	1.440.671.041,53	1.403.335.979,54	46.664.138,04	1.377.500.000,00	34.100.000,00	38.400.000,00	46.664.138,04	-17475719696630,20%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-abr-06	0	1.438.319.120,72	0,00	0,00	1.330.835.861,96	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-may-06	0	1.435.959.203,38	0,00	0,00	1.330.835.861,96	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jun-06	1	1.433.591.262,32	1.369.209.184,81	34.126.794,73	1.330.835.861,96	34.100.000,00	38.400.000,00	34.126.794,73	-12466518114242,50%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jul-06	0	1.431.217.099,17	0,00	0,00	1.296.709.067,23	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ago-06	0	1.428.834.863,87	0,00	0,00	1.296.709.067,23	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-sep-06	1	1.426.444.528,96	1.335.817.015,44	33.392.169,37	1.296.709.067,23	34.100.000,00	38.400.000,00	33.392.169,37	-1189095151111,30%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-oct-06	0	1.424.046.066,92	0,00	0,00	1.263.316.897,86	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-nov-06	0	1.421.639.450,10	0,00	0,00	1.263.316.897,86	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-dic-06	1	1.419.224.650,79	1.303.139.336,14	32.677.679,31	1.263.316.897,86	34.100.000,00	38.400.000,00	32.677.679,31	-11339154720213,40%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ene-07	0	1.416.803.527,62	0,00	0,00	1.230.639.218,56	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-feb-07	0	1.414.374.172,62	0,00	0,00	1.230.639.218,56	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-mar-07	1	1.411.936.557,82	1.271.166.727,29	31.972.608,85	1.230.639.218,56	34.100.000,00	38.400.000,00	31.972.608,85	-10806741790414,90%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-abr-07	0	1.409.490.655,12	0,00	0,00	1.198.666.609,71	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-may-07	0	1.407.036.436,36	0,00	0,00	1.198.666.609,71	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jun-07	1	1.404.573.873,25	1.239.879.685,35	31.287.041,94	1.198.666.609,71	34.100.000,00	38.400.000,00	31.287.041,94	-10287179389560,60%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jul-07	0	1.402.107.406,90	0,00	0,00	1.167.379.567,77	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ago-07	0	1.399.632.554,56	0,00	0,00	1.167.379.567,77	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-sep-07	1	1.397.149.287,72	1.209.275.898,85	30.603.786,45	1.167.379.567,77	34.100.000,00	38.400.000,00	30.603.786,45	-9780970150726,82%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-oct-07	0	1.394.657.577,77	0,00	0,00	1.136.775.781,31	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-nov-07	0	1.392.157.396,01	0,00	0,00	1.136.775.781,31	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-dic-07	1	1.389.648.713,63	1.179.329.707,16	29.946.191,74	1.136.775.781,31	34.100.000,00	38.400.000,00	29.946.191,74	-9298292534081,69%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ene-08	0	1.387.137.192,96	0,00	0,00	1.106.829.589,58	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-feb-08	0	1.384.617.133,13	0,00	0,00	1.106.829.589,58	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-mar-08	1	1.382.088.505,09	1.150.041.966,87	29.287.740,29	1.106.829.589,58	34.100.000,00	38.400.000,00	29.287.740,29	-8827324922287,28%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-abr-08	0	1.379.551.279,72	0,00	0,00	1.077.541.849,25	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-may-08	0	1.377.005.427,78	0,00	0,00	1.077.541.849,25	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jun-08	1	1.374.450.919,94	1.121.384.877,66	28.657.089,21	1.077.541.849,25	34.100.000,00	38.400.000,00	28.657.089,21	-8373601468492,84%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jul-08	0	1.371.895.084,42	0,00	0,00	1.048.894.760,06	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ago-08	0	1.369.330.559,06	0,00	0,00	1.048.894.760,06	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-sep-08	1	1.366.757.314,32	1.093.363.296,07	28.021.581,55	1.048.894.760,06	34.100.000,00	38.400.000,00	28.021.581,55	-7930107589758,99%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-oct-08	0	1.364.175.320,54	0,00	0,00	1.020.863.178,45	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-nov-08	0	1.361.584.547,98	0,00	0,00	1.020.863.178,45	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-dic-08	1	1.358.984.966,80	1.065.946.386,07	27.416.910,00	1.020.863.178,45	34.100.000,00	38.400.000,00	27.416.910,00	-7509491649067,65%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ene-09	0	1.356.395.192,20	0,00	0,00	993.446.268,49	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-feb-09	0	1.353.796.612,37	0,00	0,00	993.446.268,49	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-mar-09	1	1.351.189.197,23	1.039.164.970,23	26.781.415,84	993.446.268,49	34.100.000,00	38.400.000,00	26.781.415,84	-709439705591,01%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-abr-09	0	1.348.572.917,16	0,00	0,00	966.664.852,65	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-may-09	0	1.345.947.741,59	0,00	0,00	966.664.852,65	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jun-09	1	1.343.313.640,43	1.012.962.536,80	26.202.433,43	966.664.852,65	34.100.000,00	38.400.000,00	26.202.433,43	-6699962228459,23%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jul-09	0	1.340.685.983,63	0,00	0,00	940.462.419,22	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ago-09	0	1.338.049.392,79	0,00	0,00	940.462.419,22	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-sep-09	1	1.335.403.837,54	987.361.534,54	25.601.002,26	940.462.419,22	34.100.000,00	38.400.000,00	25.601.002,26	-6310647057017,86%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-oct-09	0	1.332.749.287,41	0,00	0,00	914.861.416,96	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-nov-09	0	1.330.085.711,81	0,00	0,00	914.861.416,96	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-dic-09	1	1.327.413.080,05	962.315.103,17	25.046.431,36	914.861.416,96	34.100.000,00	38.400.000,00	25.046.431,36	-5946022805565,23%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ene-10	0	1.324.735.607,16	0,00	0,00	889.814.985,59	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-feb-10	0	1.322.040.030,87	0,00	0,00	889.814.985,59	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-mar-10	1	1.319.353.320,21	937.820.989,55	24.494.113,62	889.814.985,59	34.100.000,00	38.400.000,00	24.494.113,62	-5994455550687,17%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-abr-10	0	1.316.648.444,14	0,00	0,00	865.320.871,97	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-may-10	0	1.313.934.371,00	0,00	0,00	865.320.871,97	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jun-10	1	1.311.211.071,00	913.858.733,74	23.962.255,82	865.320.871,97	34.100.000,00	38.400.000,00	23.962.255,82	-5252526475597,60%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jul-10	0	1.308.482.797,25	0,00	0,00	841.358.616,16	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ago-10	0	1.305.745.247,45	0,00	0,00	841.358.616,16	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-sep-10	1	1.302.998.389,95	890.426.267,96	23.432.465,77	841.358.616,16	34.100.000,00	38.400.000,00	23.432.465,77	-4920817811894,41%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-oct-10	0	1.300.242.193,12	0,00	0,00	817.926.150,38	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-nov-10	0	1.297.476.625,23	0,00	0,00	817.926.150,38	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-dic-10	1	1.294.701.654,41	867.503.852,90	22.922.415,07	817.926.150,38	34.100.000,00	38.400.000,00	22.922.415,07	-4605113187385,79%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ene-11	0	1.291.918.822,88	0,00	0,00	795.003.735,32	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-feb-11	0	1.289.126.529,73	0,00	0,00	795.003.735,32	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-mar-11	1	1.286.324.742,78	845.084.153,00	22.419.699,85	795.003.735,32	34.100.000,00	38.400.000,00	22.419.699,85	-4302340409493,44%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-abr-11	0	1											

Date		Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	4.97 Average Life Class A	Redemption Class B	9.51 Average Life Class B	Redemption Class C	9.51 Average Life Class C
13-jun-13	1	1.207.258.062,87	664.321.142,60	18.326.555,09	610.147.580,11	34.100.000,00	38.400.000,00	18.326.555,09	-2008590437718,74%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jul-13	0	1.204.214.068,30	0,00	0,00	591.821.025,02	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ago-13	0	1.201.159.724,16	0,00	0,00	591.821.025,02	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-sep-13	1	1.198.094.995,24	646.423.057,33	17.898.085,28	591.821.025,02	34.100.000,00	38.400.000,00	17.898.085,28	-1796967761855,02%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-oct-13	0	1.195.019.846,54	0,00	0,00	573.922.939,75	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-nov-13	0	1.191.934.241,74	0,00	0,00	573.922.939,75	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-dic-13	1	1.188.838.146,18	628.920.776,28	17.502.281,05	573.922.939,75	34.100.000,00	38.400.000,00	17.502.281,05	-1597958259610,85%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ene-14	0	1.185.752.699,45	0,00	0,00	556.420.658,70	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-feb-14	0	1.182.656.762,19	0,00	0,00	556.420.658,70	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-mar-14	1	1.179.550.298,75	611.839.202,20	17.081.574,08	556.420.658,70	34.100.000,00	38.400.000,00	17.081.574,08	-1405813546991,63%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-abr-14	0	1.176.433.273,35	0,00	0,00	539.339.084,62	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-may-14	0	1.173.305.650,02	0,00	0,00	539.339.084,62	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jun-14	1	1.170.167.392,80	595.136.315,91	16.702.886,29	539.339.084,62	34.100.000,00	38.400.000,00	16.702.886,29	-1220980987565,60%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jul-14	0	1.167.043.023,56	0,00	0,00	522.636.198,33	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ago-14	0	1.163.908.031,47	0,00	0,00	522.636.198,33	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-sep-14	1	1.160.762.380,40	578.841.165,85	16.295.150,06	522.636.198,33	34.100.000,00	38.400.000,00	16.295.150,06	-1041260088667,17%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-oct-14	0	1.157.606.034,12	0,00	0,00	506.341.048,27	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-nov-14	0	1.154.438.956,26	0,00	0,00	506.341.048,27	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-dic-14	1	1.151.261.110,34	562.908.160,39	15.933.005,47	506.341.048,27	34.100.000,00	38.400.000,00	15.933.005,47	-873128699517,34%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ene-15	0	1.148.090.486,41	0,00	0,00	490.408.042,81	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-feb-15	0	1.144.909.082,36	0,00	0,00	490.408.042,81	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-mar-15	1	1.141.716.861,53	547.355.832,57	15.552.327,81	490.408.042,81	34.100.000,00	38.400.000,00	15.552.327,81	-712296613864,38%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-abr-15	0	1.138.513.787,16	0,00	0,00	474.855.714,99	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-may-15	0	1.135.299.822,33	0,00	0,00	474.855.714,99	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jun-15	1	1.132.074.930,02	532.150.081,82	15.205.750,75	474.855.714,99	34.100.000,00	38.400.000,00	15.205.750,75	-556530477377,63%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jul-15	0	1.128.884.701,01	0,00	0,00	459.649.964,24	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ago-15	1	1.125.683.625,21	0,00	0,00	459.649.964,24	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-sep-15	1	1.122.471.665,76	517.347.044,48	14.803.037,34	459.649.964,24	34.100.000,00	38.400.000,00	14.803.037,34	-405603223110,67%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-oct-15	0	1.119.248.785,67	0,00	0,00	444.846.926,90	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-nov-15	0	1.116.014.947,77	0,00	0,00	444.846.926,90	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-dic-15	1	1.112.770.114,82	502.874.558,01	14.472.486,47	444.846.926,90	34.100.000,00	38.400.000,00	14.472.486,47	-264846502449,19%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ene-16	1	1.109.514.249,44	0,00	0,00	430.374.440,43	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-feb-16	1	1.106.247.314,11	0,00	0,00	430.374.440,43	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-mar-16	1	1.102.969.271,21	488.725.780,18	14.148.777,85	430.374.440,43	34.100.000,00	38.400.000,00	14.148.777,85	-130168756050,35%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-abr-16	1	1.099.680.082,96	0,00	0,00	416.225.662,60	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-may-16	1	1.096.379.711,47	0,00	0,00	416.225.662,60	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jun-16	1	1.093.068.118,71	474.894.005,94	13.831.774,24	416.225.662,60	34.100.000,00	38.400.000,00	13.831.774,24	0,00	0,00%	0,00%	0,00	0,00%
13-jul-16	1	1.089.749.295,36	0,00	0,00	402.393.888,36	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ago-16	1	1.086.419.188,00	0,00	0,00	402.393.888,36	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-sep-16	1	1.083.077.758,28	461.377.830,91	13.516.175,03	402.393.888,36	34.100.000,00	38.400.000,00	13.516.175,03	124348810319,14%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-oct-16	1	1.079.724.967,70	0,00	0,00	388.877.713,33	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-nov-16	1	1.076.360.777,65	0,00	0,00	388.877.713,33	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-dic-16	1	1.072.985.149,32	448.165.500,46	13.212.330,44	388.877.713,33	34.100.000,00	38.400.000,00	13.212.330,44	241785647109,83%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ene-17	1	1.069.601.793,66	0,00	0,00	375.665.382,88	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-feb-17	1	1.066.206.934,60	0,00	0,00	375.665.382,88	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-mar-17	1	1.062.800.533,01	435.255.331,13	12.910.169,33	375.665.382,88	34.100.000,00	38.400.000,00	12.910.169,33	352447622763,95%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-abr-17	1	1.059.382.549,66	0,00	0,00	362.755.213,55	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-may-17	1	1.055.952.945,16	0,00	0,00	362.755.213,55	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jun-17	1	1.052.511.680,44	422.636.386,69	12.618.944,44	362.755.213,55	34.100.000,00	38.400.000,00	12.618.944,44	460591472183,12%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jul-17	1	1.049.084.810,77	0,00	0,00	350.136.269,11	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ago-17	1	1.045.646.290,17	0,00	0,00	350.136.269,11	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-sep-17	1	1.042.196.078,60	410.333.543,34	12.302.843,35	350.136.269,11	34.100.000,00	38.400.000,00	12.302.843,35	562239940869,51%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-oct-17	1	1.038.734.136,30	0,00	0,00	337.833.425,76	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-nov-17	1	1.035.260.423,41	0,00	0,00	337.833.425,76	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-dic-17	1	1.031.774.899,89	398.309.045,58	12.024.497,76	337.833.425,76	34.100.000,00	38.400.000,00	12.024.497,76	658942477481,69%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ene-18	1	1.028.278.693,98	0,00	0,00	325.808.928,00	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-feb-18	1	1.024.770.600,91	0,00	0,00	325.808.928,00	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-mar-18	1	1.021.250.580,35	386.558.433,07	11.750.612,50	325.808.928,00	34.100.000,00	38.400.000,00	11.750.612,50	749689077667,22%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-abr-18	1	1.017.718.591,73	0,00	0,00	314.058.315,49	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-may-18	1	1.014.174.594,34	0,00	0,00	314.058.315,49	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jun-18	1	1.010.618.547,36	375.074.660,86	11.483.772,22	314.058.315,49	34.100.000,00	38.400.000,00	11.483.772,22	838315371775,40%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jul-18	1	1.007.059.197,72	0,00	0,00	302.574.543,28	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ago-18	1	1.003.487.746,29	0,00	0,00	302.574.543,28	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-sep-18	1	999.904.151,92	363.861.795,91	11.212.865,84	302.574.543,28	34.100.000,00	38.400.000,00	11.212.865,84	921697572395,48%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-oct-18	1	996.308.373,34	0,00	0,00	291.361.677,43	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-nov-18	1	992.700.369,11	0,00	0,00	291.361.677,43	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-dic-18	1	989.080.097,66	352.904.481,97	10.957.313,04	29								

Date		Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	4.97	Redemption Class B	9.51	Redemption Class C	9.51
									Average Life Class A		Average Life Class B		Average Life Class C
13-jun-21	1	876.821.584,16	256.929.039,61	8.545.552,44	192.974.474,47	34.100.000,00	38.400.000,00	8.545.552,44	1560417874763,36%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jul-21	1	872.969.069,11	0,00	0,00	184.428.922,03	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ago-21	1	869.103.455,51	0,00	0,00	184.428.922,03	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-sep-21	1	865.224.698,82	248.587.046,77	8.341.992,84	184.428.922,03	34.100.000,00	38.400.000,00	8.341.992,84	1599994227425,34%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-oct-21	1	861.332.754,36	0,00	0,00	176.086.929,19	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-nov-21	1	857.427.577,25	0,00	0,00	176.086.929,19	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-dic-21	1	853.509.122,62	240.439.257,96	8.147.788,81	176.086.929,19	34.100.000,00	38.400.000,00	8.147.788,81	1636890772332,78%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ene-22	1	849.579.248,15	0,00	0,00	167.939.140,38	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-feb-22	1	845.636.012,12	0,00	0,00	167.939.140,38	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-mar-22	1	841.679.369,08	232.483.169,96	7.956.087,99	167.939.140,38	34.100.000,00	38.400.000,00	7.956.087,99	1669982869785,44%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-abr-22	1	837.709.273,45	0,00	0,00	159.983.052,38	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-may-22	1	833.725.679,56	0,00	0,00	159.983.052,38	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jun-22	1	829.728.541,33	224.713.151,77	7.770.018,19	159.983.052,38	34.100.000,00	38.400.000,00	7.770.018,19	1702410985562,44%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jul-22	1	825.727.804,83	0,00	0,00	152.213.034,19	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ago-22	1	821.713.465,82	0,00	0,00	152.213.034,19	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-sep-22	1	817.685.478,05	217.133.269,38	7.579.882,40	152.213.034,19	34.100.000,00	38.400.000,00	7.579.882,40	1730487151010,83%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-oct-22	1	813.643.795,13	0,00	0,00	144.633.151,80	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-nov-22	1	809.588.370,49	0,00	0,00	144.633.151,80	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-dic-22	1	806.519.157,41	209.731.462,54	7.401.806,83	144.633.151,80	34.100.000,00	38.400.000,00	7.401.806,83	1757188941992,37%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ene-23	1	801.441.378,34	0,00	0,00	137.231.344,96	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-feb-23	1	797.349.734,82	0,00	0,00	137.231.344,96	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-mar-23	1	793.244.179,72	202.508.021,71	7.223.440,83	137.231.344,96	34.100.000,00	38.400.000,00	7.223.440,83	1779855821101,38%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-abr-23	1	789.124.665,72	0,00	0,00	130.007.904,13	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-may-23	1	784.991.145,38	0,00	0,00	130.007.904,13	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jun-23	1	780.843.571,08	195.455.097,27	7.052.924,44	130.007.904,13	34.100.000,00	38.400.000,00	7.052.924,44	1802727486719,50%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jul-23	1	776.702.343,83	0,00	0,00	122.954.979,69	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ago-23	1	772.547.036,41	0,00	0,00	122.954.979,69	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-sep-23	1	768.377.600,94	188.584.191,05	6.870.906,22	122.954.979,69	34.100.000,00	38.400.000,00	6.870.906,22	1819415967243,35%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-oct-23	1	764.193.989,39	0,00	0,00	116.084.073,47	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-nov-23	1	759.996.153,57	0,00	0,00	116.084.073,47	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-dic-23	1	755.784.045,10	181.876.225,04	6.707.966,01	116.084.073,47	34.100.000,00	38.400.000,00	6.707.966,01	1837311890503,62%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ene-24	1	751.566.751,31	0,00	0,00	109.376.107,46	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-feb-24	1	747.335.118,73	0,00	0,00	109.376.107,46	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-mar-24	1	743.089.098,56	175.334.236,74	6.541.988,30	109.376.107,46	34.100.000,00	38.400.000,00	6.541.988,30	1851382688086,77%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-abr-24	1	738.928.641,96	0,00	0,00	102.834.119,16	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-may-24	1	734.553.699,82	0,00	0,00	102.834.119,16	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jun-24	1	730.264.222,86	168.948.167,79	6.386.068,95	102.834.119,16	34.100.000,00	38.400.000,00	6.386.068,95	1866009347654,17%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jul-24	1	725.978.904,11	0,00	0,00	96.448.050,21	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ago-24	1	721.679.015,27	0,00	0,00	96.448.050,21	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-sep-24	1	717.364.506,82	162.727.507,49	6.220.660,30	96.448.050,21	34.100.000,00	38.400.000,00	6.220.660,30	1874907015357,39%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-oct-24	1	713.035.329,03	0,00	0,00	90.227.389,91	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-nov-24	1	708.691.432,04	0,00	0,00	90.227.389,91	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-dic-24	1	704.332.765,80	156.655.845,39	6.071.662,10	90.227.389,91	34.100.000,00	38.400.000,00	6.071.662,10	1885251081255,83%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ene-25	1	700.025.392,71	0,00	0,00	84.155.727,81	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-feb-25	1	695.703.374,55	0,00	0,00	84.155.727,81	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-mar-25	1	691.366.661,53	150.773.414,71	5.882.430,69	84.155.727,81	34.100.000,00	38.400.000,00	5.882.430,69	1879436604293,15%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-abr-25	1	687.015.203,68	0,00	0,00	78.273.297,13	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-may-25	1	682.648.950,88	0,00	0,00	78.273.297,13	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jun-25	1	678.267.852,82	145.032.454,20	5.740.960,50	78.273.297,13	34.100.000,00	38.400.000,00	5.740.960,50	1887053717889,74%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-jul-25	1	674.103.446,30	0,00	0,00	72.532.336,62	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-ago-25	1	669.924.880,55	0,00	0,00	72.532.336,62	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-sep-25	1	665.732.107,87	139.576.110,08	5.456.344,12	72.532.336,62	34.100.000,00	38.400.000,00	5.456.344,12	1843698676787,33%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-oct-25	1	661.525.079,71	0,00	0,00	67.075.992,50	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-nov-25	1	657.303.747,66	0,00	0,00	67.075.992,50	34.100.000,00	38.400.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%
13-dic-25	1	653.068.063,08	0,00	0,00	139.576.110,08	34.100.000,00	38.400.000,00	67.076.110,08	23275410199396,70%	34.100.000,00	1183270000000,00%	38.400.000,00	1332480000000,00%