

F.T.A. UCI 11

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

DENOMINACION DEL FONDO:	F.T.A. UCI 11		
INFORMACIÓN CORRESPONDIENTE AL:	TRIMESTRE/SEMESTRE:	15/06/2012 - 17/09/2012	AÑO: 2012
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	16 noviembre 2004	Agencia de pago de Bonos	BANCO SANTANDER	
Fecha de Desembolso BT's	22 noviembre 2004	Negociación Mercado	AJAF	
Fecha Final Amortización	15 septiembre 2041	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.A'S SERIE A	AAA	AA
		B.T.A'S SERIE B	A	BBB
		B.T.A'S SERIE C	BBB	BB

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 ES0338340005	8.211	Nominal Unitario	100.000,00	27.437,54	
		Nominal Total	821.100.000,00	225.289.640,94	27,44%
B.T.A'S SERIE B ES0338340013	60	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	6.000.000,00	6.000.000,00	100,00 %
B.T.A'S SERIE C ES0338340021	229	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	22.900.000,00	22.900.000,00	100,00 %

AMORTIZACION E INTERESES BONOS					
Actual			Próximo		
Fecha Amortización Período Actual 17 de septiembre de 2012			Fecha Próximo Cupón 17 de diciembre de 2012		
	Amortización de los Bonos	Intereses Brutos Bonos	Tipo de Interés	Importe Bruto Próximo Cupón	Importe Neto Próximo Cupón
B.T.A'S SERIE A	395,40 €	58,29 €	0,392%	27,19 €	21,48 €
B.T.A'S SERIE B	0,00 €	259,02 €	0,582%	147,12 €	116,22 €
B.T.A'S SERIE C	0,00 €	368,69 €	1,002%	253,28 €	200,09 €
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	11.356	4.137
Saldo Pendiente de Amortizar Derechos	850.000.156,93 €	256.944.702,87 €
Importes Unitarios Derechos Vivos	74.850,30 €	62.108,94 €
Tipos de Interés	4,23 %	3,47%

TASAS DE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA	SITUACIÓN ACTUAL
Tasa mensual actual anualizada:	11,86%
Tasa últimos 12 meses anualizada:	0,00%
Tasa anualizada desde Constitución del Fondo	1,90%

MOROSIDAD ACTUAL	Hasta 1 mes	De 1 a 6 meses	Mayor de 6 meses
Deuda Vencida(Principal+Intereses)	29.481,36 €	95.186,28 €	711.782,51 €
Deuda Pendiente de vencimiento	0,00 €	0,00 €	256.562.507,78 €
Deuda Total	29.481,36 €	95.186,28 €	257.274.290,29 €

F.T.A. UCI 11**INFORME TRIMESTRAL BONOS DE TITULIZACIÓN****17 de septiembre de 2012****BONOS TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. PRINCIPAL**

Saldo anterior	257.436.270,34 €
Amortizaciones	3.246.629,40 €
Saldo actual	254.189.640,94 €
% sobre saldo inicial	29,90%
Amortización devengada no pagada	0,00 €

DATOS

Fecha de determinación	10/09/2012
Fecha de Pago de Cupón Actual	17/09/2012
Fecha de Pago de Cupón Anterior	15/06/2012
Número de días	94
Tipo de referencia (%)	0,252%
Próxima Fecha de Pago	17/12/2012

BONOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. INTERESES

Intereses pagados Serie A	478.619,19 €
Intereses pagados Serie B	15.541,20 €
Intereses pagados Serie C	84.430,01 €
Intereses devengados no pagados	0,00 €

VIDA RESIDUAL (AÑOS)

	INICIAL	17-sep-12
B.T.A'S SERIE A	4,75	3,80
B.T.A'S SERIE B	7,93	6,75
B.T.A'S SERIE C	7,91	6,75

F.T.A. UCI 11

INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

17 de septiembre de 2012

DERECHOS DE CRÉDITO. PRINCIPAL	
Saldo anterior	260.317.072,73 €
Amortizaciones	3.372.369,86 €
Saldo actual	256.944.702,87 €
Número de derechos de crédito	4.137
LTV	54,75%

DERECHOS DE CRÉDITO. INTERESES	
Intereses cobrados en el trimestre	2.208.402,13 €
Intereses devengados en el trimestre	2.274.838,42 €

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	11.686,37 €	9.811,16 €	12.663,71 €	22.739,35 €	325.294,50 €
Intereses	17.794,99 €	11.521,58 €	13.673,11 €	24.777,37 €	386.488,01 €
Saldo de los derechos de crédito	9.013.584,83 €	2.786.111,54 €	2.103.748,64 €	2.283.890,42 €	3.428.868,56 €
Número de derechos de crédito	116	37	35	38	40
% sobre saldo de los derechos de crédito	3,51%	1,08%	0,82%	0,89%	1,33%

PRÉSTAMOS EN WRITE OFF	
Write Off acumulado Fecha Pago anterior	2.880.833,42 €
Write Off trimestre	-125.763,58 €
Write Off acumulados actuales	2.755.069,84 €

F.T.A. UCI 11

INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

17 de septiembre de 2012

ADJUDICADOS	
Saldo anterior	1.804.242,59 €
Diferencia	92.292,36 €
Saldo actual	1.896.534,95 €
Número de adjudicados	35

PERDIDAS DE LA CARTERA	
Saldo anterior	410.264,48 €
Diferencia	24.059,40 €
Saldo actual	434.323,88 €

F.T.A. UCI 11

ESTADO DE ORIGEN Y APLICACIÓN DE FONDOS Y CUENTA DE TESORERÍA

17 de septiembre de 2012

ORIGEN	5.377.953,28 €
PRINCIPAL COBRADO	
Amortización derechos de crédito	3.139.170,43 €
INTERESES COBRADOS	
Intereses de derechos de crédito	2.208.402,13 €
Intereses de reinversión	8.346,79 €
INGRESOS/GASTOS DE ADJUDICADOS	85.000,00 €
INGRESOS IMPORTES ASEGURADOS	28.160,00 €
OTROS	-91.126,07 €

ESTADO CUENTA DE TESORERÍA	12.871.495,22 €
FONDO DE RESERVA	
Saldo anterior	12.750.000,00 €
Utilizado en el período	0,00 €
Saldo actual	12.750.000,00 €
RETENCIÓN A CUENTA DEL IRPF	121.495,22 €

APLICACIÓN	5.377.953,28 €
GASTOS ORDINARIOS	2.752,55 €
COMISIÓN S.G.F.T	17.237,65 €
PAGO SWAP	0,00 €
COBRO SWAP	0,00 €
INTERESES B.T.A'S SERIE A	478.619,19 €
INTERESES B.T.A'S SERIE B	15.541,20 €
INTERESES B.T.A'S SERIE C	84.430,01 €
FONDOS DISPONIBLES AMORTIZACIÓN A	3.246.629,40 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO SANTANDER	21.008,32 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB	21.008,32 €
COMISIÓN ADMINISTRACIÓN UCI	6.000,00 €
COMISIÓN VARIABLE	1.484.726,65 €

F.T.A. UCI 11**MEJORA CREDITICIA Y PRÉSTAMO SUBORDINADO****17 de septiembre de 2012**

MEJORA DE CRÉDITO		
CONCEPTOS	INICIAL	17 de septiembre de 2012
EMISIÓN SUBORDINADA	28.900.000,00 € (3,40%)	28.900.000,00 € (11,25%)
FONDO DE RESERVA	12.750.000,00 € (1,50 %)	12.750.000,00 € (4,96%)

PRÉSTAMOS SUBORDINADOS		
CONCEPTOS	INICIAL	17 de septiembre de 2012
PRÉSTAMO SUBORDINADO SCH		
Saldo vivo	6.812.500,00 €	6.375.386,18 €
Tipo de interés	2,790 %	0,852%
PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB		
Saldo vivo	6.812.500,00 €	6.375.386,18 €
Tipo de interés	2,790 %	0,852%

F.T.A. UCI 11

DEFINICIONES

17 de septiembre de 2012

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).

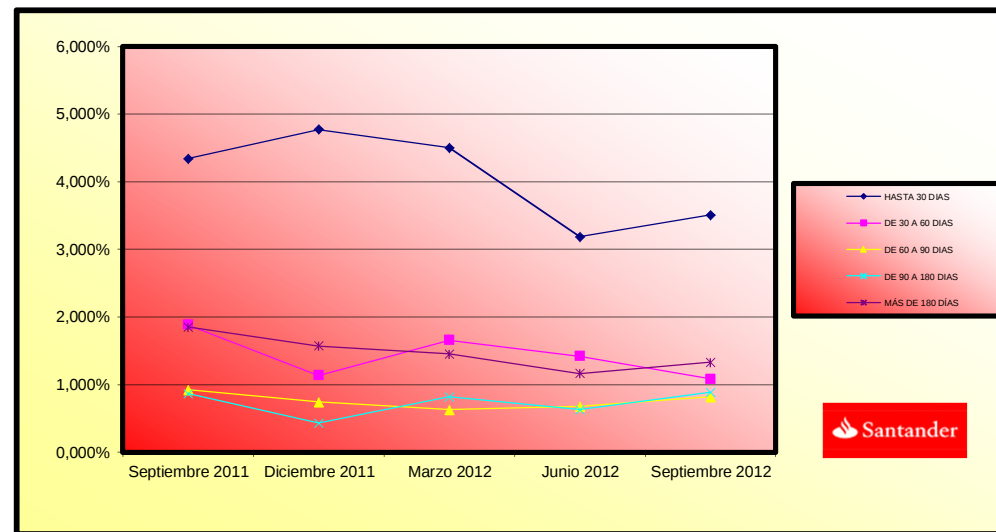
ADJUDICADOS Bienes en el activo del Fondo como consecuencia de un proceso judicial o extrajudicial.

FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 11

INFORME HISTÓRICO DE MOROSIDAD

Fecha: 17 de septiembre de 2012

MOROSIDAD HISTÓRICA					
	Septiembre 2011	Diciembre 2011	Marzo 2012	Junio 2012	Septiembre 2012
HASTA 30 DIAS	4,342%	4,774%	4,507%	3,187%	3,508%
DE 30 A 60 DIAS	1,886%	1,136%	1,658%	1,420%	1,084%
DE 60 A 90 DIAS	0,926%	0,744%	0,630%	0,675%	0,819%
DE 90 A 180 DIAS	0,869%	0,433%	0,823%	0,632%	0,889%
MÁS DE 180 DÍAS	1,851%	1,572%	1,455%	1,167%	1,334%



FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS UCI 11
--

INFORME RELATIVO A LOS TRIGGERS DEL FONDO
--

Fecha: 17 de septiembre de 2012

AMORTIZACIÓN BONOS SERIE B y C	
SI 1) ES MAYOR QUE 2) NO SE AMORTIZAN LAS SERIES B y C	
1) DERECHOS EN MOROSIDAD > 90 DÍAS	8.467.828,82 €
2) 2% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO ACTUAL	5.138.894,06 €

MOROSIDAD > 90 DÍAS (%SALDO DERECHOS DE CRÉDITO)
3,30%

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) DERECHOS EN MOROSIDAD > 90 DÍAS	8.467.828,82 €
2) 1,25% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO ACTUAL	3.211.808,79 €

NO SE AMORTIZA EL FONDO DE RESERVA

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 7 º LUGAR	
1) SALDO DE LA SERIE A	228.536.270,34 €
2) SALDO VIVO DERECHOS DE CRÉDITO (MOROSIDAD < 18 MESES)	252.996.925,13 €
3) REMANENTE F.DISPONIBLES DESPUÉS PAGO PUNTOS 1º - 4º	17.613.802,69 €
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	234.536.270,34 €
2) SALDO VIVO DERECHOS DE CRÉDITO (MOROSIDAD < 18 MESES)	252.996.925,13 €
3) REMANENTE F.DISPONIBLES DESPUÉS PAGO PUNTOS 1º - 5º	17.529.372,68 €

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
0,25 - 39,99	31.999.854,68 €	13,00%	639	19,94%
40,00 - 49,99	30.951.535,58 €	12,57%	369	11,51%
50,00 - 59,99	39.151.314,39 €	15,90%	442	13,79%
60,00 - 69,99	101.681.686,77 €	41,29%	1.290	40,25%
70,00 - 79,99	36.273.738,63 €	14,73%	405	12,64%
80,00 - 89,99	5.534.232,90 €	2,25%	56	1,75%
90,00 - 94,21	641.072,88 €	0,26%	4	0,12%
TOTALES	246.233.435,83 €	100,00%	3.205	100,00%

UCI 11

Fecha	Saldo antes de Pago	Saldo Real	Vector de Pre pago	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
			1,05%					1,90%
	850.000.000,00		100,00%	100,00%				
8-dic-04	848.447.342,89	833.517.603,20	98,95%	98,24%	1,76%	19,19%	1,76%	19,19%
8-ene-05	846.889.973,92	816.392.876,79	97,92%	96,40%	1,82%	19,75%	1,87%	20,31%
8-feb-05	845.328.036,68	802.341.378,75	96,89%	94,91%	1,72%	18,84%	1,54%	16,99%
8-mar-05	843.761.517,75	786.900.260,82	95,88%	93,26%	1,73%	18,89%	1,74%	19,02%
8-abr-05	842.190.403,70	768.001.629,57	94,88%	91,19%	1,83%	19,85%	2,22%	23,61%
8-may-05	840.614.681,05	751.784.924,91	93,88%	89,43%	1,84%	20,02%	1,93%	20,83%
8-jun-05	839.034.336,28	732.993.980,46	92,90%	87,36%	1,91%	20,68%	2,32%	24,51%
8-jul-05	837.449.355,83	713.527.819,67	91,93%	85,20%	1,98%	21,35%	2,47%	25,94%
8-ago-05	835.859.726,10	695.561.749,15	90,97%	83,22%	2,02%	21,73%	2,33%	24,66%
8-sep-05	834.265.433,46	682.206.195,00	90,01%	81,77%	1,99%	21,45%	1,73%	18,92%
8-oct-05	832.666.464,23	670.301.480,81	89,07%	80,50%	1,95%	21,07%	1,56%	17,16%
8-nov-05	831.062.804,69	654.364.086,82	88,14%	78,74%	1,97%	21,26%	2,19%	23,33%
8-dic-05	829.454.441,08	633.873.172,63	87,22%	76,42%	2,05%	21,98%	2,94%	30,13%
8-ene-06	827.841.359,61	619.627.389,01	86,30%	74,85%	2,05%	21,99%	2,06%	22,07%
8-feb-06	826.223.546,43	601.383.750,24	85,40%	72,79%	2,10%	22,44%	2,75%	28,48%
8-mar-06	824.600.987,66	584.239.740,88	84,51%	70,85%	2,13%	22,77%	2,66%	27,64%
8-abr-06	822.973.669,39	566.483.863,76	83,62%	68,83%	2,17%	23,17%	2,85%	29,29%
8-may-06	821.341.577,65	551.680.941,47	82,75%	67,17%	2,19%	23,30%	2,42%	25,47%
8-jun-06	819.704.698,44	536.851.732,28	81,88%	65,49%	2,20%	23,46%	2,49%	26,14%
8-jul-06	818.063.017,72	518.335.537,79	81,02%	63,36%	2,26%	23,95%	3,26%	32,78%
8-ago-06	816.416.521,41	505.514.356,78	80,18%	61,92%	2,26%	23,96%	2,28%	24,15%
8-sep-06	814.765.195,37	497.832.455,51	79,34%	61,10%	2,21%	23,56%	1,32%	14,74%
8-oct-06	813.109.025,44	489.785.181,54	78,51%	60,24%	2,18%	23,24%	1,42%	15,73%
8-nov-06	811.447.997,41	480.954.788,91	77,68%	59,27%	2,16%	23,01%	1,60%	17,62%
8-dic-06	809.782.097,03	470.277.417,04	76,87%	58,07%	2,15%	22,96%	2,02%	21,71%
8-ene-07	808.111.707,58	460.043.992,15	76,07%	56,93%	2,14%	22,90%	1,97%	21,28%
8-feb-07	806.436.418,33	450.559.931,77	75,27%	55,87%	2,13%	22,80%	1,86%	20,15%
8-mar-07	804.756.214,89	440.907.144,06	74,48%	54,79%	2,13%	22,73%	1,94%	20,93%
8-abr-07	803.071.082,85	431.073.415,47	73,70%	53,68%	2,12%	22,70%	2,03%	21,77%
8-may-07	801.381.007,76	421.968.045,26	72,93%	52,66%	2,12%	22,63%	1,91%	20,62%
8-jun-07	799.685.975,11	412.121.707,46	72,17%	51,54%	2,12%	22,63%	2,13%	22,73%
8-jul-07	797.986.907,49	404.454.167,85	71,41%	50,68%	2,10%	22,50%	1,65%	18,11%
8-ago-07	796.282.855,93	396.791.374,83	70,67%	49,83%	2,09%	22,38%	1,68%	18,44%
8-sep-07	794.573.805,82	391.376.030,13	69,93%	49,26%	2,06%	22,11%	1,15%	12,99%
8-oct-07	792.859.742,50	386.989.073,29	69,19%	48,81%	2,03%	21,80%	0,91%	10,36%
8-nov-07	791.140.651,25	381.540.150,55	68,47%	48,23%	2,01%	21,58%	1,19%	13,42%
8-dic-07	789.416.517,34	374.085.117,49	67,75%	47,39%	2,00%	21,51%	1,74%	18,99%
8-ene-08	787.694.525,33	368.864.560,67	67,04%	46,83%	1,98%	21,30%	1,18%	13,28%

Fecha	Saldo antes de Pago	Saldo Real	vector de Prepago	Remanencia final de mes	Mortandad Mensual	CPR	Mortandad 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
			1,05%					1,90%
8-feb-08	785.967.482,14	365.347.329,01	66,34%	46,48%	1,95%	21,00%	0,74%	8,48%
8-mar-08	784.235.372,95	361.954.516,26	65,65%	46,15%	1,91%	20,70%	0,71%	8,19%
8-abr-08	782.498.182,91	356.988.908,13	64,96%	45,62%	1,90%	20,52%	1,15%	12,99%
8-may-08	780.755.897,12	351.895.556,23	64,28%	45,07%	1,88%	20,36%	1,21%	13,56%
8-jun-08	779.008.500,62	348.169.826,92	63,61%	44,69%	1,86%	20,13%	0,84%	9,59%
8-jul-08	777.259.527,22	347.228.513,39	62,94%	44,67%	1,81%	19,73%	0,05%	0,55%
8-ago-08	775.505.423,51	346.077.498,92	62,28%	44,63%	1,78%	19,36%	0,11%	1,27%
8-sep-08	773.746.174,42	341.634.083,80	61,63%	44,15%	1,76%	19,21%	1,06%	12,00%
8-oct-08	771.981.764,88	338.356.595,89	60,99%	43,83%	1,74%	18,99%	0,73%	8,45%
8-nov-08	770.212.179,73	335.395.338,94	60,35%	43,55%	1,72%	18,77%	0,65%	7,50%
8-dic-08	768.437.403,79	333.970.278,42	59,72%	43,46%	1,69%	18,46%	0,19%	2,31%
8-ene-09	766.659.103,76	331.962.327,38	59,09%	43,30%	1,66%	18,20%	0,37%	4,36%
8-feb-09	764.875.587,37	329.978.849,13	58,47%	43,14%	1,63%	17,95%	0,37%	4,30%
8-mar-09	763.086.839,34	328.476.806,46	57,86%	43,05%	1,61%	17,68%	0,22%	2,63%
8-abr-09	761.292.844,32	326.273.336,82	57,26%	42,86%	1,59%	17,46%	0,44%	5,12%
8-may-09	759.493.586,90	323.503.228,38	56,66%	42,59%	1,57%	17,28%	0,61%	7,13%
8-jun-09	757.689.051,67	321.386.971,51	56,06%	42,42%	1,55%	17,07%	0,42%	4,90%
8-jul-09	755.881.308,93	319.112.570,09	55,48%	42,22%	1,53%	16,87%	0,47%	5,50%
8-ago-09	754.068.263,48	317.841.095,04	54,90%	42,15%	1,50%	16,63%	0,16%	1,89%
8-sep-09	752.249.899,76	314.354.974,81	54,32%	41,79%	1,49%	16,52%	0,86%	9,82%
8-oct-09	750.426.202,17	312.492.643,31	53,75%	41,64%	1,47%	16,32%	0,35%	4,13%
8-nov-09	748.597.155,07	309.793.127,81	53,19%	41,38%	1,46%	16,18%	0,62%	7,21%
8-dic-09	746.762.742,76	307.081.055,36	52,63%	41,12%	1,45%	16,04%	0,63%	7,33%
8-ene-10	744.925.018,92	304.171.922,35	52,08%	40,83%	1,43%	15,92%	0,70%	8,12%
8-feb-10	743.081.904,42	302.891.409,39	51,54%	40,76%	1,41%	15,71%	0,17%	2,07%
8-mar-10	741.233.383,45	300.122.393,54	51,00%	40,49%	1,40%	15,59%	0,67%	7,72%
8-abr-10	739.379.440,15	297.807.053,26	50,47%	40,28%	1,39%	15,45%	0,52%	6,09%
8-may-10	737.520.058,62	295.608.835,47	49,94%	40,08%	1,38%	15,31%	0,49%	5,70%
8-jun-10	735.655.222,91	293.760.620,91	49,41%	39,93%	1,36%	15,16%	0,37%	4,39%
8-jul-10	733.787.447,69	291.341.154,99	48,90%	39,70%	1,35%	15,04%	0,57%	6,64%
8-ago-10	731.914.193,66	289.072.708,07	48,39%	39,50%	1,34%	14,92%	0,52%	6,12%
8-sep-10	730.035.444,76	287.255.851,54	47,88%	39,35%	1,32%	14,78%	0,37%	4,38%
8-oct-10	728.151.184,86	286.099.404,91	47,38%	39,29%	1,31%	14,61%	0,14%	1,72%
8-nov-10	726.261.397,79	284.751.082,83	46,88%	39,21%	1,29%	14,45%	0,21%	2,52%
8-dic-10	724.366.067,35	281.674.551,27	46,39%	38,89%	1,29%	14,38%	0,82%	9,43%
8-ene-11	722.468.266,09	278.838.334,02	45,91%	38,60%	1,28%	14,31%	0,75%	8,60%
8-feb-11	720.564.897,95	277.785.066,79	45,43%	38,55%	1,26%	14,14%	0,11%	1,37%
8-mar-11	718.655.946,59	275.983.701,22	44,95%	38,40%	1,25%	14,02%	0,38%	4,52%
8-abr-11	716.741.395,64	274.448.612,53	44,48%	38,29%	1,24%	13,90%	0,29%	3,43%
8-may-11	714.821.228,68	273.778.936,22	44,01%	38,30%	1,22%	13,73%	-0,02%	-0,29%
8-jun-11	712.895.429,22	271.621.942,31	43,55%	38,10%	1,21%	13,63%	0,52%	6,06%
8-jul-11	710.965.191,30	270.217.689,41	43,10%	38,01%	1,20%	13,51%	0,25%	2,92%
8-ago-11	709.029.291,35	269.318.086,88	42,65%	37,98%	1,19%	13,36%	0,06%	0,73%
8-sep-11	707.087.712,76	268.147.150,38	42,20%	37,92%	1,18%	13,23%	0,16%	1,92%
8-oct-11	705.140.438,88	267.183.876,05	41,76%	37,89%	1,16%	13,09%	0,08%	1,00%
8-nov-11	703.187.452,99	265.696.089,52	41,32%	37,78%	1,15%	12,98%	0,28%	3,32%
8-dic-11	701.228.738,34	264.288.500,39	40,89%	37,69%	1,14%	12,87%	0,25%	2,98%
8-ene-12	699.269.967,10	263.261.093,09	40,46%	37,65%	1,13%	12,74%	0,11%	1,31%
8-feb-12	697.305.450,14	261.893.291,79	40,04%	37,56%	1,12%	12,63%	0,24%	2,83%
8-mar-12	695.335.170,59	260.588.400,21	39,62%	37,48%	1,11%	12,53%	0,22%	2,57%
8-abr-12	693.359.111,56	258.867.875,32	39,20%	37,34%	1,10%	12,44%	0,38%	4,43%

Fecha	Saldo antes de Pago	Saldo Real	vector de Prepago	Remanencia final de mes	Mortandad Mensual	CPR	Mortandad 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
			1,05%					1,90%
8-may-12	691.377.256,08	258.896.709,85	38,79%	37,45%	1,09%	12,28%	-0,30%	-3,63%
8-jun-12	689.389.587,16	257.436.239,31	38,39%	37,34%	1,08%	12,18%	0,28%	3,28%
8-jul-12	687.399.418,55	256.481.587,36	37,99%	37,31%	1,07%	12,07%	0,08%	0,98%
8-ago-12	685.403.412,10	254.970.529,27	37,59%	37,20%	1,06%	11,98%	0,30%	3,54%
8-sep-12	683.401.550,70	254.189.633,03	37,19%	37,19%	1,05%	11,86%	0,01%	0,17%

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
									3,80		6,75		6,75
Date		Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	Average Life Class A	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C
		850.000.000,00			821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00						
8-dic-04		848.447.342,89			821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-05	0	846.889.973,92	0,00	0,00	821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-05	0	845.328.036,68	0,00	0,00	821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-05	1	843.761.517,75	808.988.498,35	41.011.501,65	821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00	41.011.501,65	-11241252600981,40%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-05	0	842.190.403,70	0,00	0,00	780.088.498,35	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-05	0	840.614.681,05	0,00	0,00	780.088.498,35	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-05	1	839.034.336,28	779.460.912,77	29.527.585,58	780.088.498,35	6.000.000,00	22.900.000,00	29.527.585,58	-7821857421138,09%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-05	0	837.449.355,83	0,00	0,00	750.560.912,77	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-05	0	835.859.726,10	0,00	0,00	750.560.912,77	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-05	1	834.265.433,46	750.949.672,08	28.511.240,70	750.560.912,77	6.000.000,00	22.900.000,00	28.511.240,70	-7290324245772,84%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-05	0	832.666.464,23	0,00	0,00	722.049.672,08	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-05	0	831.062.804,69	0,00	0,00	722.049.672,08	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-05	1	829.454.441,08	723.420.970,42	27.528.701,65	722.049.672,08	6.000.000,00	22.900.000,00	27.528.701,65	-6788577828024,15%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-06	0	827.841.359,61	0,00	0,00	694.520.970,42	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-06	0	826.223.546,43	0,00	0,00	694.520.970,42	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-06	1	824.600.987,66	696.842.102,49	26.578.867,93	694.520.970,42	6.000.000,00	22.900.000,00	26.578.867,93	-6315139020250,16%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-06	0	822.973.669,39	0,00	0,00	667.942.102,49	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-06	0	821.341.577,65	0,00	0,00	667.942.102,49	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-06	1	819.704.898,44	671.181.428,18	25.660.674,31	667.942.102,49	6.000.000,00	22.900.000,00	25.660.674,31	-5860898013530,49%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-06	0	818.063.017,72	0,00	0,00	642.281.428,18	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-06	0	816.416.521,41	0,00	0,00	642.281.428,18	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-06	1	814.765.195,37	646.408.338,37	24.773.089,80	642.281.428,18	6.000.000,00	22.900.000,00	24.773.089,80	-5430261284548,03%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-06	0	813.109.025,44	0,00	0,00	617.508.338,37	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-06	0	811.447.997,41	0,00	0,00	617.508.338,37	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-06	1	809.782.097,03	622.493.221,88	23.915.116,50	617.508.338,37	6.000.000,00	22.900.000,00	23.915.116,50	-5024565976170,90%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-07	0	808.111.707,58	0,00	0,00	593.593.221,88	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-07	0	806.436.418,33	0,00	0,00	593.593.221,88	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-07	1	804.756.214,88	599.408.324,28	23.084.897,60	593.593.221,88	6.000.000,00	22.900.000,00	23.084.897,60	-4642372906590,45%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-07	0	803.071.082,85	0,00	0,00	570.508.324,28	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-07	0	801.381.007,76	0,00	0,00	570.508.324,28	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-07	1	799.685.975,11	577.124.996,28	22.283.328,00	570.508.324,28	6.000.000,00	22.900.000,00	22.283.328,00	-4276170643140,41%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-07	0	797.986.907,49	0,00	0,00	548.224.996,28	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-07	0	796.282.855,93	0,00	0,00	548.224.996,28	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-07	1	794.573.905,62	555.618.405,62	21.506.590,66	548.224.996,28	6.000.000,00	22.900.000,00	21.506.590,66	-3929254114477,29%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-07	0	792.859.742,53	0,00	0,00	526.718.405,62	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-07	0	791.140.651,25	0,00	0,00	526.718.405,62	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-07	1	789.416.517,34	534.860.546,64	20.757.858,97	526.718.405,62	6.000.000,00	22.900.000,00	20.757.858,97	-3603564317809,77%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-08	0	787.694.525,33	0,00	0,00	505.960.546,64	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-08	0	785.967.482,14	0,00	0,00	505.960.546,64	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-08	1	784.235.372,95	514.840.563,20	20.019.983,44	505.960.546,64	6.000.000,00	22.900.000,00	20.019.983,44	-3293287276344,01%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-08	0	782.498.182,91	0,00	0,00	485.940.563,20	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-08	0	780.755.897,12	0,00	0,00	485.940.563,20	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-08	1	779.008.500,62	495.519.216,05	19.321.347,15	485.940.563,20	6.000.000,00	22.900.000,00	19.321.347,15	-3000605211795,51%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-08	0	777.259.527,22	0,00	0,00	466.619.216,05	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-08	0	775.505.423,51	0,00	0,00	466.619.216,05	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-08	1	773.746.174,42	476.879.653,93	18.639.562,12	466.619.216,05	6.000.000,00	22.900.000,00	18.639.562,12	-2723240025549,78%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-08	0	771.981.764,88	0,00	0,00	447.979.653,93	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-08	0	770.212.179,73	0,00	0,00	447.979.653,93	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-08	1	768.437.403,79	458.892.277,95	17.987.375,88	447.979.653,93	6.000.000,00	22.900.000,00	17.987.375,88	-2464270509517,33%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-09	0	766.659.103,76	0,00	0,00	429.992.277,95	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-09	0	764.875.587,37	0,00	0,00	429.992.277,95	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-09	1	763.086.839,34	441.538.107,44	17.354.170,51	429.992.277,95	6.000.000,00	22.900.000,00	17.354.170,51	-222133824980,07%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-09	0	761.292.844,32	0,00	0,00	412.638.107,44	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-09	0	759.493.586,90	0,00	0,00	412.638.107,44	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-09	1	757.689.051,67	424.792.866,33	16.745.241,11	412.638.107,44	6.000.000,00	22.900.000,00	16.745.241,11	-1989334644291,65%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-09	0	755.881.308,93	0,00	0,00	395.892.866,33	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-09	0	754.068.263,48	0,00	0,00	395.892.866,33	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%

		Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	3.80		Redemption Class B	6.75		Redemption Class C	6.75	
Date									Average Life Class A			Average Life Class B			Average Life Class C	
8-sep-09	1	752.249.899,76	408.639.473,71	16.153.392,62	395.892.866,33	6.000.000,00	22.900.000,00	16.153.392,62	-1770411831443,10%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-oct-09	0	750.426.202,17	0,00	0,00	379.739.473,71	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-nov-09	0	748.597.155,07	0,00	0,00	379.739.473,71	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-dic-09	1	746.762.142,76	393.054.519,71	15.584.954,00	379.739.473,71	6.000.000,00	22.900.000,00	15.584.954,00	-1566287877049,43%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-ene-10	0	744.925.018,92	0,00	0,00	364.154.519,71	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-feb-10	0	743.081.904,42	0,00	0,00	364.154.519,71	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-mar-10	1	741.233.383,45	378.022.019,45	15.032.500,26	364.154.519,71	6.000.000,00	22.900.000,00	15.032.500,26	-1375473773565,69%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-abr-10	0	739.379.440,15	0,00	0,00	349.122.019,45	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-may-10	0	737.520.058,62	0,00	0,00	349.122.019,45	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-jun-10	1	735.655.222,91	363.520.096,10	14.501.923,35	349.122.019,45	6.000.000,00	22.900.000,00	14.501.923,35	-1193508291684,54%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-jul-10	0	733.787.447,69	0,00	0,00	334.620.096,10	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-ago-10	0	731.914.193,66	0,00	0,00	334.620.096,10	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-sep-10	1	730.035.444,76	349.534.479,76	13.985.616,34	334.620.096,10	6.000.000,00	22.900.000,00	13.985.616,34	-1022348554233,22%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-oct-10	0	728.151.184,86	0,00	0,00	320.634.479,76	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-nov-10	0	726.261.397,79	0,00	0,00	320.634.479,76	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-dic-10	1	724.366.067,35	336.044.002,68	13.490.477,09	320.634.479,76	6.000.000,00	22.900.000,00	13.490.477,09	-863390533654,97%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-ene-11	0	722.468.266,09	0,00	0,00	307.144.002,68	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-feb-11	0	720.564.897,95	0,00	0,00	307.144.002,68	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-mar-11	1	718.655.946,58	323.036.093,38	13.007.909,30	307.144.002,68	6.000.000,00	22.900.000,00	13.007.909,30	-715435011425,71%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-abr-11	0	716.741.395,64	0,00	0,00	294.136.093,38	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-may-11	0	714.821.228,68	0,00	0,00	294.136.093,38	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-jun-11	1	712.895.429,22	310.490.152,67	12.545.940,71	294.136.093,38	6.000.000,00	22.900.000,00	12.545.940,71	-574604084423,53%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-jul-11	0	710.965.191,30	0,00	0,00	281.590.152,67	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-ago-11	0	709.029.291,35	0,00	0,00	281.590.152,67	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-sep-11	1	707.087.712,76	298.392.062,18	12.098.090,49	281.590.152,67	6.000.000,00	22.900.000,00	12.098.090,49	-442790112026,80%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-oct-11	0	705.140.438,88	0,00	0,00	269.492.062,18	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-nov-11	0	703.187.452,99	0,00	0,00	269.492.062,18	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-dic-11	1	701.228.738,34	286.725.062,78	11.666.999,40	269.492.062,18	6.000.000,00	22.900.000,00	11.666.999,40	-320842483445,95%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-ene-12	0	699.269.967,10	0,00	0,00	257.825.062,78	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-feb-12	0	697.305.450,14	0,00	0,00	257.825.062,78	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-mar-12	1	695.335.170,59	275.481.298,69	11.243.764,09	257.825.062,78	6.000.000,00	22.900.000,00	11.243.764,09	-206885259197,81%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-abr-12	0	693.359.111,56	0,00	0,00	246.581.298,69	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-may-12	0	691.377.256,08	0,00	0,00	246.581.298,69	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-jun-12	1	689.389.587,16	264.639.479,47	10.841.829,23	246.581.298,69	6.000.000,00	22.900.000,00	10.841.829,23	-99744819672,23%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-jul-12	0	687.399.418,55	0,00	0,00	235.739.470,47	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-ago-12	0	685.403.412,10	0,00	0,00	235.739.470,47	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-sep-12	1	683.401.550,70	254.189.633,03	10.449.837,44	235.739.470,47	6.000.000,00	22.900.000,00	10.449.837,44	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-oct-12	0	681.393.817,18	0,00	0,00	225.289.633,03	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-nov-12	0	679.380.194,30	0,00	0,00	225.289.633,03	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-dic-12	1	677.360.664,80	244.114.637,92	10.074.995,11	225.289.633,03	6.000.000,00	22.900.000,00	10.074.995,11	91682455472,24%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-ene-13	0	675.341.971,78	0,00	0,00	215.214.637,92	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-feb-13	0	673.317.357,26	0,00	0,00	215.214.637,92	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-mar-13	1	671.286.803,87	234.408.811,85	9.705.826,07	215.214.637,92	6.000.000,00	22.900.000,00	9.705.826,07	175675451934,59%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-abr-13	0	669.250.294,19	0,00	0,00	205.508.811,85	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-may-13	0	667.207.810,75	0,00	0,00	205.508.811,85	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-jun-13	1	665.159.336,02	225.052.317,49	9.356.494,36	205.508.811,85	6.000.000,00	22.900.000,00	9.356.494,36	255432296061,24%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-jul-13	0	663.111.616,14	0,00	0,00	196.152.317,49	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-ago-13	0	661.057.889,62	0,00	0,00	196.152.317,49	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-sep-13	1	658.998.138,83	216.039.896,78	9.012.420,71	196.152.317,49	6.000.000,00	22.900.000,00	9.012.420,71	328953355817,87%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-oct-13	0	656.932.346,11	0,00	0,00	187.139.896,78	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-nov-13	0	654.860.493,73	0,00	0,00	187.139.896,78	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-dic-13	1	652.782.563,92	207.352.985,84	8.686.910,94	187.139.896,78	6.000.000,00	22.900.000,00	8.686.910,94	396123138857,73%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-ene-14	0	650.703.792,43	0,00	0,00	178.452.985,84	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-feb-14	0	648.618.923,21	0,00	0,00	178.452.985,84	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-mar-14	1	646.527.938,38	198.985.311,49	8.367.674,35	178.452.985,84	6.000.000,00	22.900.000,00	8.367.674,35	456875019615,35%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-abr-14	0	644.430.819,99	0,00	0,00	170.085.311,49	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-may-14	0	642.327.550,05	0,00	0,00	170.085.311,49	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00%
8-jun-14	1	640.218.110,52	190.920.978,93	8.064.332,55	170.085.311,49	6.000.000,00	22.900.000,00	8.064.332,55	514504416896,81%	0,00	0,00					

										3,80				6,75			
Date		Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	Average Life Class A	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C				
8-sep-17	1	554.278.130,68	109.660.219,80	4.923.960,88	85.684.180,68	6.000.000,00	22.900.000,00	4.923.960,88	899115256686,03%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-oct-17	0	551.966.993,18	0,00	0,00	80.760.219,80	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-nov-17	0	549.649.076,35	0,00	0,00	80.760.219,80	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-dic-17	1	547.324.360,30	104.919.961,19	4.740.258,61	80.760.219,80	6.000.000,00	22.900.000,00	4.740.258,61	908707575988,50%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-ene-18	0	545.002.056,18	0,00	0,00	76.019.961,19	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-feb-18	0	542.674.141,74	0,00	0,00	76.019.961,19	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-mar-18	1	540.338.796,98	100.362.499,64	4.557.461,55	76.019.961,19	6.000.000,00	22.900.000,00	4.557.461,55	914682532751,97%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-abr-18	0	537.996.601,88	0,00	0,00	71.462.499,64	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-may-18	0	535.647.536,34	0,00	0,00	71.462.499,64	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-jun-18	1	533.291.580,21	95.975.861,58	4.386.638,06	71.462.499,64	6.000.000,00	22.900.000,00	4.386.638,06	920755328581,52%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-jul-18	0	530.937.947,54	0,00	0,00	67.075.861,58	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-ago-18	0	528.577.410,87	0,00	0,00	67.075.861,58	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-sep-18	1	526.209.949,96	91.758.926,28	4.216.935,30	67.075.861,58	6.000.000,00	22.900.000,00	4.216.935,30	923930523365,70%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-oct-18	0	523.835.544,50	0,00	0,00	62.858.926,28	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-nov-18	0	521.454.174,11	0,00	0,00	62.858.926,28	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-dic-18	1	519.065.818,38	87.700.823,74	4.058.102,55	62.858.926,28	6.000.000,00	22.900.000,00	4.058.102,55	926059000996,47%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-ene-19	0	516.677.835,93	0,00	0,00	58.800.823,74	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-feb-19	0	514.282.848,73	0,00	0,00	58.800.823,74	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-mar-19	1	511.890.836,23	83.799.627,36	3.901.196,38	58.800.823,74	6.000.000,00	22.900.000,00	3.901.196,38	925363780155,01%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-abr-19	0	509.471.777,84	0,00	0,00	54.899.627,36	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-may-19	0	507.055.652,87	0,00	0,00	54.899.627,36	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%				
8-jun-19	1	504.632.440,60	0,00	83.799.627,36	54.899.627,36	6.000.000,00	22.900.000,00	54.899.627,36	13527268182092,50%	6.000.000,00	14.784.000.000,00	22.900.000,00	564256000000,00%				