

F.T.A UCI 16

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

NAME OF THE FUND:	F.T.A UCI 16		
INFORMATION AT:	QUARTER/SEMESTER:	September 16th, 2011 - December 16th, 2011	YEAR: 2011
Acting on behalf of Santander de Titulización S.G.F.T., S.A. as General Manager:		Signature:	
IGNACIO ORTEGA GAVARA - GENERAL MANAGER			

I. DATA OF THE FUND

Constitution Date	October 18, 2006	Paying Agent	BANCO SANTANDER	
Disbursement Date	October 23, 2006	Negotiation Market	AIAF	
Final Date of Redemption	June 16, 2049	Ratings Agencies	FITCH RATINGS	
			STANDARD & POORS	
Management Company	SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.	Rating	Initial	Current
	UNIÓN DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, S.	CLASS A1	---	---
		CLASS A2	AAA/AAA	BB-/A+
		CLASS B	A/A-	CCC/B
		CLASS C	BBB/BBB	CC/B-
		CLASS D	BB+/BB	CC/CCC-
		CLASS E	CCC/CCC-	C/D

II. SECURITIES ISSUED CHARGED TO THE FUND: SECURITISATION BONDS

CLASS PRIORITY ISIN CODE	NUM BONDS	NOMINAL			
			Initial	Current	%Act/In
CLASS A1 ES0338186002	4.300	Nominal per Bond	100.000,00	0,00	
		Total Nominal	430.000.000,00	0,00	0,00 %
CLASS A2 ES0338186010	12.476	Nominal per Bond	100.000,00	77.855,97	
		Total Nominal	1.247.600.000,00	970.919.373,72	77,82%
CLASS B ES0338186028	720	Nominal per Bond	100.000,00	100.000,00	
		Total Nominal	72.000.000,00	72.000.000,00	100,00 %
CLASS C ES0338186036	414	Nominal per Bond	100.000,00	100.000,00	
		Total Nominal	41.400.000,00	41.400.000,00	100,00 %
CLASS D ES0338186044	90	Nominal per Bond	100.000,00	100.000,00	
		Total Nominal	9.000.000,00	9.000.000,00	100,00 %
CLASS E ES0338186051	198	Nominal per Bond	100.000,00	100.000,00	
		Total Nominal	19.800.000,00	19.800.000,00	100,00 %

REDEMPTION AND INTEREST OF THE BONDS					
Current			Next		
Payment Date of the Current Period December 16th, 2011			Next Payment Date March 16th, 2012		
	Redemption of the Bonds	Gross Interest	Interest Rate	Gross Interest Next Coupon	Net Interest Next Coupon
CLASS A1	---	---	---	---	---
CLASS A2	1.352,13 €	336,03 €	1,573%	309,44 €	250,65 €
CLASS B	0,00 €	462,33 €	1,723%	435,54 €	352,78 €
CLASS C	0,00 €	525,53 €	1,973%	498,73 €	403,97 €
CLASS D	0,00 €	955,25 €	3,673%	928,45 €	752,05 €
CLASS E	0,00 €	0,00 €	3,723%	941,09 €	762,28 €
Accrued amortisation due not payed	2.544,24 €				
Scheduled Amortisation	NO				

III. ASSET PURCHASED BY THE FUND: CREDIT RIGHTS

CREDIT RIGHTS	ISSUE DATE	CURRENT DATE
Numbre of CR's	16.195	11.902
CR's Outstanding to be amortised	1.800.000.051,25 €	1.162.912.877,61 €
CR's Outstanding per Loan to be amortised	111.145,42 €	97.707,35 €
Interest Rate	4,24 %	3,91%

PREPAYMENT RATE	CURRENT SITUATION
Monthly Single Rate	5,78%
Average Monthly Single Rate	7,11%
Constant Prepayment Rate from Constitution	7,96%

F.T.A UCI 16

QUARTERLY BONDS PAYOUT REPORT

December 16th, 2011

BONDS. PRINCIPAL	
Previous Balance	1.129.988.547,60€
Principal Amortised	16.869.173,88€
Outstanding Balance	1.113.119.373,72€
% of Initial Balance	61,17%
Principal accrued and unpaid	31.741.938,24€

INTEREST PAID	
CLASS A1	0,00 €
CLASS A2	4.192.310,28€
CLASS B	332.877,60€
CLASS C	217.569,42€
CLASS D	85.972,50€
CLASS E	0,00 €
Interest accrued and unpaid	3.030.098,94€

DATA	
Determination Date	December 9th, 2011
Payment Date	December 16th, 2011
Last Payment Date	September 16th, 2011
Number of Days (Act/360)	91
Reference Interest Rate (%)	1,423%
Next Payment Date	March 16th, 2012

RESIDUAL LIFE (YEARS)		
	INITIAL	December 16th, 2011
CLASS A1	0,70	0,00
CLASS A2	4,71	6,32
CLASS B	6,29	15,01
CLASS C	6,29	15,01
CLASS D	6,29	15,01
CLASS E	6,53	15,01

F.T.A UCI 16

QUARTERLY COLLATERAL REPORT

December 16th, 2011

PRINCIPAL	
Previous Balance	1.179.743.305,80€
Principal Amortised	16.830.428,19€
Outstanding Balance	1.162.912.877,61€
Number of Credit Rights	11.902
LTV	58,13%

INTEREST	
Interest received during relevant period	10.253.495,24€
Interest accrued during relevant period	10.822.697,53€

PRINCIPAL BALANCE IN ARREARS					
	UP to 30 DAYS	30 to 60 DAYS	60 to 90 DAYS	90 to 180 DAYS	MORE THAN 180 DAYS
Principal Balance in Arrears	6.329,36 €	18.989,45 €	7.809,29 €	27.228,08 €	2.004.787,09 €
Interest accrued on Credit Rights in Arrears	171.063,85 €	125.247,63 €	95.754,50 €	270.369,69 €	13.519.180,12 €
Outstanding Balance	75.723.144,29 €	23.273.774,65 €	10.830.711,26 €	18.246.991,15 €	70.547.119,37 €
Number of Credit Rights	538	223	120	199	1.414
% of Outstanding Balance	6,51%	2,00%	0,93%	1,57%	6,07%

WRITE OFF	
Cumulative WRITE OFF as of previous balance	99.601.310,27€
Difference in Actual Period	1.734.156,37€
Cumulative WRITE OFF up to date	101.335.466,64€

F.T.A UCI 16

QUARTERLY COLLATERAL REPORT

December 16th, 2011

TRANSITORY PROPERTIES	
Last balance	38.783.895,62€
Difference in Actual Period	2.778.700,66€
Current balance	41.562.596,28€
Number of transitory properties	432

NET LOSSES	
Last balance	12.870.640,02€
Difference in Actual Period	-1.888.669,79€
Current balance	10.981.970,23€

F.T.A UCI 16

QUARTERLY REPORT - ALLOCATION OF CASH

December 16th, 2011

TOTAL CASH RECEIVED END OF PERIOD	21.752.519,49 €
CASH RECEIVED - PRINCIPAL	
Amortisation of Credit Rights	8.751.160,39 €
CASH RECEIVED - INTEREST	
Interest received from Credit Rights	10.253.495,24 €
Interest received under GIC	38.814,26 €
INCOMES/EXPENSES OF TRANSTORY PROPERTIES	2.559.778,45 €
INCOMES/EXPENSES OF INSURED PROPERTIES	984.390,00 €
OTHERS	-835.118,85 €

TREASURY ACCOUNT STATEMENT	917.510,30 €
PRINCIPAL RESERVE FUND	
Previous Balance	0,00 €
Period utilization	0,00 €
Outstanding Balance	0,00 €
WITHHOLDING TAXES	917.510,30 €

TOTAL CASH PAID END OF PERIOD	21.752.519,49 €
ORDINARY EXPENSES	17.036,00 €
MANAGEMENT FEE	37.500,00 €
INTEREST ON CLASS A1 BONDS	0,00 €
INTEREST ON CLASS A2 BONDS	4.192.310,28 €
INTEREST ON CLASS B BONDS	332.877,60 €
INTEREST ON CLASS C BONDS	217.569,42 €
INTEREST ON CLASS D BONDS	85.972,50 €
REDEMPTION ON CLASS A2 BONDS	16.869.173,88 €
INTEREST ON CLASS E BONDS	0,00 €
INTEREST ON SUBORDINATED LOAN SCH	0,00 €
INTEREST ON SUBORDINATED LOAN UCB	0,00 €
REDEMPTION ON SUBORDINATED LOAN SCH	0,00 €
REDEMPTION ON SUBORDINATED LOAN UCB	0,00 €
FIXED FEE	0,00 €
VARIABLE FEE	0,00 €
UTILIZATION OF THE RESERVE FUND	0,00 €
REMAINDER	79,81 €

F.T.A UCI 16

CREDIT ENHANCEMENT AND SUBORDINATED LOAN

December 16th, 2011

CREDIT ENHANCEMENT		
CONCEPTS	INITIAL	December 16th, 2011
SUBORDINATED ISSUE	122.400.000,00 € (6,80%)	122.400.000,00 € (10,53%)
PRINCIPAL RESERVE FUND	19.800.000,00 € (1,10%)	0,00 € (0,00 %)

SUBORDINATED LOANS		
CONCEPTS	INITIAL	December 16th, 2011
SUBORDINATED LOAN SCH		
Total Outstanding Subordinated Loan	950.000,00 €	325.091,26 €
Interest Rate	5,900 %	3,723%
SUBORDINATED LOAN UCB		
Total Outstanding Subordinated Loan	950.000,00 €	325.091,26 €
Interest Rate	5,900 %	3,723%

F.T.A UCI 16

DEFINITIONS

December 16th, 2011

DETERMINATION DATE Means the date in which the Gestora will carry out the necessary calculations, on behalf of the Fund, for the distribution of the available funds at this date, according with the Order of Priority of Payments.

All the information regarding the Assets (Outstanding Balance of the Credit Rights, arrears' tables, transitory properties, stratification tables, etc.) are referred to this mentioned date.

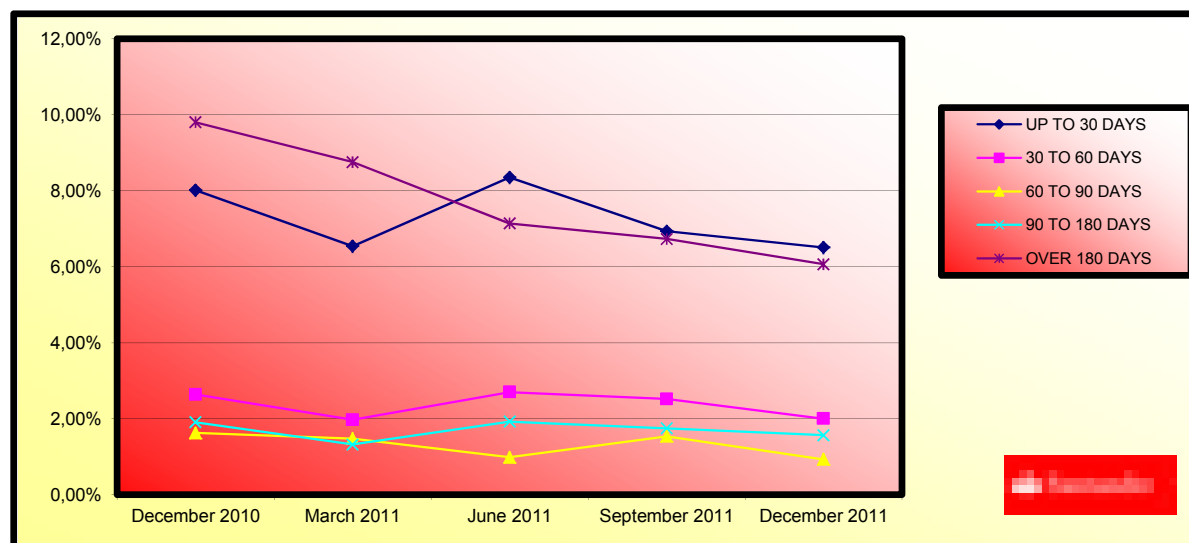
WRITE OFF Those loans that at a given date are unpaid for a period equal or higher to 12 or 18 months (according to Prospectus) of arrears in due payments.

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

ACCRUED DEFAULT BALANCE Will be the balance of the loans which have outstanding instalmentes for longer than 18 months, or which have begun the process of execution of guarantees (if this process occurs previous to the 18 months from the first failure to pay), discounting the recovered amounts.

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

ARREARS PERFORMANCE					
	December 2010	March 2011	June 2011	September 2011	December 2011
UP TO 30 DAYS	8,02%	6,541%	8,353%	6,939%	6,512%
30 TO 60 DAYS	2,64%	1,975%	2,700%	2,520%	2,001%
60 TO 90 DAYS	1,63%	1,479%	0,985%	1,538%	0,931%
90 TO 180 DAYS	1,91%	1,324%	1,925%	1,751%	1,569%
OVER 180 DAYS	9,80%	8,754%	7,141%	6,733%	6,066%



**FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS
UCI 16**

**TRIGGERS
DECEMBER 16th, 2011**

TRIGGERS BONDS	
1. IF 1.a) IS HIGHER THAN 1.b) THERE IS NO REDEMPTION OF CLASS B, CLASS C and CLASS D:	
1.a) CR's IN ARREARS OVER 90 DAYS	190.129.577,16 €
1.b) 2% CR's OUTSTANDING BALANCE	23.258.257,55 €
NO REDEMPTION OF THE CLASS B, C and D MAY OCCUR, AS THE FUND DID NOT REACH THE REQUIRED LEVELS.	

TRIGGERS RESERVE FUND	
1. IF 1.a) IS LOWER THAN 1.b) THERE IS NO REDEMPTION OF RESERVE FUND:	
1.a) CR'S OUTSTANDING BALANCE	1.162.912.877,61 €
1.b) 10% CR'S INITIAL OUTSTANDING BALANCE	180.000.005,13 €
2. IF 2.a) IS LOWER THAN 2.b) THERE IS NO REDEMPTION OF RESERVE FUND:	
2.a) CR'S INTEREST RATE	3,91%
2.b) WEIGHTED AVERAGE RATE BONDS A1, A2, B, C, D y E + 0,40%	2,16%
3. IF THERE IS A PRINCIPAL DEFICIENCY, NO REDEMPTION OF RESERVE FUND SHOULD TAKE PLACE	YES

THE RESERVE FUND MAY NOT BE AMORTISED, AS THERE IS A PRINCIPAL DEFICIENCY.

RESERVE FUND LEVELS		
CURRENT ARREARS PERCENTAGE < 0,75%	HIGHER OF 2,2% CR OUTSTANDING BALANCE 0,40% INITIAL BNODS BALANCE	NA
CURRENT ARREARS PERCENTAGE BETWEEN 0,75% AND 1,25%	HIGHER OF 2,2% CR OUTSTANDING BALANCE 0,70% INITIAL BONDS BALANCE	NA
CURRENT ARREARS PERCENTAGE > 1,25%	HIGHER OF 2,2% CR OUTSTANDING BALANCE 0,80% INITIAL BONDS BALANCE	19.800.000,00 €

**FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS
UCI 16**

**TRIGGERS
DECEMBER 16th, 2011**

INTEREST DEFERRAL FOR CLASS B, C and D	
IF 1.a) IS HIGHER THAN 1.b) CLASS B INTEREST ARE DEFERRED:	
1.a) CLASS A1 and A2 OUTSTANDING BALANCE	987.788.547,60 €
1.b) CR OUTSTANDING BALANCE (EXCLUDING > 18 MONTHS IN ARREARS) + AVAILABLE FUNDS REMAINING	1.037.215.570,20 € 17.172.795,61 €
IF 2.a) IS HIGHER THAN 2.b) CLASS C INTEREST ARE DEFERRED:	
2.a) CLASS A1, A2 and B OUTSTANDING BALANCE	1.059.788.547,60 €
2.b) CR OUTSTANDING BALANCE (EXCLUDING > 18 MONTHS IN ARREARS) + AVAILABLE FUNDS REMAINING	1.037.215.570,20 € 16.955.226,19 €
IF 3.a) IS HIGHER THAN 3.b) CLASS D INTEREST ARE DEFERRED:	
3.a) CLASS A1, A2, B and C OUTSTANDING BALANCE	1.101.188.547,60 €
3.b) CR OUTSTANDING BALANCE (EXCLUDING > 18 MONTHS IN ARREARS) + AVAILABLE FUNDS REMAINING	1.037.215.570,20 € 16.869.253,69 €

CLASS B INTEREST ARE NOT DEFERRED
EVENTHOUGH THE TRIGGER HAS BEEN HIT, INTEREST ON CLASSES C AND D BONDS SHALL NOT BE DEFERRED DUE TO THE FACT THAT THE FUND HAS LIQUIDITY REMAINING FROM THE INTEREST COLLECTION.

LIQUIDITY REMAINING	
Current Balance	5.409.043,70 €

IF 1.a) IS HIGHER THAN 9,60% CR OUTSTANDING BALANCE, INTEREST ON CLASS B, C or D SHALL BE DEFERRED	NO
1.a) ACCRUED DEFAULT BALANCE WILL BE THE SUM OF i) + ii)	130.427.822,34 €
i). CR OUTSTANDING BALANCE WITH ARREARS HIGHER THAN 18 MONTHS	125.697.307,41 €
ii). CR OUTSTANDING BALANCE IN PROCESS OF EXECUTION OF GUARANTEES WITH ARREARS LOWER THAN 18 MONTHS	4.730.514,93 €
RATIO	7,25%

LTV				
INTERVAL	OUTSTANDING	% OUTSTANDING	NUM.OF LOANS	% NUM OF LOANS
0,28 - 39,99	162.651.365,09 €	14,72%	2.201	24,14%
40,00 - 44,99	53.219.518,16 €	4,82%	403	4,42%
45,00 - 49,99	61.108.354,67 €	5,53%	422	4,63%
50,00 - 54,99	58.519.618,05 €	5,30%	386	4,23%
55,00 - 59,99	71.795.538,45 €	6,50%	454	4,98%
60,00 - 64,99	59.115.310,37 €	5,35%	394	4,32%
65,00 - 69,99	82.222.994,22 €	7,44%	538	5,90%
70,00 - 74,99	155.722.705,06 €	14,10%	1.198	13,14%
75,00 - 79,99	329.724.436,70 €	29,85%	2.614	28,67%
80,00 - 100,00	70.555.434,41 €	6,39%	507	5,56%
	1.104.635.275,18 €	100,00	9.117	100,00

F.T.A.: UCI 16

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
			0,69%					5,78%
	1.800.000.000,00		100,00%	100,00%				
01-11-06	1.797.536.963,07	1.777.699.259,42	99,31%	98,90%	1,10%	12,47%	1,10%	12,47%
01-12-06	1.795.065.685,52	1.757.039.469,70	98,63%	97,88%	1,06%	12,06%	1,03%	11,64%
01-01-07	1.792.585.676,60	1.732.965.597,00	97,95%	96,67%	1,12%	12,65%	1,23%	13,84%
01-02-07	1.790.096.905,48	1.714.233.119,07	97,27%	95,76%	1,08%	12,18%	0,94%	10,75%
01-03-07	1.787.599.341,18	1.693.175.506,25	96,60%	94,72%	1,08%	12,21%	1,09%	12,33%
01-04-07	1.785.092.952,65	1.669.557.506,70	95,94%	93,53%	1,11%	12,53%	1,26%	14,08%
01-05-07	1.782.577.708,70	1.644.647.424,39	95,28%	92,26%	1,14%	12,90%	1,35%	15,08%
01-06-07	1.780.053.578,06	1.619.770.876,00	94,62%	91,00%	1,17%	13,20%	1,37%	15,29%
01-07-07	1.777.520.529,31	1.597.030.852,52	93,97%	89,85%	1,18%	13,30%	1,26%	14,15%
01-08-07	1.774.978.530,95	1.573.264.177,93	93,32%	88,64%	1,20%	13,48%	1,35%	15,02%
01-09-07	1.772.427.551,37	1.557.247.781,41	92,68%	87,86%	1,17%	13,17%	0,88%	10,02%
01-10-07	1.769.867.558,82	1.542.130.741,40	92,04%	87,13%	1,14%	12,87%	0,83%	9,49%
01-11-07	1.767.298.521,48	1.526.259.522,92	91,40%	86,36%	1,12%	12,66%	0,89%	10,12%
01-12-07	1.764.720.407,36	1.513.748.046,10	90,78%	85,78%	1,09%	12,32%	0,67%	7,80%
01-01-08	1.762.133.184,42	1.500.412.336,34	90,15%	85,15%	1,07%	12,07%	0,74%	8,48%
01-02-08	1.759.536.820,47	1.490.635.006,66	89,53%	84,72%	1,03%	11,70%	0,51%	5,89%
01-03-08	1.756.931.283,21	1.479.372.093,27	88,91%	84,20%	1,01%	11,43%	0,61%	7,06%
01-04-08	1.754.316.540,22	1.467.484.114,61	88,30%	83,65%	0,99%	11,22%	0,66%	7,59%
01-05-08	1.751.692.558,99	1.457.076.346,68	87,69%	83,18%	0,96%	10,98%	0,56%	6,52%
01-06-08	1.749.059.306,88	1.444.195.638,00	87,09%	82,57%	0,95%	10,86%	0,73%	8,47%
01-07-08	1.746.416.751,13	1.437.175.797,87	86,49%	82,29%	0,92%	10,54%	0,34%	3,95%
01-08-08	1.743.764.858,86	1.428.177.167,06	85,89%	81,90%	0,90%	10,32%	0,48%	5,55%
01-09-08	1.741.103.597,09	1.422.246.882,23	85,30%	81,69%	0,88%	10,02%	0,26%	3,11%
01-10-08	1.738.432.932,73	1.416.945.713,59	84,71%	81,51%	0,85%	9,72%	0,22%	2,60%
01-11-08	1.735.752.832,53	1.409.587.568,59	84,13%	81,21%	0,83%	9,51%	0,37%	4,30%
01-12-08	1.733.063.263,18	1.398.661.902,48	83,55%	80,70%	0,82%	9,42%	0,62%	7,20%
01-01-09	1.730.364.191,21	1.390.828.713,27	82,97%	80,38%	0,81%	9,25%	0,40%	4,75%
01-02-09	1.727.655.583,05	1.384.826.013,16	82,40%	80,16%	0,79%	9,04%	0,28%	3,26%
01-03-09	1.724.937.405,01	1.379.419.487,16	81,83%	79,97%	0,77%	8,83%	0,23%	2,77%
01-04-09	1.722.209.623,27	1.369.775.747,92	81,27%	79,54%	0,76%	8,75%	0,54%	6,31%
01-05-09	1.719.472.203,90	1.362.063.427,51	80,71%	79,21%	0,75%	8,63%	0,40%	4,75%
01-06-09	1.716.725.112,86	1.352.710.697,56	80,15%	78,80%	0,74%	8,55%	0,53%	6,15%
01-07-09	1.713.969.126,04	1.339.913.528,64	79,60%	78,18%	0,74%	8,56%	0,79%	9,04%
01-08-09	1.711.203.401,95	1.327.695.598,99	79,05%	77,59%	0,74%	8,57%	0,75%	8,66%
01-09-09	1.708.427.906,17	1.320.161.213,28	78,51%	77,27%	0,73%	8,46%	0,41%	4,76%
01-10-09	1.705.642.604,19	1.308.815.507,86	77,97%	76,73%	0,73%	8,45%	0,70%	8,06%

01-11-09	1.702.847.461,35	1.300.273.065,81	77,43%	76,36%	0,73%	8,38%	0,49%	5,72%
01-12-09	1.700.042.442,89	1.289.324.377,33	76,90%	75,84%	0,73%	8,36%	0,68%	7,84%
01-01-10	1.697.227.513,92	1.278.664.026,17	76,37%	75,34%	0,72%	8,34%	0,66%	7,66%
01-02-10	1.694.402.639,41	1.271.395.856,83	75,84%	75,04%	0,72%	8,26%	0,40%	4,73%
01-03-10	1.691.567.784,24	1.264.686.031,25	75,32%	74,76%	0,71%	8,16%	0,36%	4,25%
01-04-10	1.688.722.913,14	1.248.843.961,75	74,80%	73,95%	0,72%	8,26%	1,09%	12,28%
01-05-10	1.685.867.990,71	1.236.380.323,19	74,28%	73,34%	0,72%	8,29%	0,83%	9,52%
01-06-10	1.683.002.981,46	1.228.541.388,81	73,77%	73,00%	0,71%	8,23%	0,46%	5,44%
01-07-10	1.680.127.849,73	1.209.189.765,06	73,26%	71,97%	0,73%	8,40%	1,41%	15,63%
01-08-10	1.677.242.559,77	1.202.832.512,28	72,76%	71,71%	0,72%	8,31%	0,35%	4,17%
01-09-10	1.674.347.075,68	1.187.058.995,86	72,26%	70,90%	0,73%	8,41%	1,14%	12,86%
01-10-10	1.671.441.361,45	1.175.020.793,62	71,76%	70,30%	0,73%	8,43%	0,84%	9,65%
01-11-10	1.668.525.380,94	1.165.504.933,13	71,27%	69,85%	0,73%	8,41%	0,64%	7,38%
01-12-10	1.665.599.097,87	1.153.257.462,21	70,78%	69,24%	0,73%	8,44%	0,88%	10,03%
01-01-11	1.662.662.475,83	1.143.706.008,51	70,29%	68,79%	0,73%	8,43%	0,65%	7,56%
01-02-11	1.659.715.478,31	1.136.550.672,31	69,80%	68,48%	0,73%	8,37%	0,45%	5,26%
01-03-11	1.656.758.068,65	1.123.157.897,90	69,32%	67,79%	0,73%	8,42%	1,00%	11,38%
01-04-11	1.653.790.210,05	1.115.169.307,36	68,84%	67,43%	0,73%	8,38%	0,53%	6,21%
01-05-11	1.650.811.865,60	1.117.682.492,96	68,37%	67,71%	0,71%	8,16%	-0,41%	-4,98%
01-06-11	1.647.822.998,25	1.098.625.671,00	67,90%	66,67%	0,72%	8,32%	1,53%	16,86%
01-07-11	1.644.823.570,82	1.092.863.228,82	67,43%	66,44%	0,71%	8,25%	0,34%	4,04%
01-08-11	1.641.813.546,00	1.087.711.635,38	66,97%	66,25%	0,71%	8,17%	0,29%	3,41%
01-09-11	1.638.792.886,35	1.080.141.995,53	66,51%	65,91%	0,70%	8,13%	0,51%	5,98%
01-10-11	1.635.761.554,30	1.077.632.058,10	66,05%	65,88%	0,69%	8,01%	0,05%	0,57%
01-11-11	1.632.719.512,14	1.070.123.160,18	65,59%	65,54%	0,69%	7,97%	0,51%	5,97%
01-12-11	1.629.666.722,03	1.061.577.410,97	65,14%	65,14%	0,69%	7,96%	0,61%	7,11%

Fecha	Principal Disponible	Amortización de Principal	Serie A1	Serie A2	Serie B	Serie C	Serie D	Serie E	Suma de todas las clases	% Serie B	% Serie C	% Serie D	Amortización Serie A1	Vida Media Serie A1	Amortización Serie A2	Vida Media Serie A2	Amortización Serie B	Vida Media Serie B	Amortización Serie C	Vida Media Serie C	Amortización Serie D	Vida Media Serie D	Amortización Serie E	Vida Media Serie E
Date	Principal available	Principal Redemption	Class A1	Class A2	Class B	Class C	Class D	Class E	Sum of all classes	% Class B	% Class C	% Class D	Redemption Class A1	Average Life Class A1	Redemption Class A2	Average Life Class A2	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C	Redemption Class D	Average Life Class D	Redemption Class E	Average Life Class E
24-10-00	1.819.800.000,00	1.800.000.000,00	430.000.000,00	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.800.000.000,00	4,000000%	2,300000%	0,500000%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-11-00	1.785.153.051,32	0,00	430.000.000,00	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.800.000.000,00	4,000000%	2,300000%	0,500000%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-12-00	1.770.417.113,30	0,00	430.000.000,00	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.800.000.000,00	4,000000%	2,300000%	0,500000%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-01-01	1.755.780.636,37	0,00	430.000.000,00	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.800.000.000,00	4,000000%	2,300000%	0,500000%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-02-01	1.741.273.736,49	0,00	430.000.000,00	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.800.000.000,00	4,000000%	2,300000%	0,500000%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-03-01	1.726.864.735,12	73.135.264,88	430.000.000,00	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.800.000.000,00	4,000000%	2,300000%	0,500000%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-04-01	1.712.951.159,16	0,00	358.864.735,12	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.247.800.000,00	1,408408%	1,698408%	0,231768%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-05-01	1.698.368.240,05	0,00	358.864.735,12	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.247.800.000,00	1,408408%	1,698408%	0,231768%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-06-01	1.684.279.218,12	42.585,51	358.864.735,12	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.247.800.000,00	1,408408%	1,698408%	0,231768%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-07-01	1.670.295.333,94	0,00	314.279.218,12	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.684.279.218,12	2,274826%	2,486026%	0,534353%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-08-01	1.656.416.836,64	0,00	314.279.218,12	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.684.279.218,12	2,274826%	2,486026%	0,534353%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-09-01	1.642.639.979,83	41.639.238,37	314.279.218,12	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.684.279.218,12	2,274826%	2,486026%	0,534353%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-10-01	1.628.967.022,47	0,00	272.639.979,83	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.642.639.979,83	3,383188%	2,520333%	0,547899%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-11-01	1.615.396.228,47	0,00	272.639.979,83	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.642.639.979,83	3,383188%	2,520333%	0,547899%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-12-01	1.601.926.987,22	40.713.112,81	272.639.979,83	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.642.639.979,83	3,383188%	2,520333%	0,547899%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-01-02	1.588.558.213,02	0,00	231.926.867,22	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.601.926.867,22	4,494587%	2,584388%	0,561823%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-02-02	1.575.289.545,32	0,00	231.926.867,22	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.601.926.867,22	4,494587%	2,584388%	0,561823%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-03-02	1.562.120.148,61	39.806.718,61	231.926.867,22	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.601.926.867,22	4,494587%	2,584388%	0,561823%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-04-02	1.549.049.312,42	0,00	192.120.148,61	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.562.120.148,61	4,609120%	2,602444%	0,576140%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-05-02	1.536.076.331,25	0,00	192.120.148,61	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.562.120.148,61	4,609120%	2,602444%	0,576140%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-06-02	1.523.200.504,55	38.919.644,06	192.120.148,61	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.562.120.148,61	4,609120%	2,602444%	0,576140%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-07-02	1.510.421.136,70	0,00	153.200.504,55	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.523.200.504,55	4,726889%	2,717981%	0,590811%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-08-02	1.497.377.536,94	0,00	153.200.504,55	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.523.200.504,55	4,726889%	2,717981%	0,590811%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-09-02	1.485.149.019,37	38.051.485,18	153.200.504,55	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.523.200.504,55	4,726889%	2,717981%	0,590811%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-10-02	1.472.454.029,39	0,00	115.149.019,37	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.485.149.019,37	4,847998%	2,787599%	0,600000%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-11-02	1.460.254.712,82	37.201.846,55	115.149.019,37	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.485.149.019,37	4,847998%	2,787599%	0,600000%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-12-02	1.443.726.962,86	0,00	77.947.172,82	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.447.947.172,82	4,972577%	2,889220%	0,621070%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-01-03	1.431.576.531,69	36.370.340,96	77.947.172,82	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.447.947.172,82	4,972577%	2,889220%	0,621070%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-02-03	1.399.635.084,06	0,00	41.579.831,26	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.411.579.831,26	5,100979%	2,932880%	0,637589%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-03-03	1.387.783.102,76	0,00	41.579.831,26	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.411.579.831,26	5,100979%	2,932880%	0,637589%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-04-03	1.376.020.242,00	35.556,56	41.579.831,26	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.411.579.831,26	5,100979%	2,932880%	0,637589%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-05-03	1.364.346.509,93	0,00	0,00	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.376.020.242,00	5,232481%	3,008677%	0,654006%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-06-03	1.352.760.818,28	0,00	0,00	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.376.020.242,00	5,232481%	3,008677%	0,654006%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-07-03	1.341.291.637,07	34.758,35	0,00	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.376.020.242,00	5,232481%	3,008677%	0,654006%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-08-03	1.329.849.814,79	0,00	0,00	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.341.291.637,07	5,368079%	3,086645%	0,671010%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-09-03	1.318.523.709,70	0,00	0,00	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	1.341.291.637,07	5,368079%	3,086645%	0,671010%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-10-03	1.307.262.524,18	33.979.013,33	0,00	1.247.800.000,00	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.0																

PERI	Disponible	Principal	DETRE A1	DETRE A2	DETRE B	DETRE L	DETRE U	DETRE E	Sum of all classes	% Class B	% Class C	% Class D	Redemption Class A1	Average Life Class A1	Redemption Class A2	Average Life Class A2	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C	Redemption Class D	Average Life Class D	Redemption Class E	Average Life Class E
Date	Principal available	Principal Redemption	Class A1	Class A2	Class B	Class C	Class D	Class E																
09-07-17	574,237 148,80	0,00	0,00	457 367 623,83	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	579 767 623,83	12,418769%	7,140792%	1,552346%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-08-17	586 743 685,18	0,00	0,00	457 367 623,83	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	579 767 623,83	12,418769%	7,140792%	1,552346%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-09-17	593 305 767,63	16,461 856,21	0,00	457 367 623,83	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	579 767 623,83	12,418769%	7,140792%	1,552346%	0,00	0,00	16,461 856,21	34,568 339,896	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-10-17	597 940 232,18	0,00	0,00	440 905 767,63	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	563 305 767,63	12,781691%	7,349472%	1,597711%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-11-17	592 545 767,63	0,00	0,00	440 905 767,63	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	563 305 767,63	12,781691%	7,349472%	1,597711%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-12-17	547 227 914,05	16,077 853,57	0,00	440 905 767,63	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	563 305 767,63	12,781691%	7,349472%	1,597711%	0,00	0,00	16,077 853,57	35,242 655,032	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-01-18	541 987 892,10	0,00	0,00	424 827 914,05	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	547 227 914,05	13,157224%	7,56544%	1,644653%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-02-18	536 728 851,31	0,00	0,00	424 827 914,05	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	547 227 914,05	13,157224%	7,56544%	1,644653%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-03-18	531 541 087,65	15,686 826,40	0,00	424 827 914,05	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	547 227 914,05	13,157224%	7,56544%	1,644653%	0,00	0,00	15,686 826,40	35,767 337,840	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-04-18	526 394 191,66	0,00	0,00	409 141 087,65	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	531 541 087,65	13,545519%	7,768874%	1,693190%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-05-18	521 287 596,35	0,00	0,00	409 141 087,65	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	531 541 087,65	13,545519%	7,768874%	1,693190%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-06-18	518 021 272,79	15,319 814,11	0,00	393 821 272,89	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	518 021 272,79	13,947507%	8,019817%	1,743438%	0,00	0,00	15,319 814,11	36,369 240,258	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-07-18	511 203 141,36	0,00	0,00	393 821 272,89	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	518 021 272,79	13,947507%	8,019817%	1,743438%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-08-18	506 224 523,06	0,00	0,00	393 821 272,89	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	518 021 272,79	13,947507%	8,019817%	1,743438%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-09-18	501 295 128,96	14,936 143,63	0,00	383 821 272,89	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	518 021 272,79	13,947507%	8,019817%	1,743438%	0,00	0,00	14,936 143,63	38,832 530,926	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-10-18	496 384 672,22	0,00	0,00	378 885 128,96	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	501 295 128,96	14,363083%	8,268773%	1,795385%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-11-18	491 522 867,99	0,00	0,00	378 885 128,96	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	501 295 128,96	14,363083%	8,268773%	1,795385%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-12-18	486 599 433,44	14,585 696,52	0,00	378 885 128,96	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	501 295 128,96	14,363083%	8,268773%	1,795385%	0,00	0,00	14,585 696,52	37,295 623,442	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-01-19	481 916 171,21	0,00	0,00	364 299 433,44	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	486 599 433,44	14,793525%	8,506277%	1,849191%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-02-19	477 170 597,61	0,00	0,00	364 299 433,44	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	486 599 433,44	14,793525%	8,506277%	1,849191%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-03-19	472 462 735,95	14,236 697,48	0,00	364 299 433,44	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	486 599 433,44	14,793525%	8,506277%	1,849191%	0,00	0,00	14,236 697,48	37,684 538,296	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-04-19	467 792 011,52	0,00	0,00	350 062 735,95	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	472 462 735,95	15,236297%	8,762596%	1,904912%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-05-19	463 158 251,53	0,00	0,00	350 062 735,95	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	472 462 735,95	15,236297%	8,762596%	1,904912%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-06-19	458 561 185,14	13,901 550,81	0,00	350 062 735,95	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	472 462 735,95	15,236297%	8,762596%	1,904912%	0,00	0,00	13,901 550,81	38,076 347,665	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-07-19	454 004 715,16	0,00	0,00	336 161 185,14	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	458 561 185,14	15,701285%	9,026239%	1,96261%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-08-19	449 484 360,19	0,00	0,00	336 161 185,14	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	458 561 185,14	15,701285%	9,026239%	1,96261%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-09-19	444 999 854,89	13,561 330,25	0,00	336 161 185,14	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	458 561 185,14	15,701285%	9,026239%	1,96261%	0,00	0,00	13,561 330,25	38,321 623,939	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-10-19	440 149 854,89	0,00	0,00	322 599 854,89	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	444 999 854,89	16,179761%	9,303374%	2,022473%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-11-19	436 137 345,09	0,00	0,00	322 599 854,89	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	444 999 854,89	16,179761%	9,303374%	2,022473%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-12-19	431 758 820,18	13,241 034,71	0,00	322 599 854,89	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	444 999 854,89	16,179761%	9,303374%	2,022473%	0,00	0,00	13,241 034,71	38,690 303,435	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-01-20	427 417 117,27	0,00	0,00	309 368 820,18	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	431 758 820,18	16,876977%	9,586867%	2,084497%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-02-20	423 109 847,77	0,00	0,00	309 368 820,18	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	431 758 820,18	16,876977%	9,586867%	2,084497%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-03-20	418 637 058,14	12,921 762,04	0,00	309 368 820,18	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	431 758 820,18	16,876977%	9,586867%	2,084497%	0,00	0,00	12,921 762,04	38,933 269,022	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-04-20	414 598 196,64	0,00	0,00	296 437 058,14	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	418 637 058,14	17,196456%	9,848412%	2,148807%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-05-20	410 393 113,31	0,00	0,00	296 437 058,14	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	418 637 058,14	17,196456%	9,848412%	2,148807%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-06-20	406 221 159,16	12,615 261,19	0,00	296 437 058,14	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	418 637 058,14	17,196456%	9,848412%	2,148807%	0,00	0,00	12,615 261,19	39,171 121,744	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-07-20	402 087 168,75	0,00	0,00	283 821 559,99	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	406 221 559,99	17,724318%	10,191483%	2,215540%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
09-08-20	397 985 776,59	0,00	0,00	283 821 559,99	72,000 00,00	414,000 00,00	9,000 00,00	19,800 00,00	406 221 559,99	17,724318%	10,191483%	2,215540%	0											

PCCIA	Disponible	Principal	DETRE A1	DETRE A2	DETRE B	DETRE L	DETRE U	DETRE E	las clases	% DETRE B	% DETRE L	% DETRE U	A1	A1	A2	Serie A2	Serie B	Serie B	Serie C	Serie C	Serie D	Serie D	Serie E	Serie E
														0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
Date	Principal available	Principal Redemption	Class A1	Class A2	Class B	Class C	Class D	Class E	Sum of all classes	% Class B	% Class C	% Class D	Redemption Class A1	Average Life Class A1	Redemption Class A2	Average Life Class A2	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C	Redemption Class D	Average Life Class D	Redemption Class E	Average Life Class E
09-12-24	1	227.084.278,45	7.949.148,73	0,00	112.833.427,18	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	235.033.427,18	30,633940%	17,814516%	3,829243%	0,00	0,00	7.949.148,73	37.750.507,328	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-01-25	0	224.480.922,38	0,00	0,00	104.684.278,45	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	227.084.278,45	31,706290%	18,231117%	3,963286%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-02-25	0	221.898.416,33	0,00	0,00	104.684.278,45	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	227.084.278,45	31,706290%	18,231117%	3,963286%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-03-25	1	219.337.501,56	7.746.776,89	0,00	104.684.278,45	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	227.084.278,45	31,706290%	18,231117%	3,963286%	0,00	0,00	7.746.776,89	37.486.653,388	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-04-25	0	216.797.719,24	0,00	0,00	96.937.501,56	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	219.337.501,56	32,826124%	18,875021%	4,103265%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-05-25	0	214.276.911,69	0,00	0,00	96.937.501,56	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	219.337.501,56	32,826124%	18,875021%	4,103265%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-06-25	1	211.780.923,55	7.556.578,01	0,00	96.937.501,56	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	219.337.501,56	32,826124%	18,875021%	4,103265%	0,00	0,00	7.556.578,01	37.261.486,162	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-07-25	0	209.307.688,88	0,00	0,00	89.380.923,55	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	211.780.923,55	33,997396%	19,548503%	4,249675%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-08-25	0	206.854.921,83	0,00	0,00	89.380.923,55	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	211.780.923,55	33,997396%	19,548503%	4,249675%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-09-25	1	204.422.469,81	7.358.453,74	0,00	89.380.923,55	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	211.780.923,55	33,997396%	19,548503%	4,249675%	0,00	0,00	7.358.453,74	36.961.513,195	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-10-25	0	202.010.181,29	0,00	0,00	82.022.469,81	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	204.422.469,81	35,221177%	20,252177%	4,402647%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-11-25	0	199.617.905,86	0,00	0,00	82.022.469,81	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	204.422.469,81	35,221177%	20,252177%	4,402647%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-12-25	1	197.245.494,17	7.176.975,64	0,00	82.022.469,81	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	204.422.469,81	35,221177%	20,252177%	4,402647%	0,00	0,00	7.176.975,64	36.703.053,416	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-01-26	0	194.911.991,03	0,00	0,00	74.845.494,17	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	197.245.494,17	36,502735%	20,989073%	4,562842%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-02-26	0	192.597.899,00	0,00	0,00	74.845.494,17	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	197.245.494,17	36,502735%	20,989073%	4,562842%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-03-26	1	190.302.953,49	6.942.540,67	0,00	74.845.494,17	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	197.245.494,17	36,502735%	20,989073%	4,562842%	0,00	0,00	6.942.540,67	36.128.981,673	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-04-26	0	188.027.130,99	0,00	0,00	67.902.953,49	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	190.302.953,49	37,834410%	21,754786%	4,726301%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-05-26	0	185.770.248,94	0,00	0,00	67.902.953,49	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	190.302.953,49	37,834410%	21,754786%	4,726301%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-06-26	1	183.532.165,65	6.770.787,85	0,00	67.902.953,49	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	190.302.953,49	37,834410%	21,754786%	4,726301%	0,00	0,00	6.770.787,85	35.858.092,435	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-07-26	0	181.356.505,16	0,00	0,00	61.132.165,65	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	183.532.165,65	39,230181%	22,557354%	4,903773%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-08-26	0	179.198.914,13	0,00	0,00	61.132.165,65	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	183.532.165,65	39,230181%	22,557354%	4,903773%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-09-26	1	177.099.257,66	6.472.907,98	0,00	61.132.165,65	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	183.532.165,65	39,230181%	22,557354%	4,903773%	0,00	0,00	6.472.907,98	34.876.028,208	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-10-26	0	174.937.491,82	0,00	0,00	54.659.257,66	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	177.099.257,66	40,664352%	23,382002%	5,083044%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-11-26	0	172.833.213,83	0,00	0,00	54.659.257,66	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	177.099.257,66	40,664352%	23,382002%	5,083044%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
09-12-26	1	170.746.561,05	177.059.257,66	0,00	54.659.257,66	72.000.000,00	41.400.000,00	9.000.000,00	19.800.000,00	177.059.257,66	40,664352%	23,382002%	5,083044%	0,00	0,00	54.659.257,66	299.478.072,746	72.000.000,00	394.488.000,00	41.400.000,00	226.830.600,00	9.000.000,00	49.311.000,00	