



F.T.A. UCI 11

MARIA JOSE HERENCIAS

ANALYST

SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.

CIUDAD GRUPO SANTANDER

28660 BOADILLA DEL MONTE

marjherencias@gruposantander.com

Tel: 912893300



NAME OF THE FUND: **F.T.A. UCI 11**

INFORMATION AT: **QUARTER/SEMESTER:** June 15, 2015 - September 15, 2015 **YEAR:** **2015**

Acting on behalf of Santander de Titulización S.G.F.T., S.A. as General Manager:	Signature:
IGNACIO ORTEGA GAVARA - GENERAL MANAGER	

I. DATA OF THE FUND

Constitution Date	November 16, 2004	Paying Agent	BANCO SANTANDER	
Disbursement Date	November 22, 2004	Negociation Market	AIAF	
Final Date of Redemption	September 15, 2041	Ratings Agencies	STANDARD & POORS	
Management Company	SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.	Rating	Initial	Current
Credit Rights's Seller	UNION DE CREDITOS INMOBILIARIOS	CLASS A	AAA	A
		CLASS B	A	BB-
		CLASS C	BBB	B-

II. SECURITIES ISSUED CHARGED TO THE FUND: SECURITISATION BONDS

CLASS PRIORITY ISIN CODE	NUM BONDS	NOMINAL			
			Initial	Current	%Act/In
CLASS A ES033834005	8.211	Nominal per Bond	100.000,00	22.011,76	
		Total Nominal	821.100.000,00	180.738.561,36	22,01 %
CLASS B ES0338340013	60	Nominal per Bond	100.000,00	100.000,00	
		Total Nominal	6.000.000,00	6.000.000,00	100,00 %
CLASS C ES0338340021	229	Nominal per Bond	100.000,00	100.000,00	
		Total Nominal	22.900.000,00	22.900.000,00	100,00 %

REDEMPTION AND INTEREST OF THE BONDS					
Current			Next		
Payment Date of the Current Period September 15, 2015			Next Payment Date December 15, 2015		
	Redemption of the Bonds	Gross Interest	Interest Rate	Gross Interest Next Coupon	Net Interest Next Coupon
CLASS A	511,35 €	7,25 €	0,102 %	5,68 €	4,57 €
CLASS B	0,00 €	80,76 €	0,292 %	73,81 €	59,42 €
CLASS C	0,00 €	188,09 €	0,712 %	179,98 €	144,89 €
Accrued amortisation due not payed	0,00 €				
Scheduled Amortisation	NO				

III. ASSET PURCHASED BY THE FUND: CREDIT RIGHTS

CREDIT RIGHTS	ISSUE DATE	CURRENT DATE
Numbre of CR's	11.356	3.953
CR's Outstanding to be amortised	850.000.156,93	215.380.251,30 €
CR's Outstanding per Loan to be amortised	74.850,30	54.485,26 €
Interest Rate	4,23 %	2,14 %

PREPAYMENT RATE	CURRENT SITUATION
Monthly Single Rate	4,07 %
Average Monthly Single Rate	2,95 %
Constant Prepayment Rate from Constitution	9,36 %

CURRENT DELINQUENCY	Up to 1 month	From 1 to 6 months	Greater than 6 months
Debt Due (Principal + Interest)	15.092,24	40.271,82	1.094.564,73
Debt to be amortised	0,00	0,00	214.745.341,08
Total Debt	15.092,24	40.271,82	215.839.905,81

F.T.A. UCI 11

QUARTERLY BONDS PAYOUT REPORT

September 15th, 2015

BONDS. PRINCIPAL	
Previous Balance	213.837.256,21 €
Principal Amortised	4.198.694,85 €
Outstanding Balance	209.638.561,36 €
% of Initial Balance	24,66%
Principal accrued and unpaid	-

INTEREST PAID	
CLASS A	59.529,75 €
CLASS B	4.845,60 €
CLASS C	43.072,61 €
Interest accrued and unpaid	0

DATA	
Pool Cut-off Date	2015/09/08
Payment Date	2015/09/15
Last Payment Date	2015/06/15
Number of Days (Act/360)	92
Reference Interest Rate (%)	-0,038%
Next Payment Date	2015/12/15

RESIDUAL LIFE (YEARS)		
	INITIAL	September 15th, 2015
CLASS A	4,75	3,74
CLASS B	7,93	6,01
CLASS C	7,91	6,01

F.T.A. UCI 11

QUARTERLY COLLATERAL REPORT

September 15th, 2015

PRINCIPAL	
Previous Balance	218.893.927,63 €
Principal Amortised	3.513.676,33 €
Outstanding Balance	215.380.251,30 €
Number of Credit Rights	3.953
LTV	49,84%

INTEREST	
Interest received during relevant period	1.100.678,25 €
Interest accrued during relevant period	1.306.058,28 €

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	12.037,98 €	7.766,20 €	3.885,16 €	15.083,35 €	596.137,53 €
Interest accrued on Credit Rights in Arrears	3.054,26 €	3.375,76 €	2.920,01 €	7.241,34 €	498.427,20 €
Outstanding Balance	3.256.001,36 €	1.218.683,93 €	527.896,66 €	762.216,58 €	6.580.784,69 €
Number of Credit Rights	52	22	8	12	157
% of Outstanding Balance	1,51%	0,57%	0,25%	0,35%	3,06%

WRITE OFF	
Cumulative WRITE OFF as of previous balance	5.056.694,90 €
Difference in Actual Period	684.982,84 €
Cumulative WRITE OFF up to date	5.741.677,74 €

F.T.A. UCI 11

QUARTERLY COLLATERAL REPORT

September 15th, 2015

TRANSITORY PROPERTIES	
Last balance	1.748.214,29 €
Difference in Actual Period	-128.433,24 €
Current balance	1.619.781,05 €
Number of transitory properties	44

NET LOSSES	
Last balance	1.558.946,25 €
Difference in Actual Period	131.387,58 €
Current balance	1.690.333,83 €

F.T.A. UCI 11

QUARTERLY REPORT - ALLOCATION OF CASH

September 15th, 2015

TOTAL CASH RECEIVED END OF PERIOD	4.870.476,98 €
CASH RECEIVED - PRINCIPAL	
Amortisation of Credit Rights	3.458.376,41 €
CASH RECEIVED - INTEREST	
Interest received from Credit Rights	1.100.678,25 €
Interest received under GIC	-3.792,46 €
INCOMES/EXPENSES OF TRANSTORY PROPERTIES	264.448,67 €
INCOMES/EXPENSES OF INSURED PROPERTIES	51.255,00 €
OTHERS	-488,89 €

TREASURY ACCOUNT STATEMENT	12.750.000,00 €
PRINCIPAL RESERVE FUND	
Previous Balance	12.750.000,00 €
Period utilization	0,00 €
Outstanding Balance	12.750.000,00 €

TOTAL CASH PAID END OF PERIOD	4.870.476,98 €
ORDINARY EXPENSES	4.285,82 €
MANAGEMENT FEE	14.174,06 €
SWAP PAYMENT	0
SWAP COLLECTION	0
INTEREST ON CLASS A BONDS	59.529,75 €
INTEREST ON CLASS B BONDS	4.845,60 €
INTEREST ON CLASS C BONDS	43.072,61 €
REDEMPTION ON CLASS A BONDS	4.198.694,85 €
INTEREST ON SUBORDINATED LOAN SANTANDER	9.547,50 €
INTEREST ON SUBORDINATED LOAN UCB	9.547,50 €
FIXED FEE	6.000,00 €
VARIABLE FEE	520.779,29 €

F.T.A. UCI 11

CREDIT ENHACEMENT AND SUBORDINATED LOAN

September 15th, 2015

CREDIT ENHACEMENT			
CONCEPTS	INITIAL		September 15th, 2015
SUBORDINATED ISSUE	28.900.000,00 €	3,40%	28.900.000,00 € 13,79%
PRINCIPAL RESERVE FUND	12.750.000,00 €	1,50%	12.750.000,00 € 6,08%

SUBORDINATED LOANS		
CONCEPTS	INITIAL	September 15th, 2015
SUBORDINATED LOAN SCH		
Total Outstanding Subordinated Loan	6.812.500,00 €	6.375.386,18 €
Interest Rate	2,790 %	0,586%
SUBORDINATED LOAN UCB		
Total Outstanding Subordinated Loan	6.812.500,00 €	6.375.386,18 €
Interest Rate	2,790 %	0,586%

F.T.A. UCI 11

DEFINITIONS

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

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

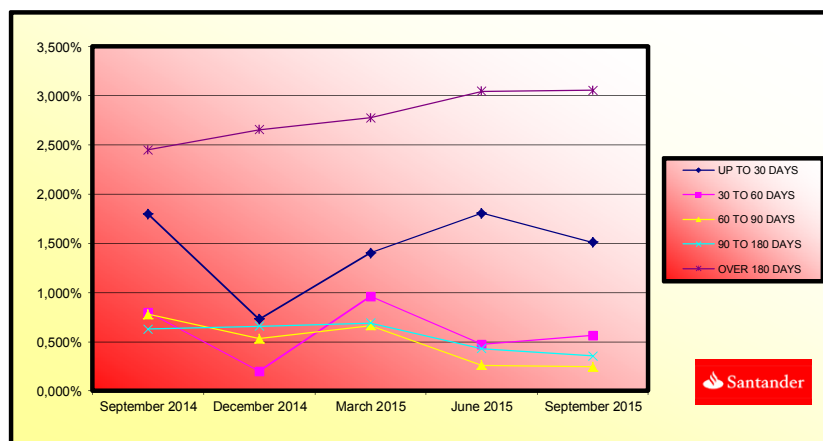
WRITE OFF Those loans that at a given date are unpaid for a period equal or higher to 12 or 18 months (according to Prospectus) of arrears in due payments.

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

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

**FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS
UCI 11**

ARREARS PERFORMANCE					
	September 2014	December 2014	March 2015	June 2015	September 2015
UP TO 30 DAYS	1,798%	0,730%	1,403%	1,807%	1,512%
30 TO 60 DAYS	0,800%	0,200%	0,961%	0,472%	0,566%
60 TO 90 DAYS	0,780%	0,532%	0,666%	0,263%	0,245%
90 TO 180 DAYS	0,628%	0,658%	0,690%	0,430%	0,354%
OVER 180 DAYS	2,453%	2,656%	2,775%	3,045%	3,055%



UCI 11

TRIGGERS

Report date: June 15th, 2015

CLASS B AND CLASS C REDEMPTION	
IF 1) IS HIGHER THAN 2) CLASS B AND CLASS C ARE NOT REDEEMED	
1) CREDIT RIGHTS IN ARREARS OVER 90 DAYS	13.084.659,01 €
2) 2% CREDIT RIGHTS OUTSTANDING BALANCE	4.307.605,03 €

CURRENT ARREARS > 90 DAYS PERCENTAGE
6,08%

CLASSES B & C CANNOT BE REDEEMED

RESERVE FUNDS TRIGGERS:	
IF 1) IS HIGHER THAN 2) RESERVE FUNDS WILL NOT BE REDEEMED	
1) CREDIT RIGHTS IN ARREARS OVER 90 DAYS	13.084.659,01 €
2) 1,25% CREDIT RIGHTS OUTSTANDING BALANCE	2.692.253,14 €

RESERVE FUND IS NOT REDEEMED

INTEREST DEFERRAL FOR CLASS B AND C	
IF 1) IS HIGHER THAN 2)+3) CLASS B INTERESTS ARE DEFERRED TO POSITION 7°	
1) CLASS A OUTSTANDING BALANCE	184.937.256,21 €
2) CR OUTSTANDING BALANCE (EXCLUDING ARREARS > 18 MONTHS)	207.373.541,42 €
3) REMAINING FUNDS AFTER PAYMENTS POINTS 1° TO 4°	17.537.641,75 €
IF 1) IS HIGHER THAN 2)+3) CLASS C INTERESTS ARE DEFERRED TO POSITION 8°	
1) CLASS A AND CLASS B OUTSTANDING BALANCE	190.937.256,21 €
2) CR OUTSTANDING BALANCE (EXCLUDING ARREARS > 18 MONTHS)	207.373.541,42 €
3) REMAINING FUNDS AFTER PAYMENTS POINTS 1° TO 5°	17.494.569,14 €

CLASS B INTEREST ARE NOT DEFERRED

CLASS C INTEREST ARE NOT DEFERRED

AGREEMENT	COUNTERPARTY	RATING AGENCY	MINIMUM RATING REQUIRED	CURRENT RATING
TREASURY ACCOUNT	BANCO SANTANDER	S&P	A-1 s/t	A-2 s/t

COUNTERPARTY DOES NOT HAVE THE MINIMUM RATING REQUIRED. TREASURY ACCOUNT HAS BEEN TRANSFERRED TO A COUNTERPARTY WITH MINIMUM RATING REQUIRED.

LTV				
INTERVAL	OUTSTANDING	% OUTSTANDING	NUM.OF LOANS	% NUM.OF LOANS
0,25 - 9,99	1.146.909,80 €	0,56%	104	3,50%
10,00 - 19,99	4.092.663,15 €	1,98%	132	4,44%
20,00 - 29,99	8.657.225,33 €	4,20%	176	5,92%
30,00 - 39,99	23.886.938,28 €	11,58%	328	11,03%
40,00 - 49,99	29.923.351,32 €	14,50%	400	13,45%
50,00 - 59,99	74.513.411,79 €	36,11%	1.040	34,98%
60,00 - 69,99	44.015.900,87 €	21,33%	580	19,51%
70,00 - 79,99	16.900.945,55 €	8,19%	183	6,16%
80,00 - 89,99	2.919.970,42 €	1,42%	28	0,94%
90,00 - 93,61	269.190,88 €	0,13%	2	0,07%

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

Fecha	Saldo antes de Pago	Saldo Real	vector de Prepago	Remanencia 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
			0,82%					2,95%
8-jul-07	797.986.907,49	404.454.167,85	76,94%	50,68%	2,10%	22,50%	1,65%	18,11%
8-ago-07	796.282.855,93	396.791.374,83	76,31%	49,83%	2,09%	22,38%	1,68%	18,44%
8-sep-07	794.573.805,82	391.376.030,13	75,69%	49,26%	2,06%	22,11%	1,15%	12,99%
8-oct-07	792.859.742,50	386.989.073,29	75,07%	48,81%	2,03%	21,80%	0,91%	10,36%
8-nov-07	791.140.651,25	381.540.150,55	74,46%	48,23%	2,01%	21,58%	1,19%	13,42%
8-dic-07	789.416.517,34	374.085.117,49	73,85%	47,39%	2,00%	21,51%	1,74%	18,99%
8-ene-08	787.694.525,33	368.864.560,67	73,25%	46,83%	1,98%	21,30%	1,18%	13,28%
8-feb-08	785.967.482,14	365.347.329,01	72,65%	46,48%	1,95%	21,00%	0,74%	8,48%
8-mar-08	784.235.372,95	361.954.516,26	72,06%	46,15%	1,91%	20,70%	0,71%	8,19%
8-abr-08	782.498.182,91	356.988.908,13	71,47%	45,62%	1,90%	20,52%	1,15%	12,99%
8-may-08	780.755.897,12	351.895.556,23	70,89%	45,07%	1,88%	20,36%	1,21%	13,56%
8-jun-08	779.008.500,62	348.169.826,92	70,31%	44,69%	1,86%	20,13%	0,84%	9,59%
8-jul-08	777.259.527,22	347.228.513,39	69,74%	44,67%	1,81%	19,73%	0,05%	0,55%
8-ago-08	775.505.423,51	346.077.498,92	69,17%	44,63%	1,78%	19,36%	0,11%	1,27%
8-sep-08	773.746.174,42	341.634.083,80	68,60%	44,15%	1,76%	19,21%	1,06%	12,00%
8-oct-08	771.981.764,88	338.356.595,89	68,04%	43,83%	1,74%	18,99%	0,73%	8,45%
8-nov-08	770.212.179,73	335.395.338,94	67,49%	43,55%	1,72%	18,77%	0,65%	7,50%
8-dic-08	768.437.403,79	333.970.278,42	66,94%	43,46%	1,69%	18,46%	0,19%	2,31%
8-ene-09	766.659.103,76	331.962.327,38	66,39%	43,30%	1,66%	18,20%	0,37%	4,36%
8-feb-09	764.875.587,37	329.978.849,13	65,85%	43,14%	1,63%	17,95%	0,37%	4,30%
8-mar-09	763.086.839,34	328.476.806,46	65,31%	43,05%	1,61%	17,68%	0,22%	2,63%
8-abr-09	761.292.844,32	326.273.336,82	64,78%	42,86%	1,59%	17,46%	0,44%	5,12%
8-may-09	759.493.586,90	323.503.228,38	64,25%	42,59%	1,57%	17,28%	0,61%	7,13%
8-jun-09	757.689.051,67	321.386.971,51	63,73%	42,42%	1,55%	17,07%	0,42%	4,90%
8-jul-09	755.881.308,93	319.112.570,09	63,21%	42,22%	1,53%	16,87%	0,47%	5,50%
8-ago-09	754.068.263,48	317.841.095,04	62,69%	42,15%	1,50%	16,63%	0,16%	1,89%
8-sep-09	752.249.899,76	314.354.974,81	62,18%	41,79%	1,49%	16,52%	0,86%	9,82%
8-oct-09	750.426.202,17	312.492.643,31	61,67%	41,64%	1,47%	16,32%	0,35%	4,13%
8-nov-09	748.597.155,07	309.793.127,81	61,17%	41,38%	1,46%	16,18%	0,62%	7,21%
8-dic-09	746.762.742,76	307.081.055,36	60,67%	41,12%	1,45%	16,04%	0,63%	7,33%
8-ene-10	744.925.018,92	304.171.922,35	60,18%	40,83%	1,43%	15,92%	0,70%	8,12%
8-feb-10	743.081.904,42	302.891.409,39	59,69%	40,76%	1,41%	15,71%	0,17%	2,07%
8-mar-10	741.233.383,45	300.122.393,54	59,20%	40,49%	1,40%	15,59%	0,67%	7,72%
8-abr-10	739.379.440,15	297.807.053,26	58,72%	40,28%	1,39%	15,45%	0,52%	6,09%
8-may-10	737.520.058,62	295.608.835,47	58,24%	40,08%	1,38%	15,31%	0,49%	5,70%
8-jun-10	735.655.222,91	293.760.620,91	57,76%	39,93%	1,36%	15,16%	0,37%	4,39%
8-jul-10	733.787.447,69	291.341.154,99	57,29%	39,70%	1,35%	15,04%	0,57%	6,64%
8-ago-10	731.914.193,66	289.072.708,07	56,82%	39,50%	1,34%	14,92%	0,52%	6,12%
8-sep-10	730.035.444,76	287.255.851,54	56,36%	39,35%	1,32%	14,78%	0,37%	4,38%
8-oct-10	728.151.184,86	286.099.404,91	55,90%	39,29%	1,31%	14,61%	0,14%	1,72%
8-nov-10	726.261.397,79	284.751.082,83	55,44%	39,21%	1,29%	14,45%	0,21%	2,52%
8-dic-10	724.366.067,35	281.674.551,27	54,99%	38,89%	1,29%	14,38%	0,82%	9,43%
8-ene-11	722.468.266,09	278.838.334,02	54,54%	38,60%	1,28%	14,31%	0,75%	8,60%
8-feb-11	720.564.897,95	277.785.066,79	54,10%	38,55%	1,26%	14,14%	0,11%	1,37%
8-mar-11	718.655.946,59	275.983.701,22	53,66%	38,40%	1,25%	14,02%	0,38%	4,52%
8-abr-11	716.741.395,64	274.448.612,53	53,22%	38,29%	1,24%	13,90%	0,29%	3,43%
8-may-11	714.821.228,68	273.778.936,22	52,78%	38,30%	1,22%	13,73%	-0,02%	-0,29%
8-jun-11	712.895.429,22	271.621.942,31	52,35%	38,10%	1,21%	13,63%	0,52%	6,06%
8-jul-11	710.965.191,30	270.217.689,41	51,93%	38,01%	1,20%	13,51%	0,25%	2,92%
8-ago-11	709.029.291,35	269.318.086,88	51,50%	37,98%	1,19%	13,36%	0,06%	0,73%
8-sep-11	707.087.712,76	268.147.150,38	51,08%	37,92%	1,18%	13,23%	0,16%	1,92%
8-oct-11	705.140.438,88	267.183.876,05	50,67%	37,89%	1,16%	13,09%	0,08%	1,00%

Fecha	Saldo antes de Pago	Saldo Real	vector de Prepago	Remanencia 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
			0,82%					2,95%
8-nov-11	703.187.452,99	265.696.089,52	50,25%	37,78%	1,15%	12,98%	0,28%	3,32%
8-dic-11	701.228.738,34	264.288.500,39	49,84%	37,69%	1,14%	12,87%	0,25%	2,98%
8-ene-12	699.269.967,10	263.261.093,09	49,44%	37,65%	1,13%	12,74%	0,11%	1,31%
8-feb-12	697.305.450,14	261.893.291,79	49,03%	37,56%	1,12%	12,63%	0,24%	2,83%
8-mar-12	695.335.170,59	260.588.400,21	48,63%	37,48%	1,11%	12,53%	0,22%	2,57%
8-abr-12	693.359.111,56	258.867.875,32	48,24%	37,34%	1,10%	12,44%	0,38%	4,43%
8-may-12	691.377.256,08	258.896.709,85	47,84%	37,45%	1,09%	12,28%	-0,30%	-3,63%
8-jun-12	689.389.587,16	257.436.239,31	47,45%	37,34%	1,08%	12,18%	0,28%	3,28%
8-jul-12	687.399.418,55	256.481.587,36	47,07%	37,31%	1,07%	12,07%	0,08%	0,98%
8-ago-12	685.403.412,10	254.970.529,27	46,68%	37,20%	1,06%	11,98%	0,30%	3,54%
8-sep-12	683.401.550,70	254.189.633,03	46,30%	37,19%	1,05%	11,86%	0,01%	0,17%
8-oct-12	681.393.817,18	253.392.724,66	45,92%	37,19%	1,04%	11,75%	0,02%	0,24%
8-nov-12	679.380.194,30	252.365.440,68	45,55%	37,15%	1,03%	11,64%	0,11%	1,31%
8-dic-12	677.360.664,80	251.163.845,27	45,18%	37,08%	1,02%	11,55%	0,18%	2,13%
8-ene-13	675.341.971,78	249.665.572,52	44,81%	36,97%	1,01%	11,47%	0,30%	3,53%
8-feb-13	673.317.357,26	248.481.194,60	44,44%	36,90%	1,00%	11,38%	0,18%	2,08%
8-mar-13	671.286.803,87	247.478.924,29	44,08%	36,87%	0,99%	11,29%	0,10%	1,22%
8-abr-13	669.250.294,19	246.515.375,54	43,72%	36,83%	0,98%	11,19%	0,09%	1,03%
8-may-13	667.207.810,75	245.328.736,88	43,36%	36,77%	0,98%	11,10%	0,18%	2,10%
8-jun-13	665.159.336,02	243.923.229,33	43,01%	36,67%	0,97%	11,03%	0,27%	3,15%
8-jul-13	663.111.616,14	242.816.536,85	42,66%	36,62%	0,96%	10,95%	0,15%	1,74%
8-ago-13	661.057.889,62	241.563.340,00	42,31%	36,54%	0,95%	10,87%	0,21%	2,46%
8-sep-13	658.998.138,83	240.513.483,02	41,97%	36,50%	0,95%	10,78%	0,12%	1,47%
8-oct-13	656.932.346,11	239.510.480,13	41,62%	36,46%	0,94%	10,70%	0,10%	1,24%
8-nov-13	654.860.493,73	238.293.492,12	41,28%	36,39%	0,93%	10,62%	0,19%	2,30%
8-dic-13	652.782.563,92	236.956.654,81	40,95%	36,30%	0,93%	10,56%	0,24%	2,89%
8-ene-14	650.703.792,43	235.767.057,78	40,61%	36,23%	0,92%	10,48%	0,18%	2,19%
8-feb-14	648.618.923,21	234.640.850,19	40,28%	36,18%	0,91%	10,41%	0,16%	1,88%
8-mar-14	646.527.938,38	233.088.807,16	39,95%	36,05%	0,91%	10,35%	0,34%	4,01%
8-abr-14	644.430.819,99	231.810.963,21	39,63%	35,97%	0,90%	10,29%	0,22%	2,66%
8-may-14	642.327.550,05	230.695.545,90	39,30%	35,92%	0,89%	10,22%	0,16%	1,85%
8-jun-14	640.218.110,52	229.708.916,49	38,98%	35,88%	0,89%	10,14%	0,10%	1,19%
8-jul-14	638.109.627,99	228.113.352,62	38,66%	35,75%	0,88%	10,09%	0,37%	4,31%
8-ago-14	635.994.960,57	226.673.132,50	38,35%	35,64%	0,88%	10,04%	0,30%	3,55%
8-sep-14	633.874.090,14	225.192.852,10	38,04%	35,53%	0,87%	9,99%	0,32%	3,78%
8-oct-14	631.746.998,48	223.972.429,77	37,73%	35,45%	0,87%	9,93%	0,21%	2,46%
8-nov-14	629.613.667,35	222.674.737,24	37,42%	35,37%	0,86%	9,87%	0,24%	2,87%
8-dic-14	627.474.078,45	221.379.343,87	37,11%	35,28%	0,86%	9,82%	0,24%	2,87%
8-ene-15	625.339.624,04	219.758.096,05	36,81%	35,14%	0,85%	9,77%	0,39%	4,62%
8-feb-15	623.198.908,55	218.662.726,28	36,51%	35,09%	0,85%	9,71%	0,16%	1,86%
8-mar-15	621.051.913,64	217.271.524,92	36,21%	34,98%	0,84%	9,66%	0,29%	3,46%
8-abr-15	618.898.620,87	216.019.650,16	35,92%	34,90%	0,84%	9,61%	0,23%	2,73%
8-may-15	616.739.011,78	214.967.591,23	35,62%	34,86%	0,83%	9,55%	0,14%	1,65%
8-jun-15	614.573.067,83	213.837.232,73	35,33%	34,79%	0,83%	9,49%	0,18%	2,08%
8-jul-15	612.414.873,02	212.477.020,97	35,05%	34,69%	0,82%	9,45%	0,29%	3,38%
8-ago-15	610.250.347,50	211.117.313,01	34,76%	34,60%	0,82%	9,40%	0,29%	3,40%
8-sep-15	608.079.472,71	209.638.573,56	34,48%	34,48%	0,82%	9,36%	0,35%	4,07%

Fecha		Principal disponible antes prepago	Principal Disponible	Amortización de principal	Serie A	Serie B	Serie C	Amortización Serie A	Vida Media Serie A	Amortización Serie B	Vida Media Serie B	Amortización Serie C	Vida Media Serie C
									3.74		6.01		6.01
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											
8-dic-04		848.447.342,89			821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00						
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	816.562.213,29	33.437.786,71	821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00	33.437.786,71	-12626734982743,80%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-05	0	842.190.403,73	0,00	0,00	787.662.213,29	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	787.662.213,29	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	792.275.949,00	24.286.264,29	787.662.213,29	6.000.000,00	22.900.000,00	24.286.264,29	-9092777351166,37%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-05	0	837.449.355,83	0,00	0,00	763.375.949,00	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	763.375.949,00	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	768.649.167,93	23.626.781,07	763.375.949,00	6.000.000,00	22.900.000,00	23.626.781,07	-8628500445207,29%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-05	0	832.666.464,23	0,00	0,00	739.749.167,93	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	739.749.167,93	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	745.664.765,52	22.984.402,41	739.749.167,93	6.000.000,00	22.900.000,00	22.984.402,41	-8184745696424,73%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-06	0	827.841.359,61	0,00	0,00	716.764.765,52	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	716.764.765,52	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	723.306.069,59	22.358.695,93	716.764.765,52	6.000.000,00	22.900.000,00	22.358.695,93	-7760703357836,42%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-06	0	822.973.669,39	0,00	0,00	694.406.069,59	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	694.406.069,59	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-06	1	819.704.698,44	701.556.829,56	21.749.240,03	694.406.069,59	6.000.000,00	22.900.000,00	21.749.240,03	-7349068206595,95%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-06	0	818.063.017,72	0,00	0,00	672.656.829,56	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	672.656.829,56	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	680.401.205,97	21.155.623,59	672.656.829,56	6.000.000,00	22.900.000,00	21.155.623,59	-6953853474020,04%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-06	0	813.109.025,44	0,00	0,00	651.501.205,97	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	651.501.205,97	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	659.823.760,24	20.577.445,73	651.501.205,97	6.000.000,00	22.900.000,00	20.577.445,73	-6576551656345,68%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-07	0	808.111.707,58	0,00	0,00	630.923.760,24	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	630.923.760,24	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-07	1	804.755.214,89	639.810.395,69	20.013.364,55	630.923.760,24	6.000.000,00	22.900.000,00	20.013.364,55	-6216151028171,47%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-07	0	803.071.082,85	0,00	0,00	610.910.395,69	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	610.910.395,69	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	620.345.456,77	19.464.938,93	610.910.395,69	6.000.000,00	22.900.000,00	19.464.938,93	-5866732592035,87%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-07	0	797.986.907,49	0,00	0,00	591.445.456,77	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	591.445.456,77	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-07	1	794.573.805,82	601.416.783,87	18.928.672,89	591.445.456,77	6.000.000,00	22.900.000,00	18.928.672,89	-5530958219025,98%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-07	0	792.859.742,50	0,00	0,00	572.516.783,87	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	572.516.783,87	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	583.008.226,21	18.408.557,67	572.516.783,87	6.000.000,00	22.900.000,00	18.408.557,67	-5211462676136,73%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-08	0	787.694.525,33	0,00	0,00	554.108.226,21	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	554.108.226,21	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	565.121.817,57	17.886.408,64	554.108.226,21	6.000.000,00	22.900.000,00	17.886.408,64	-4900875967153,53%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-08	0	782.498.182,91	0,00	0,00	536.221.817,57	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	536.221.817,57	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	547.728.094,14	17.393.723,43	536.221.817,57	6.000.000,00	22.900.000,00	17.393.723,43	-4605857964573,69%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-08	0	777.259.527,22	0,00	0,00	518.828.094,14	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	518.828.094,14	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	530.821.504,95	16.906.589,19	518.828.094,14	6.000.000,00	22.900.000,00	16.906.589,19	-4321324196142,50%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-08	0	771.981.764,88	0,00	0,00	501.921.504,95	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	501.921.504,95	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	514.381.882,76	16.439.622,19	501.921.504,95	6.000.000,00	22.900.000,00	16.439.622,19	-4052366870215,45%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-09	0	766.659.103,79	0,00	0,00	485.481.882,76	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	485.481.882,76	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	498.400.311,09	15.981.571,66	485.481.882,76	6.000.000,00	22.900.000,00	15.981.571,66	-3795623270040,02%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-09	0	761.292.844,32	0,00	0,00	469.500.311,09	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	469.500.311,09	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	482.861.441,60	15.538.869,49	469.500.311,09	6.000.000,00	22.900.000,00	15.538.869,49	-3547523905345,08%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-09	0	755.881.308,93	0,00	0,00	453.961.441,60	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	453.961.441,60	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%

										3.74		6.01		6.01	
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-09	1	752.249.899,76	467.757.572,31	15.103.869,29	453.961.441,60	6.000.000,00	22.900.000,00	15.103.869,29	-3309257761543,81%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-oct-09	0	750.426.202,17	0,00	0,00	438.857.572,31	6.000.000,00	22.900.000,00	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	438.857.572,31	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-dic-09	1	746.762.742,76	453.073.335,86	14.684.236,45	438.857.572,31	6.000.000,00	22.900.000,00	14.684.236,45	-3083689655055,23%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-ene-10	0	744.925.018,92	0,00	0,00	424.173.335,86	6.000.000,00	22.900.000,00	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	424.173.335,86	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-mar-10	1	741.233.383,45	438.801.401,55	14.271.934,31	424.173.335,86	6.000.000,00	22.900.000,00	14.271.934,31	-2868658795526,19%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-abr-10	0	739.379.440,15	0,00	0,00	409.901.401,55	6.000.000,00	22.900.000,00	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	409.901.401,55	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jun-10	1	735.655.222,91	424.927.199,96	13.874.201,60	409.901.401,55	6.000.000,00	22.900.000,00	13.874.201,60	-2661071865968,17%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jul-10	0	733.787.447,69	0,00	0,00	396.027.199,96	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-ago-10	0	731.914.193,06	0,00	0,00	396.027.199,96	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-sep-10	1	730.035.444,76	411.444.564,14	13.482.635,82	396.027.199,96	6.000.000,00	22.900.000,00	13.482.635,82	-2461929299978,77%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-oct-10	0	728.151.184,86	0,00	0,00	382.544.564,14	6.000.000,00	22.900.000,00	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	382.544.564,14	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-dic-10	1	724.366.067,35	398.338.839,43	13.105.724,71	382.544.564,14	6.000.000,00	22.900.000,00	13.105.724,71	-2273843237488,35%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-ene-11	0	722.468.266,09	0,00	0,00	369.438.839,43	6.000.000,00	22.900.000,00	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	369.438.839,43	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-mar-11	1	718.655.946,59	385.605.085,60	12.733.753,83	369.438.839,43	6.000.000,00	22.900.000,00	12.733.753,83	-2094702504778,61%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-abr-11	0	716.741.395,64	0,00	0,00	356.705.085,60	6.000.000,00	22.900.000,00	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	356.705.085,60	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jun-11	1	712.895.429,22	373.228.443,14	12.376.642,46	356.705.085,60	6.000.000,00	22.900.000,00	12.376.642,46	-1922092574215,45%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jul-11	0	710.965.191,30	0,00	0,00	344.328.443,14	6.000.000,00	22.900.000,00	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	344.328.443,14	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-sep-11	1	707.087.712,76	361.201.351,81	12.027.091,33	344.328.443,14	6.000.000,00	22.900.000,00	12.027.091,33	-1757158043485,79%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-oct-11	0	705.140.439,88	0,00	0,00	332.301.351,81	6.000.000,00	22.900.000,00	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	332.301.351,81	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-dic-11	1	701.228.738,34	349.512.696,34	11.688.655,47	332.301.351,81	6.000.000,00	22.900.000,00	11.688.655,47	-1601345799645,23%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-ene-12	0	699.269.967,10	0,00	0,00	320.612.696,34	6.000.000,00	22.900.000,00	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	320.612.696,34	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-mar-12	1	695.335.170,59	338.161.857,59	11.350.838,75	320.612.696,34	6.000.000,00	22.900.000,00	11.350.838,75	-1451772275680,13%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-abr-12	0	693.359.111,56	0,00	0,00	309.261.857,59	6.000.000,00	22.900.000,00	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	309.261.857,59	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jun-12	1	689.380.587,16	327.131.463,16	11.030.399,45	309.261.857,59	6.000.000,00	22.900.000,00	11.030.399,45	-1309307786225,10%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jul-12	0	687.399.418,55	0,00	0,00	298.231.463,43	6.000.000,00	22.900.000,00	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	298.231.463,43	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-sep-12	1	683.401.550,70	316.417.671,73	10.713.791,70	298.231.463,43	6.000.000,00	22.900.000,00	10.713.791,70	-1173160191331,81%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-oct-12	0	681.393.817,18	0,00	0,00	287.517.671,73	6.000.000,00	22.900.000,00	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	287.517.671,73	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-dic-12	1	677.360.664,80	306.007.391,75	10.410.279,98	287.517.671,73	6.000.000,00	22.900.000,00	10.410.279,98	-1045192109798,83%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-ene-13	0	675.341.971,78	0,00	0,00	277.107.391,75	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-feb-13	1	673.317.357,26	0,00	0,00	277.107.391,75	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-mar-13	1	671.286.803,87	295.901.541,52	10.105.850,24	277.107.391,75	6.000.000,00	22.900.000,00	10.105.850,24	-923674711660,45%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-abr-13	0	669.250.294,19	0,00	0,00	267.001.541,52	6.000.000,00	22.900.000,00	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	267.001.541,52	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jun-13	1	665.159.336,02	286.082.954,56	9.818.586,96	267.001.541,52	6.000.000,00	22.900.000,00	9.818.586,96	-807087847731,45%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jul-13	0	663.111.616,14	0,00	0,00	257.182.954,56	6.000.000,00	22.900.000,00	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	257.182.954,56	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-sep-13	1	658.998.138,83	276.552.540,78	9.530.413,78	257.182.954,56	6.000.000,00	22.900.000,00	9.530.413,78	-695720205753,74%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-oct-13	0	656.932.346,11	0,00	0,00	247.652.540,78	6.000.000,00	22.900.000,00	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	247.652.540,78	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-dic-13	1	652.782.563,92	267.293.983,92	9.258.556,87	247.652.540,78	6.000.000,00	22.900.000,00	9.258.556,87	-591621783722,74%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-ene-14	0	650.703.792,43	0,00	0,00	238.393.983,92	6.000.000,00	22.900.000,00	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	238.393.983,92	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-mar-14	1	646.527.938,38	258.306.365,44	8.987.618,48	238.393.983,92	6.000.000,00	22.900.000,00	8.987.618,48	-493420254392,24%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-abr-14	0	644.430.819,99	0,00	0,00	229.406.365,44	6.000.000,00	22.900.000,00	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	229.406.365,44	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jun-14	1	640.218.110,52	249.576.069,42	8.730.296,03	229.406.365,44	6.000.000,00	22.900.000,00	8.730.296,03	-398974528358,74%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-jul-14	0	638.109.627,99	0,00	0,00	220.676.069,42	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-ago-14	0	635.994.960,57	0,00	0,00	220.676.069,42	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-sep-14	1	633.874.090,14	241.104.412,79	8.471.656,62	220.676.069,42	6.000.000,00	22.900.000,00	8.471.656,62	-309215466739,85%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-oct-14	0	631.746.998,48	0,00	0,00	212.204.412,79	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-nov-14	0	629.613.667,35	0,00	0,00	212.204.412,79	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	
8-dic-14	1	627.474.078,45	232.876.208,61	8.228.204,19	212.204.412,79	6.000.000,00	22.900.000,00	8.228.							

								3,74		6,01		6,01	
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	156.984.214,74	5.906.503,32	133.990.718,07	6.000.000,00	22.900.000,00	5.906.503,32	431765392962,87%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-17	0	551.966.993,18	0,00	0,00	128.084.214,74	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	128.084.214,74	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	151.251.675,05	5.732.539,70	128.084.214,74	6.000.000,00	22.900.000,00	5.732.539,70	471214762986,58%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-18	0	545.002.656,18	0,00	0,00	122.351.675,05	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	122.351.675,05	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	145.696.372,81	5.555.302,24	122.351.675,05	6.000.000,00	22.900.000,00	5.555.302,24	506643564348,77%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-18	0	537.996.601,88	0,00	0,00	116.796.372,81	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	116.796.372,81	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	140.305.433,15	5.390.939,66	116.796.372,81	6.000.000,00	22.900.000,00	5.390.939,66	541250341775,70%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-18	0	530.937.947,54	0,00	0,00	111.405.433,15	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	111.405.433,15	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	135.081.536,28	5.223.896,87	111.405.433,15	6.000.000,00	22.900.000,00	5.223.896,87	572539096747,40%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-18	0	523.835.544,50	0,00	0,00	106.181.536,28	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	106.181.536,28	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	130.012.928,14	5.068.608,14	106.181.536,28	6.000.000,00	22.900.000,00	5.068.608,14	601643786237,34%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-19	0	516.677.835,93	0,00	0,00	101.112.928,14	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	101.112.928,14	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-19	1	511.880.836,23	125.100.819,10	4.912.109,04	101.112.928,14	6.000.000,00	22.900.000,00	4.912.109,04	627276324187,58%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-19	0	509.471.777,84	0,00	0,00	96.200.819,10	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	96.200.819,10	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	120.335.459,87	4.765.359,23	96.200.819,10	6.000.000,00	22.900.000,00	4.765.359,23	652377678952,33%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-19	0	502.221.183,66	0,00	0,00	91.435.459,87	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-19	0	499.802.853,70	0,00	0,00	91.435.459,87	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-19	1	497.377.429,98	115.726.202,85	4.609.257,02	91.435.459,87	6.000.000,00	22.900.000,00	4.609.257,02	673412450458,57%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-19	0	494.944.891,68	0,00	0,00	86.826.202,85	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-19	0	492.505.217,93	0,00	0,00	86.826.202,85	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-19	1	490.058.387,81	111.255.279,74	4.470.923,11	86.826.202,85	6.000.000,00	22.900.000,00	4.470.923,11	693887267055,57%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-20	0	487.648.819,99	0,00	0,00	82.355.279,74	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-20	0	485.232.184,09	0,00	0,00	82.355.279,74	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-20	1	482.808.459,40	106.948.536,87	4.306.742,87	82.355.279,74	6.000.000,00	22.900.000,00	4.306.742,87	707597853267,34%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-20	0	480.377.625,12	0,00	0,00	78.048.536,87	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-20	0	477.939.660,39	0,00	0,00	78.048.536,87	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-20	1	475.494.544,30	102.771.498,38	4.177.038,49	78.048.536,87	6.000.000,00	22.900.000,00	4.177.038,49	724716177522,14%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-20	0	473.072.712,19	0,00	0,00	73.871.498,38	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-20	0	470.643.776,03	0,00	0,00	73.871.498,38	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-20	1	468.207.715,00	98.739.946,89	4.031.551,49	73.871.498,38	6.000.000,00	22.900.000,00	4.031.551,49	736564457088,05%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-oct-20	0	465.764.508,19	0,00	0,00	69.839.946,89	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-nov-20	0	463.314.134,64	0,00	0,00	69.839.946,89	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-dic-20	1	460.856.573,33	94.830.334,74	3.909.612,16	69.839.946,89	6.000.000,00	22.900.000,00	3.909.612,16	749863611435,56%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ene-21	0	458.394.156,08	0,00	0,00	65.930.334,74	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-feb-21	0	455.924.515,75	0,00	0,00	65.930.334,74	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-mar-21	1	453.447.631,13	91.040.746,09	3.789.588,64	65.930.334,74	6.000.000,00	22.900.000,00	3.789.588,64	760949399413,28%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-abr-21	0	450.963.480,99	0,00	0,00	62.140.746,09	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-may-21	0	448.472.044,01	0,00	0,00	62.140.746,09	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jun-21	1	445.973.298,81	87.366.452,54	3.674.293,55	62.140.746,09	6.000.000,00	22.900.000,00	3.674.293,55	771601646446,77%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-jul-21	0	443.470.820,37	0,00	0,00	58.466.452,54	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-ago-21	0	440.961.001,33	0,00	0,00	58.466.452,54	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00%
8-sep-21	1	438.443.820,15	83.806.358,60	3.560.093,94	58.466.452,54	6.000.000,00	22.900.000,00	58.466.452,54	12815846396446,90%	6.000.000,00	13.152.000.000,00	22.900.000,00	501968000000,00%