

## **F.T.A. UCI 11**

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

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

INFORMATION AT: **QUARTER/SEMESTER:** June 16th, 2014 - September 15th, 2014 **YEAR:** 2014

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 16th, 2004                      | Paying Agent       | BANCO SANTANDER  |         |
| Disbursement Date        | November 22nd, 2004                      | Negotiation Market | AIAF             |         |
| Final Date of Redemption | September 15th, 2041                     | Ratings Agencies   | STANDARD & POORS |         |
| Management Company       | SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A. | Rating             | Initial          | Current |
|                          | UNIÓN DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, S.      | CLASS A            | AAA              | AA      |
|                          |                                          | CLASS B            | A                | BBB     |
|                          |                                          | CLASS C            | BBB              | BB      |

#### II. SECURITIES ISSUED CHARGED TO THE FUND: SECURITISATION BONDS

| CLASS PRIORITY | NUM BONDS | NOMINAL          |                |                |          |
|----------------|-----------|------------------|----------------|----------------|----------|
| ISIN CODE      |           |                  | Initial        | Current        | %Act/In  |
| CLASS A        | 8.211     | Nominal per Bond | 100.000,00     | 23.906,08      |          |
| ES0338340005   |           | Total Nominal    | 821.100.000,00 | 196.292.822,88 | 23,91%   |
| CLASS B        | 60        | Nominal per Bond | 100.000,00     | 100.000,00     |          |
| ES0338340013   |           | Total Nominal    | 6.000.000,00   | 6.000.000,00   | 100,00 % |
| CLASS C        | 229       | Nominal per Bond | 100.000,00     | 100.000,00     |          |
| ES0338340021   |           | 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   |                         |                | Next Payment Date   |                            |                          |
| September 15th, 2014                 |                         |                | December 15th, 2014 |                            |                          |
|                                      | Redemption of the Bonds | Gross Interest | Interest Rate       | Gross Interest Next Coupon | Net Interest Next Coupon |
| CLASS A                              | 550,01 €                | 23,62 €        | 0,224%              | 13,54 €                    | 10,69 €                  |
| CLASS B                              | 0,00 €                  | 144,59 €       | 0,414%              | 104,65 €                   | 82,67 €                  |
| CLASS C                              | 0,00 €                  | 250,76 €       | 0,834%              | 210,82 €                   | 166,55 €                 |
| Accrued amortisation due not paid    | 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           | 3.943            |
| CR's Outstanding to be amortised          | 850.000.156,93 € | 228.894.059,42 € |
| CR's Outstanding per Loan to be amortised | 74.850,30 €      | 58.050,74 €      |
| Interest Rate                             | 4,23 %           | 2,60%            |

| PREPAYMENT RATE                            | CURRENT SITUATION |
|--------------------------------------------|-------------------|
| Monthly Single Rate                        | 3,78%             |
| Average Monthly Single Rate                | 2,65%             |
| Constant Prepayment Rate from Constitution | 9,99%             |

**F.T.A. UCI 11**

**QUARTERLY BONDS PAYOUT REPORT**

**September 16th, 2014**

| BONDS. PRINCIPAL             |                  |
|------------------------------|------------------|
| Previous Balance             | 229.708.954,99 € |
| Principal Amortised          | 4.516.132,11 €   |
| Outstanding Balance          | 225.192.822,88 € |
| % of Initial Balance         | 26,49%           |
| Principal accrued and unpaid | 0,00 €           |

| INTEREST PAID               |              |
|-----------------------------|--------------|
| CLASS A                     | 193.943,82 € |
| CLASS B                     | 8.675,40 €   |
| CLASS C                     | 57.424,04 €  |
| Interest accrued and unpaid | 0,00 €       |

| DATA                        |                      |
|-----------------------------|----------------------|
| Determination Date          | September 8th, 2014  |
| Payment Date                | September 15th, 2014 |
| Last Payment Date           | June 16th, 2014      |
| Number of Days (Act/360)    | 91                   |
| Reference Interest Rate (%) | 0,084%               |
| Next Payment Date           | December 15th, 2014  |

| RESIDUAL LIFE (YEARS) |         |                      |
|-----------------------|---------|----------------------|
|                       | INITIAL | September 15th, 2014 |
| CLASS A               | 4,75    | 3,88                 |
| CLASS B               | 7,93    | 6,50                 |
| CLASS C               | 7,91    | 6,50                 |

**F.T.A. UCI 11**

**QUARTERLY COLLATERAL REPORT**

**September 16th, 2014**

| PRINCIPAL               |                  |
|-------------------------|------------------|
| Previous Balance        | 233.247.224,11 € |
| Principal Amortised     | 4.353.164,69 €   |
| Outstanding Balance     | 228.894.059,42 € |
| Number of Credit Rights | 3.943            |
| LTV                     | 51,62%           |

| INTEREST                                 |                |
|------------------------------------------|----------------|
| Interest received during relevant period | 1.358.689,88 € |
| Interest accrued during relevant period  | 1.381.891,18 € |

| 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                 | 10.637,45 €    | 8.768,99 €     | 13.855,90 €    | 22.427,06 €    | 377.373,76 €       |
| Interest accrued on Credit Rights in Arrears | 7.344,09 €     | 6.656,26 €     | 12.848,53 €    | 14.687,70 €    | 368.092,84 €       |
| Outstanding Balance                          | 4.115.218,98 € | 1.830.462,18 € | 1.796.395,63 € | 1.437.381,58 € | 5.613.703,48 €     |
| Number of Credit Rights                      | 60             | 28             | 28             | 21             | 58                 |
| % of Outstanding Balance                     | 1,80%          | 0,80%          | 0,78%          | 0,63%          | 2,45%              |

| WRITE OFF                                   |                |
|---------------------------------------------|----------------|
| Cumulative WRITE OFF as of previous balance | 3.538.307,62 € |
| Difference in Actual Period                 | 162.899,70 €   |
| Cumulative WRITE OFF up to date             | 3.701.207,32 € |

**F.T.A. UCI 11**

**QUARTERLY COLLATERAL REPORT**

**September 16th, 2014**

| TRANSITORY PROPERTIES           |                |
|---------------------------------|----------------|
| Last balance                    | 1.938.386,86 € |
| Difference in Actual Period     | 264.869,63 €   |
| Current balance                 | 2.203.256,49 € |
| Number of transitory properties | 52             |

| NET LOSSES                  |                |
|-----------------------------|----------------|
| Last balance                | 1.248.877,67 € |
| Difference in Actual Period | 163.312,51 €   |
| Current balance             | 1.412.190,18 € |

**F.T.A. UCI 11**

**QUARTERLY REPORT - ALLOCATION OF CASH**

September 16th, 2014

| <b>TOTAL CASH RECEIVED END OF PERIOD</b>        | <b>5.212.666,21 €</b> |
|-------------------------------------------------|-----------------------|
| <b>CASH RECEIVED - PRINCIPAL</b>                |                       |
| Amortisation of Credit Rights                   | 3.718.026,29 €        |
| <b>CASH RECEIVED - INTEREST</b>                 |                       |
| Interest received from Credit Rights            | 1.358.689,88 €        |
| Interest received under GIC                     | 136,04 €              |
| <b>INCOMES/EXPENSES OF TRANSTORY PROPERTIES</b> | <b>70.703,00 €</b>    |
| <b>INCOMES/EXPENSES OF INSURED PROPERTIES</b>   | <b>65.111,00 €</b>    |

| <b>TREASURY ACCOUNT STATEMENT</b> | <b>12.804.607,30 €</b> |
|-----------------------------------|------------------------|
| <b>PRINCIPAL RESERVE FUND</b>     |                        |
| Previous Balance                  | 12.750.000,00 €        |
| Period utilization                | 0,00 €                 |
| Outstanding Balance               | 12.750.000,00 €        |
| <b>WITHHOLDING TAXES</b>          | <b>54.607,30 €</b>     |

| <b>TOTAL CASH PAID END OF PERIOD</b>    | <b>5.212.666,21 €</b> |
|-----------------------------------------|-----------------------|
| <b>ORDINARY EXPENSES</b>                | <b>222,80 €</b>       |
| MANAGEMENT FEE                          | 14.890,18 €           |
| SWAP PAYMENT                            | 0,00 €                |
| SWAP COLLECTION                         | 0,00 €                |
| INTEREST ON CLASS A BONDS               | 193.943,82 €          |
| INTEREST ON CLASS B BONDS               | 8.675,40 €            |
| INTEREST ON CLASS C BONDS               | 57.424,04 €           |
| REDEMPTION ON CLASS A BONDS             | 4.516.132,11 €        |
| INTEREST ON SUBORDINATED LOAN SANTANDER | 13.569,30 €           |
| INTEREST ON SUBORDINATED LOAN UCB       | 13.569,30 €           |
| FIXED FEE                               | 6.000,00 €            |
| VARIABLE FEE                            | 388.239,26 €          |

**F.T.A. UCI 11**

**CREDIT ENHACEMENT AND SUBORDINATED LOAN**

**September 16th, 2014**

| CREDIT ENHACEMENT      |                          |                          |
|------------------------|--------------------------|--------------------------|
| CONCEPTS               | INITIAL                  | September 16th, 2014     |
| SUBORDINATED ISSUE     | 28.900.000,00 € (3,40%)  | 28.900.000,00 € (12,63%) |
| PRINCIPAL RESERVE FUND | 12.750.000,00 € (1,50 %) | 12.750.000,00 € (5,57%)  |

| SUBORDINATED LOANS                  |                |                      |
|-------------------------------------|----------------|----------------------|
| CONCEPTS                            | INITIAL        | September 16th, 2014 |
| SUBORDINATED LOAN SCH               |                |                      |
| Total Outstanding Subordinated Loan | 6.812.500,00 € | 6.375.386,18 €       |
| Interest Rate                       | 2,790 %        | 0,684%               |
| SUBORDINATED LOAN UCB               |                |                      |
| Total Outstanding Subordinated Loan | 6.812.500,00 € | 6.375.386,18 €       |
| Interest Rate                       | 2,790 %        | 0,684%               |

## F.T.A. UCI 11

### DEFINITIONS

September 16th, 2014

**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).

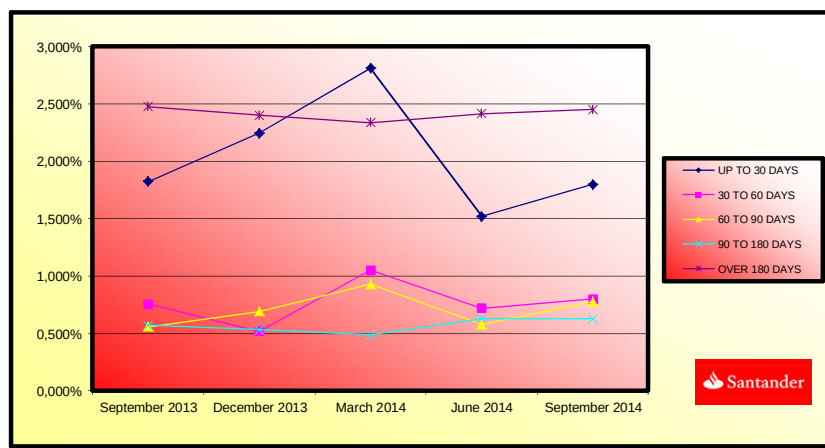
**TRANSITORY PROPERTIES** Those assets in the balance of the Fund as a consequence of a judicial or non-judicial process.



**FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS  
UCI 11**

Report date: September 16th, 2014

| ARREARS PERFORMANCE |                |               |            |           |                |
|---------------------|----------------|---------------|------------|-----------|----------------|
|                     | September 2013 | December 2013 | March 2014 | June 2014 | September 2014 |
| UP TO 30 DAYS       | 1,825%         | 2,246%        | 2,811%     | 1,521%    | 1,798%         |
| 30 TO 60 DAYS       | 0,756%         | 0,519%        | 1,052%     | 0,720%    | 0,800%         |
| 60 TO 90 DAYS       | 0,559%         | 0,692%        | 0,928%     | 0,577%    | 0,780%         |
| 90 TO 180 DAYS      | 0,573%         | 0,535%        | 0,489%     | 0,631%    | 0,628%         |
| OVER 180 DAYS       | 2,478%         | 2,401%        | 2,337%     | 2,416%    | 2,453%         |



**FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS  
UCI 11**

**TRIGGERS**

Report date: September 16th, 2014

| 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                     | 10.752.292,38 € |
| 2) 2% CREDIT RIGHTS OUTSTANDING BALANCE                      | 4.577.881,19 €  |

| CURRENT ARREARS > 90 DAYS PERCENTAGE |
|--------------------------------------|
| 4,70%                                |

**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                   | 10.752.292,38 € |
| 2) 1,25% CREDIT RIGHTS OUTSTANDING BALANCE                 | 2.861.175,74 €  |

**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 7º |                  |
| 1) CLASS A OUTSTANDING BALANCE                                           | 200.808.954,99 € |
| 2) CR OUTSTANDING BALANCE (EXCLUDING ARREARS > 18 MONTHS)                | 223.108.971,75 € |
| 3) REMAINING FUNDS AFTER PAYMENTS POINTS 1º TO 4º                        | 17.744.934,01 €  |
| IF 1) IS HIGHER THAN 2)+3) CLASS C INTERESTS ARE DEFERRED TO POSITION 8º |                  |
| 1) CLASS A AND CLASS B OUTSTANDING BALANCE                               | 206.808.954,99 € |
| 2) CR OUTSTANDING BALANCE (EXCLUDING ARREARS > 18 MONTHS)                | 223.108.971,75 € |
| 3) REMAINING FUNDS AFTER PAYMENTS POINTS 1º TO 5º                        | 17.687.509,97 €  |

**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 - 39,99  | 35.565.617,28 €         | 16,22%         | 691          | 22,71%         |
| 40,00 - 49,99 | 31.370.633,15 €         | 14,30%         | 407          | 13,37%         |
| 50,00 - 59,99 | 57.485.864,59 €         | 26,21%         | 740          | 24,32%         |
| 60,00 - 69,99 | 69.057.264,69 €         | 31,49%         | 928          | 30,50%         |
| 70,00 - 79,99 | 22.085.111,36 €         | 10,07%         | 240          | 7,89%          |
| 80,00 - 89,99 | 3.331.572,02 €          | 1,52%          | 34           | 1,12%          |
| 90,00 - 94,25 | 418.720,67 €            | 0,19%          | 3            | 0,10%          |
| <b>TOTAL</b>  | <b>219.314.783,76 €</b> | <b>100,00%</b> | <b>3.043</b> | <b>100,00%</b> |

UCI 11

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

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

| Fecha    | Saldo antes de Pago              | Saldo Real       | vector de<br>Prepago | Remanencia<br>final de mes              | Mortalidad<br>Mensual                  | CPR    | Mortalidad<br>Mensual                  | CPR    |
|----------|----------------------------------|------------------|----------------------|-----------------------------------------|----------------------------------------|--------|----------------------------------------|--------|
| Date     | Outstanding before<br>prepayment | Real outstanding | Prepayment<br>vector | Remaining at<br>the end of the<br>month | Average single<br>monthly<br>mortality | CPR    | Monthly single<br>monthly<br>mortality | CPR    |
|          |                                  |                  | 0,87%                |                                         |                                        |        |                                        | 2,65%  |
| 8-nov-11 | 703.187.452,99                   | 265.696.089,52   | 47,87%               | 37,78%                                  | 1,15%                                  | 12,98% | 0,28%                                  | 3,32%  |
| 8-dic-11 | 701.228.738,34                   | 264.288.500,39   | 47,45%               | 37,69%                                  | 1,14%                                  | 12,87% | 0,25%                                  | 2,98%  |
| 8-ene-12 | 699.269.967,10                   | 263.261.093,09   | 47,04%               | 37,65%                                  | 1,13%                                  | 12,74% | 0,11%                                  | 1,31%  |
| 8-feb-12 | 697.305.450,14                   | 261.893.291,79   | 46,63%               | 37,56%                                  | 1,12%                                  | 12,63% | 0,24%                                  | 2,83%  |
| 8-mar-12 | 695.335.170,59                   | 260.588.400,21   | 46,22%               | 37,48%                                  | 1,11%                                  | 12,53% | 0,22%                                  | 2,57%  |
| 8-abr-12 | 693.359.111,56                   | 258.867.875,32   | 45,82%               | 37,34%                                  | 1,10%                                  | 12,44% | 0,38%                                  | 4,43%  |
| 8-may-12 | 691.377.256,08                   | 258.896.709,85   | 45,42%               | 37,45%                                  | 1,09%                                  | 12,28% | -0,30%                                 | -3,63% |
| 8-jun-12 | 689.389.587,16                   | 257.436.239,31   | 45,02%               | 37,34%                                  | 1,08%                                  | 12,18% | 0,28%                                  | 3,28%  |
| 8-jul-12 | 687.399.418,55                   | 256.481.587,36   | 44,63%               | 37,31%                                  | 1,07%                                  | 12,07% | 0,08%                                  | 0,98%  |
| 8-ago-12 | 685.403.412,10                   | 254.970.529,27   | 44,24%               | 37,20%                                  | 1,06%                                  | 11,98% | 0,30%                                  | 3,54%  |
| 8-sep-12 | 683.401.550,70                   | 254.189.633,03   | 43,85%               | 37,19%                                  | 1,05%                                  | 11,86% | 0,01%                                  | 0,17%  |
| 8-oct-12 | 681.393.817,18                   | 253.392.724,66   | 43,47%               | 37,19%                                  | 1,04%                                  | 11,75% | 0,02%                                  | 0,24%  |
| 8-nov-12 | 679.380.194,30                   | 252.365.440,68   | 43,09%               | 37,15%                                  | 1,03%                                  | 11,64% | 0,11%                                  | 1,31%  |
| 8-dic-12 | 677.360.664,80                   | 251.163.845,27   | 42,71%               | 37,08%                                  | 1,02%                                  | 11,55% | 0,18%                                  | 2,13%  |
| 8-ene-13 | 675.341.971,78                   | 249.665.572,52   | 42,34%               | 36,97%                                  | 1,01%                                  | 11,47% | 0,30%                                  | 3,53%  |
| 8-feb-13 | 673.317.357,26                   | 248.481.194,60   | 41,97%               | 36,90%                                  | 1,00%                                  | 11,38% | 0,18%                                  | 2,08%  |
| 8-mar-13 | 671.286.803,87                   | 247.478.924,29   | 41,60%               | 36,87%                                  | 0,99%                                  | 11,29% | 0,10%                                  | 1,22%  |
| 8-abr-13 | 669.250.294,19                   | 246.515.375,54   | 41,24%               | 36,83%                                  | 0,98%                                  | 11,19% | 0,09%                                  | 1,03%  |
| 8-may-13 | 667.207.810,75                   | 245.328.736,88   | 40,88%               | 36,77%                                  | 0,98%                                  | 11,10% | 0,18%                                  | 2,10%  |
| 8-jun-13 | 665.159.336,02                   | 243.923.229,33   | 40,52%               | 36,67%                                  | 0,97%                                  | 11,03% | 0,27%                                  | 3,15%  |
| 8-jul-13 | 663.111.616,14                   | 242.816.536,85   | 40,17%               | 36,62%                                  | 0,96%                                  | 10,95% | 0,15%                                  | 1,74%  |
| 8-ago-13 | 661.057.889,62                   | 241.563.340,00   | 39,82%               | 36,54%                                  | 0,95%                                  | 10,87% | 0,21%                                  | 2,46%  |
| 8-sep-13 | 658.998.138,83                   | 240.513.483,02   | 39,47%               | 36,50%                                  | 0,95%                                  | 10,78% | 0,12%                                  | 1,47%  |
| 8-oct-13 | 656.932.346,11                   | 239.510.480,13   | 39,12%               | 36,46%                                  | 0,94%                                  | 10,70% | 0,10%                                  | 1,24%  |
| 8-nov-13 | 654.860.493,73                   | 238.293.492,12   | 38,78%               | 36,39%                                  | 0,93%                                  | 10,62% | 0,19%                                  | 2,30%  |
| 8-dic-13 | 652.782.563,92                   | 236.956.654,81   | 38,44%               | 36,30%                                  | 0,93%                                  | 10,56% | 0,24%                                  | 2,89%  |
| 8-ene-14 | 650.703.792,43                   | 235.767.057,78   | 38,11%               | 36,23%                                  | 0,92%                                  | 10,48% | 0,18%                                  | 2,19%  |
| 8-feb-14 | 648.618.923,21                   | 234.640.850,19   | 37,78%               | 36,18%                                  | 0,91%                                  | 10,41% | 0,16%                                  | 1,88%  |
| 8-mar-14 | 646.527.938,38                   | 233.088.807,16   | 37,45%               | 36,05%                                  | 0,91%                                  | 10,35% | 0,34%                                  | 4,01%  |
| 8-abr-14 | 644.430.819,99                   | 231.810.963,21   | 37,12%               | 35,97%                                  | 0,90%                                  | 10,29% | 0,22%                                  | 2,66%  |
| 8-may-14 | 642.327.550,05                   | 230.695.545,90   | 36,79%               | 35,92%                                  | 0,89%                                  | 10,22% | 0,16%                                  | 1,85%  |
| 8-jun-14 | 640.218.110,52                   | 229.708.916,49   | 36,47%               | 35,88%                                  | 0,89%                                  | 10,14% | 0,10%                                  | 1,19%  |
| 8-jul-14 | 638.109.627,99                   | 228.113.352,62   | 36,16%               | 35,75%                                  | 0,88%                                  | 10,09% | 0,37%                                  | 4,31%  |
| 8-ago-14 | 635.994.960,57                   | 226.673.132,50   | 35,84%               | 35,64%                                  | 0,88%                                  | 10,04% | 0,30%                                  | 3,55%  |
| 8-sep-14 | 633.874.090,14                   | 225.192.852,10   | 35,53%               | 35,53%                                  | 0,87%                                  | 9,99%  | 0,32%                                  | 3,78%  |

| Fecha      | Principal disponible<br>antes prepago    | Principal<br>Disponible | Amortización de<br>principal | Serie A        | Serie B      | Serie C       | Amortización Serie<br>A | Vida Media Serie A   | Amortización Serie<br>B | Vida Media Serie B      | Amortización Serie<br>C | Vida Media Serie C   |
|------------|------------------------------------------|-------------------------|------------------------------|----------------|--------------|---------------|-------------------------|----------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|----------------------|
|            |                                          |                         |                              |                |              |               |                         | 3,88                 |                         | 6,50                    |                         | 6,50                 |
| Date       | Principal Available<br>before prepayment | Principal<br>Available  | Principal<br>Redemption      | Class A        | Class B      | Class C       | Redemption Class<br>A   | Average Life Class A | Redemption Class<br>B   | Average Life Class<br>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                           | 814.674.598,53          | 35.325.401,47                | 821.100.000,00 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 35.325.401,47           | -12261446849589,00%  | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |
| 8-abr-05 0 | 842.190.403,70                           | 0,00                    | 0,00                         | 785.774.598,53 | 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                         | 785.774.598,53 | 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                           | 789.073.649,91          | 25.600.948,63                | 785.774.598,53 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 25.600.948,63           | -8650560540608,48%   | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |
| 8-jul-05 0 | 837.449.355,83                           | 0,00                    | 0,00                         | 760.173.649,91 | 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                         | 760.173.649,91 | 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                           | 764.214.726,37          | 24.858.923,54                | 760.173.649,91 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 24.858.923,54           | -8171128166829,23%   | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |
| 8-oct-05 0 | 832.666.464,23                           | 0,00                    | 0,00                         | 735.314.726,37 | 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                         | 735.314.726,37 | 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                           | 740.077.217,76          | 24.137.508,67                | 735.314.726,37 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 24.137.508,67           | -7714347769411,75%   | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |
| 8-ene-06 0 | 827.841.359,61                           | 0,00                    | 0,00                         | 711.177.217,70 | 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                         | 711.177.217,70 | 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                           | 716.641.072,20          | 23.436.145,50                | 711.177.217,70 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 23.436.145,50           | -7279266793680,60%   | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |
| 8-abr-06 0 | 822.973.669,39                           | 0,00                    | 0,00                         | 687.741.072,20 | 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                         | 687.741.072,20 | 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                           | 693.886.781,74          | 22.754.290,46                | 687.741.072,20 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 22.754.290,46           | -6858143144402,56%   | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |
| 8-jul-06 0 | 818.063.017,72                           | 0,00                    | 0,00                         | 664.986.781,74 | 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                         | 664.986.781,74 | 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                           | 671.795.367,29          | 22.091.414,45                | 664.986.781,74 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 22.091.414,45           | -6455111301461,69%   | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |
| 8-oct-06 0 | 813.109.025,44                           | 0,00                    | 0,00                         | 642.895.367,29 | 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                         | 642.895.367,29 | 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                           | 650.348.364,78          | 21.447.002,52                | 642.895.367,29 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 21.447.002,52           | -6071646412261,72%   | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |
| 8-ene-07 0 | 808.111.707,58                           | 0,00                    | 0,00                         | 621.448.364,78 | 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                         | 621.448.364,78 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |
| 8-mar-07 1 | 804.756.214,89                           | 629.528.747,05          | 20.819.617,72                | 621.448.364,78 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 20.819.617,72           | -5706657218126,73%   | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |
| 8-abr-07 0 | 803.071.082,85                           | 0,00                    | 0,00                         | 600.628.747,05 | 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                         | 600.628.747,05 | 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                           | 609.318.062,74          | 20.210.684,31                | 600.628.747,05 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 20.210.684,31           | -5353810274290,84%   | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |
| 8-jul-07 0 | 797.986.907,49                           | 0,00                    | 0,00                         | 580.418.062,74 | 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                         | 580.418.062,74 | 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                           | 589.701.405,45          | 19.616.657,29                | 580.418.062,74 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 19.616.657,29           | -5015979268352,00%   | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |
| 8-oct-07 0 | 792.859.742,50                           | 0,00                    | 0,00                         | 560.801.405,45 | 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                         | 560.801.405,45 | 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                           | 570.660.054,96          | 19.041.350,49                | 560.801.405,45 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 19.041.350,49           | -4695597031222,63%   | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |
| 8-ene-08 0 | 787.694.525,33                           | 0,00                    | 0,00                         | 541.760.054,96 | 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                         | 541.760.054,96 | 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                           | 552.193.179,19          | 18.466.875,77                | 541.760.054,96 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 18.466.875,77           | -4385882995347,82%   | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |
| 8-abr-08 0 | 782.498.182,91                           | 0,00                    | 0,00                         | 523.293.179,19 | 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                         | 523.293.179,19 | 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                           | 534.269.218,20          | 17.923.960,99                | 523.293.179,19 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 17.923.960,99           | -4092040294363,06%   | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |
| 8-jul-08 0 | 777.259.527,22                           | 0,00                    | 0,00                         | 505.369.218,20 | 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                         | 505.369.218,20 | 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                           | 516.880.105,82          | 17.389.112,39                | 505.369.218,20 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 17.389.112,39           | -3809954523591,68%   | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |
| 8-oct-08 0 | 771.981.764,88                           | 0,00                    | 0,00                         | 487.980.105,82 | 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                         | 487.980.105,82 | 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                           | 500.003.614,68          | 16.876.491,14                | 487.980.105,82 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 16.876.491,14           | -3544063138675,10%   | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |
| 8-ene-09 0 | 766.659.103,76                           | 0,00                    | 0,00                         | 471.103.614,68 | 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                         | 471.103.614,68 | 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                           | 483.628.579,67          | 16.375.035,01                | 471.103.614,68 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 16.375.035,01           | -3291382036860,61%   | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |
| 8-abr-09 0 | 761.292.844,32                           | 0,00                    | 0,00                         | 454.728.579,67 | 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                         | 454.728.579,67 | 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                           | 467.737.673,79          | 15.890.905,88                | 454.728.579,67 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 15.890.905,88           | -3047875747930,24%   | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |
| 8-jul-09 0 | 755.881.308,93                           | 0,00                    | 0,00                         | 438.837.673,79 | 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                         | 438.837.673,79 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00                    | 0,00                    | 0,00%                |

|          |   | Date |  | Principal Available before prepayment | Principal Available | Principal Redemption | Class A        | Class B      | Class C       | Redemption Class A | 3.88                 |      | Redemption Class B   | 6.50 |                      | Redemption Class C | 6.50 |  |
|----------|---|------|--|---------------------------------------|---------------------|----------------------|----------------|--------------|---------------|--------------------|----------------------|------|----------------------|------|----------------------|--------------------|------|--|
|          |   |      |  |                                       |                     |                      |                |              |               |                    | Average Life Class A |      | Average Life Class B |      | Average Life Class C |                    |      |  |
| 8-sep-09 | 1 |      |  | 752.249.899,76                        | 452.321.075,59      | 15.416.598,20        | 438.837.673,79 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 15.416.598,20      | -2815070831921,159%  | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-oct-09 | 0 |      |  | 750.426.202,17                        | 0,00                | 0,00                 | 423.421.075,59 | 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                 | 423.421.075,59 | 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                        | 437.361.623,76      | 14.959.451,82        | 423.421.075,59 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 14.959.451,82      | -2595464891067,40%   | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-ene-10 | 0 |      |  | 744.925.018,92                        | 0,00                | 0,00                 | 408.461.623,76 | 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                 | 408.461.623,76 | 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                        | 422.850.012,37      | 14.511.611,40        | 408.461.623,76 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 14.511.611,40      | -2387160074839,159%  | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-abr-10 | 0 |      |  | 739.379.440,15                        | 0,00                | 0,00                 | 393.950.012,37 | 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                 | 393.950.012,37 | 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                        | 408.770.028,56      | 14.079.983,81        | 393.950.012,37 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 14.079.983,81      | -2186621485591,979%  | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-jul-10 | 0 |      |  | 733.787.447,69                        | 0,00                | 0,00                 | 379.870.028,56 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-ago-10 | 0 |      |  | 731.914.193,66                        | 0,00                | 0,00                 | 379.870.028,56 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-sep-10 | 1 |      |  | 730.035.444,76                        | 395.113.633,19      | 13.656.395,37        | 379.870.028,56 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 13.656.395,37      | -1995199363393,969%  | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-oct-10 | 0 |      |  | 728.151.184,86                        | 0,00                | 0,00                 | 366.213.633,19 | 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                 | 366.213.633,19 | 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                        | 381.864.698,67      | 13.248.934,51        | 366.213.633,19 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 13.248.934,51      | -1815104028389,989%  | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-ene-11 | 0 |      |  | 722.468.266,09                        | 0,00                | 0,00                 | 352.964.698,67 | 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                 | 352.964.698,67 | 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                        | 369.016.498,56      | 12.848.200,18        | 352.964.698,67 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 12.848.200,18      | -1644569622912,869%  | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-abr-11 | 0 |      |  | 716.741.395,64                        | 0,00                | 0,00                 | 340.116.498,50 | 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                 | 340.116.498,50 | 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                        | 356.552.869,61      | 12.463.628,88        | 340.116.498,50 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 12.463.628,88      | -1480679111271,149%  | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-jul-11 | 0 |      |  | 710.965.191,30                        | 0,00                | 0,00                 | 327.652.869,61 | 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                 | 327.652.869,61 | 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                        | 344.464.715,21      | 12.088.154,40        | 327.652.869,61 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 12.088.154,40      | -1324861722440,509%  | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-oct-11 | 0 |      |  | 705.140.438,68                        | 0,00                | 0,00                 | 315.564.715,21 | 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                 | 315.564.715,21 | 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                        | 332.739.610,48      | 11.725.104,73        | 315.564.715,21 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 11.725.104,73      | -1178373025819,329%  | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-ene-12 | 0 |      |  | 699.269.967,10                        | 0,00                | 0,00                 | 303.839.610,48 | 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                 | 303.839.610,48 | 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                        | 321.375.185,37      | 11.364.425,11        | 303.839.610,48 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 11.364.425,11      | -1038708455095,749%  | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-abr-12 | 0 |      |  | 693.359.111,56                        | 0,00                | 0,00                 | 292.475.185,37 | 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                 | 292.475.185,37 | 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 |      |  | 689.989.587,16                        | 310.353.186,25      | 11.021.999,15        | 292.475.185,37 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 11.021.999,15      | -90600832977,191%    | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-jul-12 | 0 |      |  | 687.399.418,55                        | 0,00                | 0,00                 | 281.453.186,22 | 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                 | 281.453.186,22 | 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                        | 299.668.293,53      | 10.684.892,69        | 281.453.186,22 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 10.684.892,69      | -779997166063,759%   | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-oct-12 | 0 |      |  | 681.393.817,18                        | 0,00                | 0,00                 | 270.768.293,53 | 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                 | 270.768.293,53 | 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                        | 289.306.474,92      | 10.361.818,61        | 270.768.293,53 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 10.361.818,61      | -662120209180,689%   | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-ene-13 | 0 |      |  | 675.341.971,78                        | 0,00                | 0,00                 | 260.406.474,92 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-feb-13 | 0 |      |  | 673.317.357,66                        | 0,00                | 0,00                 | 260.406.474,92 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-mar-13 | 1 |      |  | 671.286.803,87                        | 279.267.010,72      | 10.039.464,21        | 260.406.474,92 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 10.039.464,21      | -551166584901,579%   | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-abr-13 | 0 |      |  | 669.250.294,19                        | 0,00                | 0,00                 | 250.367.010,72 | 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                 | 250.367.010,72 | 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                        | 269.532.142,40      | 9.734.868,32         | 250.367.010,72 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 9.734.868,32       | -444883482369,039%   | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-jul-13 | 0 |      |  | 663.111.616,14                        | 0,00                | 0,00                 | 240.632.142,40 | 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                 | 240.632.142,40 | 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 |      |  | 658.998.138,63                        | 260.101.230,07      | 9.430.912,33         | 240.632.142,40 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 9.430.912,33       | -344228300019,089%   | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-oct-13 | 0 |      |  | 656.932.346,11                        | 0,00                | 0,00                 | 231.201.230,07 | 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                 | 231.201.230,07 | 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                        | 250.957.459,66      | 9.143.770,41         | 231.201.230,07 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 9.143.770,41       | -250539309118,689%   | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-ene-14 | 0 |      |  | 650.703.792,43                        | 0,00                | 0,00                 | 222.057.459,66 | 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                 | 222.057.459,66 | 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                        | 242.098.560,05      | 8.858.899,61         | 222.057.459,66 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 8.858.899,61       | -163003752797,209%   | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-abr-14 | 0 |      |  | 644.430.439,99                        | 0,00                | 0,00                 | 213.198.560,05 | 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                 | 213.198.560,05 | 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                        | 233.510.390,82      | 8.588.169,23         | 213.198.560,05 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 8.588.169,23       | -79011156895,479%    | 0,00 | 0,00                 | 0,00 | 0,00                 | 0,00%              |      |  |
| 8-jul-14 | 0 |      |  | 638.109.627,99                        | 0,00                | 0,00                 | 204.610.390,82 | 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 |      |  |                                       |                     |                      |                |              |               |                    |                      |      |                      |      |                      |                    |      |  |



| Date     |   | Principal Available<br>before prepayment | Principal<br>Available | Principal<br>Redemption | Class A        | Class B      | Class C       | Redemption Class<br>A | 3,88                 |              | Redemption Class<br>B | 6,50                 |                  | Redemption Class C | 6,50                 |       |
|----------|---|------------------------------------------|------------------------|-------------------------|----------------|--------------|---------------|-----------------------|----------------------|--------------|-----------------------|----------------------|------------------|--------------------|----------------------|-------|
|          |   |                                          |                        |                         |                |              |               |                       | Average Life Class A |              |                       | Average Life Class B |                  |                    | Average Life Class C |       |
| 8-sep-17 | 1 | 554.278.130,68                           | 143.601.671,26         | 5.661.847,30            | 120.363.518,55 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 5.661.847,30          | 620538463603,90%     | 0,00         | 0,00                  | 0,00                 | 0,00             | 0,00               | 0,00%                | 0,00% |
| 8-oct-17 | 0 | 551.966.993,18                           | 0,00                   | 0,00                    | 114.701.671,26 | 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-17 | 0 | 549.649.076,35                           | 0,00                   | 0,00                    | 114.701.671,26 | 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-17 | 1 | 547.324.360,30                           | 138.117.870,77         | 5.483.800,49            | 114.701.671,26 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 5.483.800,49          | 650927117917,04%     | 0,00         | 0,00                  | 0,00                 | 0,00             | 0,00               | 0,00%                | 0,00% |
| 8-ene-18 | 0 | 545.002.656,18                           | 0,00                   | 0,00                    | 109.217.870,77 | 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-18 | 0 | 542.674.141,74                           | 0,00                   | 0,00                    | 109.217.870,77 | 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-18 | 1 | 540.338.796,98                           | 132.814.225,43         | 5.303.645,34            | 109.217.870,77 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 5.303.645,34          | 677275510130,45%     | 0,00         | 0,00                  | 0,00                 | 0,00             | 0,00               | 0,00%                | 0,00% |
| 8-abr-18 | 0 | 537.996.601,88                           | 0,00                   | 0,00                    | 103.914.225,43 | 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-18 | 0 | 535.647.536,34                           | 0,00                   | 0,00                    | 103.914.225,43 | 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-18 | 1 | 533.291.580,21                           | 127.678.130,51         | 5.136.094,92            | 103.914.225,43 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 5.136.094,92          | 703131394205,55%     | 0,00         | 0,00                  | 0,00                 | 0,00             | 0,00               | 0,00%                | 0,00% |
| 8-jul-18 | 0 | 530.937.947,54                           | 0,00                   | 0,00                    | 98.778.130,51  | 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-18 | 0 | 528.577.410,87                           | 0,00                   | 0,00                    | 98.778.130,51  | 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-18 | 1 | 526.209.949,96                           | 122.711.196,19         | 4.966.934,32            | 98.778.130,51  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 4.966.934,32          | 725669103703,36%     | 0,00         | 0,00                  | 0,00                 | 0,00             | 0,00               | 0,00%                | 0,00% |
| 8-oct-18 | 0 | 523.835.544,50                           | 0,00                   | 0,00                    | 93.811.196,19  | 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-18 | 0 | 521.454.174,11                           | 0,00                   | 0,00                    | 93.811.196,19  | 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-18 | 1 | 519.065.818,38                           | 117.901.928,88         | 4.809.267,31            | 93.811.196,19  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 4.809.267,31          | 746398286684,82%     | 0,00         | 0,00                  | 0,00                 | 0,00             | 0,00               | 0,00%                | 0,00% |
| 8-ene-19 | 0 | 516.677.835,93                           | 0,00                   | 0,00                    | 89.001.928,88  | 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-19 | 0 | 514.282.848,73                           | 0,00                   | 0,00                    | 89.001.928,88  | 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-19 | 1 | 511.880.836,23                           | 113.250.648,15         | 4.651.280,73            | 89.001.928,88  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 4.651.280,73          | 763740296639,14%     | 0,00         | 0,00                  | 0,00                 | 0,00             | 0,00               | 0,00%                | 0,00% |
| 8-abr-19 | 0 | 509.471.777,84                           | 0,00                   | 0,00                    | 84.350.648,15  | 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-19 | 0 | 507.055.652,87                           | 0,00                   | 0,00                    | 84.350.648,15  | 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-19 | 1 | 504.632.440,60                           | 108.747.764,29         | 4.502.883,86            | 84.350.648,15  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 4.502.883,86          | 780800060760,69%     | 0,00         | 0,00                  | 0,00                 | 0,00             | 0,00               | 0,00%                | 0,00% |
| 8-jul-19 | 0 | 502.221.183,66                           | 0,00                   | 0,00                    | 79.847.764,29  | 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-19 | 0 | 499.802.853,70                           | 0,00                   | 0,00                    | 79.847.764,29  | 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-19 | 1 | 497.377.429,98                           | 104.400.983,76         | 4.346.780,54            | 79.847.764,29  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 4.346.780,54          | 793722125771,20%     | 0,00         | 0,00                  | 0,00                 | 0,00             | 0,00               | 0,00%                | 0,00% |
| 8-oct-19 | 0 | 494.944.891,68                           | 0,00                   | 0,00                    | 75.500.983,76  | 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-19 | 0 | 492.505.217,93                           | 0,00                   | 0,00                    | 75.500.983,76  | 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-19 | 1 | 490.058.387,81                           | 100.193.532,75         | 4.207.451,00            | 75.500.983,76  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 4.207.451,00          | 806568357490,87%     | 0,00         | 0,00                  | 0,00                 | 0,00             | 0,00               | 0,00%                | 0,00% |
| 8-ene-20 | 0 | 487.648.819,99                           | 0,00                   | 0,00                    | 71.293.532,75  | 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-20 | 0 | 485.232.184,09                           | 0,00                   | 0,00                    | 71.293.532,75  | 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-20 | 1 | 482.808.459,40                           | 96.147.961,19          | 4.045.571,56            | 71.293.532,75  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 4.045.571,56          | 812350769479,55%     | 0,00         | 0,00                  | 0,00                 | 0,00             | 0,00               | 0,00%                | 0,00% |
| 8-abr-20 | 0 | 480.377.625,12                           | 0,00                   | 0,00                    | 67.247.961,19  | 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-20 | 0 | 477.939.660,39                           | 0,00                   | 0,00                    | 67.247.961,19  | 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-20 | 1 | 475.494.544,30                           | 92.232.523,83          | 3.915.437,36            | 67.247.961,19  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 3.915.437,36          | 822241845806,46%     | 0,00         | 0,00                  | 0,00                 | 0,00             | 0,00               | 0,00%                | 0,00% |
| 8-jul-20 | 0 | 473.072.712,19                           | 0,00                   | 0,00                    | 63.332.523,83  | 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-20 | 0 | 470.643.776,03                           | 0,00                   | 0,00                    | 63.332.523,83  | 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-20 | 1 | 468.207.715,00                           | 88.460.719,18          | 3.771.804,65            | 63.332.523,83  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 3.771.804,65          | 826779579915,83%     | 0,00         | 0,00                  | 0,00                 | 0,00             | 0,00               | 0,00%                | 0,00% |
| 8-oct-20 | 0 | 465.764.508,19                           | 0,00                   | 0,00                    | 59.560.719,18  | 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-20 | 0 | 463.314.134,64                           | 0,00                   | 0,00                    | 59.560.719,18  | 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-20 | 1 | 460.856.573,33                           | 84.810.775,10          | 3.649.944,07            | 59.560.719,18  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 3.649.944,07          | 833282231808,34%     | 0,00         | 0,00                  | 0,00                 | 0,00             | 0,00               | 0,00%                | 0,00% |
| 8-ene-21 | 0 | 458.394.156,08                           | 0,00                   | 0,00                    | 55.910.775,10  | 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-feb-21 | 0 | 455.924.515,75                           | 0,00                   | 0,00                    | 55.910.775,10  | 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-mar-21 | 1 | 453.447.631,13                           | 0,00                   | 84.810.775,10           | 55.910.775,10  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 55.910.775,10         | 13267626932278,90%   | 6.000.000,00 | 14.238.000.000,00     | 22.900.000,00        | 543417000000,00% |                    |                      |       |