



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

**ANA OBREGON MAZO**

**ANALISTA**

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

**GRAN VIA DE HORTALEZA 3**

**28033 MADRID**

**[aobregon@gruposantander.com](mailto:aobregon@gruposantander.com)**

**Tel: 912893301**



DENOMINACION DEL FONDO:

F.T.A. UCI 11

INFORMACIÓN

CORRESPONDIENTE AL:

TRIMESTRE/SEMESTRE:

15/03/2016

-

15/06/2016

AÑO:

2016

Personas que asumen la responsabilidad de esta información y cargos que ocupan:

IGNACIO ORTEGA GAVARA - DIRECTOR GENERAL

Firma:

## I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

|                                 |                                          |                          |                  |        |
|---------------------------------|------------------------------------------|--------------------------|------------------|--------|
| Fecha de Constitución del Fondo | 16 noviembre 2004                        | Agencia de pago de Bonos | BANCO SANTANDER  |        |
| Fecha de Desembolso BT's        | 22 noviembre 2004                        | Negociación Mercado      | AIAF             |        |
| Fecha Final Amortización        | 15 septiembre 2041                       | Agencias de calificación | STANDARD & POORS |        |
| Sociedad Gestora                | SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A. | Calificación             | Inicial          | Actual |
| Originador Derechos Crédito     | UNION DE CREDITOS INMOBILIARIOS          | B.T.A'S SERIE A          | AAA              | A      |
|                                 |                                          | B.T.A'S SERIE B          | A                | BB-    |
|                                 |                                          | B.T.A'S SERIE C          | BBB              | B-     |

## II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO: BONOS DE TITULIZACION

| SERIES PRELACIÓN<br>CÓDIGO ISIN | Nº BONOS | NOMINAL EN CIRCULACIÓN |                |                |          |
|---------------------------------|----------|------------------------|----------------|----------------|----------|
|                                 |          |                        | Inicial        | Actual         | %Act/In  |
| B.T.A'S SERIE A<br>ES033834005  | 8.211    | Nominal Unitario       | 100.000,00     | 20.517,84      |          |
|                                 |          | Nominal Total          | 821.100.000,00 | 168.471.984,24 | 20,52 %  |
| B.T.A'S SERIE B<br>ES0338340013 | 60       | Nominal Unitario       | 100.000,00     | 100.000,00     |          |
|                                 |          | Nominal Total          | 6.000.000,00   | 6.000.000,00   | 100,00 % |
| B.T.A'S SERIE C<br>ES0338340021 | 229      | Nominal Unitario       | 100.000,00     | 100.000,00     |          |
|                                 |          | Nominal Total          | 22.900.000,00  | 22.900.000,00  | 100,00 % |

| AMORTIZACION E INTERESES BONOS                     |                           |                        |                                           |                             |                            |
|----------------------------------------------------|---------------------------|------------------------|-------------------------------------------|-----------------------------|----------------------------|
| Actual                                             |                           |                        | Próximo                                   |                             |                            |
| Fecha Amortización Periodo Actual<br>15 junio 2016 |                           |                        | Fecha Próximo Cupón<br>15 septiembre 2016 |                             |                            |
|                                                    | Amortización de los Bonos | Intereses Brutos Bonos | Tipo de Interés                           | Importe Bruto Próximo Cupón | Importe Neto Próximo Cupón |
| B.T.A'S SERIE A                                    | 515,58 €                  | 0,00 €                 | 0,0000 %                                  | 0,00 €                      | 0,00 €                     |
| B.T.A'S SERIE B                                    | 0,00 €                    | 26,83 €                | 0,0670 %                                  | 17,12 €                     | 13,87 €                    |
| B.T.A'S SERIE C                                    | 0,00 €                    | 134,17 €               | 0,4870 %                                  | 124,46 €                    | 100,81 €                   |
| Amortización devengada no pagada                   | 0,00 €                    |                        |                                           |                             |                            |
| Amortización Calendario                            | NO                        |                        |                                           |                             |                            |

### III. ACTIVOS ADQUIRIDOS POR EL FONDO: DERECHOS DE CRÉDITO

| DERECHOS DE CRÉDITO                   | A LA EMISIÓN   | SITUACIÓN ACTUAL |
|---------------------------------------|----------------|------------------|
| Número de Derechos de Crédito         | 11.356         | 3.775            |
| Saldo Pendiente de Amortizar Derechos | 850.000.156,93 | 204.059.775,79   |
| Importes Unitarios Derechos Vivos     | 74.850,30      | 54.055,57        |
| Típos de Interés                      | 4,23 %         | 1,82 %           |

| TASAS DE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA             | SITUACIÓN ACTUAL |
|----------------------------------------------|------------------|
| Tasa mensual actual anualizada:              | 3,89 %           |
| Tasa últimos 12 meses anualizada:            | 3,57 %           |
| Tasa anualizada desde Constitución del Fondo | 9,00 %           |

| MOROSIDAD ACTUAL                   | Hasta 1 mes | De 1 a 6 meses | Mayor de 6 meses |
|------------------------------------|-------------|----------------|------------------|
| Deuda Vencida(Principal+Intereses) | 18.675,11   | 43.159,68      | 1.141.173,03     |
| Deuda Pendiente de vencimiento     | 0,00        | 0,00           | 203.356.053,09   |
| Deuda Total                        | 18.675,11   | 43.159,68      | 204.497.226,12   |

**F.T.A. UCI 11****INFORME TRIMESTRAL BONOS DE TITULIZACIÓN****15 de junio de 2016**

| BONOS TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. PRINCIPAL |                  |
|------------------------------------------|------------------|
| Saldo anterior                           | 201.605.411,62 € |
| Amortizaciones                           | 4.233.427,38 €   |
| Saldo actual                             | 197.371.984,24 € |
| % sobre saldo inicial                    | 23,22%           |
| Amortización devengada no pagada         | 0,00 €           |

| BONOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. INTERESES |             |
|---------------------------------------------|-------------|
| Intereses pagados Serie A                   | 0,00 €      |
| Intereses pagados Serie B                   | 1.609,80 €  |
| Intereses pagados Serie C                   | 30.724,93 € |
| Intereses devengados no pagados             | 0           |

| DATOS                           |            |
|---------------------------------|------------|
| Fecha de determinación          | 08/06/2016 |
| Fecha de Pago de Cupón Actual   | 15/06/2016 |
| Fecha de Pago de Cupón Anterior | 15/03/2016 |
| Número de días                  | 92         |
| Tipo de referencia (%)          | -0,263%    |
| Próxima Fecha de Pago           | 15/09/2016 |

| VIDA RESIDUAL (AÑOS) |         |                     |
|----------------------|---------|---------------------|
|                      | INICIAL | 15 de junio de 2016 |
| B.T.A'S SERIE A      | 4,75    | 3,65                |
| B.T.A'S SERIE B      | 7,93    | 5,75                |
| B.T.A'S SERIE C      | 7,91    | 5,75                |

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

**INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO**

**15 de junio de 2016**

| <b>DERECHOS DE CRÉDITO. PRINCIPAL</b> |                  |
|---------------------------------------|------------------|
| Saldo anterior                        | 208.183.198,38 € |
| Amortizaciones                        | 4.123.422,59 €   |
| Saldo actual                          | 204.059.775,79 € |
| Número de derechos de crédito         | 3.775            |
| LTV                                   | 48,38%           |

| <b>DERECHOS DE CRÉDITO. INTERESES</b> |              |
|---------------------------------------|--------------|
| Intereses cobrados en el trimestre    | 884.977,67 € |
| Intereses devengados en el trimestre  | 893.721,04 € |

| <b>DERECHOS DE CRÉDITO CON RETRASOS EN EL PAGO</b> |                      |                     |                     |                      |                        |
|----------------------------------------------------|----------------------|---------------------|---------------------|----------------------|------------------------|
|                                                    | <b>HASTA 30 DÍAS</b> | <b>30 A 60 DÍAS</b> | <b>60 A 90 DÍAS</b> | <b>90 A 180 DÍAS</b> | <b>MÁS DE 180 DÍAS</b> |
| Principal                                          | 13.625,99 €          | 8.220,32 €          | 8.857,55 €          | 11.739,92 €          | 661.278,92 €           |
| Intereses                                          | 5.049,12 €           | 3.342,02 €          | 4.380,10 €          | 6.619,77 €           | 479.894,11 €           |
| Saldo de los derechos de crédito                   | 4.273.760,25 €       | 1.105.327,87 €      | 986.075,75 €        | 926.644,61 €         | 5.008.321,69 €         |
| Número de derechos de crédito                      | 67                   | 18                  | 12                  | 18                   | 132                    |
| % sobre saldo de los derechos de crédito           | 2,09%                | 0,54%               | 0,48%               | 0,45%                | 2,45%                  |

| <b>PRÉSTAMOS EN WRITE OFF</b>           |                |
|-----------------------------------------|----------------|
| Write Off acumulado Fecha Pago anterior | 6.577.802,55 € |
| Write Off trimestre                     | 110.011,59 €   |
| Write Off acumulados actuales           | 6.687.814,14 € |

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

**INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO**

**15 de junio de 2016**

| ADJUDICADOS           |                |
|-----------------------|----------------|
| Saldo anterior        | 1.723.109,21 € |
| Diferencia            | 103.750,28 €   |
| Saldo actual          | 1.826.859,49 € |
| Número de adjudicados | 45             |

| PERDIDAS DE LA CARTERA |                |
|------------------------|----------------|
| Saldo anterior         | 1.791.784,89 € |
| Diferencia             | 94.674,34 €    |
| Saldo actual           | 1.886.459,23 € |

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

**ESTADO DE ORIGEN Y APLICACIÓN DE FONDOS Y CUENTA DE TESORERÍA**

15 de junio de 2016

| ORIGEN                                | 4.675.530,30 € |
|---------------------------------------|----------------|
| <b>PRINCIPAL COBRADO</b>              |                |
| Amortización derechos de crédito      | 3.748.980,75 € |
| <b>INTERESES COBRADOS</b>             |                |
| Intereses de derechos de crédito      | 884.977,67 €   |
| Intereses de reinversión              | -10.712,62 €   |
| <b>INGRESOS/GASTOS DE ADJUDICADOS</b> | 52.784,49 €    |
| <b>INGRESOS IMPORTES ASEGURADOS</b>   | 0,00 €         |
| <b>OTROS</b>                          | -499,99 €      |

| ESTADO CUENTA DE TESORERÍA | 12.750.000,00 € |
|----------------------------|-----------------|
| <b>FONDO DE RESERVA</b>    |                 |
| Saldo anterior             | 12.750.000,00 € |
| Utilizado en el período    | 0,00 €          |
| Saldo actual               | 12.750.000,00 € |

| APLICACIÓN                               | 4.675.530,30 € |
|------------------------------------------|----------------|
| GASTOS ORDINARIOS                        | 4.460,02 €     |
| COMISIÓN S.G.F.T                         | 14.137,50 €    |
| PAGO SWAP                                | 0              |
| COBRO SWAP                               | 0              |
| INTERESES B.T.A'S SERIE A                | 0,00 €         |
| INTERESES B.T.A'S SERIE B                | 1.609,80 €     |
| INTERESES B.T.A'S SERIE C                | 30.724,93 €    |
| FONDOS DISPONIBLES AMORTIZACIÓN A        | 4.233.427,38 € |
| INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO SANTANDER | 6.109,75 €     |
| INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB       | 6.109,75 €     |
| COMISIÓN ADMINISTRACIÓN UCI              | 6.000,00 €     |
| COMISIÓN VARIABLE                        | 372.951,18 €   |

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

**MEJORA CREDITICIA Y PRÉSTAMO SUBORDINADO**

**15 de junio de 2016**

| MEJORA DE CRÉDITO   |                 |        |                     |        |
|---------------------|-----------------|--------|---------------------|--------|
| CONCEPTOS           | INICIAL         |        | 15 de junio de 2016 |        |
| EMISIÓN SUBORDINADA | 28.900.000,00 € | 3,40 % | 28.900.000,00 €     | 14,64% |
| FONDO DE RESERVA    | 12.750.000,00 € | 1,50%  | 12.750.000,00 €     | 6,46%  |

| PRÉSTAMOS SUBORDINADOS   |                |                     |
|--------------------------|----------------|---------------------|
| CONCEPTOS                | INICIAL        | 15 de junio de 2016 |
| PRÉSTAMO SUBORDINADO SCH |                |                     |
| Saldo vivo               | 6.812.500,00 € | 6.375.386,18 €      |
| Tipo de interés          | 2,790 %        | 0,337%              |
| PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB |                |                     |
| Saldo vivo               | 6.812.500,00 € | 6.375.386,18 €      |
| Tipo de interés          | 2,790 %        | 0,337%              |

## F.T.A. UCI 11

### DEFINICIONES

**FECHA DE DETERMINACIÓN** Será la fecha en que la Sociedad Gestora, en nombre del Fondo, realizará los cálculos necesarios para distribuir los fondos disponibles existentes a dicha fecha, de acuerdo con el orden de prelación de pagos descrito en el Folleto Informativo.  
Todos los datos de los Activos Titulizados (Saldo Vivo DC's, tablas de morosidad, propiedades transitorias, datos estadísticos, etc.) están referidos a dicha fecha.

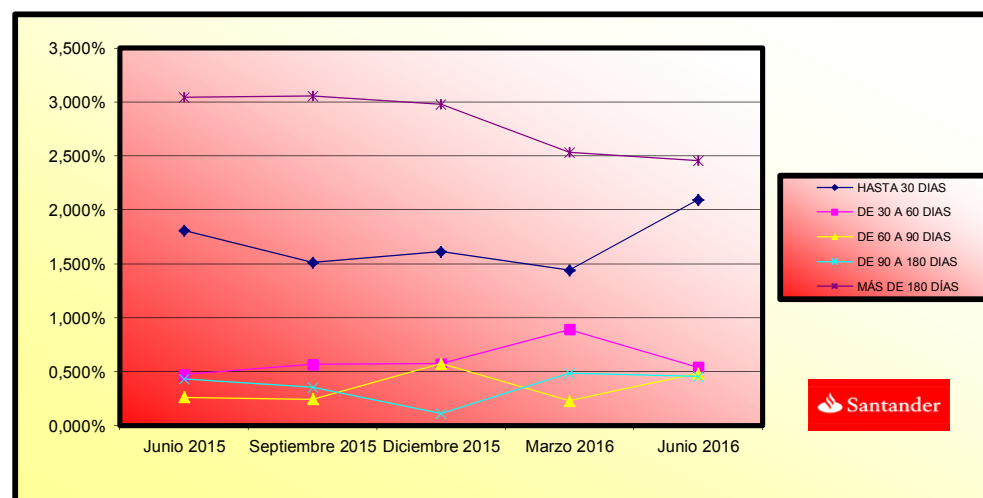
**WRITE OFF** Préstamos con cuotas pendientes con antigüedad igual o superior a 12 ó 18 meses (según Folleto Informativo).

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

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

INFORME HISTÓRICO DE MOROSIDAD

| MOROSIDAD HISTÓRICA |            |                 |                |            |            |
|---------------------|------------|-----------------|----------------|------------|------------|
|                     | Junio 2015 | Septiembre 2015 | Diciembre 2015 | Marzo 2016 | Junio 2016 |
| HASTA 30 DIAS       | 1,807%     | 1,512%          | 1,612%         | 1,439%     | 2,094%     |
| DE 30 A 60 DIAS     | 0,472%     | 0,566%          | 0,572%         | 0,892%     | 0,542%     |
| DE 60 A 90 DIAS     | 0,263%     | 0,245%          | 0,576%         | 0,228%     | 0,483%     |
| DE 90 A 180 DIAS    | 0,430%     | 0,354%          | 0,113%         | 0,484%     | 0,454%     |
| MÁS DE 180 DÍAS     | 3,045%     | 3,055%          | 2,979%         | 2,534%     | 2,454%     |



**FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS  
UCI 11**

**INFORME RELATIVO A LOS TRIGGERS DEL FONDO**

Fecha informe: 15/06/2015

| <b>AMORTIZACIÓN BONOS SERIE B y C</b>                  |                 |
|--------------------------------------------------------|-----------------|
| SI 1) ES MAYOR QUE 2) NO SE AMORTIZAN LAS SERIES B y C |                 |
| 1) DERECHOS EN MOROSIDAD > 90 DÍAS                     | 12.622.780,44 € |
| 2) 2% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO A                      | 4.081.195,52 €  |

| <b>MOROSIDAD &gt; 90 DÍAS (% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO)</b> |
|-------------------------------------------------------------|
| 6,19%                                                       |

**NO SE AMORTIZAN LAS SERIES B y C**

| <b>TRIGGERS FONDOS DE RESERVA</b>                        |                 |
|----------------------------------------------------------|-----------------|
| SI 1) ES MAYOR QUE 2) NO SE AMORTIZA EL FONDO DE RESERVA |                 |
| 1) DERECHOS EN MOROSIDAD > 90 DÍAS                       | 12.622.780,44 € |
| 2) 1,25% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO ACTUAL                | 2.550.747,20 €  |

**NO SE AMORTIZA EL FONDO DE RESERVA**

| POSTERGAMIENTO DE INTERESES DE LAS SERIES B Y C                           |                  |
|---------------------------------------------------------------------------|------------------|
| SI 1) ES MAYOR QUE 2)+3) LOS INTS DE LA SERIE B SE POSTERGAN AL 7 º LUGAR |                  |
| 1) SALDO DE LA SERIE A                                                    | 172.705.411,62 € |
| 2) SALDO VIVO DERECHOS DE CRÉDITO (MOROSIDAD < 18 MESES)                  | 195.254.867,51 € |
| 3) REMANENTE F.DISPONIBLES DESPUÉS PAGO PUNTOS 1º - 4º                    | 17.405.322,98 €  |
| SI 1) ES MAYOR QUE 2)+3) LOS INTS DE LA SERIE C SE POSTERGAN AL 8 º LUGAR |                  |
| 1) SALDOS DE LAS SERIES A Y B                                             | 178.705.411,62 € |
| 2) SALDO VIVO DERECHOS DE CRÉDITO (MOROSIDAD < 18 MESES)                  | 195.254.867,51 € |
| 3) REMANENTE F.DISPONIBLES DESPUÉS PAGO PUNTOS 1º - 5º                    | 17.374.598,05 €  |

NO SE POSTERGAN LOS INTERESES DE LA SERIE B

NO SE POSTERGAN LOS INTERESES DE LA SERIE C

| CONTRATO         | CONTRAPARTE     | AGENCIA RATING | RATING MÍNIMO EXIGIDO | RATING ACTUAL |
|------------------|-----------------|----------------|-----------------------|---------------|
| CUENTA TESORERÍA | BANCO SANTANDER | S&P            | A-1 c/p               | A-2 c/p       |

LA CONTRAPARTE NO TIENE EL RATING MÍNIMO EXIGIDO. SE HA TRASLADADO LA CUENTA DE TESORERÍA A UNA CONTRAPARTE CON EL RATING MÍNIMO EXIGIDO.

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

| Fecha    | Saldo antes de Pago              | Saldo Real       | vector de<br>Prepago | Permanencia<br>final de mes          | Mortandad<br>Mensual                   | CPR    | Mortandad<br>Mensual                   | CPR    |
|----------|----------------------------------|------------------|----------------------|--------------------------------------|----------------------------------------|--------|----------------------------------------|--------|
| Date     | Outstanding before<br>prepayment | Real outstanding | Prepayment<br>vector | Remaining at the<br>end of the month | Average single<br>monthly<br>mortality | CPR    | Monthly single<br>monthly<br>mortality | CPR    |
|          |                                  |                  | 0,78%                |                                      |                                        |        |                                        | 3,57%  |
| 8-jul-07 | 797.986.907,49                   | 404.454.167,85   | 77,77%               | 50,68%                               | 2,10%                                  | 22,50% | 1,65%                                  | 18,11% |
| 8-ago-07 | 796.282.855,93                   | 396.791.374,83   | 77,16%               | 49,83%                               | 2,09%                                  | 22,38% | 1,68%                                  | 18,44% |
| 8-sep-07 | 794.573.805,82                   | 391.376.030,13   | 76,56%               | 49,26%                               | 2,06%                                  | 22,11% | 1,15%                                  | 12,99% |
| 8-oct-07 | 792.859.742,50                   | 386.989.073,29   | 75,96%               | 48,81%                               | 2,03%                                  | 21,80% | 0,91%                                  | 10,36% |
| 8-nov-07 | 791.140.651,25                   | 381.540.150,55   | 75,36%               | 48,23%                               | 2,01%                                  | 21,58% | 1,19%                                  | 13,42% |
| 8-dic-07 | 789.416.517,34                   | 374.085.117,49   | 74,77%               | 47,39%                               | 2,00%                                  | 21,51% | 1,74%                                  | 18,99% |
| 8-ene-08 | 787.694.525,33                   | 368.864.560,67   | 74,19%               | 46,83%                               | 1,98%                                  | 21,30% | 1,18%                                  | 13,28% |
| 8-feb-08 | 785.967.482,14                   | 365.347.329,01   | 73,61%               | 46,48%                               | 1,95%                                  | 21,00% | 0,74%                                  | 8,48%  |
| 8-mar-08 | 784.235.372,95                   | 361.954.516,26   | 73,03%               | 46,15%                               | 1,91%                                  | 20,70% | 0,71%                                  | 8,19%  |
| 8-abr-08 | 782.498.182,91                   | 356.988.908,13   | 72,46%               | 45,62%                               | 1,90%                                  | 20,52% | 1,15%                                  | 12,99% |
| 8-may-08 | 780.755.897,12                   | 351.895.556,23   | 71,89%               | 45,07%                               | 1,88%                                  | 20,36% | 1,21%                                  | 13,56% |
| 8-jun-08 | 779.008.500,62                   | 348.169.826,92   | 71,33%               | 44,69%                               | 1,86%                                  | 20,13% | 0,84%                                  | 9,59%  |
| 8-jul-08 | 777.259.527,22                   | 347.228.513,39   | 70,77%               | 44,67%                               | 1,81%                                  | 19,73% | 0,05%                                  | 0,55%  |
| 8-ago-08 | 775.505.423,51                   | 346.077.498,92   | 70,22%               | 44,63%                               | 1,78%                                  | 19,36% | 0,11%                                  | 1,27%  |
| 8-sep-08 | 773.746.174,42                   | 341.634.083,80   | 69,67%               | 44,15%                               | 1,76%                                  | 19,21% | 1,06%                                  | 12,00% |
| 8-oct-08 | 771.981.764,88                   | 338.356.595,89   | 69,12%               | 43,83%                               | 1,74%                                  | 18,99% | 0,73%                                  | 8,45%  |
| 8-nov-08 | 770.212.179,73                   | 335.395.338,94   | 68,58%               | 43,55%                               | 1,72%                                  | 18,77% | 0,65%                                  | 7,50%  |
| 8-dic-08 | 768.437.403,79                   | 333.970.278,42   | 68,05%               | 43,46%                               | 1,69%                                  | 18,46% | 0,19%                                  | 2,31%  |
| 8-ene-09 | 766.659.103,76                   | 331.962.327,38   | 67,51%               | 43,30%                               | 1,66%                                  | 18,20% | 0,37%                                  | 4,36%  |
| 8-feb-09 | 764.875.587,37                   | 329.978.849,13   | 66,99%               | 43,14%                               | 1,63%                                  | 17,95% | 0,37%                                  | 4,30%  |
| 8-mar-09 | 763.086.839,34                   | 328.476.806,46   | 66,46%               | 43,05%                               | 1,61%                                  | 17,68% | 0,22%                                  | 2,63%  |
| 8-abr-09 | 761.292.844,32                   | 326.273.336,82   | 65,94%               | 42,86%                               | 1,59%                                  | 17,46% | 0,44%                                  | 5,12%  |
| 8-may-09 | 759.493.586,90                   | 323.503.228,38   | 65,43%               | 42,59%                               | 1,57%                                  | 17,28% | 0,61%                                  | 7,13%  |
| 8-jun-09 | 757.689.051,67                   | 321.386.971,51   | 64,91%               | 42,42%                               | 1,55%                                  | 17,07% | 0,42%                                  | 4,90%  |
| 8-jul-09 | 755.881.308,93                   | 319.112.570,09   | 64,41%               | 42,22%                               | 1,53%                                  | 16,87% | 0,47%                                  | 5,50%  |
| 8-ago-09 | 754.068.263,48                   | 317.841.095,04   | 63,90%               | 42,15%                               | 1,50%                                  | 16,63% | 0,16%                                  | 1,89%  |
| 8-sep-09 | 752.249.899,76                   | 314.354.974,81   | 63,40%               | 41,79%                               | 1,49%                                  | 16,52% | 0,86%                                  | 9,82%  |
| 8-oct-09 | 750.426.202,17                   | 312.492.643,31   | 62,90%               | 41,64%                               | 1,47%                                  | 16,32% | 0,35%                                  | 4,13%  |
| 8-nov-09 | 748.597.155,07                   | 309.793.127,81   | 62,41%               | 41,38%                               | 1,46%                                  | 16,18% | 0,62%                                  | 7,21%  |
| 8-dic-09 | 746.762.742,76                   | 307.081.055,36   | 61,92%               | 41,12%                               | 1,45%                                  | 16,04% | 0,63%                                  | 7,33%  |
| 8-ene-10 | 744.925.018,92                   | 304.171.922,35   | 61,44%               | 40,83%                               | 1,43%                                  | 15,92% | 0,70%                                  | 8,12%  |
| 8-feb-10 | 743.081.904,42                   | 302.891.409,39   | 60,96%               | 40,76%                               | 1,41%                                  | 15,71% | 0,17%                                  | 2,07%  |
| 8-mar-10 | 741.233.383,45                   | 300.122.393,54   | 60,48%               | 40,49%                               | 1,40%                                  | 15,59% | 0,67%                                  | 7,72%  |
| 8-abr-10 | 739.379.440,15                   | 297.807.053,26   | 60,01%               | 40,28%                               | 1,39%                                  | 15,45% | 0,52%                                  | 6,09%  |
| 8-may-10 | 737.520.058,62                   | 295.608.835,47   | 59,54%               | 40,08%                               | 1,38%                                  | 15,31% | 0,49%                                  | 5,70%  |
| 8-jun-10 | 735.655.222,91                   | 293.760.620,91   | 59,07%               | 39,93%                               | 1,36%                                  | 15,16% | 0,37%                                  | 4,39%  |
| 8-jul-10 | 733.787.447,69                   | 291.341.154,99   | 58,61%               | 39,70%                               | 1,35%                                  | 15,04% | 0,57%                                  | 6,64%  |
| 8-ago-10 | 731.914.193,66                   | 289.072.708,07   | 58,15%               | 39,50%                               | 1,34%                                  | 14,92% | 0,52%                                  | 6,12%  |
| 8-sep-10 | 730.035.444,76                   | 287.255.851,54   | 57,70%               | 39,35%                               | 1,32%                                  | 14,78% | 0,37%                                  | 4,38%  |
| 8-oct-10 | 728.151.184,86                   | 286.099.404,91   | 57,25%               | 39,29%                               | 1,31%                                  | 14,61% | 0,14%                                  | 1,72%  |
| 8-nov-10 | 726.261.397,79                   | 284.751.082,83   | 56,80%               | 39,21%                               | 1,29%                                  | 14,45% | 0,21%                                  | 2,52%  |
| 8-dic-10 | 724.366.067,35                   | 281.674.551,27   | 56,35%               | 38,89%                               | 1,29%                                  | 14,38% | 0,82%                                  | 9,43%  |
| 8-ene-11 | 722.468.266,09                   | 278.838.334,02   | 55,91%               | 38,60%                               | 1,28%                                  | 14,31% | 0,75%                                  | 8,60%  |
| 8-feb-11 | 720.564.897,95                   | 277.785.066,79   | 55,47%               | 38,55%                               | 1,26%                                  | 14,14% | 0,11%                                  | 1,37%  |
| 8-mar-11 | 718.655.946,59                   | 275.983.701,22   | 55,04%               | 38,40%                               | 1,25%                                  | 14,02% | 0,38%                                  | 4,52%  |
| 8-abr-11 | 716.741.395,64                   | 274.448.612,53   | 54,61%               | 38,29%                               | 1,24%                                  | 13,90% | 0,29%                                  | 3,43%  |
| 8-may-11 | 714.821.228,68                   | 273.778.936,22   | 54,18%               | 38,30%                               | 1,22%                                  | 13,73% | -0,02%                                 | -0,29% |
| 8-jun-11 | 712.895.429,22                   | 271.621.942,31   | 53,76%               | 38,10%                               | 1,21%                                  | 13,63% | 0,52%                                  | 6,06%  |
| 8-jul-11 | 710.965.191,30                   | 270.217.689,41   | 53,34%               | 38,01%                               | 1,20%                                  | 13,51% | 0,25%                                  | 2,92%  |
| 8-ago-11 | 709.029.291,35                   | 269.318.086,88   | 52,92%               | 37,98%                               | 1,19%                                  | 13,36% | 0,06%                                  | 0,73%  |
| 8-sep-11 | 707.087.712,76                   | 268.147.150,38   | 52,51%               | 37,92%                               | 1,18%                                  | 13,23% | 0,16%                                  | 1,92%  |
| 8-oct-11 | 705.140.438,88                   | 267.183.876,05   | 52,09%               | 37,89%                               | 1,16%                                  | 13,09% | 0,08%                                  | 1,00%  |

| Fecha    | Saldo antes de Pago              | Saldo Real       | vector de<br>Prepago | Permanencia<br>final de mes          | Mortandad<br>Mensual                   | CPR    | Mortandad<br>Mensual                   | CPR    |
|----------|----------------------------------|------------------|----------------------|--------------------------------------|----------------------------------------|--------|----------------------------------------|--------|
| Date     | Outstanding before<br>prepayment | Real outstanding | Prepayment<br>vector | Remaining at the<br>end of the month | Average single<br>monthly<br>mortality | CPR    | Monthly single<br>monthly<br>mortality | CPR    |
|          |                                  |                  | 0,78%                |                                      |                                        |        |                                        | 3,57%  |
| 8-nov-11 | 703.187.452,99                   | 265.696.089,52   | 51,69%               | 37,78%                               | 1,15%                                  | 12,98% | 0,28%                                  | 3,32%  |
| 8-dic-11 | 701.228.738,34                   | 264.288.500,39   | 51,28%               | 37,69%                               | 1,14%                                  | 12,87% | 0,25%                                  | 2,98%  |
| 8-ene-12 | 699.269.967,10                   | 263.261.093,09   | 50,88%               | 37,65%                               | 1,13%                                  | 12,74% | 0,11%                                  | 1,31%  |
| 8-feb-12 | 697.305.450,14                   | 261.893.291,79   | 50,48%               | 37,56%                               | 1,12%                                  | 12,63% | 0,24%                                  | 2,83%  |
| 8-mar-12 | 695.335.170,59                   | 260.588.400,21   | 50,09%               | 37,48%                               | 1,11%                                  | 12,53% | 0,22%                                  | 2,57%  |
| 8-abr-12 | 693.359.111,56                   | 258.867.875,32   | 49,70%               | 37,34%                               | 1,10%                                  | 12,44% | 0,38%                                  | 4,43%  |
| 8-may-12 | 691.377.256,08                   | 258.896.709,85   | 49,31%               | 37,45%                               | 1,09%                                  | 12,28% | -0,30%                                 | -3,63% |
| 8-jun-12 | 689.389.587,16                   | 257.436.239,31   | 48,92%               | 37,34%                               | 1,08%                                  | 12,18% | 0,28%                                  | 3,28%  |
| 8-jul-12 | 687.399.418,55                   | 256.481.587,36   | 48,54%               | 37,31%                               | 1,07%                                  | 12,07% | 0,08%                                  | 0,98%  |
| 8-ago-12 | 685.403.412,10                   | 254.970.529,27   | 48,16%               | 37,20%                               | 1,06%                                  | 11,98% | 0,30%                                  | 3,54%  |
| 8-sep-12 | 683.401.550,70                   | 254.189.633,03   | 47,78%               | 37,19%                               | 1,05%                                  | 11,86% | 0,01%                                  | 0,17%  |
| 8-oct-12 | 681.393.817,18                   | 253.392.724,66   | 47,41%               | 37,19%                               | 1,04%                                  | 11,75% | 0,02%                                  | 0,24%  |
| 8-nov-12 | 679.380.194,30                   | 252.365.440,68   | 47,04%               | 37,15%                               | 1,03%                                  | 11,64% | 0,11%                                  | 1,31%  |
| 8-dic-12 | 677.360.664,80                   | 251.163.845,27   | 46,67%               | 37,08%                               | 1,02%                                  | 11,55% | 0,18%                                  | 2,13%  |
| 8-ene-13 | 675.341.971,78                   | 249.665.572,52   | 46,30%               | 36,97%                               | 1,01%                                  | 11,47% | 0,30%                                  | 3,53%  |
| 8-feb-13 | 673.317.357,26                   | 248.481.194,60   | 45,94%               | 36,90%                               | 1,00%                                  | 11,38% | 0,18%                                  | 2,08%  |
| 8-mar-13 | 671.286.803,87                   | 247.478.924,29   | 45,58%               | 36,87%                               | 0,99%                                  | 11,29% | 0,10%                                  | 1,22%  |
| 8-abr-13 | 669.250.294,19                   | 246.515.375,54   | 45,22%               | 36,83%                               | 0,98%                                  | 11,19% | 0,09%                                  | 1,03%  |
| 8-may-13 | 667.207.810,75                   | 245.328.736,88   | 44,87%               | 36,77%                               | 0,98%                                  | 11,10% | 0,18%                                  | 2,10%  |
| 8-jun-13 | 665.159.336,02                   | 243.923.229,33   | 44,52%               | 36,67%                               | 0,97%                                  | 11,03% | 0,27%                                  | 3,15%  |
| 8-jul-13 | 663.111.616,14                   | 242.816.536,85   | 44,17%               | 36,62%                               | 0,96%                                  | 10,95% | 0,15%                                  | 1,74%  |
| 8-ago-13 | 661.057.889,62                   | 241.563.340,00   | 43,83%               | 36,54%                               | 0,95%                                  | 10,87% | 0,21%                                  | 2,46%  |
| 8-sep-13 | 658.998.138,83                   | 240.513.483,02   | 43,48%               | 36,50%                               | 0,95%                                  | 10,78% | 0,12%                                  | 1,47%  |
| 8-oct-13 | 656.932.346,11                   | 239.510.480,13   | 43,14%               | 36,46%                               | 0,94%                                  | 10,70% | 0,10%                                  | 1,24%  |
| 8-nov-13 | 654.860.493,73                   | 238.293.492,12   | 42,80%               | 36,39%                               | 0,93%                                  | 10,62% | 0,19%                                  | 2,30%  |
| 8-dic-13 | 652.782.563,92                   | 236.956.654,81   | 42,47%               | 36,30%                               | 0,93%                                  | 10,56% | 0,24%                                  | 2,89%  |
| 8-ene-14 | 650.703.792,43                   | 235.767.057,78   | 42,14%               | 36,23%                               | 0,92%                                  | 10,48% | 0,18%                                  | 2,19%  |
| 8-feb-14 | 648.618.923,21                   | 234.640.850,19   | 41,81%               | 36,18%                               | 0,91%                                  | 10,41% | 0,16%                                  | 1,88%  |
| 8-mar-14 | 646.527.938,38                   | 233.088.807,16   | 41,48%               | 36,05%                               | 0,91%                                  | 10,35% | 0,34%                                  | 4,01%  |
| 8-abr-14 | 644.430.819,99                   | 231.810.963,21   | 41,16%               | 35,97%                               | 0,90%                                  | 10,29% | 0,22%                                  | 2,66%  |
| 8-may-14 | 642.327.550,05                   | 230.695.545,90   | 40,83%               | 35,92%                               | 0,89%                                  | 10,22% | 0,16%                                  | 1,85%  |
| 8-jun-14 | 640.218.110,52                   | 229.708.916,49   | 40,51%               | 35,88%                               | 0,89%                                  | 10,14% | 0,10%                                  | 1,19%  |
| 8-jul-14 | 638.109.627,99                   | 228.113.352,62   | 40,20%               | 35,75%                               | 0,88%                                  | 10,09% | 0,37%                                  | 4,31%  |
| 8-ago-14 | 635.994.960,57                   | 226.673.132,50   | 39,88%               | 35,64%                               | 0,88%                                  | 10,04% | 0,30%                                  | 3,55%  |
| 8-sep-14 | 633.874.090,14                   | 225.192.852,10   | 39,57%               | 35,53%                               | 0,87%                                  | 9,99%  | 0,32%                                  | 3,78%  |
| 8-oct-14 | 631.746.998,48                   | 223.972.429,77   | 39,26%               | 35,45%                               | 0,87%                                  | 9,93%  | 0,21%                                  | 2,46%  |
| 8-nov-14 | 629.613.667,35                   | 222.674.737,24   | 38,95%               | 35,37%                               | 0,86%                                  | 9,87%  | 0,24%                                  | 2,87%  |
| 8-dic-14 | 627.474.078,45                   | 221.379.343,87   | 38,65%               | 35,28%                               | 0,86%                                  | 9,82%  | 0,24%                                  | 2,87%  |
| 8-ene-15 | 625.339.624,04                   | 219.758.096,05   | 38,35%               | 35,14%                               | 0,85%                                  | 9,77%  | 0,39%                                  | 4,62%  |
| 8-feb-15 | 623.198.908,55                   | 218.662.726,28   | 38,05%               | 35,09%                               | 0,85%                                  | 9,71%  | 0,16%                                  | 1,86%  |
| 8-mar-15 | 621.051.913,64                   | 217.271.524,92   | 37,75%               | 34,98%                               | 0,84%                                  | 9,66%  | 0,29%                                  | 3,46%  |
| 8-abr-15 | 618.898.620,87                   | 216.019.650,16   | 37,45%               | 34,90%                               | 0,84%                                  | 9,61%  | 0,23%                                  | 2,73%  |
| 8-may-15 | 616.739.011,78                   | 214.967.591,23   | 37,16%               | 34,86%                               | 0,83%                                  | 9,55%  | 0,14%                                  | 1,65%  |
| 8-jun-15 | 614.573.067,83                   | 213.837.232,73   | 36,87%               | 34,79%                               | 0,83%                                  | 9,49%  | 0,18%                                  | 2,08%  |
| 8-jul-15 | 612.414.873,02                   | 212.477.020,97   | 36,58%               | 34,69%                               | 0,82%                                  | 9,45%  | 0,29%                                  | 3,38%  |
| 8-ago-15 | 610.250.347,50                   | 211.117.313,01   | 36,29%               | 34,60%                               | 0,82%                                  | 9,40%  | 0,29%                                  | 3,40%  |
| 8-sep-15 | 608.079.472,71                   | 209.638.573,56   | 36,01%               | 34,48%                               | 0,82%                                  | 9,36%  | 0,35%                                  | 4,07%  |
| 8-oct-15 | 605.902.230,02                   | 208.547.215,68   | 35,73%               | 34,42%                               | 0,81%                                  | 9,31%  | 0,16%                                  | 1,94%  |
| 8-nov-15 | 603.718.600,75                   | 207.131.536,38   | 35,45%               | 34,31%                               | 0,81%                                  | 9,27%  | 0,32%                                  | 3,77%  |
| 8-dic-15 | 601.528.566,17                   | 206.054.562,90   | 35,17%               | 34,26%                               | 0,80%                                  | 9,21%  | 0,16%                                  | 1,88%  |
| 8-ene-16 | 599.334.314,99                   | 204.394.497,59   | 34,90%               | 34,10%                               | 0,80%                                  | 9,18%  | 0,44%                                  | 5,18%  |
| 8-feb-16 | 597.133.627,33                   | 202.992.543,14   | 34,62%               | 33,99%                               | 0,80%                                  | 9,15%  | 0,32%                                  | 3,77%  |
| 8-mar-16 | 594.926.484,33                   | 201.605.395,83   | 34,35%               | 33,89%                               | 0,79%                                  | 9,11%  | 0,31%                                  | 3,71%  |
| 8-abr-16 | 592.712.867,04                   | 200.324.578,04   | 34,08%               | 33,80%                               | 0,79%                                  | 9,06%  | 0,26%                                  | 3,12%  |
| 8-may-16 | 590.492.756,47                   | 198.775.249,80   | 33,82%               | 33,66%                               | 0,79%                                  | 9,03%  | 0,40%                                  | 4,70%  |
| 8-jun-16 | 588.266.133,58                   | 197.371.961,65   | 33,55%               | 33,55%                               | 0,78%                                  | 9,00%  | 0,33%                                  | 3,89%  |

DECRECIMIENTO SERIE B  
SUSPEN.DECREC.SERIE B  
SERIE C  
DECRECIMIENTO SERIE C  
SUSPEN.DECREC.SERIE C  
VIDA RESIDUAL DESDE

1,4%

1,4%

5,4%

8-jun-16

3,65

5,75

5,75

| Fecha    | Principal disponible antes prepag     | Principal Disponible | Amortización de principal | Serie A        | Serie B      | Serie C       | Amortización Serie A | Vida Media Serie A   | Amortización Serie B | Vida Media Serie B   | Amortización Serie C | Vida Media Serie C   |
|----------|---------------------------------------|----------------------|---------------------------|----------------|--------------|---------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
|          |                                       |                      |                           |                |              |               |                      | 3,65                 |                      | 5,75                 |                      | 5,75                 |
| Date     | Principal Available before prepayment | Principal Available  | Principal Redemption      | Class A        | Class B      | Class C       | Redemption Class A   | Average Life Class A | Redemption Class B   | Average Life Class B | Redemption Class C   | Average Life Class C |
|          | 850.000.000,00                        |                      |                           |                |              |               |                      |                      |                      |                      |                      |                      |
| 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 | 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 | 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 | 843.761.517,75                        | 817.656.940,41       | 32.343.059,59             | 821.100.000,00 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 32.343.059,59        | -13292997489612,90%  | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-abr-05 | 842.190.403,70                        | 0,00                 | 0,00                      | 788.756.940,41 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-may-05 | 840.614.681,05                        | 0,00                 | 0,00                      | 788.756.940,41 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-jun-05 | 839.034.336,28                        | 794.135.676,79       | 23.521.263,62             | 788.756.940,41 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 23.521.263,62        | -9450843724129,12%   | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-jul-05 | 837.449.355,83                        | 0,00                 | 0,00                      | 765.235.676,79 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-ago-05 | 835.859.726,10                        | 0,00                 | 0,00                      | 765.235.676,79 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-sep-05 | 834.265.433,46                        | 771.227.989,70       | 22.907.687,09             | 765.235.676,79 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 22.907.687,09        | -8993557951851,33%   | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-oct-05 | 832.666.464,23                        | 0,00                 | 0,00                      | 742.327.989,70 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-nov-05 | 831.062.804,69                        | 0,00                 | 0,00                      | 742.327.989,70 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-dic-05 | 829.454.441,08                        | 748.918.622,61       | 22.309.367,09             | 742.327.989,70 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 22.309.367,09        | -8555642278888,51%   | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-ene-06 | 827.841.359,61                        | 0,00                 | 0,00                      | 720.018.622,61 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-feb-06 | 826.223.546,43                        | 0,00                 | 0,00                      | 720.018.622,61 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-mar-06 | 824.600.987,66                        | 727.192.688,52       | 21.725.934,09             | 720.018.622,61 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 21.725.934,09        | -8136362315355,96%   | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-abr-06 | 822.973.669,39                        | 0,00                 | 0,00                      | 698.292.688,52 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-may-06 | 821.341.577,65                        | 0,00                 | 0,00                      | 698.292.688,52 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-jun-06 | 819.704.698,44                        | 706.035.661,16       | 21.157.027,36             | 698.292.688,52 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 21.157.027,36        | -7728662095498,98%   | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-jul-06 | 818.063.017,72                        | 0,00                 | 0,00                      | 677.135.661,16 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-ago-06 | 816.416.521,41                        | 0,00                 | 0,00                      | 677.135.661,16 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-sep-06 | 814.765.195,37                        | 685.433.366,35       | 20.602.294,81             | 677.135.661,16 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 20.602.294,81        | -7336477180589,50%   | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-oct-06 | 813.109.025,44                        | 0,00                 | 0,00                      | 656.533.366,35 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-nov-06 | 811.447.997,41                        | 0,00                 | 0,00                      | 656.533.366,35 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-dic-06 | 809.782.097,03                        | 665.371.973,64       | 20.061.392,71             | 656.533.366,35 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 20.061.392,71        | -6961303270707,68%   | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-ene-07 | 808.111.707,58                        | 0,00                 | 0,00                      | 636.471.973,64 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-feb-07 | 806.436.418,33                        | 0,00                 | 0,00                      | 636.471.973,64 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-mar-07 | 804.756.214,89                        | 645.838.948,06       | 19.533.025,58             | 636.471.973,64 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 19.533.025,58        | -6602162647431,28%   | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-abr-07 | 803.071.082,85                        | 0,00                 | 0,00                      | 616.938.948,06 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-may-07 | 801.381.007,76                        | 0,00                 | 0,00                      | 616.938.948,06 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-jun-07 | 799.685.975,11                        | 626.820.125,70       | 19.018.822,36             | 616.938.948,06 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 19.018.822,36        | -6253388792876,96%   | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-jul-07 | 797.988.907,49                        | 0,00                 | 0,00                      | 597.920.125,70 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-ago-07 | 796.282.855,93                        | 0,00                 | 0,00                      | 597.920.125,70 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-sep-07 | 794.573.805,82                        | 608.304.818,42       | 18.515.307,27             | 597.920.125,70 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 18.515.307,27        | -5917492204743,75%   | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-oct-07 | 792.859.742,50                        | 0,00                 | 0,00                      | 579.404.818,42 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-nov-07 | 791.140.651,25                        | 0,00                 | 0,00                      | 579.404.818,42 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-dic-07 | 789.416.517,34                        | 590.278.250,94       | 18.026.567,49             | 579.404.818,42 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 18.026.567,49        | -5597249204995,62%   | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-ene-08 | 787.694.525,33                        | 0,00                 | 0,00                      | 561.378.250,94 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-feb-08 | 785.967.452,14                        | 0,00                 | 0,00                      | 561.378.250,94 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-mar-08 | 784.235.372,95                        | 572.744.015,27       | 17.534.235,67             | 561.378.250,94 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 17.534.235,67        | -5284818629568,31%   | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-abr-08 | 782.498.182,91                        | 0,00                 | 0,00                      | 543.844.015,27 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-may-08 | 780.755.897,12                        | 0,00                 | 0,00                      | 543.844.015,27 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-jun-08 | 779.008.500,62                        | 555.673.760,32       | 17.070.254,95             | 543.844.015,27 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 17.070.254,95        | -4987928497459,21%   | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-jul-08 | 777.259.527,22                        | 0,00                 | 0,00                      | 526.773.760,32 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-ago-08 | 775.505.423,51                        | 0,00                 | 0,00                      | 526.773.760,32 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-sep-08 | 773.746.174,42                        | 539.063.302,04       | 16.610.458,28             | 526.773.760,32 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 16.610.458,28        | -4700759692926,72%   | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-oct-08 | 771.981.764,88                        | 0,00                 | 0,00                      | 510.163.302,04 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-nov-08 | 770.212.179,73                        | 0,00                 | 0,00                      | 510.163.302,04 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-dic-08 | 768.437.403,79                        | 522.893.578,54       | 16.169.723,50             | 510.163.302,04 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 16.169.723,50        | -4428887266422,83%   | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-ene-09 | 766.659.103,76                        | 0,00                 | 0,00                      | 493.993.578,54 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-feb-09 | 764.875.587,37                        | 0,00                 | 0,00                      | 493.993.578,54 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-mar-09 | 763.086.839,34                        | 507.156.896,86       | 15.736.681,67             | 493.993.578,54 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 15.736.681,67        | -4168646975607,54%   | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-abr-09 | 761.292.844,32                        | 0,00                 | 0,00                      | 478.256.896,86 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-may-09 | 759.493.586,90                        | 0,00                 | 0,00                      | 478.256.896,86 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-jun-09 | 757.689.051,67                        | 491.838.978,91       | 15.317.917,96             | 478.256.896,86 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 15.317.917,96        | -3916791621578,45%   | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-jul-09 | 755.881.308,93                        | 0,00                 | 0,00                      | 462.938.978,91 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |
| 8-ago-09 | 754.068.263,48                        | 0,00                 | 0,00                      | 462.938.978,91 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00                 | 0,00%                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%                |

|          |   |                                       |                     |                      |                |              |               | 3,65               |                    | 5,75                 |                      | 5,75               |                      |
|----------|---|---------------------------------------|---------------------|----------------------|----------------|--------------|---------------|--------------------|--------------------|----------------------|----------------------|--------------------|----------------------|
| Date     |   | Principal Available before prepayment | Principal Available | Principal Redemption | Class A        | Class B      | Class C       | Redemption Class A | Redemption Class B | Average Life Class A | Average Life Class B | Redemption Class C | Average Life Class C |
| 8-sep-09 | 1 | 752.249.899,76                        | 476.933.282,84      | 14.905.696,07        | 462.938.978,91 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 14.905.696,07      | -3674254080953,99% | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-oct-09 | 0 | 750.426.202,17                        | 0,00                | 0,00                 | 448.033.282,84 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-nov-09 | 0 | 748.597.155,07                        | 0,00                | 0,00                 | 448.033.282,84 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-dic-09 | 1 | 746.762.742,76                        | 462.425.414,29      | 14.507.866,54        | 448.033.282,84 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 14.507.866,54      | -3444167992242,72% | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ene-10 | 0 | 744.925.018,92                        | 0,00                | 0,00                 | 433.525.414,29 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-feb-10 | 0 | 743.081.904,42                        | 0,00                | 0,00                 | 433.525.414,29 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-mar-10 | 1 | 741.233.383,45                        | 448.309.129,27      | 14.116.285,02        | 433.525.414,29 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 14.116.285,02      | -3224159498391,11% | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-abr-10 | 0 | 739.379.440,15                        | 0,00                | 0,00                 | 419.409.129,27 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-may-10 | 0 | 737.520.058,62                        | 0,00                | 0,00                 | 419.409.129,27 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-jun-10 | 1 | 735.655.222,91                        | 434.570.753,17      | 13.738.376,10        | 419.409.129,27 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 13.738.376,10      | -3011452041780,21% | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-jul-10 | 0 | 733.787.447,69                        | 0,00                | 0,00                 | 405.670.753,17 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ago-10 | 0 | 731.914.193,66                        | 0,00                | 0,00                 | 405.670.753,17 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-sep-10 | 1 | 730.035.444,76                        | 421.205.155,79      | 13.365.597,38        | 405.670.753,17 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 13.365.597,38      | -2806775450612,13% | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-oct-10 | 0 | 728.151.184,86                        | 0,00                | 0,00                 | 392.305.155,79 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-nov-10 | 0 | 726.261.397,79                        | 0,00                | 0,00                 | 392.305.155,79 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-dic-10 | 1 | 724.366.067,35                        | 408.198.486,12      | 13.006.669,67        | 392.305.155,79 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 13.006.669,67      | -2613039937286,78% | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ene-11 | 0 | 722.468.266,09                        | 0,00                | 0,00                 | 379.298.486,12 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-feb-11 | 0 | 720.564.897,95                        | 0,00                | 0,00                 | 379.298.486,12 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-mar-11 | 1 | 718.655.946,59                        | 395.546.800,04      | 12.651.686,07        | 379.298.486,12 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 12.651.686,07      | -2427858557264,15% | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-abr-11 | 0 | 716.741.395,64                        | 0,00                | 0,00                 | 366.646.800,04 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-may-11 | 0 | 714.821.228,68                        | 0,00                | 0,00                 | 366.646.800,04 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-jun-11 | 1 | 712.895.429,22                        | 383.235.950,10      | 12.310.849,94        | 366.646.800,04 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 12.310.849,94      | -2249192283742,48% | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-jul-11 | 0 | 710.965.191,30                        | 0,00                | 0,00                 | 354.335.950,10 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ago-11 | 0 | 709.029.291,35                        | 0,00                | 0,00                 | 354.335.950,10 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-sep-11 | 1 | 707.087.712,76                        | 371.259.232,27      | 11.976.717,84        | 354.335.950,10 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 11.976.717,84      | -2077960544642,97% | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-oct-11 | 0 | 705.140.438,68                        | 0,00                | 0,00                 | 342.359.232,27 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-nov-11 | 0 | 703.187.452,99                        | 0,00                | 0,00                 | 342.359.232,27 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-dic-11 | 1 | 701.228.738,34                        | 359.606.255,72      | 11.652.976,54        | 342.359.232,27 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 11.652.976,54      | -1915749343705,28% | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ene-12 | 0 | 699.269.967,10                        | 0,00                | 0,00                 | 330.706.255,72 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-feb-12 | 0 | 697.305.450,14                        | 0,00                | 0,00                 | 330.706.255,72 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-mar-12 | 1 | 695.335.170,59                        | 348.277.395,92      | 11.328.859,81        | 330.706.255,72 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 11.328.859,81      | -1759371928280,56% | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-abr-12 | 0 | 693.359.111,56                        | 0,00                | 0,00                 | 319.377.395,92 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-may-12 | 0 | 691.377.256,08                        | 0,00                | 0,00                 | 319.377.395,92 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-jun-12 | 1 | 689.389.587,16                        | 337.255.756,30      | 11.021.639,52        | 319.377.395,92 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 11.021.639,52      | -16102615483,69%   | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-jul-12 | 0 | 687.399.418,55                        | 0,00                | 0,00                 | 308.355.756,30 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ago-12 | 0 | 685.403.412,10                        | 0,00                | 0,00                 | 308.355.756,30 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-sep-12 | 1 | 683.401.550,70                        | 326.538.333,12      | 10.717.423,18        | 308.355.756,30 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 10.717.423,18      | -1467215233068,48% | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-oct-12 | 0 | 681.393.817,18                        | 0,00                | 0,00                 | 297.638.333,12 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-nov-12 | 0 | 679.380.194,30                        | 0,00                | 0,00                 | 297.638.333,12 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-dic-12 | 1 | 677.360.664,80                        | 316.112.554,64      | 10.425.778,48        | 297.638.333,12 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 10.425.778,48      | -1332414489643,77% | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ene-13 | 0 | 675.341.971,78                        | 0,00                | 0,00                 | 287.212.554,64 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-feb-13 | 0 | 673.317.357,26                        | 0,00                | 0,00                 | 287.212.554,64 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-mar-13 | 1 | 671.286.803,87                        | 305.980.282,57      | 10.132.272,07        | 287.212.554,64 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 10.132.272,07      | -1203713921414,95% | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-abr-13 | 0 | 669.250.294,19                        | 0,00                | 0,00                 | 277.080.282,57 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-may-13 | 0 | 667.207.810,75                        | 0,00                | 0,00                 | 277.080.282,57 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-jun-13 | 1 | 665.159.336,02                        | 296.124.665,06      | 9.855.617,52         | 277.080.282,57 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 9.855.617,52       | -1080175680010,96% | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-jul-13 | 0 | 663.111.616,14                        | 0,00                | 0,00                 | 267.224.665,06 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ago-13 | 0 | 661.057.889,62                        | 0,00                | 0,00                 | 267.224.665,06 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-sep-13 | 1 | 658.998.138,83                        | 286.547.510,29      | 9.577.154,77         | 267.224.665,06 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 9.577.154,77       | -961546338585,81%  | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-oct-13 | 0 | 656.932.346,11                        | 0,00                | 0,00                 | 257.647.510,29 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-nov-13 | 0 | 654.860.493,73                        | 0,00                | 0,00                 | 257.647.510,29 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-dic-13 | 1 | 652.782.563,92                        | 277.232.765,35      | 9.314.744,94         | 257.647.510,29 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 9.314.744,94       | -850436213132,11%  | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ene-14 | 0 | 650.703.792,43                        | 0,00                | 0,00                 | 248.332.765,35 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-feb-14 | 0 | 648.618.923,21                        | 0,00                | 0,00                 | 248.332.765,35 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-mar-14 | 1 | 646.527.938,38                        | 268.180.297,36      | 9.052.467,99         | 248.332.765,35 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 9.052.467,99       | -745018115726,38%  | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-abr-14 | 0 | 644.430.819,99                        | 0,00                | 0,00                 | 239.280.297,36 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-may-14 | 0 | 642.327.550,05                        | 0,00                | 0,00                 | 239.280.297,36 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-jun-14 | 1 | 640.218.110,52                        | 259.376.775,24      | 8.803.522,12         | 239.280.297,36 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 8.803.522,12       | -643537466780,78%  | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-jul-14 | 0 | 638.109.627,99                        | 0,00                | 0,00                 | 230.476.775,24 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ago-14 | 0 | 635.994.960,57                        | 0,00                | 0,00                 | 230.476.775,24 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-sep-14 | 1 | 633.874.090,14                        | 250.824.347,58      | 8.552.427,66         | 230.476.775,24 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 8.552.427,66       | -546500127437,38%  | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-oct-14 | 0 | 631.746.998,48                        | 0,00                | 0,00                 | 221.924.347,58 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-nov-14 | 0 | 629.613.667,35                        | 0,00                | 0,00                 | 221.924.347,58 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-dic-14 | 1 | 627.474.078,45                        | 242.507.983,53      | 8.316.364,04         | 221.924.347,58 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 8.316.364,04       | -455736749619,76%  | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ene-15 | 0 | 625.339.624,04                        | 0,00                | 0,00                 | 213.607.983,53 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-feb-15 | 0 | 623.198.908,55                        | 0,00                | 0,00                 | 213.607.983,53 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00               | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-mar-15 | 1 | 621.051.913,64                        | 234.434.603,28      | 8.073.380,26         | 213.607.983,53 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 8.073.380,26       | -369760815744,17%  | 0,00                 | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ab     |   |                                       |                     |                      |                |              |               |                    |                    |                      |                      |                    |                      |

| Date     |   | Principal Available before prepayment | Principal Available | Principal Redemption | Class A        | Class B      | Class C       | Redemption Class A | 3,65                 | Redemption Class B | 5,75                 | Redemption Class C | 5,75                 |
|----------|---|---------------------------------------|---------------------|----------------------|----------------|--------------|---------------|--------------------|----------------------|--------------------|----------------------|--------------------|----------------------|
|          |   |                                       |                     |                      |                |              |               |                    | Average Life Class A |                    | Average Life Class B |                    | Average Life Class C |
| 8-sep-17 | 1 | 554.278.130,88                        | 165.294.024,60      | 6.046.905,67         | 142.440.930,27 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 6.046.905,67       | 276343589137,61%     | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-oct-17 | 0 | 551.966.993,18                        | 0,00                | 0,00                 | 136.394.024,60 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-nov-17 | 0 | 549.649.076,35                        | 0,00                | 0,00                 | 136.394.024,60 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-dic-17 | 1 | 547.324.360,30                        | 159.418.143,96      | 5.875.880,64         | 136.394.024,60 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 5.875.880,64       | 321998258997,16%     | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ene-18 | 0 | 545.002.656,18                        | 0,00                | 0,00                 | 130.518.143,96 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-feb-18 | 0 | 542.674.141,74                        | 0,00                | 0,00                 | 130.518.143,96 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-mar-18 | 1 | 540.338.796,98                        | 153.717.276,72      | 5.700.867,23         | 130.518.143,96 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 5.700.867,23       | 363715329560,38%     | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-abr-18 | 0 | 537.996.601,88                        | 0,00                | 0,00                 | 124.817.276,72 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-may-18 | 0 | 535.647.536,34                        | 0,00                | 0,00                 | 124.817.276,72 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-jun-18 | 1 | 533.291.580,21                        | 148.178.371,39      | 5.538.905,33         | 124.817.276,72 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 5.538.905,33       | 404340089298,16%     | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-jul-18 | 0 | 530.937.947,54                        | 0,00                | 0,00                 | 119.278.371,39 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ago-18 | 0 | 528.577.410,87                        | 0,00                | 0,00                 | 119.278.371,39 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-sep-18 | 1 | 526.209.949,96                        | 142.804.767,33      | 5.373.604,06         | 119.278.371,39 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 5.373.604,06       | 441710253799,81%     | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-oct-18 | 0 | 523.835.544,50                        | 0,00                | 0,00                 | 113.904.767,33 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-nov-18 | 0 | 521.454.174,11                        | 0,00                | 0,00                 | 113.904.767,33 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-dic-18 | 1 | 519.065.818,38                        | 137.584.541,45      | 5.220.225,89         | 113.904.767,33 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 5.220.225,89       | 476606623373,96%     | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ene-19 | 0 | 516.677.835,93                        | 0,00                | 0,00                 | 108.684.541,45 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-feb-19 | 0 | 514.282.848,75                        | 0,00                | 0,00                 | 108.684.541,45 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-mar-19 | 1 | 511.880.836,23                        | 132.519.454,91      | 5.065.086,53         | 108.684.541,45 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 5.065.086,53       | 508028179307,20%     | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-abr-19 | 0 | 509.471.777,84                        | 0,00                | 0,00                 | 103.619.454,91 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-may-19 | 0 | 507.055.652,87                        | 0,00                | 0,00                 | 103.619.454,91 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-jun-19 | 1 | 504.632.440,60                        | 127.599.653,78      | 4.919.801,14         | 103.619.454,91 | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 4.919.801,14       | 538718224556,70%     | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-jul-19 | 0 | 502.221.183,66                        | 0,00                | 0,00                 | 98.699.653,78  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ago-19 | 0 | 499.802.853,70                        | 0,00                | 0,00                 | 98.699.653,78  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-sep-19 | 1 | 497.377.429,98                        | 122.835.518,65      | 4.764.135,12         | 98.699.653,78  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 4.764.135,12       | 565502838902,63%     | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-oct-19 | 0 | 494.944.891,68                        | 0,00                | 0,00                 | 93.935.518,65  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-nov-19 | 0 | 492.505.217,93                        | 0,00                | 0,00                 | 93.935.518,65  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-dic-19 | 1 | 490.058.387,81                        | 118.208.655,27      | 4.626.863,38         | 93.935.518,65  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 4.626.863,38       | 591313140496,52%     | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ene-20 | 0 | 487.648.819,99                        | 0,00                | 0,00                 | 89.308.655,27  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-feb-20 | 0 | 485.232.184,09                        | 0,00                | 0,00                 | 89.308.655,27  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-mar-20 | 1 | 482.808.459,40                        | 113.746.981,53      | 4.461.673,74         | 89.308.655,27  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 4.461.673,74       | 610803135327,44%     | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-abr-20 | 0 | 480.377.625,12                        | 0,00                | 0,00                 | 84.846.981,53  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-may-20 | 0 | 477.939.660,39                        | 0,00                | 0,00                 | 84.846.981,53  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-jun-20 | 1 | 475.494.544,30                        | 109.414.305,52      | 4.332.676,01         | 84.846.981,53  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 4.332.676,01       | 633003964852,81%     | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-jul-20 | 0 | 473.072.712,19                        | 0,00                | 0,00                 | 80.514.305,52  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ago-20 | 0 | 470.643.776,03                        | 0,00                | 0,00                 | 80.514.305,52  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-sep-20 | 1 | 468.207.715,00                        | 105.227.849,59      | 4.186.455,93         | 80.514.305,52  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 4.186.455,93       | 650156605846,63%     | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-oct-20 | 0 | 465.764.508,19                        | 0,00                | 0,00                 | 76.327.849,59  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-nov-20 | 0 | 463.314.134,64                        | 0,00                | 0,00                 | 76.327.849,59  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-dic-20 | 1 | 460.856.573,33                        | 101.162.947,85      | 4.064.901,74         | 76.327.849,59  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 4.064.901,74       | 668269846325,71%     | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ene-21 | 0 | 458.394.156,08                        | 0,00                | 0,00                 | 72.262.947,85  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-feb-21 | 0 | 455.924.515,75                        | 0,00                | 0,00                 | 72.262.947,85  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-mar-21 | 1 | 453.447.631,13                        | 97.217.933,89       | 3.945.013,96         | 72.262.947,85  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 3.945.013,96       | 684065420077,31%     | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-abr-21 | 0 | 450.963.480,99                        | 0,00                | 0,00                 | 68.317.933,89  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-may-21 | 0 | 448.472.044,01                        | 0,00                | 0,00                 | 68.317.933,89  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-jun-21 | 1 | 445.973.298,81                        | 93.388.127,40       | 3.829.806,49         | 68.317.933,89  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 3.829.806,49       | 699322665263,51%     | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-jul-21 | 0 | 443.470.820,37                        | 0,00                | 0,00                 | 64.488.127,40  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ago-21 | 0 | 440.961.001,33                        | 0,00                | 0,00                 | 64.488.127,40  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-sep-21 | 1 | 438.443.820,15                        | 89.672.715,75       | 3.715.411,65         | 64.488.127,40  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 3.715.411,65       | 712615954962,23%     | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-oct-21 | 0 | 435.919.255,24                        | 0,00                | 0,00                 | 60.772.715,75  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-nov-21 | 0 | 433.387.284,95                        | 0,00                | 0,00                 | 60.772.715,75  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-dic-21 | 1 | 430.847.887,53                        | 86.066.451,48       | 3.606.264,27         | 60.772.715,75  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 3.606.264,27       | 724498490894,77%     | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-ene-22 | 0 | 428.303.896,47                        | 0,00                | 0,00                 | 57.166.451,48  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-feb-22 | 0 | 425.752.443,04                        | 0,00                | 0,00                 | 57.166.451,48  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00                 | 0,00               | 0,00%                |
| 8-mar-22 | 1 | 423.193.505,34                        | 82.568.136,59       | 3.498.314,90         | 57.166.451,48  | 6.000.000,00 | 22.900.000,00 | 3.498.314,90       | 11999238166114,30%   | 6.000.000,00       | 12.594.000.000,00    | 22.900.000,00      | 480671000000,00%     |