

## **F.T.H U.C.I. 12**

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

|                                                                                  |                   |                                        |            |
|----------------------------------------------------------------------------------|-------------------|----------------------------------------|------------|
| NAME OF THE FUND:                                                                | F.T.H.U.C.I. 12   |                                        |            |
| INFORMATION AT:                                                                  | QUARTER/SEMESTER: | June 16th, 2014 - September 15th, 2014 | YEAR: 2014 |
| Acting on behalf of Santander de Titulización S.G.F.T., S.A. as General Manager: |                   | Signature:                             |            |
| IGNACIO ORTEGA GAVARA - GENERAL MANAGER                                          |                   |                                        |            |

#### I. DATA OF THE FUND

|                          |                                           |                    |                  |         |
|--------------------------|-------------------------------------------|--------------------|------------------|---------|
| Constitution Date        | May 30, 2005                              | Paying Agent       | BANCO SANTANDER  |         |
| Disbursement Date        | June 02, 2005                             | Negotiation Market | AIAF             |         |
| Final Date of Redemption | December 15, 2039                         | Ratings Agencies   | STANDARD & POORS |         |
| Management Company       | SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T., S.A. | Rating             | Initial          | Current |
|                          | UNIÓN DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, S.       | CLASS A            | AAA              | AA      |
|                          |                                           | CLASS B            | A                | BBB+    |
|                          |                                           | CLASS C            | BBB              | BB      |

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

| CLASS PRIORITY<br>ISIN CODE | NUM BONDS | NOMINAL          |                |                |          |
|-----------------------------|-----------|------------------|----------------|----------------|----------|
|                             |           |                  | Initial        | Current        | %Act/In  |
| CLASS A<br>ES0338147004     | 8.672     | Nominal per Bond | 100.000,00     | 32.013,50      |          |
|                             |           | Total Nominal    | 867.200.000,00 | 277.621.072,00 | 32,01%   |
| CLASS B<br>ES0338147012     | 90        | Nominal per Bond | 100.000,00     | 100.000,00     |          |
|                             |           | Total Nominal    | 9.000.000,00   | 9.000.000,00   | 100,00 % |
| CLASS C<br>ES0338147020     | 238       | Nominal per Bond | 100.000,00     | 100.000,00     |          |
|                             |           | Total Nominal    | 23.800.000,00  | 23.800.000,00  | 100,00 % |

| REDEMPTION AND INTEREST OF THE BONDS                       |                         |                |                                          |                            |                          |
|------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------|------------------------------------------|----------------------------|--------------------------|
| Current                                                    |                         |                | Next                                     |                            |                          |
| Payment Date of the Current Period<br>September 15th, 2014 |                         |                | Next Payment Date<br>December 15th, 2014 |                            |                          |
|                                                            | Redemption of the Bonds | Gross Interest | Interest Rate                            | Gross Interest Next Coupon | Net Interest Next Coupon |
| CLASS A                                                    | 528,92 €                | 32,25 €        | 0,234%                                   | 18,94 €                    | 14,96 €                  |
| CLASS B                                                    | 0,00 €                  | 129,42 €       | 0,354%                                   | 89,48 €                    | 70,69 €                  |
| CLASS C                                                    | 0,00 €                  | 212,84 €       | 0,684%                                   | 172,90 €                   | 136,59 €                 |
| Accrued amortisation due not payed                         | 0,00 €                  |                |                                          |                            |                          |
| Scheduled Amortisation                                     | NO                      |                |                                          |                            |                          |

#### III. ASSET PURCHASED BY THE FUND: CREDIT RIGHTS

| CREDIT RIGHTS                             | ISSUE DATE       | CURRENT DATE     |
|-------------------------------------------|------------------|------------------|
| Numbre of CR's                            | 7.886            | 3.672            |
| CR's Outstanding to be amortised          | 900.000.006,57 € | 320.960.716,40 € |
| CR's Outstanding per Loan to be amortised | 114.126,30 €     | 87.407,60 €      |
| Interest Rate                             | 3,93 %           | 3,28%            |

| PREPAYMENT RATE                            | CURRENT SITUATION |
|--------------------------------------------|-------------------|
| Monthly Single Rate                        | 1,30%             |
| Average Monthly Single Rate                | 2,20%             |
| Constant Prepayment Rate from Constitution | 8,29%             |

**F.T.H U.C.I. 12**

**QUARTERLY BONDS PAYOUT REPORT**

**September 15th, 2014**

| BONDS. PRINCIPAL             |                  |
|------------------------------|------------------|
| Previous Balance             | 315.007.866,24 € |
| Principal Amortised          | 4.586.794,24 €   |
| Outstanding Balance          | 310.421.072,00 € |
| % of Initial Balance         | 34,49%           |
| Principal accrued and unpaid | 0,00 €           |

| INTEREST PAID               |              |
|-----------------------------|--------------|
| CLASS A                     | 279.672,00 € |
| CLASS B                     | 11.647,80 €  |
| CLASS C                     | 50.655,92 €  |
| Interest accrued and unpaid | 0,00 €       |

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

| RESIDUAL LIFE (YEARS) |         |                      |
|-----------------------|---------|----------------------|
|                       | INITIAL | September 15th, 2014 |
| CLASS A               | 4,80    | 4,91                 |
| CLASS B               | 8,04    | 9,00                 |
| CLASS C               | 8,04    | 9,00                 |

**F.T.H U.C.I. 12**

**QUARTERLY COLLATERAL REPORT**

**September 15th, 2014**

| PRINCIPAL               |                  |
|-------------------------|------------------|
| Previous Balance        | 325.388.217,21 € |
| Principal Amortised     | 4.427.500,81 €   |
| Outstanding Balance     | 320.960.716,40 € |
| Number of Credit Rights | 3.672            |
| LTV                     | 48,45%           |

| INTEREST                                 |                |
|------------------------------------------|----------------|
| Interest received during relevant period | 2.336.431,08 € |
| Interest accrued during relevant period  | 2.362.759,09 € |

| PRINCIPAL BALANCE IN ARREARS                 |                |                |                |                |                    |
|----------------------------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|--------------------|
|                                              | UP to 30 DAYS  | 30 to 60 DAYS  | 60 to 90 DAYS  | 90 to 180 DAYS | MORE THAN 180 DAYS |
| Principal Balance in Arrears                 | 14.816,36 €    | 16.403,99 €    | 11.388,03 €    | 62.435,99 €    | 749.824,04 €       |
| Interest accrued on Credit Rights in Arrears | 13.474,42 €    | 14.341,83 €    | 15.462,57 €    | 45.060,97 €    | 1.155.553,64 €     |
| Outstanding Balance                          | 8.006.004,05 € | 3.309.646,90 € | 2.220.689,99 € | 2.502.893,56 € | 9.445.796,25 €     |
| Number of Credit Rights                      | 81             | 32             | 21             | 25             | 67                 |
| % of Outstanding Balance                     | 2,49%          | 1,03%          | 0,69%          | 0,78%          | 2,94%              |

| WRITE OFF                                   |                 |
|---------------------------------------------|-----------------|
| Cumulative WRITE OFF as of previous balance | 10.380.372,91 € |
| Difference in Actual Period                 | 159.244,59 €    |
| Cumulative WRITE OFF up to date             | 10.539.617,50 € |

**F.T.H U.C.I. 12**

**QUARTERLY COLLATERAL REPORT**

**September 15th, 2014**

| TRANSITORY PROPERTIES           |                |
|---------------------------------|----------------|
| Last balance                    | 4.929.120,92 € |
| Difference in Actual Period     | 344.293,41 €   |
| Current balance                 | 5.273.414,33 € |
| Number of Transitory properties | 110            |

| NET LOSSES                  |                |
|-----------------------------|----------------|
| Last balance                | 3.465.329,75 € |
| Difference in Actual Period | 319.213,32 €   |
| Current balance             | 3.784.543,07 € |

**F.T.H U.C.I. 12**

**QUARTERLY REPORT - ALLOCATION OF CASH**

**September 15th, 2014**

| <b>TOTAL CASH RECEIVED END OF PERIOD</b>        | <b>5.855.367,50 €</b> |
|-------------------------------------------------|-----------------------|
| <b>CASH RECEIVED - PRINCIPAL</b>                |                       |
| Amortisation of Credit Rights                   | 3.471.107,76 €        |
| <b>CASH RECEIVED - INTEREST</b>                 |                       |
| Interest received from Credit Rights            | 2.336.431,08 €        |
| Interest received under GIC                     | 1.619,36              |
| <b>INCOMES/EXPENSES OF TRANSTORY PROPERTIES</b> | <b>42.000,00 €</b>    |
| <b>OTHERS</b>                                   | <b>4.209,30 €</b>     |

| <b>TOTAL CASH PAID END OF PERIOD</b>    | <b>5.855.367,50 €</b> |
|-----------------------------------------|-----------------------|
| <b>ORDINARY EXPENSES</b>                | <b>3.742,53 €</b>     |
| MANAGEMENT FEE                          | 17.670,65 €           |
| INTEREST ON CLASS A BONDS               | 279.672,00 €          |
| INTEREST ON CLASS B BONDS               | 11.647,80 €           |
| INTEREST ON CLASS C BONDS               | 50.655,92 €           |
| REDEMPTION ON CLASS A BONDS             | 4.586.794,24 €        |
| INTEREST ON SUBORDINATED LOAN SANTANDER | 10.360,36 €           |
| INTEREST ON SUBORDINATED LOAN UCB       | 10.360,36 €           |
| FIXED FEE                               | 6.000,00 €            |
| VARIABLE FEE                            | 878.463,64 €          |

| <b>TREASURY ACCOUNT STATEMENT</b> | <b>10.421.794,24 €</b> |
|-----------------------------------|------------------------|
| <b>PRINCIPAL RESERVE FUND</b>     |                        |
| Previous Balance                  | 10.350.000,00 €        |
| Period utilization                | 0,00 €                 |
| Outstanding Balance               | 10.350.000,00 €        |
| <b>WITHHOLDING TAXES</b>          | <b>71.794,24 €</b>     |

**F.T.H U.C.I. 12**

**CREDIT ENHACEMENT AND SUBORDINATED LOAN**

**September 15th, 2014**

| <b>CREDIT ENHACEMENT</b> |                          |                             |
|--------------------------|--------------------------|-----------------------------|
| <b>CONCEPTS</b>          | <b>INITIAL</b>           | <b>September 15th, 2014</b> |
| SUBORDINATED ISSUE       | 32.800.000,00 € (3,64%)  | 32.800.000,00 € (10,22%)    |
| PRINCIPAL RESERVE FUND   | 10.350.000,00 € (1,15 %) | 10.350.000,00 € (3,22%)     |

| <b>SUBORDINATED LOANS</b>           |                |                             |
|-------------------------------------|----------------|-----------------------------|
| <b>CONCEPTS</b>                     | <b>INITIAL</b> | <b>September 15th, 2014</b> |
| SUBORDINATED LOAN SCH               |                |                             |
| Total Outstanding Subordinated Loan | 5.612.500,00 € | 5.175.003,26 €              |
| Interest Rate                       | 2,682 %        | 0,634%                      |
| SUBORDINATED LOAN UCB               |                |                             |
| Total Outstanding Subordinated Loan | 5.612.500,00 € | 5.175.003,26 €              |
| Interest Rate                       | 2,682 %        | 0,634%                      |

## F.T.H U.C.I. 12

### DEFINITIONS

September 15th, 2014

**DETERMINATION DATE** Means the date in which the Gestora will carry out the necessary calculations, on behalf of the Fund, for the distribution of the available funds at this date, according with the Order of Priority of Payments.  
All the information regarding the Assets (Outstanding Balance of the Credit Rights, arrears' tables, transitory properties, stratification tables, etc.) are referred to this mentioned date.

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

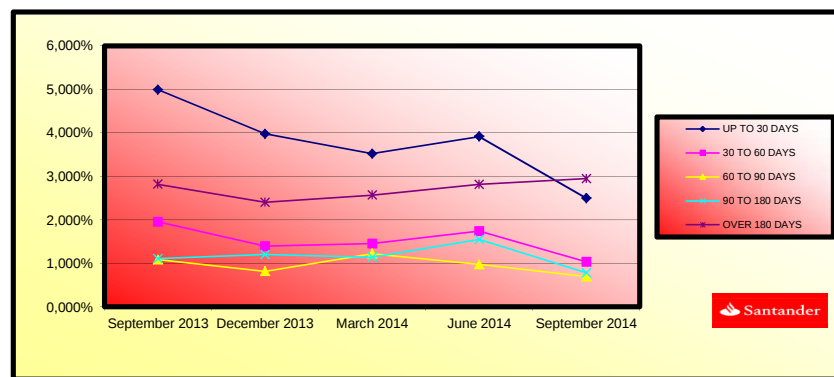
**NET LOSSES** Those loans which the Originator considers that will not recover (net of recoveries).

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

**FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA  
UCI 12**

Report date: September 15th, 2014

| ARREARS PERFORMANCE |                |               |            |           |                |
|---------------------|----------------|---------------|------------|-----------|----------------|
|                     | September 2013 | December 2013 | March 2014 | June 2014 | September 2014 |
| UP TO 30 DAYS       | 4,989%         | 3,975%        | 3,517%     | 3,913%    | 2,494%         |
| 30 TO 60 DAYS       | 1,954%         | 1,396%        | 1,452%     | 1,742%    | 1,031%         |
| 60 TO 90 DAYS       | 1,086%         | 0,815%        | 1,220%     | 0,972%    | 0,692%         |
| 90 TO 180 DAYS      | 1,108%         | 1,202%        | 1,139%     | 1,549%    | 0,780%         |
| OVER 180 DAYS       | 2,818%         | 2,399%        | 2,567%     | 2,813%    | 2,943%         |



**FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA  
UCI 12**

**TRIGGERS**

Report date: September 15th, 2014

| CLASS B AND CLASS C REDEMPTION                               |                 |
|--------------------------------------------------------------|-----------------|
| IF 1) IS HIGHER THAN 2) CLASS B AND CLASS C ARE NOT REDEEMED |                 |
| 1) CR'S IN ARREARS OVER 90 DAYS                              | 22.488.307,31 € |
| 2) 2% CR'S OUTSTANDING BALANCE                               | 6.419.214,33 €  |

| CURRENT ARREARS PERCENTAGE |
|----------------------------|
| 7,01%                      |

CLASSES B & C CANNOT BE REDEEMED

| RESERVE FUNDS TRIGGERS                                    |       |
|-----------------------------------------------------------|-------|
| IF 1) IS HIGHER THAN 2) RESERVE FUNDS WILL NOT BE REDUCED |       |
| 1) BONDS WEIGHTED AVERAGE RATE + 0,40%                    | 0,83% |
| 1) MP'S WEIGHTED AVERAGE RATE                             | 3,28% |

RESERVE FUND CAN BE REDEEMED

| RESERVE FUND LEVELS                                |                                                                                |              |
|----------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|--------------|
| CURRENT ARREARS PERCENTAGE < 0,75%                 | HIGHER OF<br>2,3% CR OUTSTANDING BALANCE<br>0,40% INITIAL BALANCE OF THE BONDS | NA           |
| CURRENT ARREARS PERCENTAGE BETWEEN 0,75% AND 1,25% | HIGHER OF<br>2,3% CR OUTSTANDING BALANCE<br>0,70% INITIAL BALANCE OF THE BONDS | NA           |
| CURRENT ARREARS PERCENTAGE > 1,25%                 | HIGHER OF<br>2,3% CR OUTSTANDING BALANCE<br>0,80% INITIAL BALANCE OF THE BONDS | 10.350.000 € |

| INTEREST DEFERRAL FOR CLASS B AND C                                     |  |                  |
|-------------------------------------------------------------------------|--|------------------|
| IF 1) IS HIGHER THAN 2)+3) CLASS B INTERESTS ARE DEFERRED TO POSITION 6 |  |                  |
| 1) CLASS A OUTSTANDING BALANCE                                          |  | 282.207.866,24 € |
| 2) CR OUTSTANDING BALANCE (EXCLUDING ARREARS > 18 MONTHS)               |  | 307.549.575,11 € |
| 3) REMAINING FUNDS AFTER PAYMENTS OF POINT 1º TO 3º                     |  | 15.892.634,52 €  |
| IF 1) IS HIGHER THAN 2)+3) CLASS C INTERESTS ARE DEFERRED TO POSITION 7 |  |                  |
| 1) CLASS A AND CLASS B OUTSTANDING BALANCE                              |  | 291.207.866,24 € |
| 2) CR OUTSTANDING BALANCE (EXCLUDING ARREARS > 18 MONTHS)               |  | 307.549.575,11 € |
| 3) REMAINING FUNDS AFTER PAYMENTS OF POINT 1º TO 4º                     |  | 15.841.978,60 €  |

CLASS B INTEREST ARE NOT DEFERRED

CLASS C INTEREST ARE NOT DEFERRED

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

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

| LTV           |                 |               |              |                 |
|---------------|-----------------|---------------|--------------|-----------------|
| INTERVAL      | OUTSTANDING     | % OUTSTANDING | NUM.OF LOANS | % NUM. OF LOANS |
| 0,17 - 39,99  | 60.337.546,54 € | 18,80%        | 1.117        | 30,42%          |
| 40,00 - 49,99 | 56.122.793,90 € | 17,49%        | 567          | 15,44%          |
| 50,00 - 59,99 | 78.328.072,05 € | 24,40%        | 778          | 21,19%          |
| 60,00 - 69,99 | 85.480.958,24 € | 26,63%        | 867          | 23,61%          |
| 70,00 - 79,95 | 40.691.345,67 € | 12,68%        | 343          | 9,34%           |

F.T.H.: UCI 12

| 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    |
|          |                               |                  | 0,72%             |                                   |                                  |        |                                  | 2,20%  |
|          | 900.000.006,57                |                  | 100,00%           | 100,00%                           |                                  |        |                                  |        |
| 01-07-05 | 898.420.072,18                | 862.418.638,74   | 99,28%            | 95,99%                            | 4,01%                            | 38,78% | 4,01%                            | 38,78% |
| 01-08-05 | 896.834.963,50                | 842.920.105,66   | 98,57%            | 93,99%                            | 3,05%                            | 31,06% | 2,09%                            | 22,37% |
| 01-09-05 | 895.244.663,59                | 830.590.005,35   | 97,86%            | 92,78%                            | 2,47%                            | 25,91% | 1,29%                            | 14,40% |
| 01-10-05 | 893.649.155,45                | 815.668.621,72   | 97,16%            | 91,27%                            | 2,26%                            | 23,96% | 1,62%                            | 17,81% |
| 01-11-05 | 892.048.422,02                | 800.443.136,60   | 96,46%            | 89,73%                            | 2,14%                            | 22,90% | 1,69%                            | 18,50% |
| 01-12-05 | 890.442.446,19                | 780.802.538,17   | 95,77%            | 87,69%                            | 2,17%                            | 23,11% | 2,28%                            | 24,16% |
| 01-01-06 | 888.831.210,78                | 766.417.710,00   | 95,08%            | 86,23%                            | 2,09%                            | 22,43% | 1,66%                            | 18,24% |
| 01-02-06 | 887.214.698,58                | 748.930.811,56   | 94,40%            | 84,41%                            | 2,10%                            | 22,44% | 2,10%                            | 22,52% |
| 01-03-06 | 885.592.892,31                | 732.611.319,81   | 93,72%            | 82,73%                            | 2,09%                            | 22,34% | 2,00%                            | 21,53% |
| 01-04-06 | 883.965.774,61                | 715.140.659,01   | 93,05%            | 80,90%                            | 2,10%                            | 22,46% | 2,21%                            | 23,48% |
| 01-05-06 | 882.333.328,11                | 702.340.622,52   | 92,38%            | 79,60%                            | 2,05%                            | 22,03% | 1,61%                            | 17,68% |
| 01-06-06 | 880.695.535,35                | 683.270.618,78   | 91,71%            | 77,58%                            | 2,09%                            | 22,42% | 2,53%                            | 26,51% |
| 01-07-06 | 879.053.328,73                | 665.733.712,32   | 91,06%            | 75,73%                            | 2,12%                            | 22,63% | 2,38%                            | 25,15% |
| 01-08-06 | 877.405.743,88                | 652.435.660,82   | 90,40%            | 74,36%                            | 2,09%                            | 22,43% | 1,81%                            | 19,72% |
| 01-09-06 | 875.752.763,19                | 644.032.394,94   | 89,75%            | 73,54%                            | 2,03%                            | 21,80% | 1,10%                            | 12,45% |
| 01-10-06 | 874.094.368,99                | 633.389.918,98   | 89,11%            | 72,46%                            | 1,99%                            | 21,46% | 1,47%                            | 16,24% |
| 01-11-06 | 872.430.543,55                | 622.756.261,81   | 88,47%            | 71,38%                            | 1,96%                            | 21,18% | 1,49%                            | 16,50% |
| 01-12-06 | 870.761.269,08                | 610.946.659,07   | 87,83%            | 70,16%                            | 1,95%                            | 21,04% | 1,71%                            | 18,68% |
| 01-01-07 | 869.086.527,74                | 600.539.188,15   | 87,20%            | 69,10%                            | 1,93%                            | 20,82% | 1,51%                            | 16,73% |
| 01-02-07 | 867.406.301,62                | 588.547.375,03   | 86,58%            | 67,85%                            | 1,92%                            | 20,76% | 1,81%                            | 19,65% |
| 01-03-07 | 865.720.572,76                | 580.095.763,80   | 85,95%            | 67,01%                            | 1,89%                            | 20,45% | 1,24%                            | 13,95% |
| 01-04-07 | 864.029.323,14                | 567.331.426,62   | 85,34%            | 65,66%                            | 1,89%                            | 20,50% | 2,01%                            | 21,61% |
| 01-05-07 | 862.332.534,67                | 557.167.045,84   | 84,72%            | 64,61%                            | 1,88%                            | 20,38% | 1,60%                            | 17,58% |
| 01-06-07 | 860.630.189,23                | 546.333.111,62   | 84,12%            | 63,48%                            | 1,88%                            | 20,33% | 1,75%                            | 19,10% |
| 01-07-07 | 858.922.773,27                | 536.864.985,43   | 83,51%            | 62,50%                            | 1,86%                            | 20,19% | 1,54%                            | 16,97% |
| 01-08-07 | 857.209.765,52                | 528.501.626,96   | 82,91%            | 61,65%                            | 1,84%                            | 20,01% | 1,36%                            | 15,16% |
| 01-09-07 | 855.491.147,67                | 521.886.614,41   | 82,32%            | 61,00%                            | 1,81%                            | 19,72% | 1,05%                            | 11,93% |
| 01-10-07 | 853.766.901,35                | 516.662.298,11   | 81,73%            | 60,52%                            | 1,78%                            | 19,37% | 0,80%                            | 9,20%  |
| 01-11-07 | 852.037.008,13                | 510.149.805,96   | 81,14%            | 59,87%                            | 1,75%                            | 19,12% | 1,06%                            | 12,00% |
| 01-12-07 | 850.301.449,50                | 502.998.030,23   | 80,56%            | 59,16%                            | 1,73%                            | 18,94% | 1,20%                            | 13,49% |
| 01-01-08 | 848.560.206,92                | 497.504.653,70   | 79,98%            | 58,63%                            | 1,71%                            | 18,67% | 0,89%                            | 10,16% |
| 01-02-08 | 846.813.261,76                | 490.912.230,27   | 79,40%            | 57,97%                            | 1,69%                            | 18,49% | 1,12%                            | 12,66% |
| 01-03-08 | 845.060.595,37                | 484.242.603,91   | 78,83%            | 57,30%                            | 1,67%                            | 18,33% | 1,15%                            | 13,00% |
| 01-04-08 | 843.302.188,99                | 478.044.211,52   | 78,27%            | 56,69%                            | 1,66%                            | 18,15% | 1,07%                            | 12,16% |
| 01-05-08 | 841.538.023,83                | 473.846.369,31   | 77,70%            | 56,31%                            | 1,63%                            | 17,87% | 0,67%                            | 7,75%  |

|          |                |                |        |        |       |        |        |        |
|----------|----------------|----------------|--------|--------|-------|--------|--------|--------|
| 01-06-08 | 839.768.081,03 | 469.562.236,81 | 77,15% | 55,92% | 1,60% | 17,62% | 0,70%  | 8,03%  |
| 01-07-08 | 837.992.341,66 | 465.651.578,90 | 76,59% | 55,57% | 1,58% | 17,35% | 0,62%  | 7,22%  |
| 01-08-08 | 836.210.786,75 | 462.193.589,20 | 76,04% | 55,27% | 1,55% | 17,07% | 0,53%  | 6,19%  |
| 01-09-08 | 834.423.397,25 | 457.699.224,53 | 75,50% | 54,85% | 1,53% | 16,87% | 0,76%  | 8,75%  |
| 01-10-08 | 832.630.154,05 | 453.378.221,46 | 74,95% | 54,45% | 1,51% | 16,67% | 0,73%  | 8,42%  |
| 01-11-08 | 830.831.037,97 | 450.213.991,37 | 74,42% | 54,19% | 1,48% | 16,42% | 0,48%  | 5,64%  |
| 01-12-08 | 829.026.029,80 | 448.819.444,57 | 73,88% | 54,14% | 1,45% | 16,08% | 0,09%  | 1,11%  |
| 01-01-09 | 827.216.517,07 | 446.923.168,73 | 73,35% | 54,03% | 1,42% | 15,79% | 0,20%  | 2,43%  |
| 01-02-09 | 825.401.078,18 | 444.555.988,38 | 72,82% | 53,86% | 1,40% | 15,53% | 0,31%  | 3,67%  |
| 01-03-09 | 823.579.693,74 | 442.146.115,24 | 72,30% | 53,69% | 1,37% | 15,28% | 0,32%  | 3,80%  |
| 01-04-09 | 821.752.344,26 | 438.713.142,06 | 71,78% | 53,39% | 1,36% | 15,10% | 0,56%  | 6,47%  |
| 01-05-09 | 819.919.010,21 | 434.939.492,06 | 71,27% | 53,05% | 1,34% | 14,94% | 0,64%  | 7,40%  |
| 01-06-09 | 818.079.671,99 | 432.253.929,96 | 70,75% | 52,84% | 1,32% | 14,74% | 0,39%  | 4,63%  |
| 01-07-09 | 816.236.838,22 | 428.612.444,35 | 70,25% | 52,51% | 1,31% | 14,59% | 0,62%  | 7,18%  |
| 01-08-09 | 814.387.969,17 | 425.464.329,77 | 69,74% | 52,24% | 1,29% | 14,43% | 0,51%  | 5,94%  |
| 01-09-09 | 812.533.045,07 | 422.749.203,24 | 69,24% | 52,03% | 1,27% | 14,25% | 0,41%  | 4,83%  |
| 01-10-09 | 810.672.046,10 | 420.081.553,57 | 68,74% | 51,82% | 1,26% | 14,08% | 0,40%  | 4,73%  |
| 01-11-09 | 808.804.952,35 | 415.995.137,78 | 68,25% | 51,43% | 1,25% | 13,98% | 0,74%  | 8,57%  |
| 01-12-09 | 806.931.743,87 | 413.076.769,02 | 67,76% | 51,19% | 1,23% | 13,83% | 0,47%  | 5,51%  |
| 01-01-10 | 805.054.414,17 | 410.772.614,91 | 67,27% | 51,02% | 1,22% | 13,65% | 0,33%  | 3,84%  |
| 01-02-10 | 803.170.936,21 | 408.262.064,12 | 66,79% | 50,83% | 1,20% | 13,50% | 0,38%  | 4,44%  |
| 01-03-10 | 801.281.289,87 | 406.425.253,97 | 66,31% | 50,72% | 1,18% | 13,32% | 0,22%  | 2,55%  |
| 01-04-10 | 799.385.454,93 | 404.231.139,63 | 65,83% | 50,57% | 1,17% | 13,16% | 0,30%  | 3,59%  |
| 01-05-10 | 797.483.411,13 | 400.994.622,38 | 65,36% | 50,28% | 1,16% | 13,05% | 0,56%  | 6,56%  |
| 01-06-10 | 795.575.138,14 | 398.334.972,04 | 64,89% | 50,07% | 1,15% | 12,92% | 0,42%  | 4,98%  |
| 01-07-10 | 793.661.819,21 | 394.358.952,15 | 64,43% | 49,69% | 1,14% | 12,85% | 0,76%  | 8,74%  |
| 01-08-10 | 791.742.234,17 | 390.698.493,21 | 63,96% | 49,35% | 1,13% | 12,78% | 0,69%  | 7,95%  |
| 01-09-10 | 789.816.362,48 | 388.203.648,97 | 63,50% | 49,15% | 1,12% | 12,65% | 0,40%  | 4,65%  |
| 01-10-10 | 787.884.183,57 | 386.880.993,17 | 63,05% | 49,10% | 1,11% | 12,48% | 0,10%  | 1,15%  |
| 01-11-10 | 785.945.676,77 | 385.034.637,31 | 62,60% | 48,99% | 1,09% | 12,34% | 0,23%  | 2,75%  |
| 01-12-10 | 784.000.821,36 | 380.486.480,83 | 62,15% | 48,53% | 1,09% | 12,32% | 0,94%  | 10,67% |
| 01-01-11 | 782.053.911,56 | 377.880.118,35 | 61,70% | 48,32% | 1,08% | 12,21% | 0,44%  | 5,13%  |
| 01-02-11 | 780.100.625,64 | 376.513.421,11 | 61,26% | 48,26% | 1,07% | 12,06% | 0,11%  | 1,34%  |
| 01-03-11 | 778.140.942,70 | 373.504.344,27 | 60,82% | 48,00% | 1,06% | 11,98% | 0,55%  | 6,40%  |
| 01-04-11 | 776.174.841,80 | 371.856.632,62 | 60,38% | 47,91% | 1,05% | 11,85% | 0,19%  | 2,24%  |
| 01-05-11 | 774.202.301,92 | 370.848.716,84 | 59,95% | 47,90% | 1,03% | 11,70% | 0,02%  | 0,20%  |
| 01-06-11 | 772.223.301,97 | 368.174.693,44 | 59,52% | 47,68% | 1,02% | 11,61% | 0,47%  | 5,46%  |
| 01-07-11 | 770.241.975,35 | 366.303.866,58 | 59,09% | 47,56% | 1,01% | 11,50% | 0,25%  | 2,98%  |
| 01-08-11 | 768.254.159,88 | 366.470.234,97 | 58,66% | 47,70% | 1,00% | 11,31% | -0,30% | -3,71% |
| 01-09-11 | 766.259.834,31 | 363.149.058,21 | 58,24% | 47,39% | 0,99% | 11,26% | 0,65%  | 7,51%  |
| 01-10-11 | 764.258.977,32 | 362.076.703,25 | 57,82% | 47,38% | 0,98% | 11,13% | 0,03%  | 0,41%  |
| 01-11-11 | 762.251.567,53 | 360.089.858,32 | 57,41% | 47,24% | 0,97% | 11,03% | 0,29%  | 3,39%  |
| 01-12-11 | 760.237.583,48 | 358.200.157,06 | 57,00% | 47,12% | 0,96% | 10,93% | 0,26%  | 3,09%  |
| 01-01-12 | 758.226.394,26 | 356.670.279,41 | 56,59% | 47,04% | 0,95% | 10,82% | 0,16%  | 1,94%  |
| 01-02-12 | 756.208.618,39 | 355.475.304,40 | 56,18% | 47,01% | 0,94% | 10,71% | 0,07%  | 0,83%  |
| 01-03-12 | 754.184.234,31 | 353.366.817,10 | 55,78% | 46,85% | 0,93% | 10,62% | 0,33%  | 3,85%  |
| 01-04-12 | 752.153.220,37 | 352.843.094,46 | 55,38% | 46,91% | 0,92% | 10,49% | -0,12% | -1,47% |
| 01-05-12 | 750.115.554,86 | 350.960.157,35 | 54,98% | 46,79% | 0,91% | 10,40% | 0,26%  | 3,12%  |
| 01-06-12 | 748.071.215,99 | 349.309.051,11 | 54,58% | 46,69% | 0,90% | 10,31% | 0,20%  | 2,36%  |

|          |                |                |        |        |       |        |        |        |
|----------|----------------|----------------|--------|--------|-------|--------|--------|--------|
| 01-07-12 | 746.028.531,07 | 348.487.505,91 | 54,19% | 46,71% | 0,89% | 10,19% | -0,04% | -0,46% |
| 01-08-12 | 743.979.156,35 | 346.553.096,70 | 53,80% | 46,58% | 0,88% | 10,11% | 0,28%  | 3,32%  |
| 01-09-12 | 741.923.069,93 | 345.608.681,25 | 53,42% | 46,58% | 0,87% | 10,00% | 0,00%  | -0,05% |
| 01-10-12 | 739.860.249,83 | 344.452.156,05 | 53,03% | 46,56% | 0,86% | 9,90%  | 0,06%  | 0,68%  |
| 01-11-12 | 737.790.673,99 | 342.846.050,04 | 52,65% | 46,47% | 0,86% | 9,82%  | 0,19%  | 2,22%  |
| 01-12-12 | 735.714.320,29 | 341.651.841,92 | 52,27% | 46,44% | 0,85% | 9,72%  | 0,07%  | 0,80%  |
| 01-01-13 | 733.639.620,24 | 339.808.674,30 | 51,90% | 46,32% | 0,84% | 9,65%  | 0,26%  | 3,05%  |
| 01-02-13 | 731.558.125,54 | 338.685.022,02 | 51,53% | 46,30% | 0,83% | 9,56%  | 0,05%  | 0,56%  |
| 01-03-13 | 729.469.813,95 | 337.592.709,88 | 51,16% | 46,28% | 0,83% | 9,46%  | 0,04%  | 0,45%  |
| 01-04-13 | 727.374.663,14 | 336.661.580,32 | 50,79% | 46,28% | 0,82% | 9,37%  | -0,01% | -0,14% |
| 01-05-13 | 725.272.650,71 | 334.732.793,17 | 50,42% | 46,15% | 0,81% | 9,31%  | 0,28%  | 3,36%  |
| 01-06-13 | 723.163.754,19 | 333.439.234,72 | 50,06% | 46,11% | 0,80% | 9,22%  | 0,10%  | 1,15%  |
| 01-07-13 | 721.052.834,40 | 332.097.459,56 | 49,70% | 46,06% | 0,80% | 9,15%  | 0,11%  | 1,32%  |
| 01-08-13 | 718.935.001,34 | 330.388.322,56 | 49,35% | 45,96% | 0,79% | 9,08%  | 0,22%  | 2,63%  |
| 01-09-13 | 716.810.232,38 | 329.343.544,45 | 48,99% | 45,95% | 0,78% | 9,00%  | 0,02%  | 0,25%  |
| 01-10-13 | 714.678.504,80 | 328.221.731,31 | 48,64% | 45,93% | 0,78% | 8,92%  | 0,04%  | 0,52%  |
| 01-11-13 | 712.539.795,82 | 326.574.366,10 | 48,29% | 45,83% | 0,77% | 8,85%  | 0,20%  | 2,41%  |
| 01-12-13 | 710.394.082,56 | 324.772.662,75 | 47,94% | 45,72% | 0,76% | 8,80%  | 0,25%  | 2,97%  |
| 01-01-14 | 708.248.288,98 | 323.075.181,05 | 47,60% | 45,62% | 0,76% | 8,74%  | 0,22%  | 2,62%  |
| 01-02-14 | 706.095.467,93 | 321.726.709,52 | 47,26% | 45,56% | 0,75% | 8,67%  | 0,11%  | 1,36%  |
| 01-03-14 | 703.935.596,38 | 320.000.368,88 | 46,92% | 45,46% | 0,75% | 8,62%  | 0,23%  | 2,74%  |
| 01-04-14 | 701.768.651,26 | 318.111.923,24 | 46,58% | 45,33% | 0,74% | 8,57%  | 0,28%  | 3,35%  |
| 01-05-14 | 699.594.609,40 | 316.632.236,49 | 46,25% | 45,26% | 0,74% | 8,51%  | 0,16%  | 1,85%  |
| 01-06-14 | 697.413.447,54 | 315.007.844,30 | 45,91% | 45,17% | 0,73% | 8,45%  | 0,20%  | 2,40%  |
| 01-07-14 | 695.238.923,74 | 313.592.274,11 | 45,58% | 45,11% | 0,73% | 8,39%  | 0,14%  | 1,64%  |
| 01-08-14 | 693.057.278,37 | 311.744.642,03 | 45,26% | 44,98% | 0,72% | 8,35%  | 0,28%  | 3,27%  |
| 01-09-14 | 690.868.488,11 | 310.421.098,90 | 44,93% | 44,93% | 0,72% | 8,29%  | 0,11%  | 1,30%  |

| Fecha    |   | Principal disponible<br>antes prepago    | Principal<br>Disponible | Amortización de<br>principal | Serie A     | Serie B   | Serie C    | Amortización Serie<br>A | Vida Media Serie A   | Amortización<br>Serie B | Vida Media Serie B   | Amortización<br>Serie C | Vida Media Serie C   |
|----------|---|------------------------------------------|-------------------------|------------------------------|-------------|-----------|------------|-------------------------|----------------------|-------------------------|----------------------|-------------------------|----------------------|
|          |   |                                          |                         |                              |             |           |            |                         | 4,91                 |                         | 9,00                 |                         | 9,00                 |
| Date     |   | Principal Available<br>before prepayment | Principal Available     | Principal<br>Redemption      | Class A     | Class B   | Class C    | Redemption Class<br>A   | Average Life Class A | Redemption<br>Class B   | Average Life Class B | Redemption<br>Class C   | Average Life Class C |
|          |   | 900.000.000,00                           |                         |                              |             |           |            |                         |                      |                         |                      |                         |                      |
| 03-06-05 |   | 900.000.000,00                           |                         |                              | 867.200.000 | 9.000.000 | 23.800.000 |                         |                      |                         |                      |                         |                      |
| 08-07-05 | 0 | 891.968.091,79                           | 0,00                    | 0,00                         | 867.200.000 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-08-05 | 0 | 884.000.022,53                           | 0,00                    | 0,00                         | 867.200.000 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-09-05 | 0 | 876.095.316,07                           | 876.095.309,50          | 23.904.690,50                | 867.200.000 | 9.000.000 | 23.800.000 | 23.904.690,50           | -7857471766595,00%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-10-05 | 1 | 868.253.493,24                           | 0,00                    | 0,00                         | 843.295.310 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-11-05 | 0 | 860.474.078,40                           | 0,00                    | 0,00                         | 843.295.310 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-12-05 | 1 | 852.756.599,43                           | 852.756.592,86          | 23.338.716,64                | 843.295.310 | 9.000.000 | 23.800.000 | 23.338.716,64           | -7459053838199,39%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-01-06 | 0 | 845.100.587,69                           | 0,00                    | 0,00                         | 819.956.593 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-02-06 | 0 | 837.505.578,01                           | 0,00                    | 0,00                         | 819.956.593 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-03-06 | 1 | 829.971.108,62                           | 829.971.102,05          | 22.785.490,81                | 819.956.593 | 9.000.000 | 23.800.000 | 22.785.490,81           | -7077173444693,05%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-04-06 | 0 | 822.496.721,21                           | 0,00                    | 0,00                         | 797.171.102 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-05-06 | 0 | 815.081.960,82                           | 0,00                    | 0,00                         | 797.171.102 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-06-06 | 1 | 807.726.375,84                           | 807.726.369,27          | 22.244.732,78                | 797.171.102 | 9.000.000 | 23.800.000 | 22.244.732,78           | -6704562459968,92%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-07-06 | 0 | 800.430.382,99                           | 0,00                    | 0,00                         | 774.926.369 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-08-06 | 0 | 793.192.662,75                           | 0,00                    | 0,00                         | 774.926.369 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-09-06 | 1 | 786.012.773,54                           | 786.012.766,97          | 21.713.602,31                | 774.926.369 | 9.000.000 | 23.800.000 | 21.713.602,31           | -6344714594611,57%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-10-06 | 0 | 778.890.277,03                           | 0,00                    | 0,00                         | 753.212.767 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-11-06 | 0 | 771.824.738,17                           | 0,00                    | 0,00                         | 753.212.767 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-12-06 | 1 | 764.815.725,07                           | 764.815.718,50          | 21.197.048,46                | 753.212.767 | 9.000.000 | 23.800.000 | 21.197.048,46           | -6000884419835,53%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-01-07 | 0 | 757.862.809,08                           | 0,00                    | 0,00                         | 732.015.719 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-02-07 | 0 | 750.965.564,67                           | 0,00                    | 0,00                         | 732.015.719 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-03-07 | 1 | 744.123.569,50                           | 744.123.562,93          | 20.692.155,57                | 732.015.719 | 9.000.000 | 23.800.000 | 20.692.155,57           | -5671719841277,21%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-04-07 | 0 | 737.336.404,33                           | 0,00                    | 0,00                         | 711.323.563 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-05-07 | 0 | 730.603.653,02                           | 0,00                    | 0,00                         | 711.323.563 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-06-07 | 1 | 723.924.902,49                           | 723.924.895,92          | 20.198.667,01                | 711.323.563 | 9.000.000 | 23.800.000 | 20.198.667,01           | -5350626891323,90%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-07-07 | 0 | 717.300.164,21                           | 0,00                    | 0,00                         | 691.124.896 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-08-07 | 0 | 710.728.605,06                           | 0,00                    | 0,00                         | 691.124.896 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-09-07 | 1 | 704.209.821,11                           | 704.209.814,54          | 19.715.081,39                | 691.124.896 | 9.000.000 | 23.800.000 | 19.715.081,39           | -5041146310849,18%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-10-07 | 0 | 697.743.411,41                           | 0,00                    | 0,00                         | 671.409.815 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-11-07 | 0 | 691.328.978,00                           | 0,00                    | 0,00                         | 671.409.815 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-12-07 | 1 | 684.966.125,84                           | 684.966.119,27          | 19.243.695,27                | 671.409.815 | 9.000.000 | 23.800.000 | 19.243.695,27           | -4745495252971,15%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-01-08 | 0 | 678.654.462,83                           | 0,00                    | 0,00                         | 652.166.119 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-02-08 | 0 | 672.393.599,75                           | 0,00                    | 0,00                         | 652.166.119 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-03-08 | 1 | 666.183.150,29                           | 666.183.143,72          | 18.782.975,55                | 652.166.119 | 9.000.000 | 23.800.000 | 18.782.975,55           | -4460956692443,54%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-04-08 | 0 | 660.022.730,97                           | 0,00                    | 0,00                         | 633.383.144 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-05-08 | 0 | 653.911.961,17                           | 0,00                    | 0,00                         | 633.383.144 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-06-08 | 1 | 647.850.463,07                           | 647.850.456,50          | 18.332.687,22                | 633.383.144 | 9.000.000 | 23.800.000 | 18.332.687,22           | -4185352492336,02%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-07-08 | 0 | 641.837.861,66                           | 0,00                    | 0,00                         | 615.050.457 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-08-08 | 0 | 635.873.784,69                           | 0,00                    | 0,00                         | 615.050.457 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-09-08 | 1 | 629.957.862,68                           | 629.957.856,11          | 17.892.600,39                | 615.050.457 | 9.000.000 | 23.800.000 | 17.892.600,39           | -3920268744791,27%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-10-08 | 0 | 624.089.728,90                           | 0,00                    | 0,00                         | 597.157.856 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-11-08 | 0 | 618.269.019,29                           | 0,00                    | 0,00                         | 597.157.856 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-12-08 | 1 | 612.495.372,54                           | 612.495.365,97          | 17.462.490,15                | 597.157.856 | 9.000.000 | 23.800.000 | 17.462.490,15           | -3667122930618,98%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-01-09 | 0 | 606.769.461,91                           | 0,00                    | 0,00                         | 579.695.366 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-02-09 | 0 | 601.089.888,01                           | 0,00                    | 0,00                         | 579.695.366 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-03-09 | 1 | 595.456.297,57                           | 595.456.291,00          | 17.039.074,97                | 579.695.366 | 9.000.000 | 23.800.000 | 17.039.074,97           | -3424854069563,21%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-04-09 | 0 | 589.868.339,93                           | 0,00                    | 0,00                         | 562.656.291 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-05-09 | 0 | 584.325.667,05                           | 0,00                    | 0,00                         | 562.656.291 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-06-09 | 1 | 578.827.933,47                           | 578.827.926,90          | 16.628.364,10                | 562.656.291 | 9.000.000 | 23.800.000 | 16.628.364,10           | -3189320234348,73%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-07-09 | 0 | 573.376.572,28                           | 0,00                    | 0,00                         | 546.027.927 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-08-09 | 0 | 567.969.447,37                           | 0,00                    | 0,00                         | 546.027.927 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-09-09 | 1 | 562.606.221,07                           | 562.606.214,50          | 16.221.712,40                | 546.027.927 | 9.000.000 | 23.800.000 | 16.221.712,40           | -2962084684100,16%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-10-09 | 0 | 557.286.558,19                           | 0,00                    | 0,00                         | 529.806.214 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-11-09 | 0 | 552.010.126,06                           | 0,00                    | 0,00                         | 529.806.214 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-12-09 | 1 | 546.776.594,45                           | 546.776.587,88          | 15.829.626,62                | 529.806.214 | 9.000.000 | 23.800.000 | 15.829.626,62           | -2746440218320,46%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-01-10 | 0 | 541.586.990,16                           | 0,00                    | 0,00                         | 513.976.588 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-02-10 | 0 | 536.439.618,24                           | 0,00                    | 0,00                         | 513.976.588 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-03-10 | 1 | 531.334.155,89                           | 531.334.149,32          | 15.442.438,56                | 513.976.588 | 9.000.000 | 23.800.000 | 15.442.438,56           | -2540281142811,14%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-04-10 | 0 | 526.270.282,70                           | 0,00                    | 0,00                         | 498.534.149 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-05-10 | 0 | 521.247.680,65                           | 0,00                    | 0,00                         | 498.534.149 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-06-10 | 1 | 516.266.034,08                           | 516.266.027,51          | 15.068.121,81                | 498.534.149 | 9.000.000 | 23.800.000 | 15.068.121,81           | -2340079316867,44%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-07-10 | 0 | 511.325.805,14                           | 0,00                    | 0,00                         | 483.466.028 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-08-10 | 0 | 506.425.898,73                           | 0,00                    | 0,00                         | 483.466.028 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-09-10 | 1 | 501.566.006,26                           | 501.565.999,69          | 14.700.027,82                | 483.466.028 | 9.000.000 | 23.800.000 | 14.700.027,82           | -2147674064733,52%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-10-10 | 0 | 496.745.821,39                           | 0,00                    | 0,00                         | 468.766.000 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-11-10 | 0 | 491.965.040,08                           | 0,00                    | 0,00                         | 468.766.000 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-12-10 | 1 | 487.223.360,53                           | 487.223.353,96          | 14.342.645,73                | 468.766.000 | 9.000.000 | 23.800.000 | 14.342.645,73           | -1964942465120,90%   | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-01-11 | 0 | 482.523.145,54                           | 0,00                    | 0,00                         | 454.423.354 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                |
| 08-02-11 | 0 | 477.861.405,86                           | 0,00                    | 0,00                         | 454.423.354 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%                | 0,00                    | 0,00%</              |

|          |   |                                       |                     |                      |             |           |              |                    | 4,91                 |                    |                      | 9,00               |                      |  | 9,00 |
|----------|---|---------------------------------------|---------------------|----------------------|-------------|-----------|--------------|--------------------|----------------------|--------------------|----------------------|--------------------|----------------------|--|------|
| 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 |  |      |
| 08-09-11 | 1 | 446.289.325,27                        | 446.289.318,70      | 13.304.010,48        | 426.793.329 | 9.000.000 | 23.800.000   | 13.304.010,48      | -1458119548764,56%   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-10-11 | 0 | 441.927.328,74                        | 0,00                | 0,00                 | 413.489.319 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-11-11 | 0 | 437.601.204,70                        | 0,00                | 0,00                 | 413.489.319 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-12-11 | 1 | 433.310.677,66                        | 433.310.671,09      | 12.978.647,61        | 413.489.319 | 9.000.000 | 23.800.000   | 12.978.647,61      | -1304354084801,96%   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-01-12 | 0 | 429.060.788,12                        | 0,00                | 0,00                 | 400.510.671 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-02-12 | 0 | 424.845.891,69                        | 0,00                | 0,00                 | 400.510.671 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-03-12 | 1 | 420.665.719,50                        | 420.665.712,93      | 12.644.958,16        | 400.510.671 | 9.000.000 | 23.800.000   | 12.644.958,16      | -1155749176236,74%   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-04-12 | 0 | 416.520.004,67                        | 0,00                | 0,00                 | 387.865.713 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-05-12 | 0 | 412.408.482,30                        | 0,00                | 0,00                 | 387.865.713 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-06-12 | 1 | 408.330.889,48                        | 408.330.882,91      | 12.334.830,02        | 387.865.713 | 9.000.000 | 23.800.000   | 12.334.830,02      | -1013923027325,50%   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-07-12 | 0 | 404.291.489,85                        | 0,00                | 0,00                 | 375.530.883 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-08-12 | 0 | 400.285.449,49                        | 0,00                | 0,00                 | 375.530.883 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-09-12 | 1 | 396.312.511,74                        | 396.312.505,17      | 12.018.377,74        | 375.530.883 | 9.000.000 | 23.800.000   | 12.018.377,74      | -877341575313,80%    | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-10-12 | 0 | 392.372.421,84                        | 0,00                | 0,00                 | 363.512.505 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-11-12 | 0 | 388.464.926,94                        | 0,00                | 0,00                 | 363.512.505 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-12-12 | 1 | 384.589.776,06                        | 384.589.769,49      | 11.722.735,68        | 363.512.505 | 9.000.000 | 23.800.000   | 11.722.735,68      | -749082810038,30%    | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-01-13 | 0 | 380.751.107,47                        | 0,00                | 0,00                 | 351.789.769 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-02-13 | 0 | 376.944.237,78                        | 0,00                | 0,00                 | 351.789.769 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-03-13 | 1 | 373.168.922,01                        | 373.168.915,44      | 11.420.854,04        | 351.789.769 | 9.000.000 | 23.800.000   | 11.420.854,04      | -627004886869,56%    | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-04-13 | 0 | 369.424.916,99                        | 0,00                | 0,00                 | 340.368.915 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-05-13 | 0 | 365.711.981,36                        | 0,00                | 0,00                 | 340.368.915 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-06-13 | 1 | 362.029.875,56                        | 362.029.868,99      | 11.139.046,46        | 340.368.915 | 9.000.000 | 23.800.000   | 11.139.046,46      | -509054423178,96%    | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-07-13 | 0 | 358.380.788,96                        | 0,00                | 0,00                 | 329.229.869 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-08-13 | 0 | 354.762.031,45                        | 0,00                | 0,00                 | 329.229.869 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-09-13 | 1 | 351.173.369,01                        | 351.173.362,44      | 10.856.506,55        | 329.229.869 | 9.000.000 | 23.800.000   | 10.856.506,55      | -396262489077,39%    | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-10-13 | 0 | 347.614.569,37                        | 0,00                | 0,00                 | 318.373.362 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-11-13 | 0 | 344.085.402,01                        | 0,00                | 0,00                 | 318.373.362 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-12-13 | 1 | 340.585.638,09                        | 340.585.631,52      | 10.587.730,91        | 318.373.362 | 9.000.000 | 23.800.000   | 10.587.730,91      | -290103827047,12%    | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-01-14 | 0 | 337.118.357,16                        | 0,00                | 0,00                 | 307.785.632 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-02-14 | 0 | 333.679.990,41                        | 0,00                | 0,00                 | 307.785.632 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-03-14 | 1 | 330.270.314,42                        | 330.270.307,85      | 10.315.323,67        | 307.785.632 | 9.000.000 | 23.800.000   | 10.315.323,67      | -189801955545,71%    | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-04-14 | 0 | 326.889.107,43                        | 0,00                | 0,00                 | 297.470.308 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-05-14 | 0 | 323.536.149,35                        | 0,00                | 0,00                 | 297.470.308 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-06-14 | 1 | 320.211.221,72                        | 320.211.215,15      | 10.059.092,70        | 297.470.308 | 9.000.000 | 23.800.000   | 10.059.092,70      | -92543652871,09%     | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-07-14 | 0 | 316.920.389,84                        | 0,00                | 0,00                 | 287.411.215 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-08-14 | 0 | 313.657.086,57                        | 0,00                | 0,00                 | 287.411.215 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-09-14 | 1 | 310.421.098,90                        | 310.421.092,33      | 9.790.122,82         | 287.411.215 | 9.000.000 | 23.800.000   | 9.790.122,82       | 0,00                 | 0,00%              | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-10-14 | 0 | 307.212.215,41                        | 0,00                | 0,00                 | 277.621.092 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-11-14 | 0 | 304.030.226,26                        | 0,00                | 0,00                 | 277.621.092 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-12-14 | 1 | 300.874.923,19                        | 300.874.916,62      | 9.546.175,71         | 277.621.092 | 9.000.000 | 23.800.000   | 9.546.175,71       | 86870198968,12%      | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-01-15 | 0 | 297.763.019,46                        | 0,00                | 0,00                 | 268.074.917 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-02-15 | 0 | 294.677.201,90                        | 0,00                | 0,00                 | 268.074.917 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-03-15 | 1 | 291.617.268,50                        | 291.617.261,93      | 9.257.654,69         | 268.074.917 | 9.000.000 | 23.800.000   | 9.257.654,69       | 167563549867,42%     | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-04-15 | 0 | 288.583.018,73                        | 0,00                | 0,00                 | 258.817.262 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-05-15 | 0 | 285.574.253,57                        | 0,00                | 0,00                 | 258.817.262 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-06-15 | 1 | 282.590.775,49                        | 282.590.768,92      | 9.026.493,01         | 258.817.262 | 9.000.000 | 23.800.000   | 9.026.493,01       | 246423259164,31%     | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-07-15 | 0 | 279.633.611,40                        | 0,00                | 0,00                 | 249.790.769 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-08-15 | 0 | 276.701.330,15                        | 0,00                | 0,00                 | 249.790.769 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-09-15 | 1 | 273.793.738,70                        | 273.793.732,13      | 8.797.036,79         | 249.790.769 | 9.000.000 | 23.800.000   | 8.797.036,79       | 321091842936,05%     | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-10-15 | 0 | 270.910.645,47                        | 0,00                | 0,00                 | 240.993.732 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-11-15 | 0 | 268.051.860,33                        | 0,00                | 0,00                 | 240.993.732 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-12-15 | 1 | 265.217.194,53                        | 265.217.187,96      | 8.576.544,17         | 240.993.732 | 9.000.000 | 23.800.000   | 8.576.544,17       | 391090414162,98%     | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-01-16 | 0 | 262.408.189,86                        | 0,00                | 0,00                 | 232.417.188 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-02-16 | 0 | 259.622.912,08                        | 0,00                | 0,00                 | 232.417.188 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-03-16 | 1 | 256.861.176,85                        | 256.861.170,28      | 8.356.017,68         | 232.417.188 | 9.000.000 | 23.800.000   | 8.356.017,68       | 457074166916,75%     | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-04-16 | 0 | 254.122.801,17                        | 0,00                | 0,00                 | 224.061.170 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-05-16 | 0 | 251.407.603,44                        | 0,00                | 0,00                 | 224.061.170 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-06-16 | 1 | 248.715.403,39                        | 248.715.396,82      | 8.145.773,46         | 224.061.170 | 9.000.000 | 23.800.000   | 8.145.773,46       | 520514924245,19%     | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-07-16 | 0 | 246.050.709,54                        | 0,00                | 0,00                 | 215.915.397 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-08-16 | 0 | 243.408.604,81                        | 0,00                | 0,00                 | 215.915.397 | 9.000.000 | 23.800.000   | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-09-16 | 1 | 240.788.913,42                        | 240.788.906,85      | 7.926.489,96         | 215.915.397 | 9.000.000 | 23.800.000   | 7.926.489,96       | 579426416431,39%     | 0,00               | 0,00%                | 0,00               | 0,00%                |  |      |
| 08-10-16 | 0 | 238.191.460,89                        | 0,00                | 0,00                 | 207.988.907 | 9.000.000 | 23.800.000</ |                    |                      |                    |                      |                    |                      |  |      |

| Date     |   | Principal Available<br>before prepayment | Principal Available | Principal<br>Redemption | Class A     | Class B   | Class C    | Redemption Class<br>A | 4.91                 | Redemption<br>Class B | 9.00                 | Redemption<br>Class C | 9.00                 |
|----------|---|------------------------------------------|---------------------|-------------------------|-------------|-----------|------------|-----------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|
|          |   |                                          |                     |                         |             |           |            |                       | Average Life Class A |                       | Average Life Class B |                       | Average Life Class C |
| 08-04-17 | 0 | 223.081.349,93                           | 0,00                | 0,00                    | 192.744.727 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 08-05-17 | 0 | 220.638.972,10                           | 0,00                | 0,00                    | 192.744.727 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 08-06-17 | 1 | 218.217.436,61                           | 218.217.430,04      | 7.327.297,38            | 192.744.727 | 9.000.000 | 23.800.000 | 7.327.297,38          | 735660657121,96%     | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 08-07-17 | 0 | 215.819.704,43                           | 0,00                | 0,00                    | 185.417.430 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 08-08-17 | 0 | 213.442.455,79                           | 0,00                | 0,00                    | 185.417.430 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 08-09-17 | 1 | 211.085.530,76                           | 211.085.524,19      | 7.131.905,85            | 185.417.430 | 9.000.000 | 23.800.000 | 7.131.905,85          | 781656880837,72%     | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 08-10-17 | 0 | 208.748.770,61                           | 0,00                | 0,00                    | 178.285.524 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 08-11-17 | 0 | 206.432.017,80                           | 0,00                | 0,00                    | 178.285.524 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 08-12-17 | 1 | 204.135.115,96                           | 204.135.109,39      | 6.950.414,80            | 178.285.524 | 9.000.000 | 23.800.000 | 6.950.414,80          | 825014237144,69%     | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 07-01-18 | 1 | 201.860.917,80                           | 0,00                | 0,00                    | 171.335.109 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-02-18 | 1 | 199.606.227,98                           | 0,00                | 0,00                    | 171.335.109 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 08-03-18 | 1 | 197.370.893,93                           | 197.370.887,36      | 6.764.222,04            | 171.335.109 | 9.000.000 | 23.800.000 | 6.764.222,04          | 863791153887,92%     | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 07-04-18 | 1 | 195.154.764,20                           | 0,00                | 0,00                    | 164.570.887 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 07-05-18 | 1 | 192.957.688,49                           | 0,00                | 0,00                    | 164.570.887 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-06-18 | 1 | 190.779.517,64                           | 190.779.511,07      | 6.591.376,28            | 164.570.887 | 9.000.000 | 23.800.000 | 6.591.376,28          | 901041138048,56%     | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-07-18 | 0 | 188.624.019,04                           | 0,00                | 0,00                    | 157.979.511 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-08-18 | 0 | 186.487.086,78                           | 0,00                | 0,00                    | 157.979.511 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-09-18 | 1 | 184.368.575,42                           | 184.368.568,85      | 6.410.942,22            | 157.979.511 | 9.000.000 | 23.800.000 | 6.410.942,22          | 935356469477,43%     | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-10-18 | 0 | 182.268.340,58                           | 0,00                | 0,00                    | 151.568.569 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-11-18 | 0 | 180.186.238,97                           | 0,00                | 0,00                    | 151.568.569 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-12-18 | 1 | 178.122.128,37                           | 178.122.121,80      | 6.246.447,05            | 151.568.569 | 9.000.000 | 23.800.000 | 6.246.447,05          | 968199239061,21%     | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-01-19 | 0 | 176.080.596,79                           | 0,00                | 0,00                    | 145.322.122 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-02-19 | 0 | 174.056.722,46                           | 0,00                | 0,00                    | 145.322.122 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-03-19 | 1 | 172.050.366,79                           | 172.050.360,22      | 6.071.761,58            | 145.322.122 | 9.000.000 | 23.800.000 | 6.071.761,58          | 995768899755,00%     | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-04-19 | 0 | 170.061.392,25                           | 0,00                | 0,00                    | 139.250.360 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-05-19 | 0 | 168.089.662,33                           | 0,00                | 0,00                    | 139.250.360 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-06-19 | 1 | 166.135.041,55                           | 166.135.034,98      | 5.915.325,23            | 139.250.360 | 9.000.000 | 23.800.000 | 5.915.325,23          | 1024534330627,46%    | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-07-19 | 0 | 164.210.032,94                           | 0,00                | 0,00                    | 133.335.035 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-08-19 | 0 | 162.301.725,13                           | 0,00                | 0,00                    | 133.335.035 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-09-19 | 1 | 160.409.986,91                           | 160.409.980,34      | 5.725.054,64            | 133.335.035 | 9.000.000 | 23.800.000 | 5.725.054,64          | 1044249966893,07%    | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-10-19 | 0 | 158.534.688,01                           | 0,00                | 0,00                    | 127.609.980 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-11-19 | 0 | 156.675.699,15                           | 0,00                | 0,00                    | 127.609.980 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-12-19 | 1 | 154.832.892,05                           | 154.832.885,48      | 5.577.094,86            | 127.609.980 | 9.000.000 | 23.800.000 | 5.577.094,86          | 1068013666394,13%    | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-01-20 | 0 | 153.029.530,00                           | 0,00                | 0,00                    | 122.032.885 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-02-20 | 0 | 151.241.836,08                           | 0,00                | 0,00                    | 122.032.885 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-03-20 | 1 | 149.469.687,09                           | 149.469.680,52      | 5.363.204,96            | 122.032.885 | 9.000.000 | 23.800.000 | 5.363.204,96          | 1075858913993,72%    | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-04-20 | 0 | 147.712.960,76                           | 0,00                | 0,00                    | 116.669.681 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-05-20 | 0 | 145.971.535,72                           | 0,00                | 0,00                    | 116.669.681 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-06-20 | 1 | 144.245.291,55                           | 144.245.284,98      | 5.224.395,54            | 116.669.681 | 9.000.000 | 23.800.000 | 5.224.395,54          | 1096078183755,62%    | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-07-20 | 0 | 142.535.696,83                           | 0,00                | 0,00                    | 111.445.285 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-08-20 | 0 | 140.841.027,16                           | 0,00                | 0,00                    | 111.445.285 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-09-20 | 1 | 139.161.164,95                           | 139.161.158,38      | 5.084.126,60            | 111.445.285 | 9.000.000 | 23.800.000 | 5.084.126,60          | 1113423725825,35%    | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-10-20 | 0 | 137.495.993,50                           | 0,00                | 0,00                    | 106.361.158 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-11-20 | 0 | 135.845.396,98                           | 0,00                | 0,00                    | 106.361.158 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-12-20 | 1 | 134.209.260,44                           | 134.209.253,87      | 4.951.904,51            | 106.361.158 | 9.000.000 | 23.800.000 | 4.951.904,51          | 1129529419364,77%    | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-01-21 | 0 | 132.589.008,71                           | 0,00                | 0,00                    | 101.409.254 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-02-21 | 0 | 130.982.972,54                           | 0,00                | 0,00                    | 101.409.254 | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-03-21 | 1 | 129.391.039,72                           | 129.391.033,15      | 4.818.220,72            | 101.409.254 | 9.000.000 | 23.800.000 | 4.818.220,72          | 1142400133718,28%    | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-04-21 | 0 | 127.813.098,85                           | 0,00                | 0,00                    | 96.591.033  | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-05-21 | 0 | 126.249.039,40                           | 0,00                | 0,00                    | 96.591.033  | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-06-21 | 1 | 124.698.751,65                           | 124.698.745,08      | 4.692.288,06            | 96.591.033  | 9.000.000 | 23.800.000 | 4.692.288,06          | 1155710549971,28%    | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-07-21 | 0 | 124.698.751,65                           | 0,00                | 0,00                    | 91.898.745  | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-08-21 | 0 | 124.698.751,65                           | 0,00                | 0,00                    | 91.898.745  | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-09-21 | 1 | 124.698.751,65                           | 120.132.182,79      | 4.566.562,30            | 91.898.745  | 9.000.000 | 23.800.000 | 4.566.562,30          | 1166756666375,04%    | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-10-21 | 0 | 124.698.751,65                           | 0,00                | 0,00                    | 87.332.183  | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-11-21 | 0 | 124.698.751,65                           | 0,00                | 0,00                    | 87.332.183  | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-12-21 | 1 | 124.698.751,65                           | 115.685.603,79      | 4.446.579,00            | 87.332.183  | 9.000.000 | 23.800.000 | 4.446.579,00          | 1176564803629,96%    | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-01-22 | 0 | 114.232.436,64                           | 0,00                | 0,00                    | 82.885.604  | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-02-22 | 0 | 112.792.144,81                           | 0,00                | 0,00                    | 82.885.604  | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-03-22 | 1 | 111.364.632,74                           | 111.364.626,17      | 4.320.977,62            | 82.885.604  | 9.000.000 | 23.800.000 | 4.320.977,62          | 1182219475675,79%    | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-04-22 | 0 | 109.949.799,07                           | 0,00                | 0,00                    | 78.564.626  | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-05-22 | 0 | 108.547.543,22                           | 0,00                | 0,00                    | 78.564.626  | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-06-22 | 1 | 107.157.765,36                           | 107.157.758,79      | 4.206.867,38            | 78.564.626  | 9.000.000 | 23.800.000 | 4.206.867,38          | 1189702095151,12%    | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-07-22 | 0 | 105.782.067,75                           | 0,00                | 0,00                    | 74.357.759  | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-08-22 | 0 | 104.418.631,83                           | 0,00                | 0,00                    | 74.357.759  | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-09-22 | 1 | 103.067.360,18                           | 103.067.353,61      | 4.090.405,18            | 74.357.759  | 9.000.000 | 23.800.000 | 4.090.405,18          | 1194398312427,56%    | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-10-22 | 0 | 101.728.156,12                           | 0,00                | 0,00                    | 70.267.354  | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-11-22 | 0 | 100.400.923,70                           | 0,00                | 0,00                    | 70.267.354  | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-12-22 | 1 | 99.085.567,68                            | 99.085.561,11       | 3.981.792,50            | 70.267.354  | 9.000.000 | 23.800.000 | 3.981.792,50          | 1198917720617,38%    | 0,00                  | 0,00%                | 0,00                  | 0,00%                |
| 06-01-23 | 0 | 97.784.969,65                            | 0,00                | 0,00                    | 66.285.561  | 9.000.000 | 23.800.000 | 0,00                  | 0,0                  |                       |                      |                       |                      |