



F.T.A. UCI 11

SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.
GRAN VIA DE HORTALEZA 3
28033 MADRID
santanderdetitulizacion@gruposantander.com

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO: BONOS DE TITULIZACION

SERIES PRELACIÓN CÓDIGO ISIN	Nº BONOS	NOMINAL EN CIRCULACIÓN			
			Inicial	Actual	%Act/In
B.T.A'S SERIE A ES033834005	8.211	Nominal Unitario	100.000,00	18.482,24	
		Nominal Total	821.100.000,00	151.757.672,64	18,48 %
B.T.A'S SERIE B ES0338340013	60	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	6.000.000,00	6.000.000,00	100,00 %
B.T.A'S SERIE C ES0338340021	229	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	22.900.000,00	22.900.000,00	100,00 %

AMORTIZACION E INTERESES BONOS					
Actual			Próximo		
Fecha Amortización Periodo Actual 15 junio 2017			Fecha Próximo Cupón 15 septiembre 2017		
	Amortización de los Bonos	Intereses Brutos Bonos	Tipo de Interés	Importe Bruto Próximo Cupón	Importe Neto Próximo Cupón
B.T.A'S SERIE A	413,05 €	0,00 €	0,0000 %	0,00 €	0,00 €
B.T.A'S SERIE B	0,00 €	0,00 €	0,0000 %	0,00 €	0,00 €
B.T.A'S SERIE C	0,00 €	107,33 €	0,4190 %	107,08 €	86,73 €
Amortización devengada no pagada	0,00 €				
Amortización Calendario	NO				



III. ACTIVOS ADQUIRIDOS POR EL FONDO: DERECHOS DE CRÉDITO

DERECHOS DE CRÉDITO	A LA EMISIÓN	SITUACIÓN ACTUAL
Número de Derechos de Crédito	11.356	3.654
Saldo Pendiente de Amortizar Derechos	850.000.156,93	181.411.111,11 €
Importes Unitarios Derechos Vivos	74.850,30	111.111,11
Tipos de Interés	4,23 %	1,67 %

TASAS DE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA	SITUACIÓN ACTUAL
Tasa mensual actual anualizada:	11,11 %
Tasa últimos 12 meses anualizada:	11,11 %
Tasa anualizada desde Constitución del Fondo	11,11 %

MOROSIDAD ACTUAL	Hasta 1 mes	De 1 a 6 meses	Mayor de 6 meses
Deuda Vencida(Principal+Intereses)	18.837,54	72.919,78	1.196.600,41
Deuda Pendiente de vencimiento	0,00	0,00	111.111,11 €
Deuda Total	18.837,54	72.919,78	111.111,11 €

A

F.T.A. UCI 11**INFORME TRIMESTRAL BONOS DE TITULIZACIÓN**

15/06/2017

BONOS TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. PRINCIPAL	
Saldo anterior	184.049.226,19 €
Amortizaciones	3.391.553,55 €
Saldo actual	180.657.672,64 €
% sobre saldo inicial	21,25%
Amortización devengada no pagada	0,00 €

BONOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. INTERESES	
Intereses pagados Serie A	0,00 €
Intereses pagados Serie B	0,00 €
Intereses pagados Serie C	24.578,57 €
Intereses devengados no pagados	0

DATOS	
Fecha de determinación	08/06/2017
Fecha de Pago de Cupón Actual	15/06/2017
Fecha de Pago de Cupón Anterior	15/03/2017
Número de días	92
Tipo de referencia (%)	0,331%
Próxima Fecha de Pago	15/09/2017

VIDA RESIDUAL (AÑOS)		
	INICIAL	15-jun-17
B.T.A'S SERIE A	4,75	3,60
B.T.A'S SERIE B	7,93	5,25
B.T.A'S SERIE C	7,91	5,25

F.T.A. UCI 11

INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

15/06/2017

DERECHOS DE CRÉDITO. PRINCIPAL	
Saldo anterior	191.792.740,90 €
Amortizaciones	3.394.877,10 €
Saldo actual	188.397.863,80 €
Número de derechos de crédito	3.654
LTV	46,40%

DERECHOS DE CRÉDITO. INTERESES	
Intereses cobrados en el trimestre	723.014,67 €
Intereses devengados en el trimestre	731.529,08 €

DERECHOS DE CRÉDITO CON RETRASOS EN EL PAGO					
	HASTA 30 DIAS	30 A 60 DIAS	60 A 90 DIAS	90 A 180 DIAS	MÁS DE 180 DIAS
Principal	14.717,64 €	20.058,45 €	16.341,22 €	19.633,55 €	722.224,03 €
Intereses	4.119,90 €	6.332,28 €	6.315,84 €	4.238,44 €	474.376,38 €
Saldo de los derechos de crédito	3.854.699,39 €	2.824.009,90 €	1.372.277,83 €	779.059,18 €	4.023.244,56 €
Número de derechos de crédito	77	40	24	17	111
% sobre saldo de los derechos de crédito	2,05%	1,50%	0,73%	0,41%	2,14%

PRÉSTAMOS EN WRITE OFF	
Write Off acumulado Fecha Pago anterior	7.743.546,46 €
Write Off trimestre	-3.343,55 €
Write Off acumulados actuales	7.740.202,91 €

F.T.A. UCI 11

INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

15/06/2017

ADJUDICADOS	
Saldo anterior	1.708.112,95 €
Diferencia	71.747,64 €
Saldo actual	1.779.860,59 €
Número de adjudicados	47

PERDIDAS DE LA CARTERA	
Saldo anterior	2.173.496,30 €
Diferencia	66.220,81 €
Saldo actual	2.239.717,11 €

F.T.A. UCI 11

ESTADO DE ORIGEN Y APLICACIÓN DE FONDOS Y CUENTA DE TESORERÍA

15/06/2017

ORIGEN	4.104.429,78 €
PRINCIPAL COBRADO	
Amortización derechos de crédito	3.082.182,96 €
INTERESES COBRADOS	
Intereses de derechos de crédito	723.014,67 €
Intereses de reinversión	-11.359,17 €
INGRESOS/GASTOS DE ADJUDICADOS	223.061,33 €
INGRESOS IMPORTES ASEGURADOS	88.045,00 €
OTROS	-515,01 €

APLICACIÓN	4.104.429,78 €
GASTOS ORDINARIOS	4.594,37 €
COMISIÓN S.G.F.T	14.551,88 €
PAGO SWAP	0,00 €
COBRO SWAP	0,00 €
INTERESES B.T.A'S SERIE A	0,00 €
INTERESES B.T.A'S SERIE B	0,00 €
INTERESES B.T.A'S SERIE C	24.578,57 €
FONDOS DISPONIBLES AMORTIZACIÓN A	3.391.553,55 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO SANTANDER	4.399,02 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB	4.399,02 €
COMISIÓN ADMINISTRACIÓN UCI	6.000,00 €
COMISIÓN VARIABLE	654.353,38 €

ESTADO CUENTA DE TESORERÍA	12.750.000,00 €
FONDO DE RESERVA	
Saldo anterior	12.750.000,00 €
Variación en el período	0,00 €
Saldo actual	12.750.000,00 €

F.T.A. UCI 11

MEJORA CREDITICIA Y PRÉSTAMO SUBORDINADO

15/06/2017

MEJORA DE CRÉDITO				
CONCEPTOS	INICIAL		15-jun-17	
EMISIÓN SUBORDINADA	28.900.000,00 €	3,40 %	28.900.000,00 €	16,00%
FONDO DE RESERVA	12.750.000,00 €	1,50%	12.750.000,00 €	7,06%

PRÉSTAMOS SUBORDINADOS				
CONCEPTOS	INICIAL		15-jun-17	
PRÉSTAMO SUBORDINADO SCH				
Saldo vivo	6.812.500,00 €		6.375.386,18 €	
Tipo de interés	2,790 %		0,269%	
PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB				
Saldo vivo	6.812.500,00 €		6.375.386,18 €	
Tipo de interés	2,790 %		0,269%	

F.T.A. UCI 11

DEFINICIONES

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

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

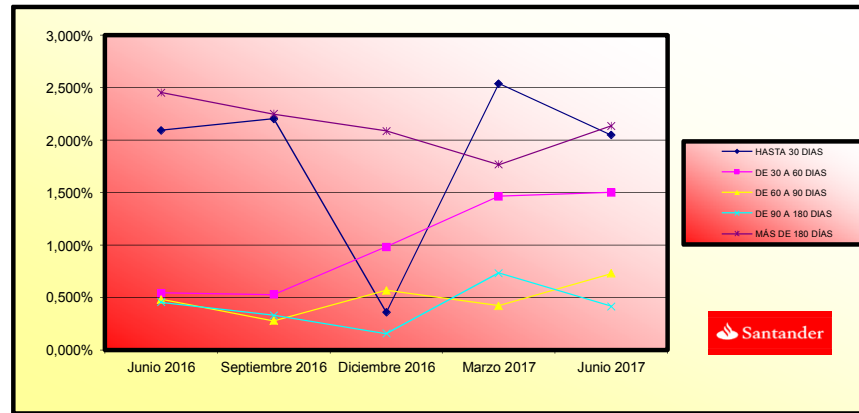
PÉRDIDAS DE LA CARTERA Aquellos préstamos cuya deuda el Cedente considera que no va a recuperar (neto de recuperaciones).

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

FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS
UCI 11

INFORME HISTÓRICO DE MOROSIDAD

MOROSIDAD HISTÓRICA					
	Junio 2016	Septiembre 2016	Diciembre 2016	Marzo 2017	Junio 2017
HASTA 30 DIAS	2,094%	2,202%	0,357%	2,539%	2,046%
DE 30 A 60 DIAS	0,542%	0,527%	0,982%	1,466%	1,499%
DE 60 A 90 DIAS	0,483%	0,279%	0,567%	0,422%	0,728%
DE 90 A 180 DIAS	0,454%	0,331%	0,155%	0,731%	0,414%
MÁS DE 180 DIAS	2,454%	2,248%	2,086%	1,766%	2,136%



**FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS
UCI 11**

INFORME RELATIVO A LOS TRIGGERS DEL FONDO

15/06/2017

AMORTIZACIÓN BONOS SERIE B y C	
SI 1) ES MAYOR QUE 2) NO SE AMORTIZAN LAS SERIES B y C	
1) DERECHOS EN MOROSIDAD > 90 DÍAS	12.542.506,65 €
2) 2% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO ACTUAL	3.767.957,28 €

MOROSIDAD > 90 DÍAS (% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO)
6,66%

NO SE AMORTIZAN LAS SERIES B y C

TRIGGERS FONDOS DE RESERVA	
SI 1) ES MAYOR QUE 2) NO SE AMORTIZA EL FONDO DE RESERVA	
1) DERECHOS EN MOROSIDAD > 90 DÍAS	12.542.506,65 €
2) 1,25% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO ACTUAL	2.354.973,30 €

NO SE AMORTIZA EL FONDO DE RESERVA

POSTERGAMIENTO DE INTERESES DE LAS SERIES B Y C	
SI 1) ES MAYOR QUE 2)+3) LOS INTS DE LA SERIE B SE POSTERGAN AL 7 ° LUGAR	
1) SALDO DE LA SERIE A	155.149.226,19 €
2) SALDO VIVO DERECHOS DE CRÉDITO (MOROSIDAD < 18 MESES)	179.086.313,73 €
3) REMANENTE F.DISPONIBLES DESPUÉS PAGO PUNTOS 1° - 4°	16.835.283,53 €
SI 1) ES MAYOR QUE 2)+3) LOS INTS DE LA SERIE C SE POSTERGAN AL 8 ° LUGAR	
1) SALDOS DE LAS SERIES A Y B	161.149.226,19 €
2) SALDO VIVO DERECHOS DE CRÉDITO (MOROSIDAD < 18 MESES)	179.086.313,73 €
3) REMANENTE F.DISPONIBLES DESPUÉS PAGO PUNTOS 1° - 5°	16.810.704,96 €

NO SE POSTERGAN LOS INTERESES DE LA SERIE B

NO SE POSTERGAN LOS INTERESES DE LA SERIE C

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

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

**FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS
UCI 11**

LTV					
INTERVALO - INTERVAL	SALDO - OUTSTANDING	% SALDOS VIVOS - % OUTSTANDING	Nº PRÉSTAMOS- NUMBER LOANS	% Nº PRÉSTAMOS- % NUMBER LOANS	
0,00 - 9,99	1.209.492,33	0,6706%	109		3,8831%
10,00 - 19,99	4.350.687,81	2,4122%	140		4,9875%
20,00 - 29,99	10.627.062,09	5,8921%	203		7,2319%
30,00 - 39,99	24.435.912,65	13,5484%	371		13,2170%
40,00 - 49,99	34.315.761,28	19,0262%	496		17,6701%
50,00 - 59,99	67.126.434,25	37,2180%	1.023		36,4446%
60,00 - 69,99	26.116.975,86	14,4805%	343		12,2195%
70,00 - 79,99	10.108.665,18	5,6047%	103		3,6694%
80,00 - 89,99	1.798.652,37	0,9973%	17		0,6056%
90,00 - 93,41	270.477,88	0,1500%	2		0,0713%

UCI 11

Fecha	Saldo antes de Pago	Saldo Real	Vector de Prepago	Permanencia final de mes	Mortalidad Mensual	CPR	Mortalidad Mensual	CPR
Date	Outstanding before prepayment	Real outstanding	Prepayment vector	Remaining at the end of the month	Average single monthly mortality	CPR	Monthly single mortality	CPR
			0,75%					4,04%
	850.000.000,00		100,00%	100,00%				
8-dic-04	848.447.342,89	833.517.603,20	99,25%	98,24%	1,76%	19,19%	1,76%	19,19%
8-ene-05	846.889.973,92	816.392.876,79	98,51%	96,40%	1,82%	19,75%	1,87%	20,31%
8-feb-05	845.328.036,68	802.341.378,75	97,77%	94,91%	1,72%	18,84%	1,54%	16,99%
8-mar-05	843.761.517,75	786.900.260,82	97,04%	93,26%	1,73%	18,89%	1,74%	19,02%
8-abr-05	842.190.403,70	768.001.629,57	96,32%	91,19%	1,83%	19,85%	2,22%	23,61%
8-may-05	840.614.681,05	751.784.924,91	95,60%	89,43%	1,84%	20,02%	1,93%	20,83%
8-jun-05	839.034.336,28	732.993.980,46	94,88%	87,36%	1,91%	20,68%	2,32%	24,51%
8-jul-05	837.449.355,83	713.527.819,67	94,17%	85,20%	1,98%	21,35%	2,47%	25,94%
8-ago-05	835.859.726,10	695.561.749,15	93,47%	83,22%	2,02%	21,73%	2,33%	24,66%
8-sep-05	834.265.433,46	682.206.195,00	92,77%	81,77%	1,99%	21,45%	1,73%	18,92%
8-oct-05	832.666.464,23	670.301.480,81	92,07%	80,50%	1,95%	21,07%	1,56%	17,16%
8-nov-05	831.062.804,69	654.364.086,82	91,39%	78,74%	1,97%	21,26%	2,19%	23,33%
8-dic-05	829.454.441,08	633.873.172,63	90,70%	76,42%	2,05%	21,98%	2,94%	30,13%
8-ene-06	827.841.359,61	619.627.389,01	90,02%	74,85%	2,05%	21,99%	2,06%	22,07%
8-feb-06	826.223.546,43	601.383.750,24	89,35%	72,79%	2,10%	22,44%	2,75%	28,48%
8-mar-06	824.600.987,66	584.239.740,88	88,68%	70,85%	2,13%	22,77%	2,66%	27,64%
8-abr-06	822.973.669,39	566.483.863,76	88,02%	68,83%	2,17%	23,17%	2,85%	29,29%
8-may-06	821.341.577,65	551.680.941,47	87,36%	67,17%	2,19%	23,30%	2,42%	25,47%
8-jun-06	819.704.698,44	536.851.732,28	86,71%	65,49%	2,20%	23,46%	2,49%	26,14%
8-jul-06	818.063.017,72	518.335.537,79	86,06%	63,36%	2,26%	23,95%	3,26%	32,78%
8-ago-06	816.416.521,41	505.514.356,78	85,42%	61,92%	2,26%	23,96%	2,28%	24,15%
8-sep-06	814.765.195,37	497.832.455,51	84,78%	61,10%	2,21%	23,56%	1,32%	14,74%
8-oct-06	813.109.025,44	489.785.181,54	84,14%	60,24%	2,18%	23,24%	1,42%	15,73%
8-nov-06	811.447.997,41	480.954.788,91	83,51%	59,27%	2,16%	23,01%	1,60%	17,62%
8-dic-06	809.782.097,03	470.277.417,04	82,89%	58,07%	2,15%	22,96%	2,02%	21,71%
8-ene-07	808.111.707,58	460.043.992,15	82,27%	56,93%	2,14%	22,90%	1,97%	21,28%
8-feb-07	806.436.418,33	450.559.931,77	81,66%	55,87%	2,13%	22,80%	1,86%	20,15%
8-mar-07	804.756.214,89	440.907.144,06	81,04%	54,79%	2,13%	22,73%	1,94%	20,93%
8-abr-07	803.071.082,85	431.073.415,47	80,44%	53,68%	2,12%	22,70%	2,03%	21,77%
8-may-07	801.381.007,76	421.968.045,26	79,84%	52,66%	2,12%	22,63%	1,91%	20,62%
8-jun-07	799.685.975,11	412.121.707,46	79,24%	51,54%	2,12%	22,63%	2,13%	22,73%

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

Fecha	Saldo antes de Pago	Saldo Real	vector de Prepago	Remanencia final de mes	Mortalidad Mensual	CPR	Mortalidad Mensual	CPR
Date	Outstanding before prepayment	Real outstanding	Prepayment vector	Remaining at the end of the month	Average single monthly mortality	CPR	Monthly single monthly mortality	CPR
			0,75%					4,04%
8-nov-11	703.187.452,99	265.696.089,52	53,23%	37,78%	1,15%	12,98%	0,28%	3,32%
8-dic-11	701.228.738,34	264.288.500,39	52,83%	37,69%	1,14%	12,87%	0,25%	2,98%
8-ene-12	699.269.967,10	263.261.093,09	52,44%	37,65%	1,13%	12,74%	0,11%	1,31%
8-feb-12	697.305.450,14	261.893.291,79	52,05%	37,56%	1,12%	12,63%	0,24%	2,83%
8-mar-12	695.335.170,59	260.588.400,21	51,66%	37,48%	1,11%	12,53%	0,22%	2,57%
8-abr-12	693.359.111,56	258.867.875,32	51,27%	37,34%	1,10%	12,44%	0,38%	4,43%
8-may-12	691.377.256,08	258.896.709,85	50,89%	37,45%	1,09%	12,28%	-0,30%	-3,63%
8-jun-12	689.389.587,16	257.436.239,31	50,51%	37,34%	1,08%	12,18%	0,28%	3,28%
8-jul-12	687.399.418,55	256.481.587,36	50,13%	37,31%	1,07%	12,07%	0,08%	0,98%
8-ago-12	685.403.412,10	254.970.529,27	49,75%	37,20%	1,06%	11,98%	0,30%	3,54%
8-sep-12	683.401.550,70	254.189.633,03	49,38%	37,19%	1,05%	11,86%	0,01%	0,17%
8-oct-12	681.393.817,18	253.392.724,66	49,01%	37,19%	1,04%	11,75%	0,02%	0,24%
8-nov-12	679.380.194,30	252.365.440,68	48,65%	37,15%	1,03%	11,64%	0,11%	1,31%
8-dic-12	677.360.664,80	251.163.845,27	48,28%	37,08%	1,02%	11,55%	0,18%	2,13%
8-ene-13	675.341.971,78	249.665.572,52	47,92%	36,97%	1,01%	11,47%	0,30%	3,53%
8-feb-13	673.317.357,26	248.481.194,60	47,56%	36,90%	1,00%	11,38%	0,18%	2,08%
8-mar-13	671.286.803,87	247.478.924,29	47,21%	36,87%	0,99%	11,29%	0,10%	1,22%
8-abr-13	669.250.294,19	246.515.375,54	46,85%	36,83%	0,98%	11,19%	0,09%	1,03%
8-may-13	667.207.810,75	245.328.736,88	46,50%	36,77%	0,98%	11,10%	0,18%	2,10%
8-jun-13	665.159.336,02	243.923.229,33	46,16%	36,67%	0,97%	11,03%	0,27%	3,15%
8-jul-13	663.111.616,14	242.816.536,85	45,81%	36,62%	0,96%	10,95%	0,15%	1,74%
8-ago-13	661.057.889,62	241.563.340,00	45,47%	36,54%	0,95%	10,87%	0,21%	2,46%
8-sep-13	658.998.138,83	240.513.483,02	45,13%	36,50%	0,95%	10,78%	0,12%	1,47%
8-oct-13	656.932.346,11	239.510.480,13	44,79%	36,46%	0,94%	10,70%	0,10%	1,24%
8-nov-13	654.860.493,73	238.293.492,12	44,46%	36,39%	0,93%	10,62%	0,19%	2,30%
8-dic-13	652.782.563,92	236.956.654,81	44,12%	36,30%	0,93%	10,56%	0,24%	2,89%
8-ene-14	650.703.792,43	235.767.057,78	43,79%	36,23%	0,92%	10,48%	0,18%	2,19%
8-feb-14	648.618.923,21	234.640.850,19	43,47%	36,18%	0,91%	10,41%	0,16%	1,88%
8-mar-14	646.527.938,38	233.088.807,16	43,14%	36,05%	0,91%	10,35%	0,34%	4,01%
8-abr-14	644.430.819,99	231.810.963,21	42,82%	35,97%	0,90%	10,29%	0,22%	2,66%
8-may-14	642.327.550,05	230.695.545,90	42,50%	35,92%	0,89%	10,22%	0,16%	1,85%
8-jun-14	640.218.110,52	229.708.916,49	42,18%	35,88%	0,89%	10,14%	0,10%	1,19%
8-jul-14	638.109.627,99	228.113.352,62	41,87%	35,75%	0,88%	10,09%	0,37%	4,31%
8-ago-14	635.994.960,57	226.673.132,50	41,55%	35,64%	0,88%	10,04%	0,30%	3,55%
8-sep-14	633.874.090,14	225.192.852,10	41,24%	35,53%	0,87%	9,99%	0,32%	3,78%
8-oct-14	631.746.998,48	223.972.429,77	40,93%	35,45%	0,87%	9,93%	0,21%	2,46%
8-nov-14	629.613.667,35	222.674.737,24	40,63%	35,37%	0,86%	9,87%	0,24%	2,87%
8-dic-14	627.474.078,45	221.379.343,87	40,32%	35,28%	0,86%	9,82%	0,24%	2,87%
8-ene-15	625.339.624,04	219.758.096,05	40,02%	35,14%	0,85%	9,77%	0,39%	4,62%
8-feb-15	623.198.908,55	218.662.726,28	39,72%	35,09%	0,85%	9,71%	0,16%	1,86%
8-mar-15	621.051.913,64	217.271.524,92	39,43%	34,98%	0,84%	9,66%	0,29%	3,46%
8-abr-15	618.898.620,87	216.019.650,16	39,13%	34,90%	0,84%	9,61%	0,23%	2,73%
8-may-15	616.739.011,78	214.967.591,23	38,84%	34,86%	0,83%	9,55%	0,14%	1,65%
8-jun-15	614.573.067,83	213.837.232,73	38,55%	34,79%	0,83%	9,49%	0,18%	2,08%
8-jul-15	612.414.873,02	212.477.020,97	38,26%	34,69%	0,82%	9,45%	0,29%	3,38%
8-ago-15	610.250.347,50	211.117.313,01	37,97%	34,60%	0,82%	9,40%	0,29%	3,40%
8-sep-15	608.079.472,71	209.638.573,56	37,69%	34,48%	0,82%	9,36%	0,35%	4,07%
8-oct-15	605.902.230,02	208.547.215,68	37,41%	34,42%	0,81%	9,31%	0,16%	1,94%
8-nov-15	603.718.600,75	207.131.536,38	37,13%	34,31%	0,81%	9,27%	0,32%	3,77%
8-dic-15	601.528.566,17	206.054.562,90	36,85%	34,26%	0,80%	9,21%	0,16%	1,88%
8-ene-16	599.334.314,99	204.394.497,59	36,57%	34,10%	0,80%	9,18%	0,44%	5,18%
8-feb-16	597.133.627,33	202.992.543,14	36,30%	33,99%	0,80%	9,15%	0,32%	3,77%
8-mar-16	594.926.484,33	201.605.395,83	36,03%	33,89%	0,79%	9,11%	0,31%	3,71%
8-abr-16	592.712.867,04	200.324.578,04	35,76%	33,80%	0,79%	9,06%	0,26%	3,12%
8-may-16	590.492.756,47	198.775.249,80	35,49%	33,66%	0,79%	9,03%	0,40%	4,70%
8-jun-16	588.266.133,58	197.371.961,65	35,23%	33,55%	0,78%	9,00%	0,33%	3,89%
8-jul-16	586.040.157,64	195.911.020,00	34,96%	33,43%	0,78%	8,96%	0,36%	4,27%

Fecha	Saldo antes de Pago	Saldo Real	vector de Prepago	Remanencia final de mes	Mortandau Mensual	CPR	Mortandau 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
			0,75%					4,04%
8-ago-16	583.807.652,18	194.629.344,46	34,70%	33,34%	0,78%	8,93%	0,27%	3,24%
8-sep-16	581.568.598,03	193.258.870,10	34,44%	33,23%	0,77%	8,89%	0,32%	3,79%
8-oct-16	579.322.975,99	192.149.295,98	34,19%	33,17%	0,77%	8,84%	0,19%	2,24%
8-nov-16	577.070.766,80	190.838.799,89	33,93%	33,07%	0,77%	8,81%	0,29%	3,48%
8-dic-16	574.811.951,12	189.280.007,29	33,68%	32,93%	0,76%	8,78%	0,43%	5,01%
8-ene-17	572.555.085,34	187.291.480,89	33,42%	32,71%	0,76%	8,78%	0,66%	7,64%
8-feb-17	570.291.599,43	185.567.790,61	33,17%	32,54%	0,76%	8,76%	0,53%	6,14%
8-mar-17	568.021.473,95	184.049.194,44	32,93%	32,40%	0,76%	8,73%	0,42%	4,95%
8-abr-17	565.744.689,44	182.968.473,58	32,68%	32,34%	0,75%	8,69%	0,19%	2,22%
8-may-17	563.461.226,37	181.846.871,10	32,44%	32,27%	0,75%	8,65%	0,21%	2,49%
8-jun-17	561.171.065,13	180.657.660,89	32,19%	32,19%	0,75%	8,61%	0,25%	2,94%

DECRECIMIENTO SERIE B 1,4%
 SUSPEN.DECREC.SERIE B 1,4%
 SERIE C
 DECRECIMIENTO SERIE C 5,4%
 SUSPEN.DECREC.SERIE C
 VIDA RESIDUAL DESDE 8-jun-17 3,60 5,25 5,25

Fecha	Principal disponible antes prepago	Principal Disponible	Amortización de principal	Serie A	Serie B	Serie C	Amortización Serie A	Vida Media Serie A	Amortización Serie B	Vida Media Serie B	Amortización Serie C	Vida Media Serie C
								3,60		5,25		5,25
Date	Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	Average Life Class A	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C
	850.000.000,00											
8-dic-04	848.447.342,89			821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00						
8-ene-05	846.889.973,92	0,00	0,00	821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-05	845.328.036,68	0,00	0,00	821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-05	843.761.517,75	786.900.260,82	63.099.739,18	821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00	63.099.739,18	-28237133283050,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-05	842.190.403,70	0,00	0,00	758.000.260,82	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-05	840.614.681,05	0,00	0,00	758.000.260,82	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-05	839.034.336,28	732.993.980,46	53.906.280,36	758.000.260,82	6.000.000,00	22.900.000,00	53.906.280,36	-23627122681788,10%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-05	837.448.355,83	0,00	0,00	704.093.980,46	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-05	835.859.726,10	0,00	0,00	704.093.980,46	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-sep-05	834.265.433,46	682.206.195,00	50.787.785,46	704.093.980,46	6.000.000,00	22.900.000,00	50.787.785,46	-21793038740886,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-oct-05	832.666.464,23	0,00	0,00	653.306.195,00	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-nov-05	831.062.804,69	0,00	0,00	653.306.195,00	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-dic-05	829.454.441,08	633.873.172,63	48.333.022,37	653.306.195,00	6.000.000,00	22.900.000,00	48.333.022,37	-20299869395400,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ene-06	827.841.359,61	0,00	0,00	604.973.172,63	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-06	826.223.546,43	0,00	0,00	604.973.172,63	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-06	824.600.987,66	584.239.740,88	49.633.431,75	604.973.172,63	6.000.000,00	22.900.000,00	49.633.431,75	-20399340449250,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-06	822.973.669,39	0,00	0,00	555.339.740,88	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-06	821.341.577,65	0,00	0,00	555.339.740,88	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-06	819.704.698,44	536.851.732,28	47.388.008,60	555.339.740,88	6.000.000,00	22.900.000,00	47.388.008,60	-19040501855480,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-06	818.063.017,72	0,00	0,00	507.951.732,28	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-06	816.416.521,41	0,00	0,00	507.951.732,28	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-sep-06	814.765.195,37	497.832.455,51	39.019.276,77	507.951.732,28	6.000.000,00	22.900.000,00	39.019.276,77	-15318968059902,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-oct-06	813.109.025,44	0,00	0,00	468.932.455,51	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-nov-06	811.447.987,41	0,00	0,00	468.932.455,51	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-dic-06	809.782.097,03	470.277.417,04	27.555.038,47	468.932.455,51	6.000.000,00	22.900.000,00	27.555.038,47	-10567357253245,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ene-07	808.111.707,58	0,00	0,00	441.377.417,04	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-07	806.436.418,33	0,00	0,00	441.377.417,04	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-07	804.756.214,89	440.907.144,06	29.370.272,98	441.377.417,04	6.000.000,00	22.900.000,00	29.370.272,98	-10999167231010,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-07	803.071.082,85	0,00	0,00	412.007.144,06	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-07	801.381.007,76	0,00	0,00	412.007.144,06	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-07	799.685.975,11	412.121.707,46	28.785.436,60	412.007.144,06	6.000.000,00	22.900.000,00	28.785.436,60	-10515319989980,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-07	797.986.907,49	0,00	0,00	383.221.707,46	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-07	796.282.855,93	0,00	0,00	383.221.707,46	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-sep-07	794.573.805,82	391.376.030,13	20.745.677,33	383.221.707,46	6.000.000,00	22.900.000,00	20.745.677,33	-7387535697212,99%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-oct-07	792.859.742,50	0,00	0,00	362.476.030,13	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-nov-07	791.140.651,25	0,00	0,00	362.476.030,13	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-dic-07	789.416.517,34	374.085.117,49	17.290.912,64	362.476.030,13	6.000.000,00	22.900.000,00	17.290.912,64	-5999946686080,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ene-08	787.694.525,33	0,00	0,00	345.185.117,49	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-08	785.967.462,14	0,00	0,00	345.185.117,49	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-08	784.235.372,95	361.954.516,26	12.130.601,23	345.185.117,49	6.000.000,00	22.900.000,00	12.130.601,23	-4098930155616,99%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-08	782.498.182,91	0,00	0,00	333.054.516,26	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-08	780.755.897,12	0,00	0,00	333.054.516,26	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-08	779.008.500,62	348.169.826,92	13.784.689,34	333.054.516,26	6.000.000,00	22.900.000,00	13.784.689,34	-4531027386057,99%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-08	777.259.527,22	0,00	0,00	319.269.826,92	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-08	775.505.423,51	0,00	0,00	319.269.826,92	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-sep-08	773.746.174,42	341.634.083,80	6.535.743,12	319.269.826,92	6.000.000,00	22.900.000,00	6.535.743,12	-2088169926840,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-oct-08	771.981.764,88	0,00	0,00	312.734.083,80	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-nov-08	770.212.179,73	0,00	0,00	312.734.083,80	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-dic-08	768.437.403,79	333.970.278,42	7.663.805,38	312.734.083,80	6.000.000,00	22.900.000,00	7.663.805,38	-2378845189952,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ene-09	766.659.103,76	0,00	0,00	305.070.278,42	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-09	764.875.587,37	0,00	0,00	305.070.278,42	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-09	763.086.839,34	328.476.806,46	5.493.471,96	305.070.278,42	6.000.000,00	22.900.000,00	5.493.471,96	-1655732448744,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-09	761.292.844,32	0,00	0,00	299.576.806,46	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-09	759.493.586,80	0,00	0,00	299.576.806,46	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-09	757.689.051,57	321.386.971,51	7.089.834,95	299.576.806,46	6.000.000,00	22.900.000,00	7.089.834,95	-2071649772390,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-09	755.881.308,93	0,00	0,00	292.486.971,51	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-09	754.068.263,48	0,00	0,00	292.486.971,51	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00

Date		Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	3.60		5.25		5.25	
									Average Life Class A	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C	
8-sep-09	1	752.249.899,76	314.354.974,81	7.031.996,70	292.486.971,51	6.000.000,00	22.900.000,00	7.031.996,70	-1990055066100,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-oct-09	0	750.426.202,17	0,00	0,00	285.454.974,81	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-nov-09	0	748.597.155,07	0,00	0,00	285.454.974,81	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-dic-09	1	746.762.742,76	307.081.055,36	7.273.919,45	285.454.974,81	6.000.000,00	22.900.000,00	7.273.919,45	-1992326537355,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ene-10	0	744.925.018,92	0,00	0,00	278.181.055,36	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-feb-10	0	743.081.904,42	0,00	0,00	278.181.055,36	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-mar-10	1	741.233.383,45	300.122.393,54	6.958.661,82	278.181.055,36	6.000.000,00	22.900.000,00	6.958.661,82	-1843349516118,01%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-abr-10	0	739.379.440,15	0,00	0,00	271.222.393,54	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-may-10	0	737.520.058,62	0,00	0,00	271.222.393,54	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jun-10	1	735.655.222,91	293.760.620,91	6.361.772,63	271.222.393,54	6.000.000,00	22.900.000,00	6.361.772,63	-1626705261490,98%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jul-10	0	733.787.447,69	0,00	0,00	264.860.620,91	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ago-10	0	731.914.153,66	0,00	0,00	264.860.620,91	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-sep-10	1	730.035.444,76	287.255.851,54	6.504.769,37	264.860.620,91	6.000.000,00	22.900.000,00	6.504.769,37	-1603425649705,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-oct-10	0	728.151.184,86	0,00	0,00	258.355.851,54	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-nov-10	0	726.261.397,79	0,00	0,00	258.355.851,54	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-dic-10	1	724.366.067,35	281.674.551,27	5.581.300,27	258.355.851,54	6.000.000,00	22.900.000,00	5.581.300,27	-1325000684098,01%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ene-11	0	722.468.266,09	0,00	0,00	252.774.551,27	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-feb-11	0	720.564.897,95	0,00	0,00	252.774.551,27	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-mar-11	1	718.655.946,58	275.983.701,22	5.690.850,05	252.774.551,27	6.000.000,00	22.900.000,00	5.690.850,05	-1299790151419,99%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-abr-11	0	716.741.395,64	0,00	0,00	247.083.701,22	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-may-11	0	714.821.228,68	0,00	0,00	247.083.701,22	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jun-11	1	712.895.429,22	271.621.942,31	4.361.758,91	247.083.701,22	6.000.000,00	22.900.000,00	4.361.758,91	-956097553072,01%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jul-11	0	710.965.191,30	0,00	0,00	242.721.942,31	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ago-11	0	709.029.291,35	0,00	0,00	242.721.942,31	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-sep-11	1	707.087.712,76	268.147.150,38	3.474.791,93	242.721.942,31	6.000.000,00	22.900.000,00	3.474.791,93	-729706305300,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-oct-11	0	705.140.438,86	0,00	0,00	239.247.150,38	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-nov-11	0	703.187.452,96	0,00	0,00	239.247.150,38	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-dic-11	1	701.228.738,34	264.288.500,39	3.858.649,99	239.247.150,38	6.000.000,00	22.900.000,00	3.858.649,99	-77520278299,01%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ene-12	0	699.269.967,10	0,00	0,00	235.388.500,39	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-feb-12	0	697.305.450,14	0,00	0,00	235.388.500,39	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-mar-12	1	695.335.170,59	260.588.400,21	3.700.100,18	235.388.500,39	6.000.000,00	22.900.000,00	3.700.100,18	-709679214523,99%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-abr-12	0	693.359.111,56	0,00	0,00	231.688.400,21	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-may-12	0	691.377.256,08	0,00	0,00	231.688.400,21	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jun-12	1	689.389.587,16	257.436.239,31	3.152.240,33	231.688.400,21	6.000.000,00	22.900.000,00	3.152.240,33	-5755845803049,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jul-12	0	687.399.418,55	0,00	0,00	228.536.239,31	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ago-12	0	685.403.412,10	0,00	0,00	228.536.239,31	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-sep-12	1	683.401.550,70	254.189.633,03	3.246.606,28	228.536.239,31	6.000.000,00	22.900.000,00	3.246.606,28	-562961528952,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-oct-12	0	681.393.817,18	0,00	0,00	225.289.633,03	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-nov-12	0	679.380.194,30	0,00	0,00	225.289.633,03	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-dic-12	1	677.360.664,80	251.163.845,27	3.025.787,76	225.289.633,03	6.000.000,00	22.900.000,00	3.025.787,76	-497136928968,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ene-13	0	675.341.971,78	0,00	0,00	222.263.845,27	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-feb-13	0	673.317.357,85	0,00	0,00	222.263.845,27	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-mar-13	1	671.286.803,87	247.478.924,29	3.684.920,98	222.263.845,27	6.000.000,00	22.900.000,00	3.684.920,98	-572268228194,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-abr-13	0	669.250.294,19	0,00	0,00	218.578.924,29	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-may-13	0	667.207.810,75	0,00	0,00	218.578.924,29	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jun-13	1	665.159.336,02	243.923.229,33	3.555.694,96	218.578.924,29	6.000.000,00	22.900.000,00	3.555.694,96	-519487033656,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jul-13	0	663.111.616,14	0,00	0,00	215.023.229,33	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ago-13	0	661.057.889,62	0,00	0,00	215.023.229,33	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-sep-13	1	658.998.138,63	240.513.483,03	3.409.746,31	215.023.229,33	6.000.000,00	22.900.000,00	3.409.746,31	-4667942986939,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-oct-13	0	656.932.346,11	0,00	0,00	211.613.483,03	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-nov-13	0	654.860.493,73	0,00	0,00	211.613.483,03	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-dic-13	1	652.782.563,92	236.956.654,81	3.556.828,21	211.613.483,03	6.000.000,00	22.900.000,00	3.556.828,21	-454562645238,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ene-14	0	650.703.792,43	0,00	0,00	208.056.654,81	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-feb-14	0	648.618.923,21	0,00	0,00	208.056.654,81	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-mar-14	1	646.527.938,38	233.088.807,16	3.867.847,65	208.056.654,81	6.000.000,00	22.900.000,00	3.867.847,65	-459500300820,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-abr-14	0	644.430.819,89	0,00	0,00	204.188.807,16	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-may-14	0	642.327.550,05	0,00	0,00	204.188.807,16	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jun-14	1	640.218.110,52	229.708.916,49	3.379.890,67	204.188.807,16	6.000.000,00	22.900.000,00	3.379.890,67	-370436017432,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jul-14	0	638.109.627,99	0,00	0,00	200.808.916,49	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ago-14	0	635.994.960,57	0,00	0,00	200.808.916,49	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-sep-14	1	633.874.090,14	225.192.852,10	4.516.064,39	200.808.916,49	6.000.000,00	22.900.000,00	4.516.064,39	-453412864756,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-oct-14	0	631.746.998,48	0,00	0,00	196.292.852,10	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-nov-14	0	629.613.667,35	0,00	0,00	196.292.852,10	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-dic-14	1	627.474.078,45	221.379.343,87	3.813.508,23	196.292.852,10	6.000.000,00	22.900.000,00	3.813.508,23	-348173301389,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ene-15	0	625.339.624,04	0,00	0,00	192.479.343,87	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-feb-15	0	623.198.908,55	0,00	0,00	192.479.343,87	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-mar-15	1	621.051.913,64	217.271.524,92	4.107.818,95	192.479.343,87	6.000.000,00	22.900.000,00	4.107.818,95	-338073499585,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-abr-15	0	618.898.620,87	0,00	0,00	188.371.524,92	6.000.000,00								

Date	Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	3.60		5.25		5.25	
								Average Life Class A	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C	
8-sep-17	1	554.278.130,68	174.465.386,08	6.192.274,81	151.757.660,89	6.000.000,00	22.900.000,00	6.192.274,81	56968928214,97%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-oct-17	0	551.966.993,18	0,00	0,00	145.565.386,08	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-nov-17	0	549.649.076,35	0,00	0,00	145.565.386,08	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-dic-17	1	547.324.360,30	168.440.580,64	6.024.805,44	145.565.386,08	6.000.000,00	22.900.000,00	6.024.805,44	110253939595,08%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ene-18	0	545.022.656,16	0,00	0,00	139.540.580,64	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-18	0	542.674.141,74	0,00	0,00	139.540.580,64	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-18	1	540.338.796,98	162.588.012,68	5.852.567,96	139.540.580,64	6.000.000,00	22.900.000,00	5.852.567,96	159775105442,83%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-18	0	537.996.601,88	0,00	0,00	133.688.012,68	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-18	0	535.647.536,34	0,00	0,00	133.688.012,68	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-18	1	533.291.580,21	156.894.427,05	5.693.585,62	133.688.012,68	6.000.000,00	22.900.000,00	5.693.585,62	207815875291,60%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-18	0	530.937.947,54	0,00	0,00	127.994.427,05	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-18	0	528.577.410,87	0,00	0,00	127.994.427,05	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-sep-18	1	526.209.949,96	151.363.884,92	5.530.542,13	127.994.427,05	6.000.000,00	22.900.000,00	5.530.542,13	252745775325,41%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-oct-18	0	523.835.544,50	0,00	0,00	122.463.884,92	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-nov-18	0	521.454.174,11	0,00	0,00	122.463.884,92	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-dic-18	1	519.065.818,38	145.984.269,20	5.379.615,73	122.463.884,92	6.000.000,00	22.900.000,00	5.379.615,73	294802941759,78%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ene-19	0	516.677.835,93	0,00	0,00	117.084.269,20	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-19	0	514.282.848,73	0,00	0,00	117.084.269,20	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-19	1	511.880.836,23	140.757.945,66	5.226.323,54	117.084.269,20	6.000.000,00	22.900.000,00	5.226.323,54	333439441652,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-19	0	509.471.777,84	0,00	0,00	111.857.945,66	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-19	0	507.055.652,87	0,00	0,00	111.857.945,66	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-19	1	504.632.440,60	135.674.938,82	5.083.006,84	111.857.945,66	6.000.000,00	22.900.000,00	5.083.006,84	371059499535,59%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-19	0	502.221.183,66	0,00	0,00	106.774.938,82	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-19	0	499.802.853,70	0,00	0,00	106.774.938,82	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-sep-19	1	497.377.429,98	130.746.767,92	4.928.170,90	106.774.938,82	6.000.000,00	22.900.000,00	4.928.170,90	405095647669,63%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-oct-19	0	494.944.891,68	0,00	0,00	101.846.767,92	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-nov-19	0	492.505.217,93	0,00	0,00	101.846.767,92	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-dic-19	1	490.058.387,81	125.954.339,35	4.792.428,57	101.846.767,92	6.000.000,00	22.900.000,00	4.792.428,57	437548728147,04%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ene-20	0	487.648.819,99	0,00	0,00	97.054.339,35	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-20	0	485.232.184,09	0,00	0,00	97.054.339,35	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-20	1	482.808.459,40	121.327.876,81	4.626.462,54	97.054.339,35	6.000.000,00	22.900.000,00	4.626.462,54	464496839097,36%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-20	0	480.377.625,12	0,00	0,00	92.427.876,81	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-20	0	477.939.660,39	0,00	0,00	92.427.876,81	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-20	1	475.494.544,30	116.829.275,80	4.498.601,01	92.427.876,81	6.000.000,00	22.900.000,00	4.498.601,01	493046671075,35%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-20	0	473.072.712,19	0,00	0,00	87.929.275,80	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-20	0	470.843.776,03	0,00	0,00	87.929.275,80	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-sep-20	1	468.207.715,00	112.477.364,42	4.351.911,38	87.929.275,80	6.000.000,00	22.900.000,00	4.351.911,38	51700072397,52%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-oct-20	0	465.764.508,19	0,00	0,00	83.577.364,42	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-nov-20	0	463.314.134,64	0,00	0,00	83.577.364,42	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-dic-20	1	460.856.573,33	108.246.227,97	4.231.136,45	83.577.364,42	6.000.000,00	22.900.000,00	4.231.136,45	541162351358,33%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ene-21	0	458.394.156,08	0,00	0,00	79.346.227,97	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-21	0	455.924.515,75	0,00	0,00	79.346.227,97	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-21	1	453.447.831,13	104.134.477,46	4.111.750,52	79.346.227,97	6.000.000,00	22.900.000,00	4.111.750,52	562898645548,38%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-21	0	450.963.480,99	0,00	0,00	75.234.477,46	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-21	0	448.472.044,01	0,00	0,00	75.234.477,46	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-21	1	445.973.298,81	100.137.485,45	3.996.992,00	75.234.477,46	6.000.000,00	22.900.000,00	3.996.992,00	583960531721,13%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-21	0	443.470.820,37	0,00	0,00	71.237.485,45	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-21	0	440.961.001,33	0,00	0,00	71.237.485,45	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-sep-21	1	438.443.820,15	96.254.755,83	3.882.729,62	71.237.485,45	6.000.000,00	22.900.000,00	3.882.729,62	602987910207,06%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-oct-21	0	435.919.255,24	0,00	0,00	67.354.755,83	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-nov-21	0	433.381.284,95	0,00	0,00	67.354.755,83	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-dic-21	1	430.847.887,53	92.481.024,24	3.773.731,59	67.354.755,83	6.000.000,00	22.900.000,00	3.773.731,59	620401473935,62%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ene-22	0	428.303.896,47	0,00	0,00	63.581.024,24	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-22	0	425.752.443,04	0,00	0,00	63.581.024,24	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-22	1	423.193.505,34	88.815.359,19	3.665.665,04	63.581.024,24	6.000.000,00	22.900.000,00	3.665.665,04	635626318361,14%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-22	0	420.627.061,43	0,00	0,00	59.915.359,19	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-22	0	418.053.089,27	0,00	0,00	59.915.359,19	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-22	1	415.471.566,81	85.253.223,64	3.562.135,56	59.915.359,19	6.000.000,00	22.900.000,00	3.562.135,56	650445952734,08%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-22	0	412.981.381,82	0,00	0,00	56.353.223,64	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-22	0	410.303.628,30	0,00	0,00	56.353.223,64	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-sep-22	1	407.708.284,03	81.797.392,04	3.455.831,60	56.353.223,64	6.000.000,00	22.900.000,00	3.455.831,60	10808548293702,70%	6.000.000,00	11.508.000.000,00	22.900.000,00	43.922.200.000,00