

F.T.A. UCI 15

**SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.
AVENIDA GRAN VÍA DE HORTALEZA, 3
28033 MADRID**

DENOMINACION DEL FONDO: F.T.A. UCI 15

INFORMACIÓN CORRESPONDIENTE AL: TRIMESTRE/SEMESTRE: 19/06/2017 - 18/09/2017 AÑO: 2017

Personas que asumen la responsabilidad de esta información y cargos que ocupan: IGNACIO ORTEGA GAVARA - DIRECTOR GENERAL Firma:

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	28 abril 2006	Agencia de pago de Bonos	BANCO SANTANDER	
Fecha de Desembolso BT's	05 mayo 2006	Negociación Mercado	AIAF	
Fecha Final Amortización	18 diciembre 2048	Agencias de calificación	FITCH RATINGS STANDARD & POORS	
Sociedad Gestora	SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.	Calificación	Inicial	Actual
	UNIÓN DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, S.A.	B.T.A'S SERIE A	AAA/AAA	BB+ / BBB-
		B.T.A'S SERIE B	A+/A-	B / B
		B.T.A'S SERIE C	BBB+/BBB	CC / B-
		B.T.A'S SERIE D	CCC-/No Rating	CC / No Rating

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO: BONOS DE TITULIZACION

SERIES PRELACION CÓDIGO ISIN	Nº BONOS	NOMINAL EN CIRCULACIÓN			
			Inicial	Actual	%Act/In
B.T.A'S SERIE A ES0380957003	13.406	Nominal Unitario	100.000,00	32.224,58	
		Nominal Total	1.340.600.000,00	432.002.719,48	32,22%
B.T.A'S SERIE B ES0380957011	329	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	32.900.000,00	32.900.000,00	100,00 %
B.T.A'S SERIE C ES0380957029	565	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	56.500.000,00	56.500.000,00	100,00 %
B.T.A'S SERIE D ES0380957037	216	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	21.600.000,00	21.600.000,00	100,00%

AMORTIZACION E INTERESES BONOS					
Actual			Próximo		
Fecha Amortización Período Actual 18 de septiembre de 2017			Fecha Próximo Cupón 18 de diciembre de 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	693,07 €	0,00 €	0,000%	0,00 €	0,00 €
B.T.A'S SERIE B	0,00 €	0,00 €	0,000%	0,00 €	0,00 €
B.T.A'S SERIE C	0,00 €	50,81 €	0,201%	50,81 €	41,15 €
B.T.A'S SERIE D	0,00 €	63,45 €	0,251%	63,45 €	51,39 €
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	13.817	7.685
Saldo Pendiente de Amortizar Derechos	1.430.000.010,21 €	569.735.516,77 €
Importes Unitarios Derechos Vivos	103.495,69 €	74.136,05 €
Tipos de Interés	3,99 %	2,17%

TASAS DE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA	SITUACIÓN ACTUAL
Tasa mensual actual anualizada:	3,06%
Tasa últimos 12 meses anualizada:	3,31%
Tasa anualizada desde Constitución del Fondo	6,12%

MOROSIDAD ACTUAL	Hasta 1 mes	De 1 a 6 meses	Mayor de 6 meses
Deuda Vencida(Principal+Intereses)	54.230,93 €	202.786,64 €	6.311.274,41 €
Deuda Pendiente de vencimiento	0,00 €	0,00 €	566.662.771,46 €
Deuda Total	54.230,93 €	202.786,64 €	572.974.045,87 €

F.T.A. UCI 15**INFORME TRIMESTRAL BONOS DE TITULIZACIÓN**

18 de septiembre de 2017

BONOS TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. PRINCIPAL	
Saldo anterior	552.294.015,90 €
Amortizaciones	9.291.296,42 €
Saldo actual	543.002.719,48 €
% sobre saldo inicial	37,41%
Amortización devengada no pagada	0,00 €

DATOS	
Fecha de determinación	11/09/2017
Fecha de Pago de Cupón Actual	18/09/2017
Fecha de Pago de Cupón Anterior	19/06/2017
Número de días	91
Tipo de referencia (%)	-0,329%
Próxima Fecha de Pago	18/12/2017

BONOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. INTERESES	
Intereses pagados Serie A	0,00 €
Intereses pagados Serie B	0,00 €
Intereses pagados Serie C	28.707,65 €
Intereses pagados Serie D	13.705,20 €
Intereses devengados no pagados	0,00 €

VIDA RESIDUAL (AÑOS)		
	INICIAL	18-sep-17
B.T.A'S SERIE A	3,71	5,50
B.T.A'S SERIE B	6,30	11,01
B.T.A'S SERIE C	6,30	11,01
B.T.A'S SERIE D	6,34	11,01

F.T.A. UCI 15

INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

18 de septiembre de 2017

DERECHOS DE CRÉDITO. PRINCIPAL	
Saldo anterior	579.164.674,23 €
Amortizaciones	9.429.157,46 €
Saldo actual	569.735.516,77 €
Número de derechos de crédito	7.685
LTV	54,68%

DERECHOS DE CRÉDITO. INTERESES	
Intereses cobrados en el trimestre	2.428.145,71 €
Intereses devengados en el trimestre	2.326.616,94 €

DERECHOS DE CRÉDITO CON RETRASOS EN EL PAGO					
	HASTA 30 DÍAS	30 A 60 DÍAS	60 A 90 DÍAS	90 A 180 DÍAS	MÁS DE 180 DÍAS
Principal	34.452,25 €	29.770,18 €	29.639,18 €	51.218,58 €	2.927.665,12 €
Intereses	19.778,68 €	27.168,21 €	24.657,43 €	40.333,06 €	3.383.609,29 €
Saldo de los derechos de crédito	15.981.680,67 €	8.437.804,75 €	5.473.926,26 €	3.352.583,65 €	19.145.964,50 €
Número de derechos de crédito	181	92	52	42	330
% sobre saldo de los derechos de crédito	2,81%	1,48%	0,96%	0,59%	3,36%

PRÉSTAMOS EN WRITE OFF	
Write Off acumulado Fecha Pago anterior	48.470.647,76 €
Write Off trimestre	-137.916,78 €
Write Off acumulados actuales	48.332.730,98 €

F.T.A. UCI 15

INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

18 de septiembre de 2017

ADJUDICADOS	
Saldo anterior	19.017.899,23 €
Diferencia	111.976,56 €
Saldo actual	19.129.875,79 €
Número derechos de crédito adjudicados	371

PERDIDAS DE LA CARTERA	
Saldo anterior	45.682.685,36 €
Diferencia	1.549.878,38 €
Saldo actual	47.232.563,74 €

F.T.A. UCI 15

ESTADO DE ORIGEN Y APLICACIÓN DE FONDOS Y CUENTA DE TESORERÍA

18 de septiembre de 2017

ORIGEN	10.793.863,45 €
PRINCIPAL COBRADO	
Amortización derechos de crédito	7.095.182,76 €
INTERESES COBRADOS	
Intereses de derechos de crédito	2.428.145,71 €
Intereses de reinversión	-20.559,13 €
INGRESOS/GASTOS DE ADJUDICADOS	1.205.054,11 €
INGRESOS/GASTOS DE CANTIDADES ASEGURADAS	86.040,00 €
OTROS	0,00 €

ESTADO CUENTA DE TESORERÍA	21.608.055,05 €
FONDO DE RESERVA	
Saldo anterior	21.600.000,00 €
Reposición en el período	0,00 €
Saldo actual	21.600.000,00 €
RETENCIÓN A CUENTA DEL IRPF	8.055,05 €

APLICACIÓN	10.793.863,45 €
GASTOS ORDINARIOS	4.682,68 €
COMISIÓN S.G.F.T.	27.539,04 €
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	28.707,65 €
FONDOS DISPONIBLES AMORTIZACIÓN A	9.291.296,42 €
INTERESES B.T.A'S SERIE D	13.705,20 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO SANTANDER	0,00 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB	0,00 €
AMORTIZACIÓN PRÉSTAMO SUBORDINADO SANTANDER	0,00 €
AMORTIZACIÓN PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB	0,00 €
COMISIÓN FIJA	6.000,00 €
COMISIÓN VARIABLE	1.421.932,46 €

F.T.A. UCI 15

MEJORA CREDITICIA Y PRÉSTAMO SUBORDINADO

18 de septiembre de 2017

MEJORA DE CRÉDITO		
CONCEPTOS	INICIAL	18 de septiembre de 2017
EMISIÓN SUBORDINADA	89.400.000,00 € (6,25%)	89.400.000,00 € (15,69%)
FONDO DE RESERVA	21.600.000,00 € (1,51%)	21.600.000,00 € (3,79%)

PRÉSTAMOS SUBORDINADOS		
CONCEPTOS	INICIAL	18 de septiembre de 2017
PRÉSTAMO SUBORDINADO SCH		
Saldo vivo	705.000,00 €	0,00 €
Tipo de interés	3,490 %	---
PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB		
Saldo vivo	705.000,00 €	0,00 €
Tipo de interés	3,490 %	---

F.T.A. UCI 15

DEFINICIONES

18 de septiembre de 2017

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.

SALDO ACUMULADO DE FALLIDOS Será el saldo de los préstamos que se encuentren con cuotas pendientes con antigüedad superior a 18 meses, o que hayan empezado el proceso de ejecución de garantías (si dicho proceso acaeciera con anterioridad a los 18 meses desde el primer impago), descontadas las cantidades recuperadas.

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

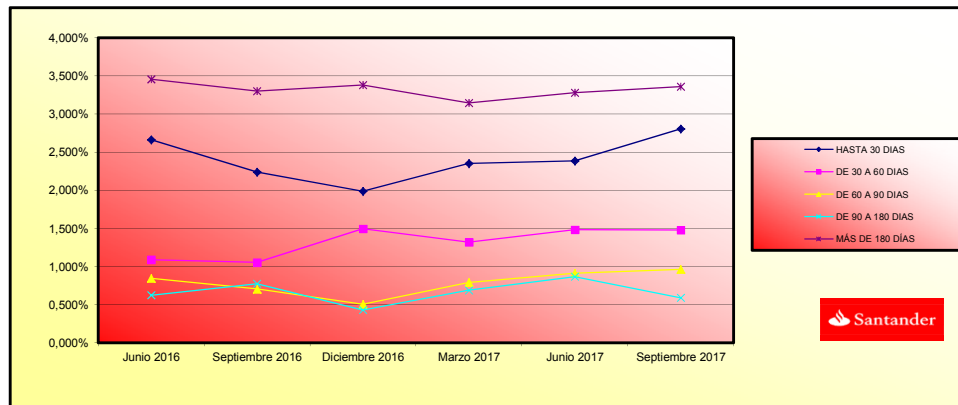
PÉRDIDAS DE LA CARTERA Aquellos préstamos cuya deuda el Cedente considera que no va a recuperar (neto de recuperaciones).

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

FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS
UCI 15

INFORME DE MOROSIDAD

MOROSIDAD HISTÓRICA						
	Junio 2016	Septiembre 2016	Diciembre 2016	Marzo 2017	Junio 2017	Septiembre 2017
HASTA 30 DIAS	2,665%	2,239%	1,990%	2,354%	2,387%	2,805%
DE 30 A 60 DIAS	1,090%	1,053%	1,496%	1,321%	1,484%	1,481%
DE 60 A 90 DIAS	0,845%	0,704%	0,507%	0,792%	0,913%	0,961%
DE 90 A 180 DIAS	0,622%	0,772%	0,431%	0,688%	0,868%	0,588%
MÁS DE 180 DIAS	3,457%	3,301%	3,383%	3,148%	3,280%	3,361%



FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS
UCI 15

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS TRIGGERS
18 DE SEPTIEMBRE DE 2017

TRIGGERS BONOS	
1. SI 1.a) ES MAYOR QUE 1.b) NO SE AMORTIZA LA SERIE B Y C:	
1.a) MOROSIDAD SUPERIOR A 90 DÍAS	70.831.279,13 €
1.b) 2% SALDO VIVO DERECHOS DE CREDITO	11.394.710,34 €

SE HA ALCANZADO EL TRIGGER DE AMORTIZACIÓN, POR LO QUE LAS SERIES B y C NO SE AMORTIZAN.

TRIGGERS FONDO DE RESERVA	
1. SI 1.a) ES INFERIOR QUE 1.b) NO SE AMORTIZA EL FONDO DE RESERVA:	
1.a) SALDO VIVO DE LOS ACTIVOS	569.735.516,77 €
1.b) 10% SALDO INICIAL DE LOS ACTIVOS	143.000.001,02 €
2. SI 2.a) ES INFERIOR QUE 2.b) NO SE AMORTIZA EL FONDO DE RESERVA:	
2.a) TIPO DE INTERÉS MEDIO PONDERADO DE LOS ACTIVOS	2,17%
2.b) TIPO DE INTERÉS MEDIO PONDERADO DE LOS BONOS + 0,40%	0,28%

NO SE HAN ALCANZADO LOS TRIGGERS.

NIVELES DEL FONDOS DE RESERVA SEGÚN LA MOROSIDAD		
MOROSIDAD ACTUAL < 0,75%	MAYOR DE 3% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO 0,4% DEL SALDO INICIAL BONOS	N/A
MOROSIDAD ACTUAL ENTRE 0,75% Y 1,25%	MAYOR DE 3% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO 0,70% DEL SALDO INICIAL DERECHOS	N/A
MOROSIDAD ACTUAL > 1,25%	MAYOR DE 3% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO 0,80% DEL SALDO INICIAL DERECHOS	21.600.000,00 €

MOROSIDAD SUPERIOR A 90 DÍAS SUPERA EL LÍMITE DEL 1,25%, POR TANTO, EL FONDO DE RESERVA NO PUEDE DISMINUIR

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	441.294.015,90 €
2) SALDO VIVO DERECHOS DE CRÉDITO (SIN MOROSIDAD SUPERIOR A 18 MESES)	515.702.378,56 €
3) REMANENTE F.DISPONIBLES DESPUÉS PAGO PUNTOS 1° - 4°	32.361.641,73 €
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	474.194.015,90 €
2) SALDO VIVO DERECHOS DE CRÉDITO (SIN MOROSIDAD SUPERIOR A 18 MESES)	515.702.378,56 €
3) REMANENTE F.DISPONIBLES DESPUÉS PAGO PUNTOS 1° - 5°	32.332.934,08 €

NO SE POSTERGAN LOS INTERESES DE LA SERIE B

NO SE POSTERGAN LOS INTERESES DE LA SERIE C

REMANENTE INTERESES	Importe
Saldo actual	2.346.657,21 €

SI 1.a) ES MAYOR QUE 9,60% SALDO INICIAL DC's, SE POSTERGARÁN LOS INTERESES DE LAS SERIES B ó C, EN SU CASO	NO
i.a) SALDO ACUMULADO DE PRÉSTAMOS FALLIDOS ES LA SUMA DE i) + ii)	55.434.514,32 €
i). SALDO DC's MOROSIDAD > 18 MESES	54.033.138,21 €
ii). SALDO DC's JUDICIALES CON MOROSIDAD < 18 MESES	1.401.376,11 €
PORCENTAJE ACTUAL	3,88%

CONTRATO	CONTRAPARTE	AGENCIA RATING	RATING MÍNIMO EXIGIDO	RATING ACTUAL
CUENTA TESORERÍA	BANCO SANTANDER	S&P FITCH	A-1 c/p F-1 c/p	A-2 c/p F-2 c/p
AGENTE DE PAGOS	BANCO SANTANDER	S&P FITCH	A-1 c/p F-1 c/p	A-2 c/p F-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.

ESTADÍSTICO DE VALORES DE TASACIÓN ACTUALES SOBRE SALDOS VIVOS				
	SALDO VIVO (MILES)	% SALDOS VIVOS	Nº PRÉSTAMOS	% Nº DE PRÉSTAMOS
0,20 - 39,99	73.913.873,47 €	13,77%	1.130	21,42%
40,00 - 49,99	71.233.906,86 €	13,27%	641	12,15%
50,00 - 59,99	100.400.805,98 €	18,71%	925	17,53%
60,00 - 69,99	164.615.018,80 €	30,67%	1.554	29,45%
70,00 - 79,99	100.077.499,16 €	18,65%	818	15,50%
80,00 - 94,83	26.495.164,78 €	4,94%	208	3,94%
	536.736.269,05 €	100,00%	5.276	100,00%

F.T.A. UCI 15

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	CPR	Monthly single monthly	CPR
			0.53%					3.31%
01-06-06	1.430.000.000,00		100,00%	100,00%				
01-07-06	1.427.867.898,67	1.380.043.487,53	99,47%	96,65%	3,35%	33,56%	3,35%	33,56%
01-08-06	1.425.729.199,74	1.353.249.969,08	96,95%	94,92%	2,57%	26,88%	1,79%	19,53%
01-09-06	1.423.583.389,63	1.327.391.212,12	96,43%	93,24%	2,31%	24,41%	1,76%	19,22%
01-10-06	1.421.430.444,70	1.315.940.418,08	97,92%	92,55%	1,92%	20,73%	0,74%	8,56%
01-11-06	1.419.270.341,23	1.297.490.943,21	97,40%	91,42%	1,78%	19,37%	1,22%	13,72%
01-12-06	1.417.103.055,41	1.275.442.619,04	96,89%	90,00%	1,74%	18,99%	1,55%	17,08%
01-01-07	1.414.928.563,38	1.258.146.654,54	96,38%	88,92%	1,66%	18,24%	1,20%	13,53%
01-02-07	1.412.746.941,15	1.237.697.663,55	95,87%	87,61%	1,64%	18,00%	1,47%	16,32%
01-03-07	1.410.562.896,70	1.223.628.940,59	95,37%	86,29%	1,57%	17,27%	0,98%	11,18%
01-04-07	1.408.381.609,90	1.204.243.585,17	94,87%	85,51%	1,55%	17,13%	1,43%	15,88%
01-05-07	1.406.158.052,55	1.179.024.458,45	94,37%	83,85%	1,59%	17,48%	1,94%	20,96%
01-06-07	1.403.947.168,38	1.161.496.331,55	93,88%	82,73%	1,57%	17,27%	1,33%	14,86%
01-07-07	1.401.728.933,02	1.142.960.875,12	93,38%	81,54%	1,56%	17,17%	1,44%	15,98%
01-08-07	1.397.270.310,87	1.101.396.337,69	92,40%	78,82%	1,57%	17,33%	1,77%	19,31%
01-09-07	1.395.029.874,95	1.091.486.277,77	91,92%	78,24%	1,52%	16,81%	0,74%	8,53%
01-10-07	1.392.211.681,82	1.070.351.579,59	91,44%	77,21%	1,51%	16,69%	1,47%	14,72%
01-11-07	1.390.526.830,00	1.064.435.247,80	90,98%	76,55%	1,47%	16,32%	0,86%	9,80%
01-12-07	1.388.263.771,35	1.052.639.111,52	90,48%	75,82%	1,45%	16,04%	0,95%	10,79%
01-01-08	1.385.993.388,69	1.042.056.670,85	90,00%	75,18%	1,42%	15,73%	0,84%	9,66%
01-02-08	1.383.715.457,01	1.031.569.624,24	89,53%	74,55%	1,39%	15,45%	0,94%	9,96%
01-03-08	1.381.429.951,21	1.022.457.994,61	89,06%	74,01%	1,36%	15,14%	0,72%	8,30%
01-04-08	1.379.136.846,10	1.014.169.355,03	88,59%	73,54%	1,33%	14,82%	0,65%	7,48%
01-05-08	1.376.836.116,41	1.006.555.566,61	88,13%	73,11%	1,30%	14,50%	0,58%	6,80%
01-06-08	1.374.527.736,80	998.594.597,38	87,66%	72,65%	1,27%	14,22%	0,63%	7,25%
01-07-08	1.372.211.681,82	990.375.042,13	87,20%	72,20%	1,25%	13,98%	0,73%	7,80%
01-08-08	1.369.887.925,97	983.543.547,82	86,75%	71,80%	1,22%	13,69%	0,50%	5,85%
01-09-08	1.367.556.443,62	985.241.602,52	86,29%	72,04%	1,16%	13,11%	-0,34%	-4,20%
01-10-08	1.365.217.209,10	980.988.583,26	85,84%	71,86%	1,13%	12,78%	0,26%	3,09%
01-11-08	1.362.870.196,62	967.051.291,16	85,39%	70,96%	1,14%	12,82%	1,25%	14,02%
01-12-08	1.360.515.300,33	960.585.402,33	84,94%	70,66%	1,11%	12,58%	0,45%	4,87%
01-01-09	1.358.153.338,83	954.925.810,28	84,49%	70,31%	1,09%	12,37%	0,50%	5,81%
01-02-09	1.355.783.443,56	950.099.266,39	84,05%	70,08%	1,07%	12,13%	0,33%	3,91%
01-03-09	1.353.405.668,37	944.260.166,47	83,61%	69,77%	1,05%	11,93%	0,44%	5,15%
01-04-09	1.351.019.987,09	938.820.045,34	83,17%	69,34%	1,04%	11,80%	0,51%	7,11%
01-05-09	1.348.628.373,42	931.491.274,54	82,73%	69,07%	1,02%	11,60%	0,39%	4,81%
01-06-09	1.346.224.800,98	925.020.233,76	82,30%	68,71%	1,01%	11,46%	0,52%	6,04%
01-07-09	1.343.815.536,75	916.684.022,78	81,86%	68,22%	1,00%	11,38%	0,72%	8,34%
01-08-09	1.341.398.261,71	909.495.828,22	81,43%	67,80%	0,99%	11,27%	0,61%	7,03%
01-09-09	1.338.981.924,24	904.644.124,40	81,01%	67,40%	0,98%	11,10%	0,45%	4,16%
01-10-09	1.336.539.572,60	898.264.885,57	80,58%	67,21%	0,96%	10,98%	0,52%	6,11%
01-11-09	1.334.098.104,99	890.862.284,36	80,16%	66,78%	0,96%	10,90%	0,64%	7,44%
01-12-09	1.331.648.519,50	884.524.551,82	79,74%	66,42%	0,95%	10,79%	0,53%	6,16%
01-01-10	1.329.191.054,09	877.748.978,70	79,32%	66,04%	0,94%	10,70%	0,58%	6,77%
01-02-10	1.326.725.427,62	869.514.837,72	78,90%	65,67%	0,93%	10,61%	0,66%	7,53%
01-03-10	1.324.251.582,90	863.787.994,90	78,49%	65,23%	0,92%	10,55%	0,47%	5,53%
01-04-10	1.321.769.522,69	857.025.226,48	78,07%	64,84%	0,92%	10,47%	0,60%	6,93%
01-05-10	1.319.279.209,62	851.593.316,56	77,66%	64,55%	0,91%	10,37%	0,45%	5,23%
01-06-10	1.316.843.896,26	845.767.853,41	77,25%	64,26%	0,90%	10,27%	0,55%	5,79%
01-07-10	1.314.274.959,22	836.928.310,84	76,85%	63,88%	0,90%	10,27%	0,86%	9,81%
01-08-10	1.311.760.970,88	828.049.732,05	76,45%	63,13%	0,90%	10,26%	0,87%	9,97%
01-09-10	1.309.238.623,52	822.803.112,58	76,05%	62,85%	0,89%	10,16%	0,44%	5,18%
01-10-10	1.306.707.899,36	815.621.494,23	75,65%	62,42%	0,89%	10,12%	0,68%	7,87%
01-11-10	1.304.184.760,50	809.499.327,95	75,25%	62,07%	0,88%	10,06%	0,69%	7,91%
01-12-10	1.301.621.148,98	802.308.952,86	74,85%	61,64%	0,88%	10,02%	0,69%	8,01%
01-01-11	1.299.071.461,15	797.750.452,49	74,46%	61,41%	0,87%	9,92%	0,37%	4,39%
01-02-11	1.296.513.295,61	791.819.492,28	74,07%	61,07%	0,86%	9,86%	0,55%	6,38%
01-03-11	1.293.946.824,16	787.659.136,58	73,68%	60,66%	0,85%	9,77%	0,41%	4,16%
01-04-11	1.291.371.418,54	781.979.146,09	73,29%	60,55%	0,85%	9,70%	0,50%	5,81%
01-05-11	1.288.787.650,35	777.549.645,46	72,91%	60,33%	0,84%	9,61%	0,37%	4,34%
01-06-11	1.286.195.291,14	773.708.773,59	72,53%	60,15%	0,83%	9,51%	0,29%	3,46%
01-07-11	1.283.595.617,63	769.406.717,01	72,15%	59,94%	0,82%	9,43%	0,35%	4,17%
01-08-11	1.280.987.300,21	761.747.749,92	71,77%	59,74%	0,81%	9,35%	0,43%	5,09%
01-09-11	1.278.370.310,13	760.413.358,28	71,39%	59,48%	0,81%	9,28%	-0,03%	-0,35%
01-10-11	1.275.744.618,56	758.448.666,20	71,01%	59,45%	0,80%	9,15%	0,05%	0,64%
01-11-11	1.273.110.196,56	754.407.680,14	70,64%	59,26%	0,79%	9,08%	0,33%	3,85%
01-12-11	1.270.467.015,12	749.435.478,37	70,27%	59,09%	0,78%	9,02%	0,21%	2,50%
01-01-12	1.267.815.045,09	747.518.363,38	69,90%	58,96%	0,77%	8,90%	0,05%	0,56%
01-02-12	1.265.154.257,26	744.179.051,10	69,53%	58,82%	0,77%	8,82%	0,24%	2,81%
01-03-12	1.262.484.622,32	739.194.434,50	69,17%	58,55%	0,76%	8,77%	0,46%	5,38%
01-04-12	1.259.806.110,84	737.587.615,18	68,81%	58,55%	0,75%	8,65%	0,01%	0,06%
01-05-12	1.257.118.993,30	734.949.257,75	68,44%	58,46%	0,74%	8,56%	0,44%	4,73%
01-06-12	1.254.422.340,11	730.750.161,83	68,08%	58,25%	0,74%	8,50%	0,36%	4,21%
01-07-12	1.251.718.239,23	728.537.502,40	67,73%	58,20%	0,73%	8,40%	0,09%	1,04%
01-08-12	1.249.005.147,21	722.727.126,46	67,37%	57,86%	0,73%	8,38%	0,58%	6,77%
01-09-12	1.246.283.034,17	722.855.309,26	67,02%	57,62%	0,72%	8,25%	0,11%	2,53%
01-10-12	1.243.551.870,10	719.397.608,24	66,67%	57,85%	0,71%	8,18%	0,23%	2,75%
01-11-12	1.240.811.624,90	716.897.587,68	66,32%	57,78%	0,70%	8,09%	0,13%	1,52%
01-12-12	1.238.062.268,40	715.024.387,15	65,97%	57,75%	0,69%	8,00%	0,04%	0,48%
01-01-13	1.235.313.459,17	710.548.918,39	65,62%	57,52%	0,69%	7,96%	0,40%	4,75%
01-02-13	1.232.565.810,14	709.026.493,50	65,28%	57,44%	0,68%	7,89%	0,13%	1,57%
01-03-13	1.229.788.390,94	705.716.537,85	64,93%	57,39%	0,68%	7,81%	0,10%	1,22%
01-04-13	1.227.012.071,07	701.317.631,74	64,59%	57,16%	0,67%	7,77%	0,40%	4,68%
01-05-13	1.224.226.519,93	698.775.192,19	64,25%	57,08%	0,67%	7,70%	0,14%	1,62%
01-06-13	1.221.431.036,83	696.754.375,50	63,92%	57,04%	0,66%	7,62%	0,08%	0,73%
01-07-13	1.218.627.810,35	692.997.742,83	63,58%	56,87%	0,65%	7,57%	0,31%	3,66%
01-08-13	1.215.814.590,91	690.830.156,58	63,25%	56,82%	0,65%	7,50%	0,08%	0,98%
01-09-13	1.212.992.017,52	687.831.601,50	62,91%	56,71%	0,64%	7,44%	0,20%	2,40%
01-10-13	1.210.160.059,07	684.142.259,43	62,58%	56,53%	0,64%	7,40%	0,30%	3,58%
01-11-13	1.207.318.694,35	681.407.343,26	62,25%	56,40%	0,63%	7,34%	0,24%	2,34%
01-12-13	1.204.467.932,07	678.389.936,27	61,93%	56,32%	0,63%	7,29%	0,21%	2,46%
01-01-14	1.201.609.812,79	672.727.092,66	61,60%	55,99%	0,63%	7,29%	0,60%	6,95%
01-02-14	1.198.742.260,49	669.741.168,36	61,28%	55,87%	0,62%	7,24%	0,21%	2,44%
01-03-14	1.195.865.173,58	666.294.362,96	60,96%	55,80%	0,62%	7,20%	0,20%	3,19%
01-04-14	1.192.978.520,36	660.791.682,01	60,64%	55,59%	0,62%	7,19%	0,57%	6,86%
01-05-14	1.190.082.269,02	657.294.908,44	60,32%	55,23%	0,62%	7,		

Fecha	Principal disponible	Amortización de principal	Serie A	Serie B	Serie C	Serie D	Suma de todas las clases	% Serie B	% Serie C	Amortización Serie A	Vida Media A	Amortización Serie B	Vida Media B	Amortización Serie C	Vida Media C	Amortización Serie D	Vida Media D
Date	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Class D	Sum of all classes	% Class B	% Class C	Redemption Class A	5.50 Average Life A	Redemption Class B	11.01 Average Life B	Redemption Class C	11.01 Average Life C	Redemption Class D	11.01 Average Life D
	1.451.600.000,00	1.430.000.000,00															
08-05-06	1.430.000.000,00	0,00	1.340.600.000,00	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00					0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-06-06	1.420.368.521,62	0,00	1.340.600.000,00	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00					0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-07-06	1.410.792.240,02	0,00	1.340.600.000,00	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00					0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-08-06	1.401.270.369,87	0,00	1.340.600.000,00	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00					0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-09-06	1.391.802.617,38	38.197.382,62	1.340.600.000,00	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.430.000.000,00	2,306699%	3,951049%	38.197.382,62	-153.477.083.356	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-10-06	1.382.388.690,34	0,00	1.302.402.617,38	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.391.802.617,38	2,363841%	4,059484%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-11-06	1.373.028.298,06	0,00	1.302.402.617,38	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.391.802.617,38	2,363841%	4,059484%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-12-06	1.363.721.151,43	28.081.465,95	1.302.402.617,38	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.391.802.617,38	2,363841%	4,059484%	28.081.465,95	-110.275.916.790	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-01-07	1.354.466.962,85	0,00	1.274.321.151,43	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.382.388.690,34	2,412517%	4,143076%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-02-07	1.345.265.446,24	0,00	1.274.321.151,43	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.382.388.690,34	2,412517%	4,143076%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-03-07	1.336.116.317,06	27.604.834,37	1.274.321.151,43	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.382.388.690,34	2,412517%	4,143076%	27.604.834,37	-105.919.749.474	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-04-07	1.327.019.292,27	0,00	1.246.716.317,06	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.336.116.317,06	2,462360%	4,228674%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-05-07	1.317.974.090,33	0,00	1.246.716.317,06	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.336.116.317,06	2,462360%	4,228674%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-06-07	1.308.980.431,18	27.135.885,88	1.246.716.317,06	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.336.116.317,06	2,462360%	4,228674%	27.135.885,88	-101.623.892.625	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-07-07	1.300.036.036,29	0,00	1.219.580.431,18	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.308.980.431,18	2,513407%	4,316336%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-08-07	1.291.119.629,43	0,00	1.219.580.431,18	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.308.980.431,18	2,513407%	4,316336%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-09-07	1.282.305.932,35	26.674.498,83	1.219.580.431,18	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.308.980.431,18	2,513407%	4,316336%	26.674.498,83	-97.441.944.214	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-10-07	1.273.515.673,57	0,00	1.192.905.932,35	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.282.305.932,35	2,565690%	4,406125%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-11-07	1.264.775.579,50	0,00	1.192.905.932,35	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.282.305.932,35	2,565690%	4,406125%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-12-07	1.256.085.378,90	26.220.553,46	1.192.905.932,35	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.282.305.932,35	2,565690%	4,406125%	26.220.553,46	-93.397.611.424	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-01-08	1.247.444.801,95	0,00	1.166.685.378,90	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.256.085.378,90	2,619249%	4,498102%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-02-08	1.238.853.580,29	0,00	1.166.685.378,90	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.256.085.378,90	2,619249%	4,498102%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-03-08	1.230.311.446,99	25.773.931,92	1.166.685.378,90	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.256.085.378,90	2,619249%	4,498102%	25.773.931,92	-89.461.317.685	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-04-08	1.221.818.136,47	0,00	1.140.911.446,98	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.230.311.446,98	2,674120%	4,592333%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-05-08	1.213.373.384,64	0,00	1.140.911.446,98	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.230.311.446,98	2,674120%	4,592333%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-06-08	1.204.976.928,79	25.334.518,19	1.140.911.446,98	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.230.311.446,98	2,674120%	4,592333%	25.334.518,19	-85.605.336.971	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-07-08	1.196.628.507,57	0,00	1.115.576.928,79	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.204.976.928,79	2,730343%	4,688866%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-08-08	1.188.327.861,05	0,00	1.115.576.928,79	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.204.976.928,79	2,730343%	4,688866%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-09-08	1.180.074.730,69	24.902.198,10	1.115.576.928,79	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.204.976.928,79	2,730343%	4,688866%	24.902.198,10	-81.853.525.157	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-10-08	1.171.868.859,28	0,00	1.090.674.730,69	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.180.074.730,69	2,787959%	4,787322%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-11-08	1.163.090.801,01	0,00	1.090.674.730,69	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.180.074.730,69	2,787959%	4,787322%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-12-08	1.155.597.871,43	24.476.859,26	1.090.674.730,69	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.180.074.730,69	2,787959%	4,787322%	24.476.859,26	-78.228.042.188	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-01-09	1.147.532.758,23	0,00	1.066.197.871,43	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.155.597.871,43	2,847011%	4,889244%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-02-09	1.139.513.885,16	0,00	1.066.197.871,43	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.155.597.871,43	2,847011%	4,889244%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-03-09	1.131.541.001,81	24.056.869,62	1.066.197.871,43	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.155.597.871,43	2,847011%	4,889244%	24.056.869,62	-74.720.637.031	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-04-09	1.123.613.859,11	0,00	1.042.141.001,81	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.131.541.001,81	2,907539%	4,993191%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-05-09	1.115.732.209,30	0,00	1.042.141.001,81	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.131.541.001,81	2,907539%	4,993191%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-06-09	1.107.895.805,95	23.645.195,86	1.042.141.001,81	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.131.541.001,81	2,907539%	4,993191%	23.645.195,86	-71.266.620.336	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-07-09	1.100.104.644,13	0,00	1.018.495.805,95	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.107.895.805,95	2,969593%	5,099758%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-08-09	1.092.358.238,09	0,00	1.018.495.805,95	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.107.895.805,95	2,969593%	5,099758%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-09-09	1.084.656.345,29	23.239.460,65	1.018.495.805,95	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.107.895.805,95	2,969593%	5,099758%	23.239.460,65	-67.905.704.027	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-10-09	1.076.998.724,51	0,00	995.256.345,29	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.084.656.345,29	3,033219%	5,209023%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-11-09	1.069.385.135,78	0,00	995.256.345,29	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.084.656.345,29	3,033219%	5,209023%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-12-09	1.061.815.340,23	22.841.004,87	995.256.345,29	32.900.000,00	56.500.000,00	21.600.000,00	1.084.656.345,29	3,033219%	5,209023%	22.841.004,87	-64.662.884.778	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
11-01-10	1.054.289.311,41	0,00	972.415.340,43	32.900.000,00													

Fecha	Principal disponible	principal	Serie A	Serie B	Serie C	Serie D	las clases	% Serie A	% Serie C	A	Vida media A	Serie B	Vida media B	Serie C	Vida media C	Serie D	Vida media D
Date	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Class D	Sum of all classes	% Class B	% Class C	Redemption Class A	Average Life A	Redemption Class B	Average Life B	Redemption Class C	Average Life C	Redemption Class D	Average Life D
11-10-13	0	757.356.943.99	0.00	673.737.386.73	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	763.137.386.73	4.311150%	7.403647%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-11-13	0	751.610.307.51	0.00	673.737.386.73	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	763.137.386.73	4.311150%	7.403647%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-12-13	1	745.897.293.03	17.240.093.70	673.737.386.73	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	763.137.386.73	4.311150%	7.403647%	17.240.093.70	-23.618.928.364	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-01-14	0	740.219.176.54	0.00	673.737.386.73	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	745.897.293.03	4.410795%	7.574769%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-02-14	0	734.574.162.48	0.00	656.497.293.03	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	745.897.293.03	4.410795%	7.574769%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-03-14	1	728.962.285.59	16.935.007.44	656.497.293.03	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	745.897.293.03	4.410795%	7.574769%	16.935.007.44	-21.676.809.529	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-04-14	0	723.383.293.54	0.00	639.562.285.59	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	728.962.285.59	4.513265%	7.750744%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-05-14	0	717.837.007.00	0.00	639.562.285.59	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	728.962.285.59	4.513265%	7.750744%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-06-14	1	712.323.247.57	16.639.038.01	639.562.285.59	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	728.962.285.59	4.513265%	7.750744%	16.639.038.01	-19.767.177.161	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-07-14	0	706.842.176.77	0.00	622.923.247.57	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	712.323.247.57	4.618690%	7.931792%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-08-14	0	701.393.276.70	0.00	622.923.247.57	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	712.323.247.57	4.618690%	7.931792%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-09-14	1	695.376.371.82	16.346.875.76	622.923.247.57	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	712.323.247.57	4.618690%	7.931792%	16.346.875.76	-17.916.175.828	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-10-14	0	690.591.287.51	0.00	606.576.371.82	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	695.976.371.82	4.727172%	8.118092%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-11-14	0	685.237.850.09	0.00	606.576.371.82	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	695.976.371.82	4.727172%	8.118092%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-12-14	1	679.915.886.81	16.060.485.01	606.576.371.82	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	695.976.371.82	4.727172%	8.118092%	16.060.485.01	-16.140.787.430	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-01-15	0	674.627.946.38	0.00	590.515.886.81	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	679.915.886.81	4.838834%	8.309851%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-02-15	0	669.371.117.74	0.00	590.515.886.81	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	679.915.886.81	4.838834%	8.309851%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-03-15	1	664.145.231.02	15.770.655.79	590.515.886.81	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	679.915.886.81	4.838834%	8.309851%	15.770.655.79	-14.430.150.047	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-04-15	0	658.950.177.23	0.00	574.745.231.02	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	664.145.231.02	4.953736%	8.507175%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-05-15	0	653.785.608.24	0.00	574.745.231.02	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	664.145.231.02	4.953736%	8.507175%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-06-15	1	648.651.536.89	15.493.694.13	574.745.231.02	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	664.145.231.02	4.953736%	8.507175%	15.493.694.13	-12.751.310.272	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-07-15	0	643.551.087.88	0.00	559.251.536.89	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	648.651.536.89	5.072061%	8.710378%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-08-15	0	638.480.720.66	0.00	559.251.536.89	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	648.651.536.89	5.072061%	8.710378%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-09-15	1	633.440.270.83	15.211.266.06	559.251.536.89	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	648.651.536.89	5.072061%	8.710378%	15.211.266.06	-11.119.435.490	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-10-15	0	628.429.574.87	0.00	544.040.270.83	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	633.440.270.83	5.193860%	8.919547%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-11-15	0	624.440.270.83	0.00	544.040.270.83	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	633.440.270.83	5.193860%	8.919547%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-12-15	0	618.496.794.81	14.943.476.02	544.040.270.83	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	633.440.270.83	5.193860%	8.919547%	14.943.476.02	-9.563.824.655	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-01-16	0	613.593.047.92	0.00	529.096.794.81	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	618.496.794.81	5.319349%	9.130551%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-02-16	0	608.718.275.20	0.00	529.096.794.81	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	618.496.794.81	5.319349%	9.130551%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-03-16	1	603.872.318.18	14.624.476.62	529.096.794.81	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	618.496.794.81	5.319349%	9.130551%	14.624.476.62	-8.028.837.665	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-04-16	0	599.055.019.30	0.00	514.472.318.18	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	603.872.318.18	5.448172%	9.356282%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-05-16	0	594.266.221.78	0.00	514.472.318.18	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	603.872.318.18	5.448172%	9.356282%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-06-16	1	589.505.769.72	14.366.548.46	514.472.318.18	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	603.872.318.18	5.448172%	9.356282%	14.366.548.46	-6.565.512.647	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-07-16	0	584.773.025.79	0.00	500.105.769.72	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	589.505.769.72	5.580466%	9.584300%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-08-16	0	580.069.282.45	0.00	500.105.769.72	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	589.505.769.72	5.580466%	9.584300%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-09-16	1	575.392.939.55	14.112.830.17	500.105.769.72	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	589.505.769.72	5.580466%	9.584300%	14.112.830.17	-5.151.183.012	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-10-16	0	570.744.326.70	0.00	485.992.939.55	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	575.392.939.55	5.717832%	9.819377%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-11-16	0	566.123.292.11	0.00	485.992.939.55	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	575.392.939.55	5.717832%	9.819377%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-12-16	1	561.529.684.76	13.863.254.79	485.992.939.55	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	575.392.939.55	5.717832%	9.819377%	13.863.254.79	-3.798.531.812	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-01-17	0	556.963.943.56	0.00	472.129.684.76	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	561.529.684.76	5.858996%	10.061801%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-02-17	0	552.425.325.79	0.00	472.129.684.76	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	561.529.684.76	5.858996%	10.061801%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-03-17	1	547.913.682.89	13.616.001.87	472.129.684.76	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	561.529.684.76	5.858996%	10.061801%	13.616.001.87	-2.505.344.344	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-04-17	0	543.428.867.07	0.00	458.513.682.89	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	547.913.682.89	6.004595%	10.311843%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-05-17	0	538.970.731.36	0.00	458.513.682.89	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	547.913.682.89	6.004595%	10.311843%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-06-17	1	534.539.129.53	13.374.553.36	458.513.682.89	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	547.913.682.89	6.004595%	10.311843%	13.374.553.36	-1.230.458.909	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-07-17	0	530.134.154.14	0.00	445.139.129.53	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	534.539.129.53	6.154835%	10.569853%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-08-17	0	525.755.420.87	0.00	445.139.129.53	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	534.539.129.53	6.154835%	10.569853%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-09-17	1	521.402.785.79	13.136.343.74	445.139.129.53	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	534.539.129.53	6.154835%	10.569853%	13.136.343.74	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-10-17	0	517.076.105.87	0.00	432.002.785.79	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	521.402.785.79	6.309901%	10.836152%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11-11-17	0	512.775.238.75	0.00	432.002.785.79	32.900.000.00	56.500.000.00	21.600.000.00	521.402.785.79	6.309901%	10.836152%</							

Date	Principal Available	Principal Redemption	Series A				Series B				Series C				Series D					
			Class A	Class B	Class C	Class D	Class A	Class B	Class C	Class D	Class A	Class B	Class C	Class D	Class A	Class B	Class C	Class D		
11-10-21	0	338,324,276.35	0.00	252,103,162.12	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	341,503,162.12	9,633879%	16,544503%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-11-21	0	335,164,780.37	0.00	252,103,162.12	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	341,503,162.12	9,633879%	16,544503%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-12-21	1	332,024,567.10	9,478,595.02	252,103,162.12	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	341,503,162.12	9,633879%	16,544503%	9,478,595.02	14,710,779.470	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-01-22	0	328,905,874.26	0.00	242,624,567.10	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	332,024,567.10	9,908090%	17,016813%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-02-22	0	325,805,838.22	0.00	242,624,567.10	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	332,024,567.10	9,908090%	17,016813%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-03-22	1	322,724,950.75	9,299,616.35	242,624,567.10	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	332,024,567.10	9,908090%	17,016813%	9,299,616.35	15,269,970.048	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-04-22	0	319,662,908.11	0.00	233,324,950.75	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	322,724,950.75	10,194440%	17,507168%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-05-22	0	316,619,606.15	0.00	233,324,950.75	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	322,724,950.75	10,194440%	17,507168%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-06-22	1	313,594,941.26	9,130,009.48	233,324,950.75	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	322,724,950.75	10,194440%	17,507168%	9,130,009.48	15,831,436.442	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-07-22	0	310,589,193.36	0.00	224,194,941.26	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	313,594,941.26	10,491241%	18,016872%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-08-22	0	307,601,874.26	0.00	224,194,941.26	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	313,594,941.26	10,491241%	18,016872%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-09-22	1	304,632,881.98	8,962,059.29	224,194,941.26	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	313,594,941.26	10,491241%	18,016872%	8,962,059.29	16,364,720.259	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-10-22	0	301,682,115.19	0.00	215,232,881.98	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	304,632,881.98	10,799885%	18,546914%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-11-22	0	298,749,473.04	0.00	215,232,881.98	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	304,632,881.98	10,799885%	18,546914%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-12-22	1	295,834,855.22	8,798,026.76	215,232,881.98	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	304,632,881.98	10,799885%	18,546914%	8,798,026.76	16,865,817.291	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-01-23	0	292,939,837.94	0.00	206,434,855.22	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	295,834,855.22	11,121070%	19,098493%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-02-23	0	290,062,633.94	0.00	206,434,855.22	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	295,834,855.22	11,121070%	19,098493%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-03-23	1	287,203,144.59	8,631,710.63	206,434,855.22	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	295,834,855.22	11,121070%	19,098493%	8,631,710.63	17,323,843.244	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-04-23	0	284,361,271.88	0.00	197,803,144.59	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	287,203,144.59	11,455306%	19,672487%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-05-23	0	281,536,917.93	0.00	197,803,144.59	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	287,203,144.59	11,455306%	19,672487%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-06-23	1	278,729,986.00	8,473,158.59	197,803,144.59	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	287,203,144.59	11,455306%	19,672487%	8,473,158.59	17,785,159.877	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-07-23	0	275,941,007.51	0.00	189,329,986.00	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	278,729,986.00	11,803538%	20,270514%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-08-23	0	273,169,253.85	0.00	189,329,986.00	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	278,729,986.00	11,803538%	20,270514%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-09-23	1	270,414,629.56	8,315,356.44	189,329,986.00	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	278,729,986.00	11,803538%	20,270514%	8,315,356.44	18,218,945.958	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-10-23	0	267,677,039.66	0.00	181,014,629.56	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	270,414,629.56	12,166502%	20,893840%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-11-23	0	264,946,389.70	0.00	181,014,629.56	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	270,414,629.56	12,166502%	20,893840%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-12-23	0	262,252,585.72	8,162,043.84	172,852,585.72	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	262,252,585.72	12,545168%	21,544116%	8,162,043.84	18,625,784.052	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-01-24	0	259,569,532.60	0.00	172,852,585.72	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	262,252,585.72	12,545168%	21,544116%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-02-24	0	256,903,110.28	0.00	172,852,585.72	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	262,252,585.72	12,545168%	21,544116%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-03-24	1	254,253,226.50	7,999,359.22	172,852,585.72	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	262,252,585.72	12,545168%	21,544116%	7,999,359.22	18,982,479.421	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-04-24	0	251,619,789.45	0.00	164,853,226.50	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	254,253,226.50	12,939855%	22,221940%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-05-24	0	249,002,707.83	0.00	164,853,226.50	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	254,253,226.50	12,939855%	22,221940%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-06-24	1	246,401,890.84	7,851,335.66	164,853,226.50	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	254,253,226.50	12,939855%	22,221940%	7,851,335.66	19,353,542.410	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-07-24	0	243,618,890.84	0.00	157,001,890.84	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	246,401,890.84	13,352170%	22,930019%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-08-24	0	241,251,287.97	0.00	157,001,890.84	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	246,401,890.84	13,352170%	22,930019%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-09-24	1	238,700,009.85	7,701,880.99	157,001,890.84	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	246,401,890.84	13,352170%	22,930019%	7,701,880.99	19,693,709.685	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-10-24	0	236,164,628.68	0.00	149,300,009.85	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	238,700,009.85	13,782991%	23,669878%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-11-24	0	233,645,056.11	0.00	149,300,009.85	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	238,700,009.85	13,782991%	23,669878%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-12-24	1	231,141,204.27	7,558,805.58	149,300,009.85	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	238,700,009.85	13,782991%	23,669878%	7,558,805.58	20,015,717.171	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-01-25	0	228,658,676.92	0.00	141,741,204.27	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	231,141,204.27	14,233724%	24,443933%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-02-25	0	226,191,655.00	0.00	141,741,204.27	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	231,141,204.27	14,233724%	24,443933%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-03-25	1	223,740,052.27	7,401,152.00	141,741,204.27	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	231,141,204.27	14,233724%	24,443933%	7,401,152.00	20,264,354.185	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-04-25	0	221,303,782.96	0.00	134,340,052.27	32,900,000.00	56,500,000.00	21,600,000.00	223,740,052.27	14,704564%	25,252519%	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0	0.00	0
11-05-25	0	218,882,761.75	0.00	134,340,052.27	32,900,000.00	56,500,000.00														