

PYMES BANESTO 2

ANA OBREGON MAZO
ANALISTA
SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.
CIUDAD GRUPO SANTANDER
28660 BOADILLA DEL MONTE
aobregon@gruposantander.com
Tel: 912893301

DENOMINACION DEL FONDO:

PYMES BANESTO 2

INFORMACIÓN

CORRESPONDIENTE AL:

TRIMESTRE/SEMESTRE:

17/06/2013 - 16/09/2013

AÑO:

2013

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	17 noviembre 2006	Agencia de pago de Bonos	AIAF	
Fecha de Desembolso BT's	23 noviembre 2006	Negociación Mercado	BANESTO	
Fecha Final Amortización	31 diciembre 2031	Agencias de calificación	MOODY'S ESPAÑA FITCH RATINGS STANDARD & POORS	
Sociedad Gestora	SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.	Calificación	Inicial	Actual
	BANESTO	BONOS SERIE A1	Aaa/AAA/AAA	Cancelada
		BONOS SERIE A2	Aaa/AAA/AAA	A3/BBB-/AA-
		BONOS SERIE B	A1/AA-/A	B1/B/BBB
		BONOS SERIE C	Baa3/BBB/BBB	Caa3/CC/B

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO: BONOS DE TITULIZACION

SERIES PRELACIÓN CÓDIGO ISIN	Nº BONOS	NOMINAL EN CIRCULACIÓN			
			Inicial	Actual	%Act/In
BONOS SERIE A1 ES0372260002	4.000	Nominal Unitario	100.000,00	0,00	
		Nominal Total	400.000.000,00	0	0,00 %
BONOS SERIE A2 ES0372260010	5.417	Nominal Unitario	100.000,00	23.587,41	
		Nominal Total	541.700.000,00	127.772.999,97	23,59%
BONOS SERIE B ES0372260020	243	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	24.300.000,00	24.300.000,00	100,00 %
BONOS SERIE C ES0372260036	340	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	34.000.000,00	34.000.000,00	100,00 %

AMORTIZACION E INTERESES BONOS					
Actual			Próximo		
Fecha Amortización Período Actual			Fecha Próximo Cupón		
16 de septiembre de 2013			16 de diciembre de 2013		
	Amortización de los Bonos	Intereses Brutos Bonos	Tipo de Interés	Importe Bruto Próximo Cupón	Importe Neto Próximo Cupón
BONOS SERIE A1	---	---	---	---	---
BONOS SERIE A2	2.264,24 €	24,11 €	0,384%	22,90 €	18,09 €
BONOS SERIE B	0,00 €	121,08 €	0,494%	124,87 €	98,65 €
BONOS SERIE C	0,00 €	189,33 €	0,764%	193,12 €	152,56 €
Amortización devengada no pagada	637,23				
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	10.836	2.102
Saldo Pendiente de Amortizar Derechos	1.000.000.015,00 €	182.621.129,13 €
Importes Unitarios Derechos Vivos	92.284,98 €	86.879,70 €
Tipos de Interés	3,74 %	1,53%

TASAS DE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA	SITUACIÓN ACTUAL
Tasa mensual actual anualizada:	5,81%
Tasa últimos 12 meses anualizada:	6,75%
Tasa anualizada desde Constitución del Fondo	8,35%

MOROSIDAD ACTUAL	Hasta 1 mes	De 1 a 6 meses	Mayor de 6 meses
Deuda Vencida(Principal+Intereses)	207.547,78 €	836.355,13 €	372.630,95 €
Deuda Pendiente de vencimiento	0,00 €	0,00 €	181.348.422,10 €
Deuda Total	207.547,78 €	836.355,13 €	181.721.053,05 €

PYMES BANESTO 2

INFORME TRIMESTRAL BONOS DE TITULIZACIÓN

16 de septiembre de 2013

BONOS TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. PRINCIPAL	
Saldo anterior	198.338.388,05 €
Amortizaciones	12.265.388,08 €
Saldo actual	186.072.999,97 €
% sobre saldo inicial	18,61%
Amortización devengada no pagada	3.451.877,18 €

BONOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. INTERESES	
Intereses pagados Serie A1	0,00 €
Intereses pagados Serie A2	130.603,87 €
Intereses pagados Serie B	29.422,44 €
Intereses pagados Serie C	64.372,20 €
Intereses devengados no pagados	0,00 €

DATOS	
Fecha de determinación	09/09/2013
Fecha de Pago de Cupón Actual	16/09/2013
Fecha de Pago de Cupón Anterior	17/06/2013
Número de días	91
Tipo de referencia (%)	0,224%
Próxima Fecha de Pago	16/12/2013

VIDA RESIDUAL (AÑOS)		
	INICIAL	16-sep-13
BONOS SERIE A1	2,84	0,00
BONOS SERIE A2	5,20	1,37
BONOS SERIE B	5,55	2,25
BONOS SERIE C	5,55	2,25

PYMES BANESTO 2

INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

16 de septiembre de 2013

DERECHOS DE CRÉDITO. PRINCIPAL	
Saldo anterior	196.165.089,62 €
Amortizaciones	13.543.960,49 €
Saldo actual	182.621.129,13 €
Número de derechos de crédito	2.102
LTV	23,68%

DERECHOS DE CRÉDITO. INTERESES	
Intereses cobrados en el trimestre	681.691,13 €
Intereses devengados en el trimestre	767.847,40 €

DERECHOS DE CRÉDITO EN MOROSIDAD					
	HASTA 30 DIAS	30 A 60 DIAS	60 A 90 DIAS	90 A 180 DIAS	MAS 180 DIAS
Principal	196.041,62 €	199.093,47 €	165.008,18 €	368.576,54 €	343.987,22 €
Intereses	11.506,16 €	24.241,66 €	18.125,20 €	61.310,08 €	28.643,73 €
Saldo de los derechos de crédito	16.082.398,95 €	9.356.631,72 €	4.025.046,43 €	5.869.378,54 €	9.782.461,15 €
Número de derechos de crédito	150	82	28	47	72
% sobre saldo de los derechos de crédito	8,81%	5,12%	2,20%	3,21%	5,36%

Se excluyen en este informe los vencidos y no pagados con antigüedad entre 1 y 15 días por considerarse morosidad técnica con un gran porcentaje de recobro.

PRÉSTAMOS EN WRITE OFF	
Write Off acumulado Fecha Pago anterior	21.274.641,58 €
Write Off trimestre	1.245.992,87 €
Write Off acumulados actuales	22.520.634,45 €

PYMES BANESTO 2

INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

16 de septiembre de 2013

CONTENCIOSOS / JUDICIALES	
Saldo anterior	3.503.299,03 €
Diferencia	381.038,29 €
Saldo actual	3.884.337,32 €

PÉRDIDAS DE LA CARTERA	
Saldo anterior	0,00 €
Diferencia	0,00 €
Saldo actual	0,00 €

ADJUDICADOS	
Saldo anterior	10.256.907,63 €
Diferencia	134.817,76 €
Saldo actual	10.391.725,39 €

PYMES BANESTO 2

ESTADO DE ORIGEN Y APLICACIÓN DE FONDOS Y CUENTA DE TESORERÍA

16 de septiembre de 2013

ORIGEN	12.881.315,02 €
PRINCIPAL COBRADO	
Amortización derechos de crédito	11.678.496,20 €
INTERESES COBRADOS	
Intereses de derechos de crédito	681.691,13 €
Intereses de reinversión	-20,90 €
INGRESOS POR ADJUDICADOS	94.392,94 €
CONTENCIOSOS	521.673,85 €
OTROS	-94.918,20 €

ESTADO CUENTA DE TESORERÍA	47.107,91 €
FONDO DE RESERVA	
Saldo anterior	0,00 €
Utilizado en el período	0,00 €
Saldo actual	0,00 €
RETENCIÓN A CUENTA DEL IRPF	47.107,91 €

APLICACIÓN	12.881.315,02 €
GASTOS ORDINARIOS	3.921,12 €
COMISIÓN S.G.F.T.	9.889,75 €
PAGO SWAP	682.509,22 €
COBRO SWAP	-304.839,49 €
INTERESES BONOS SERIE A1	0,00 €
INTERESES BONOS SERIE A2	130.603,87 €
INTERESES BONOS SERIE B	29.422,44 €
INTERESES BONOS SERIE C	64.372,20 €
DOTACIÓN AMORTIZACIÓN SERIE A2	12.265.388,08 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO	0,00 €
AMORTIZACIÓN PRÉSTAMO SUBORDINADO	0,00 €
EXCESO	47,83 €
DISPOSICIÓN FONDO DE RESERVA	0,00 €

PYMES BANESTO 2

MEJORA CREDITICIA Y PRÉSTAMO SUBORDINADO

16 de septiembre de 2013

MEJORA DE CRÉDITO		
CONCEPTOS	INICIAL	16-sep-13
EMISIÓN SUBORDINADA	58.300.000,00 € (5,83%)	58.300.000,00 € (31,92%)
FONDO DE RESERVA	25.000.000,00 € (2,50 %)	0,00 € (0,00%)

PRÉSTAMOS SUBORDINADOS		
CONCEPTOS	INICIAL	16-sep-13
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO RESERVA		
Saldo vivo	25.000.000,00 €	25.000.000,00 €
Tipo de interés	5,431 %	2,024%
PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN		
Saldo vivo	1.750.000,00 €	570.027,35 €
Tipo de interés	4,631 %	1,224%

PYMES BANESTO 2

DEFINICIONES

16 de septiembre de 2013

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 Préstamos cuya deuda el Cedente considera que no va a recuperar (neto de recuperaciones).

PRÉSTAMOS FALLIDOS Aquellos préstamos cuya deuda el Cedente considera que no va a recuperar, o aquellos préstamos que tienen cuotas pendientes con antigüedad.

SALDO VIVO ACUMULADO DE PRÉSTAMOS FALLIDOS Saldo vivo acumulado de los Derechos de Crédito derivados de Préstamos Fallidos, sin tener en cuenta los importes recobrados.

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

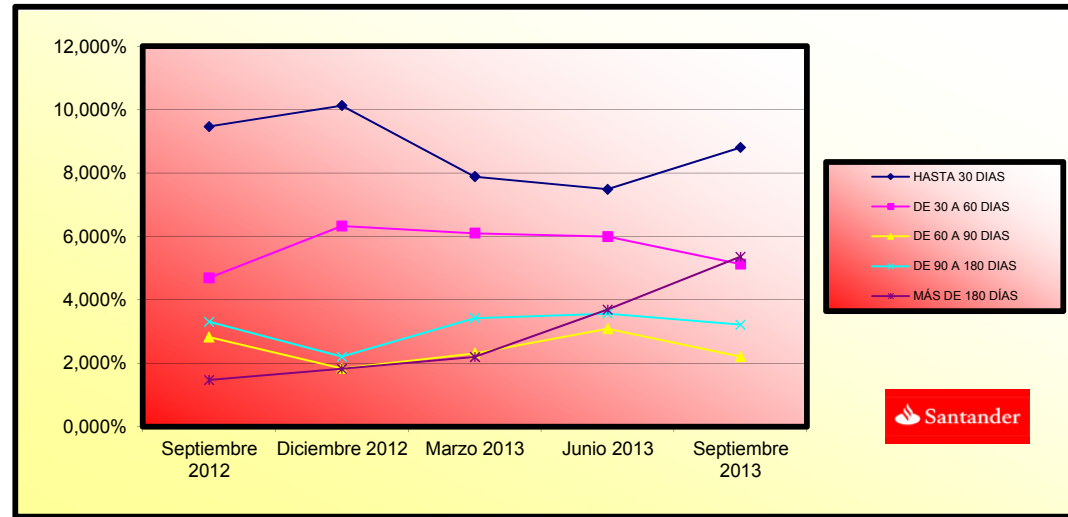
CONTENCIOSO / JUDICIAL Préstamos sobre los que el Cedente va a iniciar acciones judiciales. Esta cantidad está incluida en el cuadro de morosidad.

**FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
PYMES BANESTO 2**

INFORME DE MOROSIDAD

Fecha: 16 de septiembre de 2013

MOROSIDAD HISTÓRICA					
	Septiembre 2012	Diciembre 2012	Marzo 2013	Junio 2013	Septiembre 2013
HASTA 30 DIAS	9,465%	10,128%	7,886%	7,487%	8,806%
DE 30 A 60 DIAS	4,692%	6,325%	6,098%	5,992%	5,124%
DE 60 A 90 DIAS	2,821%	1,831%	2,311%	3,081%	2,204%
DE 90 A 180 DIAS	3,304%	2,209%	3,422%	3,564%	3,214%
MÁS DE 180 DÍAS	1,468%	1,822%	2,196%	3,689%	5,357%



**FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
PYMES BANESTO 2**

INFORME RELATIVO A LOS TRIGGERS DEL FONDO

Fecha: 16 de septiembre de 2013

TRIGGERS FONDOS DE RESERVA		
SI 1) ES MAYOR QUE 2) NO SE AMORTIZA EL FONDO DE RESERVA		
1) SALDO VIVO PRÉSTAMOS MOROSOS	15.651.839,69 €	8,570661984
2) 1,00% * SALDO VIVO PRÉSTAMOS	1.826.211,29 €	

NO PUEDE DISMINUIR EL FONDO DE RESERVA REQUERIDO

FALLIDOS ACUMULADOS SIN RECUPERACIONES	33.648.991,39 €	0,033648991
---	-----------------	-------------

TRIGGERS DIFERIMIENTO DE INTERESES CLASES B y C		
DIFERIMIENTO DE INTS CLASE B, SI SALDO VIVO DE FALLIDOS ACUMULADOS SIN RECUPERACIONES > 7,90% SALDO INICIAL DE ACTIVOS		NO
DIFERIMIENTO DE INTS CLASE C, SI SALDO VIVO DE FALLIDOS ACUMULADOS SIN RECUPERACIONES > 5,00% SALDO INICIAL DE ACTIVOS		NO

TRIGGERS AMORTIZACIÓN A PRORRATA SERIES B y C	
NO AMORTIZACIÓN A PRORRATA SERIE B SI SALDO VIVO PRÉSTAMOS MOROSOS > 1,25% DEL SALDO VIVO DE LOS PRÉSTAMOS NO FALLIDOS	Si
NO AMORTIZACIÓN A PRORRATA SERIE C SI SALDO VIVO PRÉSTAMOS MOROSOS > 1,00% DEL SALDO VIVO DE LOS PRÉSTAMOS NO FALLIDOS	Si

LA AMORTIZACIÓN A PRORRATA DE LAS SERIES B y C NO PODRÁ TENER LUGAR.

CONTRATO	CONTRAPARTE	AGENCIA RATING	RATING MÍNIMO EXIGIDO	RATING ACTUAL
CUENTA TESORERÍA	BANCO SANTANDER	FITCH	F-1 c/p	BBB+ l/p F-2 c/p
		S&P	A-1 c/p	BBB l/p A-2 c/p
		MOODY'S	P-1 c/p	Baa2 l/p P-2 c/p
SWAP	BANCO SANTANDER	FITCH	A l/p F-1 c/p	BBB+ l/p F-2 c/p
		S&P	A- l/p	BBB l/p A-2 c/p
		MOODY'S	A2 l/p P-1 c/p	Baa2 l/p P-2 c/p
AGENTE DE PAGOS	BANCO SANTANDER	FITCH	F-1 c/p	BBB+ l/p F-2 c/p
		S&P	A-1 c/p	BBB l/p A-2 c/p
		MOODY'S	P-1 c/p	Baa2 l/p P-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.
LA CONTRAPARTE DEL SWAP NO TIENE EL RATING MÍNIMO EXIGIDO. SE HA CONSTITUIDO UN DEPÓSITO EN GARANTÍA DEL SWAP.**

ESTADÍSTICO DE VALORES DE TASACIÓN SOBRE SALDOS VIVOS				
INTERVALO	SALDO	% SALDOS VIVOS	Nº PRÉSTAMOS	% Nº PRÉSTAMOS
0,05 - 39,99	82.742.881,67 €	78,72%	924	84,69%
40,00 - 49,99	16.959.923,16 €	16,13%	131	12,01%
50,00 - 59,99	4.181.579,98 €	3,98%	27	2,47%
60,00 - 69,99	491.645,87 €	0,47%	4	0,37%
70,00 - 79,99	61.721,39 €	0,06%	1	0,09%
80,00 - 84,69	675.443,91 €	0,64%	4	0,37%
	105.113.195,98 €	100,00%	1.091	100,00%

F.T.A.: PYMES BANESTO 2

Fecha	Saldo antes de Pago	Saldo Real	Vector de Prepago	Permanencia final de mes	Mortalidad Mensual	CPR	Mortalidad Mensual	CPR
			0,72%					6,75%
01-01-09	898.630.831,02	895.142.710,25	100,00%	100,00%				
01-02-09	871.373.281,37	873.504.381,06	99,28%	99,61%	0,39%	4,56%	0,39%	4,56%
01-03-09	850.911.662,86	842.138.868,62	97,84%	100,24%	-0,12%	-1,48%	-0,64%	-7,89%
01-04-09	830.353.894,77	805.337.304,89	97,14%	98,97%	0,34%	4,06%	1,27%	14,24%
01-05-09	809.699.525,31	773.241.845,26	96,43%	96,99%	0,76%	8,77%	2,00%	21,55%
01-06-09	788.948.100,52	753.490.155,81	95,74%	95,50%	0,92%	10,47%	1,54%	16,95%
01-07-09	771.726.775,55	732.869.738,61	95,04%	95,51%	0,76%	8,79%	-0,01%	-0,10%
01-08-09	754.424.527,20	703.100.391,03	94,35%	94,96%	0,74%	8,48%	0,57%	6,59%
01-09-09	737.040.975,23	683.553.670,67	93,67%	93,20%	0,88%	10,03%	1,86%	20,19%
01-10-09	719.575.737,58	655.857.524,16	92,99%	92,74%	0,83%	9,56%	0,49%	5,69%
01-11-09	702.028.430,42	637.458.032,97	92,32%	91,15%	0,92%	10,53%	1,72%	18,82%
01-12-09	684.398.668,09	621.182.996,45	91,65%	90,80%	0,87%	9,99%	0,38%	4,42%
01-01-10	668.895.295,49	598.499.000,41	90,99%	90,76%	0,80%	9,24%	0,04%	0,51%
01-02-10	653.319.072,22	584.840.755,53	90,33%	89,48%	0,85%	9,76%	1,42%	15,76%
01-03-10	637.669.655,94	560.872.587,53	89,68%	89,52%	0,79%	9,05%	-0,05%	-0,57%
01-04-10	621.946.702,73	539.370.640,95	89,03%	87,96%	0,85%	9,76%	1,74%	19,04%
01-05-10	606.149.867,04	520.687.206,46	88,38%	86,72%	0,89%	10,13%	1,40%	15,59%
01-06-10	590.278.801,68	506.119.855,95	87,74%	85,90%	0,89%	10,17%	0,95%	10,80%
01-07-10	578.097.786,52	488.511.870,09	87,11%	85,74%	0,85%	9,75%	0,18%	2,19%
01-08-10	565.859.532,51	479.350.112,39	86,48%	84,50%	0,88%	10,09%	1,45%	16,03%
01-09-10	553.563.770,69	464.583.496,29	85,85%	84,71%	0,83%	9,48%	-0,25%	-3,00%
01-10-10	541.210.230,82	446.453.129,00	85,23%	83,93%	0,83%	9,53%	0,93%	10,58%
01-11-10	528.798.641,42	438.411.608,32	84,61%	82,49%	0,87%	9,97%	1,71%	18,69%
01-12-10	516.328.729,69	426.183.769,05	84,00%	82,91%	0,81%	9,32%	-0,50%	-6,21%
01-01-11	505.527.373,90	414.714.705,63	83,39%	82,54%	0,80%	9,15%	0,44%	5,17%
01-02-11	494.675.262,30	404.947.273,26	82,79%	82,04%	0,79%	9,07%	0,61%	7,10%
01-03-11	483.772.156,41	388.250.999,91	82,19%	81,86%	0,77%	8,82%	0,21%	2,53%
01-04-11	472.817.816,59	375.253.779,26	81,60%	80,25%	0,81%	9,31%	1,96%	21,16%
01-05-11	461.812.002,10	367.008.219,64	81,01%	79,37%	0,82%	9,43%	1,11%	12,52%
01-06-11	450.754.471,06	355.318.202,44	80,42%	79,47%	0,79%	9,07%	-0,13%	-1,61%
01-07-11	443.118.241,43	345.903.135,60	79,84%	78,83%	0,79%	9,08%	0,81%	9,30%
01-08-11	435.446.128,99	336.071.284,02	79,26%	78,06%	0,80%	9,14%	0,97%	11,06%
01-09-11	427.737.965,14	328.587.720,42	78,69%	77,18%	0,81%	9,26%	1,13%	12,75%
01-10-11	419.993.580,46	320.111.306,44	78,12%	76,82%	0,80%	9,14%	0,46%	5,44%
01-11-11	412.212.804,76	311.898.821,55	77,55%	76,22%	0,80%	9,14%	0,78%	9,00%
01-12-11	404.395.467,03	304.319.127,62	76,99%	75,66%	0,79%	9,12%	0,73%	8,38%
01-01-12	397.463.610,30	297.277.413,39	76,43%	75,25%	0,79%	9,04%	0,54%	6,34%
01-02-12	390.499.180,63	289.439.922,42	75,88%	74,79%	0,78%	8,99%	0,61%	7,08%
01-03-12	383.502.024,96	282.854.016,02	75,33%	74,12%	0,79%	9,02%	0,90%	10,28%
01-04-12	376.471.989,50	275.147.244,45	74,79%	73,76%	0,78%	8,94%	0,49%	5,75%
01-05-12	369.408.919,76	268.156.068,36	74,24%	73,09%	0,78%	8,98%	0,91%	10,37%
01-06-12	362.312.660,51	260.734.542,40	73,71%	72,59%	0,78%	8,95%	0,68%	7,83%
01-07-12	356.294.619,32	254.965.439,15	73,17%	71,96%	0,78%	8,97%	0,86%	9,88%
01-08-12	350.248.299,23	250.306.087,06	72,64%	71,56%	0,78%	8,92%	0,56%	6,53%
01-09-12	344.173.567,35	244.131.798,97	72,12%	71,47%	0,76%	8,76%	0,13%	1,58%
01-10-12	338.070.290,18	238.268.269,40	71,60%	70,93%	0,76%	8,75%	0,75%	8,58%
01-11-12	331.938.333,58	232.131.616,48	71,08%	70,48%	0,76%	8,72%	0,64%	7,41%
01-12-12	325.777.562,79	227.208.714,38	70,56%	69,93%	0,76%	8,73%	0,78%	8,92%
01-01-13	320.030.532,50	221.616.235,31	70,05%	69,74%	0,75%	8,61%	0,27%	3,19%
01-02-13	314.256.496,80	216.761.282,83	69,55%	69,25%	0,75%	8,61%	0,71%	8,19%
01-03-13	308.455.328,78	211.891.416,94	69,04%	68,98%	0,74%	8,53%	0,39%	4,62%
01-04-13	302.626.900,95	205.082.347,96	68,54%	68,69%	0,73%	8,46%	0,41%	4,79%
01-05-13	296.771.085,22	200.587.416,17	68,05%	67,77%	0,75%	8,59%	1,35%	15,04%
01-06-13	290.887.752,88	196.165.089,62	67,56%	67,59%	0,74%	8,49%	0,26%	3,10%
01-07-13	286.042.749,09	191.727.988,21	67,07%	67,44%	0,73%	8,38%	0,23%	2,69%
01-08-13	281.174.978,52	186.783.091,64	66,58%	67,03%	0,72%	8,36%	0,61%	7,04%
01-09-13	276.284.334,19	182.621.129,13	66,10%	66,43%	0,73%	8,39%	0,89%	10,20%
				66,10%	0,72%	8,35%	0,50%	5,81%

Fecha	Principal Disponible	Amortización de principal	Serie A1	Serie A2	Serie B	Serie C	Suma todas las series	% Serie B	% Serie C	Amortización Serie A1	Vida Media Serie A1	Amortización Serie A2	Vida Media Serie A2	Amortización Serie B	Vida Media Serie B	Amortización Serie C	Vida Media Serie C
											0,00		1,37		2,25		2,25
Date	Principal available	Principal Redemption	Class A1	Class A2	Class B	Class C	Sum of all Classes	% Class B	% Class C	Redemption Class A1	Average Life Class A1	Redemption Class A2	Average Life Class A2	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C
08-01-09 0	924.781.111,43	0,00	400.000.000,00	541.700.000,00	24.300.000,00	34.000.000,00	400.000.000,00			0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-02-09 1	892.127.315,22	0,00	400.000.000,00	541.700.000,00	24.300.000,00	34.000.000,00	400.000.000,00			0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-03-09 0	858.806.422,30	0,00	400.000.000,00	541.700.000,00	24.300.000,00	34.000.000,00	400.000.000,00			0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-04-09 0	832.570.546,10	97.185.787,03	400.000.000,00	541.700.000,00	24.300.000,00	34.000.000,00	1.000.000.000,00	4,864%	6,808%	67.053.680,00	-110.303.303.600	90.807.446,14	-149.378.248.900	0,00	0	0,00	0
08-05-09 1	806.576.038,00	0,00	332.946.320,00	450.892.553,86	24.300.000,00	34.000.000,00	842.138.873,86	3,012735%	4,037339%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-06-09 1	780.821.018,73	0,00	332.946.320,00	450.892.553,86	24.300.000,00	34.000.000,00	842.138.873,86	3,112109%	4,037339%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-07-09 0	755.303.622,96	76.219.198,37	332.946.320,00	450.892.553,86	24.300.000,00	34.000.000,00	842.138.873,86	3,217249%	4,037339%	76.219.198,37	-118.368.415.074	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-08-09 1	733.469.777,94	0,00	256.727.121,63	450.892.553,86	24.300.000,00	34.000.000,00	765.919.675,49	3,313020%	4,439108%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-09-09 1	711.836.047,01	0,00	256.727.121,63	450.892.553,86	24.300.000,00	34.000.000,00	765.919.675,49	3,413707%	4,439108%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-10-09 0	690.400.873,64	67.656.836,15	256.727.121,63	450.892.553,86	24.300.000,00	34.000.000,00	765.919.675,49	3,519694%	4,439108%	67.656.836,15	-98.846.637.616	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-11-09 0	669.162.712,84	0,00	189.070.285,48	450.892.553,86	24.300.000,00	34.000.000,00	698.262.839,34	3,631404%	4,869227%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-12-09 1	648.120.031,05	0,00	189.070.285,48	450.892.553,86	24.300.000,00	34.000.000,00	698.262.839,34	3,749306%	4,869227%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-01-10 0	627.271.306,14	65.739.429,12	189.070.285,48	450.892.553,86	24.300.000,00	34.000.000,00	698.262.839,34	3,873922%	4,869227%	65.739.429,12	-90.063.017.892	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-02-10 0	608.625.199,04	0,00	123.330.856,36	450.892.553,86	24.300.000,00	34.000.000,00	632.523.410,22	3,992605%	5,375295%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-03-10 1	590.150.319,98	0,00	123.330.856,36	450.892.553,86	24.300.000,00	34.000.000,00	632.523.410,22	4,117595%	5,375295%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-04-10 0	571.845.336,42	57.409.244,06	123.330.856,36	450.892.553,86	24.300.000,00	34.000.000,00	632.523.410,22	4,249401%	5,375295%	57.409.244,06	-73.483.832.398	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-05-10 0	553.708.925,73	0,00	65.921.612,30	450.892.553,86	24.300.000,00	34.000.000,00	575.114.166,16	4,388587%	5,911870%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-06-10 1	535.739.775,07	0,00	65.921.612,30	450.892.553,86	24.300.000,00	34.000.000,00	575.114.166,16	4,535784%	5,911870%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-07-10 0	517.936.581,35	55.768.623,79	65.921.612,30	450.892.553,86	24.300.000,00	34.000.000,00	575.114.166,16	4,691694%	5,911870%	55.768.623,79	-66.253.125.064	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-08-10 0	503.577.395,82	0,00	10.152.988,51	450.892.553,86	24.300.000,00	34.000.000,00	519.345.542,37	4,691694%	6,546701%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-09-10 1	489.349.422,02	0,00	10.152.988,51	450.892.553,86	24.300.000,00	34.000.000,00	519.345.542,37	4,825475%	6,546701%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-10-10 0	473.951.640,17	43.631.898,94	10.152.988,51	450.892.553,86	24.300.000,00	34.000.000,00	519.345.542,37	4,965777%	6,546701%	43.631.898,94	-11.127.675.402	33.478.910,43	-36.692.885.836	0,00	0	0,00	0
08-11-10 1	461.283.038,02	0,00	0,00	417.413.643,43	24.300.000,00	34.000.000,00	475.713.643,43	5,113081%	7,154105%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-12-10 1	447.442.610,84	0,00	0,00	417.413.643,43	24.300.000,00	34.000.000,00	475.713.643,43			0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-01-11 0	433.729.361,36	42.374.669,14	0,00	417.413.643,43	24.300.000,00	34.000.000,00	475.713.643,43			0,00	42.374.669,14	-42.586.542.489	0,00	0	0,00	0	
08-02-11 0	421.582.651,86	0,00	0,00	375.038.974,28	24.300.000,00	34.000.000,00	433.338.974,28	5,603%	7,839%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-03-11 0	409.547.018,83	0,00	0,00	375.038.974,28	24.300.000,00	34.000.000,00	433.338.974,28			0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-04-11 0	397.621.598,82	36.519.752,56	0,00	375.038.974,28	24.300.000,00	34.000.000,00	433.338.974,28			0,00	36.519.752,56	-33.415.573.590	0,00	0	0,00	0	
08-05-11 1	385.805.534,75	0,00	0,00	338.519.221,73	24.300.000,00	34.000.000,00	396.819.221,73	6,111%	8,551%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-06-11 0	374.097.975,90	0,00	0,00	338.519.221,73	24.300.000,00	34.000.000,00	396.819.221,73			0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-07-11 0	362.498.077,89	32.840.077,74	0,00	338.519.221,73	24.300.000,00	34.000.000,00	396.819.221,73			0,00	32.840.077,74	-27.027.383.982	0,00	0	0,00	0	
08-08-11 0	353.777.994,48	0,00	0,00	305.679.143,98	24.300.000,00	34.000.000,00	363.979.143,98	6,703%	9,379%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-09-11 1	345.136.700,83	0,00	0,00	305.679.143,98	24.300.000,00	34.000.000,00	363.979.143,98			0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-10-11 0	336.573.586,40	25.508.205,15	0,00	305.679.143,98	24.300.000,00	34.000.000,00	363.979.143,98			0,00	25.508.205,15	-18.646.497.964	0,00	0	0,00	0	
08-11-11 0	328.096.045,15	0,00	0,00	280.170.938,83	24.300.000,00	34.000.000,00	338.470.938,83	7,220%	10,102%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-12-11 0	319.679.475,65	0,00	0,00	280.170.938,83	24.300.000,00	34.000.000,00	338.470.938,83			0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-01-12 0	311.347.280,52	24.753.231,23	0,00	280.170.938,83	24.300.000,00	34.000.000,00	338.470.938,83			0,00	24.753.231,23	-15.842.067.987	0,00	0	0,00	0	
08-02-12 0	303.795.749,42	0,00	0,00	255.417.707,60	24.300.000,00	34.000.000,00	313.717.707,60	7,805%	10,920%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-03-12 1	296.312.497,61	0,00	0,00	255.417.707,60	24.300.000,00	34.000.000,00	313.717.707,60			0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-04-12 0	288.896.995,87	21.751.416,87	0,00	255.417.707,60	24.300.000,00	34.000.000,00	313.717.707,60			0,00	21.751.416,87	-11.941.527.863	0,00	0	0,00	0	
08-05-12 0	281.548.718,94	0,00	0,00	233.666.290,73	24.300.000,00	34.000.000,00	291.966.290,73	8,411%	11,769%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-06-12 1	274.267.145,43	0,00	0,00	233.666.290,73	24.300.000,00	34.000.000,00	291.966.290,73			0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-07-12 0	267.051.757,82	21.097.157,62	0,00	233.666.290,73	24.300.000,00	34.000.000,00	291.966.290,73			0,00	21.097.157,62	-9.641.401.032	0,00	0	0,00	0	
08-08-12 1	260.715.419,13	0,00	0,00	212.569.133,11	24.300.000,00	34.000.000,00	270.869.133,11	9,099%	12,732%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-09-12 0	254.436.264,14	0,00	0,00	212.569.133,11	24.300.000,00	34.000.000,00	270.869.133,11			0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-10-12 0	248.213.849,86	20.370.126,21	0,00	212.569.133,11	24.300.000,00	34.000.000,00	270.869.133,11			0,00	20.370.126,21	-7.435.096.066	0,00	0	0,00	0	
08-11-12 0	242.047.736,80	0,00	0,00	192.199.006,90	24.300.000,00	34.000.000,00	250.499.006,90	9,790%	13,698%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-12-12 0	235.937.487,91	0,00	0,00	192.199.006,90	24.300.000,00	34.000.000,00	250.499.006,90			0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-01-13 0	229.802.670,58	20.008.580,73	0,00	192.199.006,90	24.300.000,00	34.000.000,00	250.499.006,90			0,00	20.008.580,73	-5.482.351.120	0,00	0	0,00	0	
08-02-13 0	224.192.475,66	0,00	0,00	172.190.426,17	24.300.000,00	34.000.000,00	230.490.426,17	10,571%	14,790%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-03-13 0	218.554.812,04	0,00	0,00	172.190.426,17	24.300.000,00	34.000.000,00	230.490.426,17			0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-04-13 0	212.967.781,92	17.048.821,44	0,00	172.190.426,17	24.300.000,00	34.000.000,00	230.490.426,17			0,00	17.048.821,44	-3.136.983.145	0,00	0	0,00	0	
08-05-13 1	207.431.488,10	0,00	0,00	155.141.604,73	24.300.000,00	34.000.000,00	213.441.604,73	11,410%	15,965%	0,00	0	0,00	0	0,00	0	0,00	0
08-06-13 0	201.945.536,89	0,00	0,00	155.141.604,73	24.300.000,00	34.000.000,00											