



## **F.T.H. HIPOTEBANSA XI**

**FRANCISCO FORTES CLAVERO**

**ANALISTA**

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

**GRAN VIA DE HORTALEZA 3**

**28033 MADRID**

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

**Tel: 912893290**



DENOMINACION DEL FONDO:

F.T.H. HIPOTEBANSA XI

INFORMACIÓN

CORRESPONDIENTE AL:

TRIMESTRE/SEMESTRE:

17/05/2016 - 16/08/2016

AÑO:

2016

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

### I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	26 noviembre 2002	Agencia de pago de Bonos	BANCO SANTANDER	
Fecha de Desembolso BT's	29 noviembre 2002	Negociación Mercado	AIAF	
Fecha Final Amortización	15 febrero 2035	Agencias de calificación	MOODY'S ESPAÑA STANDARD & POORS	
Sociedad Gestora	SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.	Calificación	Inicial	Actual
Originador Derechos Crédito	BANCO SANTANDER	B.T.H. SERIE A	Aaa/AAA	Aa <del>+</del> /AA
		B.T.H SERIE B	A2/A	BaF/B-

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

SERIES PRELACIÓN CÓDIGO ISIN	Nº BONOS	NOMINAL EN CIRCULACIÓN			
			Inicial	Actual	%Act/In
B.T.H. SERIE A ES0338447008	10.408	Nominal Unitario	100.000,00	12.4F1,11	
		Nominal Total	1.040.800.000,00	129.6F.11 F,G	12,4F %
B.T.H SERIE B ES0338447016	212	Nominal Unitario	100.000,00	31,11€11	
		Nominal Total	21.200.000,00	1.111.111,11€	31,11 %

AMORTIZACION E INTERESES BONOS					
Actual			Próximo		
Fecha Amortización Periodo Actual 16 agosto 2016			Fecha Próximo Cupón 15 noviembre 2016		
	Amortización de los Bonos	Intereses Brutos Bonos	Tipo de Interés	Importe Bruto Próximo Cupón	Importe Neto Próximo Cupón
B.T.H. SERIE A	51 G3 €	0,00 €	0,0000 %	0,00 €	0,00 €
B.T.H SERIE B	111,1€€	18,65 €	0,1510 %	14,H €	11,12 €
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	13.082	3.886
Saldo Pendiente de Amortizar Derechos	1.062.000.934,18	137.176.783,32
Importes Unitarios Derechos Vivos	81.180,32	35.300,25
Tipos de Interés	4,46 %	0,92 %

TASAS DE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA	SITUACIÓN ACTUAL
Tasa mensual actual anualizada:	1,11 %
Tasa últimos 12 meses anualizada:	1,10 %
Tasa anualizada desde Constitución del Fondo	1,11 %

MOROSIDAD ACTUAL	Hasta 1 mes	De 1 a 6 meses	Mayor de 6 meses
Deuda Vencida(Principal+Intereses)	12.729,86	22.108,25	0,00
Deuda Pendiente de vencimiento	0,00	0,00	137.144.490,25
Deuda Total	12.729,86	22.108,25	137.144.490,25

## F.T.H. HIPOTEBANSA XI

### INFORME TRIMESTRAL BONOS DE TITULIZACIÓN

16-ago-16

BONOS TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. PRINCIPAL	
Saldo anterior	143.167.829,32 €
Amortizaciones	5.991.049,04 €
Saldo actual	137.176.780,28 €
% sobre saldo inicial	12,92%
Amortización devengada no pagada	0,00 €

BONOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. INTERESES	
Intereses pagados Serie A	0,00 €
Intereses pagados Serie B	3.953,80 €
Intereses devengados no pagados	0,00 €

DATOS	
Fecha de determinación	08/08/2016
Fecha de Pago de Cupón Actual	16/08/2016
Fecha de Pago de Cupón Anterior	17/05/2016
Número de días	91
Tipo de referencia (%)	-0,299%
Próxima Fecha de Pago	15/11/2016

VIDA RESIDUAL (AÑOS)		
	INICIAL	16/08/2016
B.T.H. SERIE A	6,7	1,51
B.T.H. SERIE B	12,8	1,75

## F.T.H. HIPOTEBANSA XI

### INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

16-ago-16

DERECHOS DE CRÉDITO. PRINCIPAL	
Saldo anterior	143.167.798,91 €
Amortizaciones	5.991.015,59 €
Saldo actual	137.176.783,32 €
Número de derechos de crédito	3.886
LTV	30,69%

DERECHOS DE CRÉDITO. INTERESES	
Intereses cobrados en el trimestre	329.766,63 €
Intereses devengados en el trimestre	331.549,22 €

DERECHOS DE CRÉDITO EN MOROSIDAD					
	HASTA 30 DÍAS	30 A 60 DÍAS	60 A 90 DÍAS	90 A 180 DÍAS	MAS 180 DIAS
Principal	11.750,68 €	4.245,79 €	12.272,12 €	4.024,48 €	0,00 €
Intereses	979,18 €	342,28 €	805,98 €	417,60 €	0,00 €
Saldo de los derechos de crédito	2.199.663,48 €	363.488,92 €	306.506,53 €	220.075,00 €	1.097.254,01 €
Número de derechos de crédito	41	10	9	5	28
% sobre saldo de los derechos de crédito	1,60%	0,26%	0,22%	0,16%	0,80%

## F.T.H. HIPOTEBANSA XI

### INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

16-ago-16

CONTENCIOSOS / JUDICIALES	
Saldo anterior	1.153.267,69 €
Diferencia	66.660,01 €
Saldo actual	1.219.927,70 €
Número derechos de crédito contenciosos	30

ADJUDICADOS	
Saldo anterior	1.253.416,55 €
Diferencia	-25.465,86 €
Saldo actual	1.227.950,69 €
Número derechos de crédito adjudicados	19

PERDIDAS NETAS	
Saldo anterior	261.640,73 €
Diferencia	475,75 €
Saldo actual	262.116,48 €

## F.T.H. HIPOTEBANSA XI

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

16-ago-16

ORIGEN	6.384.288,41 €
<b>PRINCIPAL COBRADO</b>	
Amortización derechos de crédito	5.950.987,34 €
<b>INTERESES COBRADOS</b>	
Intereses de derechos de crédito	329.766,63 €
Intereses de reinversión	-10.670,30 €
<b>CONTENCIOSOS / JUDICIALES</b>	43.682,60 €
<b>INGRESOS/GASTOS DE ADJUDICADOS</b>	-4.137,67 €
<b>FONDO DE RESERVA</b>	74.887,70 €
<b>OTROS</b>	-227,89 €

ESTADO CUENTA DE TESORERÍA	4.369.709,79 €
<b>FONDO DE RESERVA</b>	
Saldo anterior	1.431.677,99 €
Utilizado en el período	-59.910,16 €
Saldo actual	1.371.767,83 €
<b>FONDO DE RESERVA SECUNDARIO</b>	
Saldo anterior	3.012.919,50 €
Utilizado en el período	-14.977,54 €
Saldo actual	2.997.941,96 €
<b>RETENCIÓN A CUENTA DEL IRPF</b>	0,00 €
<b>GASTOS EMISIÓN RETENIDOS</b>	0,00 €
<b>OTROS</b>	0,00 €

APLICACIÓN	6.384.288,41 €
GASTOS ORDINARIOS	10.641,52 €
COMISION GESTION	19.110,00 €
COBRO SWAP A	0,00 €
PAGO SWAP A	120.742,66 €
COBRO SWAP B	-3.953,55 €
PAGO SWAP B	7.244,56 €
INTERESES B.T.H. SERIE A	0,00 €
AMORTIZACION BONOS SERIE A	5.852.210,24 €
AMORTIZACION BONOS SERIE B	138.838,80 €
INTERESES B.T.H SERIE B	3.953,80 €
INTERESES PTO.SUBORDINADO A	4.223,64 €
INTERESES PTO. SUBORDINADO B	0,00 €
AMORTIZACION PSB A GASTOS EMISION	0,00 €
AMORTIZACION PSB A GASTOS CONSTITUCION	0,00 €
AMORTIZACION PSB A FONDO RESERVA	74.887,70 €
AMORTIZACION PSB B GASTOS EMISION	0,00 €
AMORTIZACION PSB B GASTOS CONSTITUCION	0,00 €
AMORTIZACION PSB B FONDO RESERVA	0,00 €
COMIS. ADMON. BANCO SANTANDER	6.000,00 €
EXCESO POR REDONDEO	0,00 €
MARGEN FINANCIERO	150.389,04 €



**F.T.H. HIPOTEBANSA XI****MEJORA CREDITICIA Y PRÉSTAMO SUBORDINADO****16-ago-16**

<b>MEJORA DE CRÉDITO</b>		
<b>CONCEPTOS</b>	<b>INICIAL</b>	<b>16-ago-16</b>
EMISIÓN SUBORDINADA	2,00 %	5,81%
FONDO DE RESERVA	10.620.000,00 € (1,00 %)	1.371.767,83 € 1,00%
FONDO DE RESERVA SECUNDARIO	5.310.000,00 € (0,50 %)	2.997.941,96 € 2,19%

<b>PRÉSTAMOS SUBORDINADOS</b>		
<b>CONCEPTOS</b>	<b>INICIAL</b>	<b>16-ago-16</b>
PRESTAMO SUBORDINADO A		
Saldo vivo	17.045.178,00 €	4.371.561,25 €
Tipo de interés	3,860 %	0,325%

## F.T.H. HIPOTEBANSA XI

### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS TRIGGERS

16-ago-16

TRIGGERS FONDO DE RESERVA	
SI 1) ES MAYOR QUE 2) NO SE AMORTIZA NINGÚN FONDO DE RESERVA	
1) 99% SALDO ANTERIOR PENDIENTE DE BONOS	141.736.151,02 €
2) SALDO VIVO DCHOS. CRÉDITO EN MOROSIDAD < 90 DÍAS + AMORTIZACION DC'S	141.810.441,65 €

EL FONDO DE RESERVA SE HA REDUCIDO EN ESTE PERIODO

TRIGGERS BONOS	
SI 1) ES MAYOR QUE 2) NO SE AMORTIZA LA SERIE B	
1) DERECHOS EN MOROSIDAD > 90 DÍAS	1.317.329,01 €
2) 4% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO ACTUAL	5.487.071,33 €

LA SERIE B SE AMORTIZA

CONTRATO	CONTRAPARTE	AGENCIA RATING	RATING MÍNIMO EXIGIDO	RATING ACTUAL
CUENTA TESORERÍA	BANCO SANTANDER	MOODYS	P-1 c/p	A3 l/p P-2 c/p
		S&P	A-1 c/p A l/p	A- l/p A-2 c/p
SWAP	BANCO SANTANDER	MOODYS	A2 l/p P-1 c/p	A3 l/p P-2 c/p
		S&P	A l/p	A- l/p A-2 c/p

LA CONTRAPARTE NO TIENE EL RATING MÍNIMO EXIGIDO. SE HA TRASLADADO LA CUENTA DE TESORERIA A UNA CONTRAPARTE CON EL RATING MINIMO EXIGIDO. SE HA CONSTITUIDO UN DEPOSITO EN GARANTIA DEL SWAP

## F.T.H. HIPOTEBANSA XI

### DEFINICIONES

16-ago-16

**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.

**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.

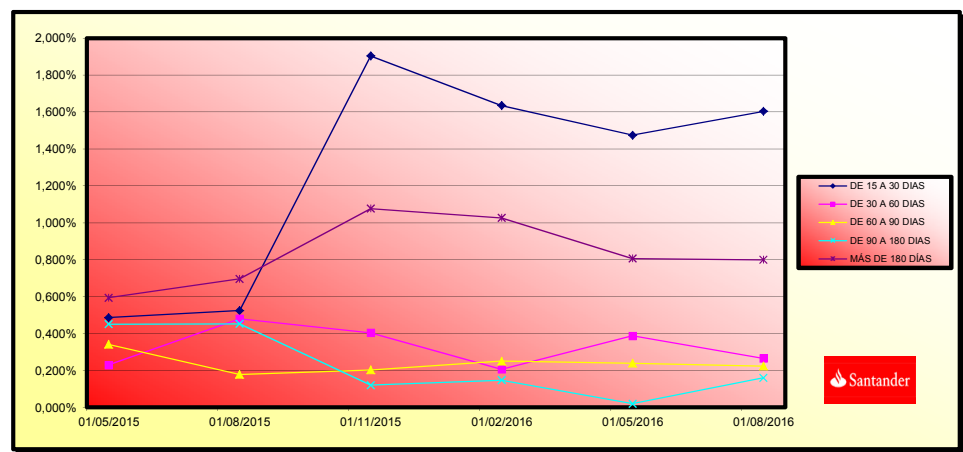
**CONTENCIOSO / JUDICIAL** Préstamos sobre los que el Cedente va a iniciar acciones judiciales. Esta cantidad está incluida en el cuadro de morosidad.

**FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS  
HIPOTEBANSA 11**

Fecha: 16 de Agosto de 2016

**INFORME HISTÓRICO DE MOROSIDAD**

<b>MOROSIDAD HISTÓRICA</b>						
	<b>08/05/2015</b>	<b>10/08/2015</b>	<b>06/11/2015</b>	<b>08/02/2016</b>	<b>09/05/2016</b>	<b>08/08/2016</b>
<b>DE 15 A 30 DIAS</b>	0,486%	0,524%	1,904%	1,635%	1,474%	1,604%
<b>DE 30 A 60 DIAS</b>	0,230%	0,481%	0,405%	0,207%	0,387%	0,265%
<b>DE 60 A 90 DIAS</b>	0,341%	0,179%	0,203%	0,251%	0,240%	0,223%
<b>DE 90 A 180 DIAS</b>	0,450%	0,452%	0,121%	0,148%	0,020%	0,160%
<b>MÁS DE 180 DIAS</b>	0,594%	0,696%	1,077%	1,027%	0,806%	0,800%



**FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS  
HIPOTEBANSA 11**

**VALORES DE TASACIÓN SOBRE SALDOS VIVOS**

Fecha: 16 de Agosto de 2016

ESTADÍSTICO DE VALORES DE TASACIÓN ACTUALES SOBRE SALDOS VIVOS				
	SALDO VIVO	% SALDOS VIVOS	Nº PRÉSTAMOS	% Nº DE PRÉSTAMOS
0-9,99	4.593.316,29	3,35%	827	21,28%
10-19,99	11.132.912,58	8,12%	465	11,97%
20-29,99	20.652.513,97	15,06%	630	16,21%
30-39,99	26.367.053,07	19,22%	663	17,06%
40-49,99	29.318.267,15	21,37%	557	14,33%
50-59,99	26.172.487,70	19,08%	443	11,40%
60-69,99	12.025.977,51	8,77%	198	5,10%
70-79,99	4.635.584,21	3,38%	71	1,83%
> 80	2.278.670,84	1,66%	32	0,82%





1.062.000.000,00  
6,00%  
0,75%  
15-ago-16

69285,54

VIDA RESIDUAL DESDE

1,51

1,75

FECHA	Principal disponible para la amortización	SERIE A	SERIE B	SERIE A		SERIE B	
				PRINCIPAL	VIDA MEDIA	PRINCIPAL	VIDA MEDIA
15-dic-02	0,00	1.040.800.000,00	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ene-03	0,00	1.040.800.000,00	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-feb-03	24.061.955,24	1.040.800.000,00	21.200.000,00	24.061.955,24	-118.625.439.333,20	0,00	0,00
15-mar-03	0,00	1.016.738.044,76	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-abr-03	0,00	1.016.738.044,76	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-may-03	27.122.715,18	1.016.738.044,76	21.200.000,00	27.122.715,18	-131.301.064.186,38	0,00	0,00
15-jun-03	0,00	989.615.329,58	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-jul-03	0,00	989.615.329,58	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ago-03	28.718.625,14	989.615.329,58	21.200.000,00	28.718.625,14	-136.384.750.789,86	0,00	0,00
15-sep-03	0,00	960.896.704,44	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-oct-03	0,00	960.896.704,44	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-nov-03	28.661.508,40	960.896.704,44	21.200.000,00	28.661.508,40	-133.476.644.618,80	0,00	0,00
15-dic-03	0,00	932.235.196,04	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ene-04	0,00	932.235.196,04	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-feb-04	31.604.208,19	932.235.196,04	21.200.000,00	31.604.208,19	-144.273.210.387,35	0,00	0,00
15-mar-04	0,00	900.630.987,85	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-abr-04	0,00	900.630.987,85	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-may-04	34.413.403,21	900.630.987,85	21.200.000,00	34.413.403,21	-153.999.979.364,75	0,00	0,00
15-jun-04	0,00	866.217.584,64	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-jul-04	0,00	866.217.584,64	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ago-04	29.784.636,27	866.217.584,64	21.200.000,00	29.784.636,27	-130.546.060.771,41	0,00	0,00
15-sep-04	0,00	836.432.948,37	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-oct-04	0,00	836.432.948,37	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-nov-04	75.035.418,16	836.432.948,37	21.200.000,00	75.035.418,16	-321.976.979.324,56	0,00	0,00
15-dic-04	0,00	761.397.530,21	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ene-05	0,00	761.397.530,21	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-feb-05	40.274.529,57	761.397.530,21	21.200.000,00	40.274.529,57	-169.112.749.664,43	0,00	0,00
15-mar-05	0,00	721.123.000,64	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-abr-05	0,00	721.123.000,64	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-may-05	35.438.913,80	721.123.000,64	21.200.000,00	35.438.913,80	-145.653.935.718,00	0,00	0,00
15-jun-05	0,00	685.684.086,84	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-jul-05	0,00	685.684.086,84	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ago-05	40.670.101,35	685.684.086,84	21.200.000,00	40.670.101,35	-163.412.467.224,30	0,00	0,00
15-sep-05	0,00	645.013.985,49	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-oct-05	0,00	645.013.985,49	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-nov-05	27.972.838,02	645.013.985,49	21.200.000,00	27.972.838,02	-109.821.362.066,52	0,00	0,00
15-dic-05	0,00	617.041.147,47	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ene-06	0,00	617.041.147,47	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-feb-06	32.546.658,75	617.041.147,47	21.200.000,00	32.546.658,75	-124.783.889.647,50	0,00	0,00
15-mar-06	0,00	584.494.488,72	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-abr-06	0,00	584.494.488,72	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-may-06	30.608.886,55	584.494.488,72	21.200.000,00	30.608.886,55	-114.630.280.129,75	0,00	0,00
15-jun-06	0,00	553.885.602,17	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-jul-06	0,00	553.885.602,17	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ago-06	24.588.822,40	553.885.602,17	21.200.000,00	24.588.822,40	-89.822.968.227,20	0,00	0,00
15-sep-06	0,00	529.296.779,77	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-oct-06	0,00	529.296.779,77	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-nov-06	21.033.977,43	529.296.779,77	21.200.000,00	21.033.977,43	-74.901.993.628,23	0,00	0,00
15-dic-06	0,00	508.262.802,34	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ene-07	0,00	508.262.802,34	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-feb-07	24.321.100,15	508.262.802,34	21.200.000,00	24.321.100,15	-84.369.896.420,35	0,00	0,00
15-mar-07	0,00	483.941.702,19	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-abr-07	0,00	483.941.702,19	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-may-07	19.559.281,65	483.941.702,19	21.200.000,00	19.559.281,65	-66.110.371.977,00	0,00	0,00
15-jun-07	0,00	464.382.420,54	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-jul-07	0,00	464.382.420,54	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ago-07	19.726.158,91	464.382.420,54	21.200.000,00	19.726.158,91	-64.859.610.496,08	0,00	0,00
15-sep-07	0,00	444.656.261,63	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-oct-07	0,00	444.656.261,63	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-nov-07	13.485.961,17	444.656.261,63	21.200.000,00	13.485.961,17	-43.101.131.899,32	0,00	0,00
15-dic-07	0,00	431.170.300,46	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ene-08	0,00	431.170.300,46	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-feb-08	19.506.102,29	431.170.300,46	21.200.000,00	19.506.102,29	-60.546.941.508,16	0,00	0,00
15-mar-08	0,00	411.664.198,17	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-abr-08	0,00	411.664.198,17	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-may-08	15.097.836,76	411.664.198,17	21.200.000,00	15.097.836,76	-45.504.879.994,64	0,00	0,00
15-jun-08	0,00	396.566.361,41	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-jul-08	0,00	396.566.361,41	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ago-08	17.872.437,44	396.566.361,41	21.200.000,00	17.872.437,44	-52.223.262.199,68	0,00	0,00
15-sep-08	0,00	378.693.923,97	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-oct-08	0,00	378.693.923,97	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-nov-08	11.203.992,04	378.693.923,97	21.200.000,00	11.203.992,04	-31.707.297.473,20	0,00	0,00
15-dic-08	0,00	367.489.931,93	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ene-09	0,00	367.489.931,93	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-feb-09	12.558.585,58	367.489.931,93	21.200.000,00	12.558.585,58	-34.385.407.318,04	0,00	0,00
15-mar-09	0,00	354.931.346,35	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-abr-09	0,00	354.931.346,35	21.200.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-may-09	9.842.431,37	354.931.346,35	21.200.000,00	9.375.766,18	-24.836.404.611,32	466.665,19	-1.236.196.087,81
15-jun-09	0,00	345.555.580,17	20.733.334,81	0,00	0,00	0,00	0,00
15-jul-09	0,00	345.555.580,17	20.733.334,81	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ago-09	12.465.400,39	345.555.580,17	20.733.334,81	11.759.811,69	-30.069.838.487,95	705.588,70	-1.804.190.309,28



1.062.000.000,000  
 6,00%  
 0,75%  
 15-ago-16

69285,54

VIDA RESIDUAL DESDE

1,51

1,75

		SERIE A		SERIE B		SERIE A		SERIE B	
		PRINCIPAL	VIDA	PRINCIPAL	VIDA	PRINCIPAL	VIDA	PRINCIPAL	VIDA
15-sep-09	1	0,00	333.795.768,48	20.027.746,11	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-oct-09	1	0,00	333.795.768,48	20.027.746,11	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-nov-09	1	12.857.526,27	333.795.768,48	20.027.746,11	12.129.741,76	-29.899.813.448,63	727.784,51	-1.793.988.806,92	0,00
15-dic-09	1	0,00	321.666.026,72	19.299.961,60	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ene-10	1	0,00	321.666.026,72	19.299.961,60	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-feb-10	1	12.584.982,31	321.666.026,72	19.299.961,60	11.872.624,82	-28.173.738.699,65	712.357,49	-1.690.424.321,98	0,00
15-mar-10	1	0,00	309.793.401,90	18.587.604,11	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-abr-10	1	0,00	309.793.401,90	18.587.604,11	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-may-10	1	10.560.215,51	309.793.401,90	18.587.604,11	9.962.467,46	-22.754.275.683,81	597.748,05	-1.365.256.541,03	0,00
15-jun-10	1	0,00	299.830.934,43	17.989.856,07	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-jul-10	1	0,00	299.830.934,43	17.989.856,07	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ago-10	1	9.960.464,25	299.830.934,43	17.989.856,07	9.396.664,39	-20.597.488.335,85	563.799,86	-1.235.849.300,15	0,00
15-sep-10	1	0,00	290.434.270,05	17.426.056,20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-oct-10	1	0,00	290.434.270,05	17.426.056,20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-nov-10	1	8.147.583,17	290.434.270,05	17.426.056,20	7.686.399,22	-16.141.438.355,66	461.183,95	-968.486.301,34	0,00
15-dic-10	1	0,00	282.747.870,83	16.964.872,25	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ene-11	1	0,00	282.747.870,83	16.964.872,25	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-feb-11	1	10.813.446,82	282.747.870,83	16.964.872,25	10.201.364,92	-20.484.340.768,45	612.081,90	-1.229.060.446,11	0,00
15-mar-11	1	0,00	272.546.505,91	16.352.790,35	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-abr-11	1	0,00	272.546.505,91	16.352.790,35	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-may-11	1	7.940.170,85	272.546.505,91	16.352.790,35	7.490.727,22	-14.374.705.529,39	449.443,63	-862.482.331,76	0,00
15-jun-11	1	0,00	265.055.778,69	15.903.346,72	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-jul-11	1	0,00	265.055.778,69	15.903.346,72	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ago-11	1	7.680.966,69	265.055.778,69	15.903.346,72	7.246.194,99	-13.238.798.247,76	434.771,70	-794.327.894,87	0,00
15-sep-11	1	0,00	257.809.583,70	15.468.575,02	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-oct-11	1	0,00	257.809.583,70	15.468.575,02	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-nov-11	1	6.853.524,21	257.809.583,70	15.468.575,02	6.465.588,88	-11.217.796.702,22	387.935,33	-673.067.802,13	0,00
15-dic-11	1	0,00	251.343.994,82	15.080.639,69	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ene-12	1	0,00	251.343.994,82	15.080.639,69	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-feb-12	1	9.533.199,13	251.343.994,82	15.080.639,69	8.993.584,08	-14.776.458.651,50	539.615,05	-886.587.519,09	0,00
15-mar-12	1	0,00	242.350.410,74	14.541.024,64	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-abr-12	1	0,00	242.350.410,74	14.541.024,64	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-may-12	1	9.033.021,26	242.350.410,74	14.541.024,64	8.521.718,17	-13.234.228.317,72	511.303,09	-794.053.699,06	0,00
15-jun-12	1	0,00	233.828.692,57	14.029.721,55	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-jul-12	1	0,00	233.828.692,57	14.029.721,55	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ago-12	1	8.007.339,51	233.828.692,57	14.029.721,55	7.554.093,88	-11.036.531.154,82	453.245,63	-662.191.869,29	0,00
15-sep-12	1	0,00	226.274.598,69	13.576.475,92	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-oct-12	1	0,00	226.274.598,69	13.576.475,92	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-nov-12	1	7.186.508,19	226.274.598,69	13.576.475,92	6.779.724,71	-9.281.443.124,63	406.783,48	-556.886.587,48	0,00
15-dic-12	1	0,00	219.494.873,98	13.169.692,44	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ene-13	1	0,00	219.494.873,98	13.169.692,44	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-feb-13	1	8.517.496,57	219.494.873,98	13.169.692,44	8.035.374,12	-10.261.172.754,61	482.122,45	-615.670.365,28	0,00
15-mar-13	1	0,00	211.459.499,86	12.687.569,99	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-abr-13	1	0,00	211.459.499,86	12.687.569,99	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-may-13	1	6.973.863,92	211.459.499,86	12.687.569,99	6.579.116,91	-7.815.990.883,92	394.747,01	-468.959.453,04	0,00
15-jun-13	1	0,00	204.880.382,95	12.292.822,98	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-jul-13	1	0,00	204.880.382,95	12.292.822,98	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ago-13	1	6.515.003,52	204.880.382,95	12.292.822,98	6.515.003,52	-7.140.443.857,92	0,00	0,00	0,00
15-sep-13	1	0,00	198.365.379,43	12.292.822,98	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-oct-13	1	0,00	198.365.379,43	12.292.822,98	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-nov-13	1	6.080.651,22	198.365.379,43	12.292.822,98	5.367.689,63	-5.389.160.389,47	712.961,59	-715.813.435,41	0,00
15-dic-13	1	0,00	192.997.689,80	11.579.861,39	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ene-14	1	0,00	192.997.689,80	11.579.861,39	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-feb-14	1	7.153.270,94	192.997.689,80	11.579.861,39	6.748.368,81	-6.154.512.355,92	404.902,13	-369.270.741,36	0,00
15-mar-14	1	0,00	186.249.320,99	11.174.959,26	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-abr-14	1	0,00	186.249.320,99	11.174.959,26	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-may-14	1	7.469.918,55	186.249.320,99	11.174.959,26	7.047.092,97	-5.799.757.515,71	422.825,58	-347.985.450,94	0,00
15-jun-14	1	0,00	179.202.228,02	10.752.133,68	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-jul-14	1	0,00	179.202.228,02	10.752.133,68	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ago-14	1	6.039.715,18	179.202.228,02	10.752.133,68	5.697.844,51	-4.165.124.336,40	341.870,67	-249.907.460,18	0,00
15-sep-14	1	0,00	173.504.383,51	10.410.263,01	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-oct-14	1	0,00	173.504.383,51	10.410.263,01	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-nov-14	1	5.749.172,43	173.504.383,51	10.410.263,01	5.423.747,58	-3.465.774.700,73	325.424,85	-207.946.482,04	0,00
15-dic-14	1	0,00	168.080.635,93	10.084.838,16	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ene-15	1	0,00	168.080.635,93	10.084.838,16	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-feb-15	1	6.377.229,41	168.080.635,93	10.084.838,16	6.016.254,16	-3.290.891.025,73	360.975,25	-197.453.461,54	0,00
15-mar-15	1	0,00	162.064.381,77	9.723.862,91	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-abr-15	1	0,00	162.064.381,77	9.723.862,91	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-may-15	1	5.853.288,37	162.064.381,77	9.723.862,91	5.521.970,16	-2.529.062.333,45	331.318,21	-151.743.740,01	0,00
15-jun-15	1	0,00	156.542.411,61	9.392.544,70	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-jul-15	1	0,00	156.542.411,61	9.392.544,70	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ago-15	1	5.475.052,69	156.542.411,61	9.392.544,70	5.165.144,05	-1.890.442.721,26	309.908,64	-113.426.563,28	0,00
15-sep-15	1	0,00	151.377.267,57	9.082.636,05	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-oct-15	1	0,00	151.377.267,57	9.082.636,05	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-nov-15	1	4.883.517,83	151.377.267,57	9.082.636,05	4.883.517,83	-1.338.083.885,42	0,00	0,00	0,00
15-dic-15	1	0,00	146.493.749,74	9.082.636,05	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ene-16	1	0,00	146.493.749,74	9.082.636,05	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-feb-16	1	6.343.306,10	146.493.749,74	9.082.636,05	6.343.306,10	-1.154.481.710,20	0,00	0,00	0,00
15-mar-16	1	0,00	140.150.443,64	9.082.636,05	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-abr-16	1	0,00	140.150.443,64	9.082.636,05	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-may-16	1	6.066.214,96	140.150.443,64	9.082.636,05	5.087.363,70	-468.037.460,59	978.851,26	-90.054.315,73	0,00
15-jun-16	1	0,00	135.063.079,93	8.103.784,80	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-jul-16	1	0,00	135.063.079,93	8.103.784,80	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ago-16	1	5.991.015,59	135.063.079,93	8.103.784,80	5.852.177,79	0,00	138.837,80	0,00	0,00
15-sep-16	1	0,00	129.210.902,14	7.964.947,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

1.062.000.000,000  
 6,00%  
 0,75%  
 15-ago-16

69285,54

VIDA RESIDUAL DESDE

1,51

1,75

	Principal	SERIE A	SERIE B	SERIE A PRINCIPAL	VIDA	SERIE B PRINCIPAL	VIDA	
15-oct-16 1	0,00	129.210.902,14	7.964.947,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-nov-16 1	6.346.941,54	129.210.902,14	7.964.947,00	6.346.941,54	583.918.621,81	0,00	0,00	0,00
15-dic-16 1	0,00	122.863.960,60	7.964.947,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ene-17 1	0,00	122.863.960,60	7.964.947,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-feb-17 1	6.159.280,98	122.863.960,60	7.964.947,00	6.159.280,98	1.133.307.701,14	0,00	0,00	0,00
15-mar-17 1	0,00	116.704.679,62	7.964.947,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-abr-17 1	0,00	116.704.679,62	7.964.947,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-may-17 1	5.979.545,19	116.704.679,62	7.964.947,00	5.979.545,19	1.632.415.836,99	0,00	0,00	0,00
15-jun-17 1	0,00	110.725.134,43	7.964.947,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-jul-17 1	0,00	110.725.134,43	7.964.947,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ago-17 1	5.308.960,49	110.725.134,43	7.964.947,00	5.308.960,49	1.937.770.579,42	0,00	0,00	0,00
15-sep-17 1	0,00	105.416.173,94	7.964.947,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-oct-17 1	0,00	105.416.173,94	7.964.947,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
15-nov-17 1	4.913.295,61	105.416.173,94	7.964.947,00	4.913.295,61	2.245.376.094,48	0,00	0,00	0,00
15-dic-17 1	0,00	100.502.878,32	7.964.947,00	0	0,00	0,00	0,00	0,00
15-ene-18 1	0,00	100.502.878,32	7.964.947,00	0	0,00	0,00	0,00	0,00
15-feb-18 1	4.768.935,72	100.502.878,32	7.964.947,00	4.768.935,72	2.618.145.711,77	0,00	0,00	0,00
15-mar-18 1	0,00	95.733.942,60	7.964.947,00	0	0	0,00	0,00	0,00
15-abr-18 1	0,00	95.733.942,60	7.964.947,00	0	0	0,00	0,00	0,00
15-may-18 1	103.699.823,78	95.733.942,60	7.964.947,00	95.733.942,60	61.078.255.379,91	7.964.947,00	5.081.636.183,47	