



## **F.T.A. UCI 11**

**SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.**  
**GRAN VIA DE HORTALEZA 3**  
**28033 MADRID**  
**[santanderdetitulizacion@gruposantander.com](mailto:santanderdetitulizacion@gruposantander.com)**



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

SERIES PRELACIÓN CÓDIGO ISIN	Nº BONOS	NOMINAL EN CIRCULACIÓN			
			Inicial	Actual	%Act/In
B.T.A'S SERIE A ES033834005	8.211	Nominal Unitario	100.000,00	18.895,29	
		Nominal Total	821.100.000,00	155.149.226,19	18,90 %
B.T.A'S SERIE B ES0338340013	60	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	6.000.000,00	6.000.000,00	100,00 %
B.T.A'S SERIE C ES0338340021	229	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	22.900.000,00	22.900.000,00	100,00 %

AMORTIZACION E INTERESES BONOS					
Actual			Próximo		
Fecha Amortización Periodo Actual 15 marzo 2017			Fecha Próximo Cupón 15 junio 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	637,05 €	0,00 €	0,0000 %	0,00 €	0,00 €
B.T.A'S SERIE B	0,00 €	3,50 €	0,0000 %	0,00 €	0,00 €
B.T.A'S SERIE C	0,00 €	108,50 €	0,4200 %	107,33 €	86,94 €
Amortización devengada no pagada	0,00 €				
Amortización Calendario	NO				

### III. ACTIVOS ADQUIRIDOS POR EL FONDO: DERECHOS DE CRÉDITO

DERECHOS DE CRÉDITO	A LA EMISIÓN	SITUACIÓN ACTUAL
Número de Derechos de Crédito	11.356	3.680
Saldo Pendiente de Amortizar Derechos	850.000.156,93	FJFÈJGÈI €€€
Importes Unitarios Derechos Vivos	74.850,30	Í GÈFÍ ÈJ
Tipos de Interés	4,23 %	1,69 %

TASAS DE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA	SITUACIÓN ACTUAL
Tasa mensual actual anualizada:	Í ÈÍ %
Tasa últimos 12 meses anualizada:	Í ÈÍ Å
Tasa anualizada desde Constitución del Fondo	ì ÈH%

MOROSIDAD ACTUAL	Hasta 1 mes	De 1 a 6 meses	Mayor de 6 meses
Deuda Vencida(Principal+Intereses)	25.756,50	68.227,55	1.137.753,11
Deuda Pendiente de vencimiento	0,00	0,00	FJFÈI ÈÈÍ ÈÈ
Deuda Total	25.756,50	68.227,55	FJGÈI GÈI ÈJ

**F.T.A. UCI 11****INFORME TRIMESTRAL BONOS DE TITULIZACIÓN****15 de marzo de 2017**

<b>BONOS TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. PRINCIPAL</b>	
Saldo anterior	189.280.043,74 €
Amortizaciones	5.230.817,55 €
Saldo actual	184.049.226,19 €
% sobre saldo inicial	21,65%
Amortización devengada no pagada	0,00 €

<b>BONOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. INTERESES</b>	
Intereses pagados Serie A	0,00 €
Intereses pagados Serie B	210,00 €
Intereses pagados Serie C	24.846,50 €
Intereses devengados no pagados	0

<b>DATOS</b>	
Fecha de determinación	08/03/2017
Fecha de Pago de Cupón Actual	15/03/2017
Fecha de Pago de Cupón Anterior	15/12/2016
Número de días	90
Tipo de referencia (%)	0,330%
Próxima Fecha de Pago	15/06/2017

<b>VIDA RESIDUAL (AÑOS)</b>		
	<b>INICIAL</b>	<b>15 de marzo de 2017</b>
B.T.A'S SERIE A	4,75	3,54
B.T.A'S SERIE B	7,93	5,51
B.T.A'S SERIE C	7,91	5,51

**F.T.A. UCI 11**

**INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO**

15 de marzo de 2017

<b>DERECHOS DE CRÉDITO. PRINCIPAL</b>	
Saldo anterior	196.692.911,05 €
Amortizaciones	4.900.170,15 €
Saldo actual	191.792.740,90 €
Número de derechos de crédito	3.680
LTV	36,03%

<b>DERECHOS DE CRÉDITO. INTERESES</b>	
Intereses cobrados en el trimestre	754.176,59 €
Intereses devengados en el trimestre	753.576,66 €

<b>DERECHOS DE CRÉDITO CON RETRASOS EN EL PAGO</b>					
	<b>HASTA 30 DIAS</b>	<b>30 A 60 DIAS</b>	<b>60 A 90 DIAS</b>	<b>90 A 180 DIAS</b>	<b>MÁS DE 180 DIAS</b>
Principal	20.468,46 €	20.288,06 €	9.658,96 €	21.430,67 €	676.589,67 €
Intereses	5.288,04 €	6.482,39 €	3.511,30 €	6.856,17 €	461.163,44 €
Saldo de los derechos de crédito	4.870.395,64 €	2.810.914,60 €	809.610,38 €	1.402.849,26 €	3.383.428,50 €
Número de derechos de crédito	89	46	13	24	107
% sobre saldo de los derechos de crédito	2,54%	1,47%	0,42%	0,73%	1,76%

<b>PRÉSTAMOS EN WRITE OFF</b>	
Write Off acumulado Fecha Pago anterior	7.412.903,76 €
Write Off trimestre	330.642,70 €
Write Off acumulados actuales	7.743.546,46 €

**F.T.A. UCI 11**

**INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO**

15 de marzo de 2017

<b>ADJUDICADOS</b>	
Saldo anterior	1.682.120,06 €
Diferencia	25.992,89 €
Saldo actual	1.708.112,95 €
Número de adjudicados	45

<b>PERDIDAS DE LA CARTERA</b>	
Saldo anterior	2.064.937,48 €
Diferencia	108.558,82 €
Saldo actual	2.173.496,30 €

**F.T.A. UCI 11**

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

15 de marzo de 2017

ORIGEN	5.492.465,61 €
<b>PRINCIPAL COBRADO</b>	
Amortización derechos de crédito	4.644.096,00 €
<b>INTERESES COBRADOS</b>	
Intereses de derechos de crédito	754.176,59 €
Intereses de reinversión	-11.449,59 €
<b>INGRESOS/GASTOS DE ADJUDICADOS</b>	99.717,58 €
<b>INGRESOS IMPORTES ASEGURADOS</b>	5.940,00 €
<b>OTROS</b>	-14,97 €

APLICACIÓN	5.492.465,61 €
GASTOS ORDINARIOS	592,54 €
COMISIÓN S.G.F.T	14.551,88 €
PAGO SWAP	0,00 €
COBRO SWAP	0,00 €
INTERESES B.T.A'S SERIE A	0,00 €
INTERESES B.T.A'S SERIE B	210,00 €
INTERESES B.T.A'S SERIE C	24.846,50 €
FONDOS DISPONIBLES AMORTIZACIÓN A	5.230.817,55 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO SANTANDER	4.526,52 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB	4.526,52 €
COMISIÓN ADMINISTRACIÓN UCI	6.000,00 €
COMISIÓN VARIABLE	206.394,09 €

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



**F.T.A. UCI 11****MEJORA CREDITICIA Y PRÉSTAMO SUBORDINADO**

15 de marzo de 2017

<b>MEJORA DE CRÉDITO</b>				
<b>CONCEPTOS</b>	<b>INICIAL</b>		<b>15 de marzo de 2017</b>	
EMISIÓN SUBORDINADA	28.900.000,00 €	3,40 %	28.900.000,00 €	15,70%
FONDO DE RESERVA	12.750.000,00 €	1,50%	12.750.000,00 €	6,93%

<b>PRÉSTAMOS SUBORDINADOS</b>				
<b>CONCEPTOS</b>	<b>INICIAL</b>		<b>15 de marzo de 2017</b>	
<b>PRÉSTAMO SUBORDINADO SCH</b>				
Saldo vivo	6.812.500,00 €		6.375.386,18 €	
Tipo de interés		2,790 %		0,270%
<b>PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB</b>				
Saldo vivo	6.812.500,00 €		6.375.386,18 €	
Tipo de interés		2,790 %		0,270%

## F.T.A. UCI 11

### DEFINICIONES

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

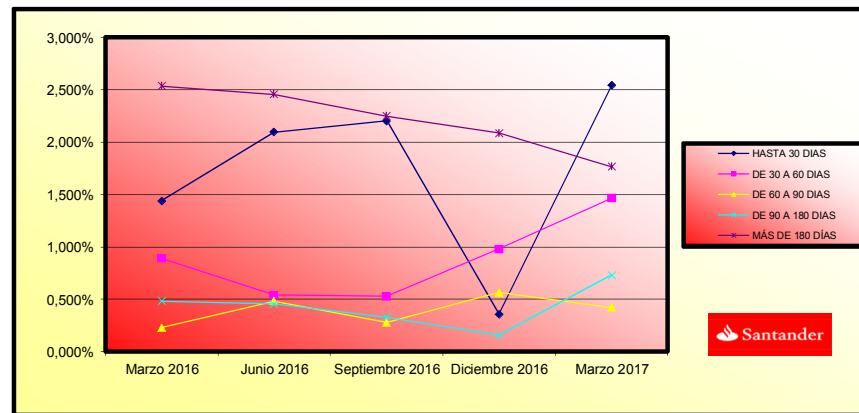
**WRITE OFF** Préstamos con cuotas pendientes con antigüedad igual o superior a 12 ó 18 meses (según Folleto Informativo).

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

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

INFORME HISTÓRICO DE MOROSIDAD

MOROSIDAD HISTÓRICA					
	Marzo 2016	Junio 2016	Septiembre 2016	Diciembre 2016	Marzo 2017
HASTA 30 DIAS	1,439%	2,094%	2,202%	0,357%	2,539%
DE 30 A 60 DIAS	0,892%	0,542%	0,527%	0,982%	1,466%
DE 60 A 90 DIAS	0,228%	0,483%	0,279%	0,567%	0,422%
DE 90 A 180 DIAS	0,484%	0,454%	0,331%	0,155%	0,731%
MÁS DE 180 DIAS	2,534%	2,454%	2,248%	2,086%	1,764%



**FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS  
UCI 11**

INFORME RELATIVO A LOS TRIGGERS DEL FONDO

15/03/2017

AMORTIZACIÓN BONOS SERIE B y C	
SI 1) ES MAYOR QUE 2) NO SE AMORTIZAN LAS SERIES B y C	
1) DERECHOS EN MOROSIDAD > 90 DÍAS	12.529.824,22 €
2) 2% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO ACTUAL	3.835.854,82 €

MOROSIDAD > 90 DÍAS (% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO)
6,53%

**NO SE AMORTIZAN LAS SERIES B y C**

TRIGGERS FONDOS DE RESERVA	
SI 1) ES MAYOR QUE 2) NO SE AMORTIZA EL FONDO DE RESERVA	
1) DERECHOS EN MOROSIDAD > 90 DÍAS	12.529.824,22 €
2) 1,25% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO ACTUAL	2.397.409,26 €

**NO SE AMORTIZA EL FONDO DE RESERVA**

POSTERGAMIENTO DE INTERESES DE LAS SERIES B Y C	
SI 1) ES MAYOR QUE 2)+3) LOS INTS DE LA SERIE B SE POSTERGAN AL 7 ° LUGAR	
1) SALDO DE LA SERIE A	160.380.043,74 €
2) SALDO VIVO DERECHOS DE CRÉDITO (MOROSIDAD < 18 MESES)	182.399.563,55 €
3) REMANENTE F.DISPONIBLES DESPUÉS PAGO PUNTOS 1° - 4°	18.227.111,19 €
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	166.380.043,74 €
2) SALDO VIVO DERECHOS DE CRÉDITO (MOROSIDAD < 18 MESES)	182.399.563,55 €
3) REMANENTE F.DISPONIBLES DESPUÉS PAGO PUNTOS 1° - 5°	18.202.264,69 €

**NO SE POSTERGAN LOS INTERESES DE LA SERIE B**

**NO SE POSTERGAN LOS INTERESES DE LA SERIE C**

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

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

**FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS  
UCI 11**

LTV						
INTERVALO - INTERVAL	SALDO - OUTSTANDING	% SALDOS VIVOS - % OUTSTANDING	Nº PRÉSTAMOS- NUMBER LOANS	% Nº PRÉSTAMOS- % NUMBER LOANS		
0,00 - 9,99	9.322.538,71	4,8607%	966	25,9853%		
10,00 - 19,99	4.212.922,00	2,1966%	143	3,8869%		
20,00 - 29,99	10.589.992,51	5,5216%	203	5,5178%		
30,00 - 39,99	23.858.305,22	12,4396%	355	9,6494%		
40,00 - 49,99	31.315.104,20	16,3276%	442	12,0141%		
50,00 - 59,99	71.304.106,15	37,1777%	1.077	29,2743%		
60,00 - 69,99	28.255.873,60	14,7325%	372	10,1114%		
70,00 - 79,99	10.737.519,63	5,5985%	111	3,0171%		
80,00 - 89,99	1.925.906,03	1,0042%	18	0,4893%		
90,00 - 93,41	270.505,06	0,1410%	2	0,0544%		

UCI 11

Fecha	Saldo antes de Pago	Saldo Real	Vector de Prepago	Permanencia final de mes	Mortalidad Mensual	CPR	Mortalidad Mensual	CPR
Date	Outstanding before prepayment	Real outstanding	Prepayment vector	Remaining at the end of the month	Average single monthly mortality	CPR	Monthly single mortality	CPR
			0,76%					4,37%
	850.000.000,00		100,00%	100,00%				
8-dic-04	848.447.342,89	833.517.603,20	99,24%	98,24%	1,76%	19,19%	1,76%	19,19%
8-ene-05	846.889.973,92	816.392.876,79	98,49%	96,40%	1,82%	19,75%	1,87%	20,31%
8-feb-05	845.328.036,68	802.341.378,75	97,74%	94,91%	1,72%	18,84%	1,54%	16,99%
8-mar-05	843.761.517,75	786.900.260,82	97,00%	93,26%	1,73%	18,89%	1,74%	19,02%
8-abr-05	842.190.403,70	768.001.629,57	96,26%	91,19%	1,83%	19,85%	2,22%	23,61%
8-may-05	840.614.681,05	751.784.924,91	95,53%	89,43%	1,84%	20,02%	1,93%	20,83%
8-jun-05	839.034.336,28	732.993.980,46	94,81%	87,36%	1,91%	20,68%	2,32%	24,51%
8-jul-05	837.449.355,83	713.527.819,67	94,09%	85,20%	1,98%	21,35%	2,47%	25,94%
8-ago-05	835.859.726,10	695.561.749,15	93,38%	83,22%	2,02%	21,73%	2,33%	24,66%
8-sep-05	834.265.433,46	682.206.195,00	92,67%	81,77%	1,99%	21,45%	1,73%	18,92%
8-oct-05	832.666.464,23	670.301.480,81	91,97%	80,50%	1,95%	21,07%	1,56%	17,16%
8-nov-05	831.062.804,69	654.364.086,82	91,27%	78,74%	1,97%	21,26%	2,19%	23,33%
8-dic-05	829.454.441,08	633.873.172,63	90,58%	76,42%	2,05%	21,98%	2,94%	30,13%
8-ene-06	827.841.359,61	619.627.389,01	89,89%	74,85%	2,05%	21,99%	2,06%	22,07%
8-feb-06	826.223.546,43	601.383.750,24	89,21%	72,79%	2,10%	22,44%	2,75%	28,48%
8-mar-06	824.600.987,66	584.239.740,88	88,53%	70,85%	2,13%	22,77%	2,66%	27,64%
8-abr-06	822.973.669,39	566.483.863,76	87,86%	68,83%	2,17%	23,17%	2,85%	29,29%
8-may-06	821.341.577,65	551.680.941,47	87,19%	67,17%	2,19%	23,30%	2,42%	25,47%
8-jun-06	819.704.698,44	536.851.732,28	86,53%	65,49%	2,20%	23,46%	2,49%	26,14%
8-jul-06	818.063.017,72	518.335.537,79	85,87%	63,36%	2,26%	23,95%	3,26%	32,78%
8-ago-06	816.416.521,41	505.514.356,78	85,22%	61,92%	2,26%	23,96%	2,28%	24,15%
8-sep-06	814.765.195,37	497.832.455,51	84,58%	61,10%	2,21%	23,56%	1,32%	14,74%
8-oct-06	813.109.025,44	489.785.181,54	83,93%	60,24%	2,18%	23,24%	1,42%	15,73%
8-nov-06	811.447.997,41	480.954.788,91	83,30%	59,27%	2,16%	23,01%	1,60%	17,62%
8-dic-06	809.782.097,03	470.277.417,04	82,67%	58,07%	2,15%	22,96%	2,02%	21,71%
8-ene-07	808.111.707,58	460.043.992,15	82,04%	56,93%	2,14%	22,90%	1,97%	21,28%
8-feb-07	806.436.418,33	450.559.931,77	81,42%	55,87%	2,13%	22,80%	1,86%	20,15%
8-mar-07	804.756.214,89	440.907.144,06	80,80%	54,79%	2,13%	22,73%	1,94%	20,93%
8-abr-07	803.071.082,85	431.073.415,47	80,19%	53,68%	2,12%	22,70%	2,03%	21,77%
8-may-07	801.381.007,76	421.968.045,26	79,58%	52,66%	2,12%	22,63%	1,91%	20,62%
8-jun-07	799.685.975,11	412.121.707,46	78,97%	51,54%	2,12%	22,63%	2,13%	22,73%

Fecha	Saldo antes de Pago	Saldo Real	vector de Prepago	Remanencia final de mes	Mortalidad Mensual	CPR	Mortalidad Mensual	CPR
Date	Outstanding before prepayment	Real outstanding	Prepayment vector	Remaining at the end of the month	Average single monthly mortality	CPR	Monthly single monthly mortality	CPR
			0,76%					4,37%
8-jul-07	797.986.907,49	404.454.167,85	78,37%	50,68%	2,10%	22,50%	1,65%	18,11%
8-ago-07	796.282.855,93	396.791.374,83	77,78%	49,83%	2,09%	22,38%	1,68%	18,44%
8-sep-07	794.573.805,82	391.376.030,13	77,19%	49,26%	2,06%	22,11%	1,15%	12,99%
8-oct-07	792.859.742,50	386.989.073,29	76,60%	48,81%	2,03%	21,80%	0,91%	10,36%
8-nov-07	791.140.651,25	381.540.150,55	76,02%	48,23%	2,01%	21,58%	1,19%	13,42%
8-dic-07	789.416.517,34	374.085.117,49	75,45%	47,39%	2,00%	21,51%	1,74%	18,99%
8-ene-08	787.694.525,33	368.864.560,67	74,87%	46,83%	1,98%	21,30%	1,18%	13,28%
8-feb-08	785.967.482,14	365.347.329,01	74,31%	46,48%	1,95%	21,00%	0,74%	8,48%
8-mar-08	784.235.372,95	361.954.516,26	73,74%	46,15%	1,91%	20,70%	0,71%	8,19%
8-abr-08	782.498.182,91	356.988.908,13	73,18%	45,62%	1,90%	20,52%	1,15%	12,99%
8-may-08	780.755.897,12	351.895.556,23	72,63%	45,07%	1,88%	20,36%	1,21%	13,56%
8-jun-08	779.008.500,62	348.169.826,92	72,08%	44,69%	1,86%	20,13%	0,84%	9,59%
8-jul-08	777.259.527,22	347.228.513,39	71,53%	44,67%	1,81%	19,73%	0,05%	0,55%
8-ago-08	775.505.423,51	346.077.498,92	70,99%	44,63%	1,78%	19,36%	0,11%	1,27%
8-sep-08	773.746.174,42	341.634.083,80	70,45%	44,15%	1,76%	19,21%	1,06%	12,00%
8-oct-08	771.981.764,88	338.356.595,89	69,92%	43,83%	1,74%	18,99%	0,73%	8,45%
8-nov-08	770.212.179,73	335.395.338,94	69,39%	43,55%	1,72%	18,77%	0,65%	7,50%
8-dic-08	768.437.403,79	333.970.278,42	68,86%	43,46%	1,69%	18,46%	0,19%	2,31%
8-ene-09	766.659.103,76	331.962.327,38	68,34%	43,30%	1,66%	18,20%	0,37%	4,36%
8-feb-09	764.875.587,37	329.978.849,13	67,82%	43,14%	1,63%	17,95%	0,37%	4,30%
8-mar-09	763.086.839,34	328.476.806,46	67,30%	43,05%	1,61%	17,68%	0,22%	2,63%
8-abr-09	761.292.844,32	326.273.336,82	66,79%	42,86%	1,59%	17,46%	0,44%	5,12%
8-may-09	759.493.586,90	323.503.228,38	66,29%	42,59%	1,57%	17,28%	0,61%	7,13%
8-jun-09	757.689.051,67	321.386.971,51	65,78%	42,42%	1,55%	17,07%	0,42%	4,90%
8-jul-09	755.881.308,93	319.112.570,09	65,28%	42,22%	1,53%	16,87%	0,47%	5,50%
8-ago-09	754.068.263,48	317.841.095,04	64,79%	42,15%	1,50%	16,63%	0,16%	1,89%
8-sep-09	752.249.899,76	314.354.974,81	64,30%	41,79%	1,49%	16,52%	0,86%	9,82%
8-oct-09	750.426.202,17	312.492.643,31	63,81%	41,64%	1,47%	16,32%	0,35%	4,13%
8-nov-09	748.597.155,07	309.793.127,81	63,33%	41,38%	1,46%	16,18%	0,62%	7,21%
8-dic-09	746.762.742,76	307.081.055,36	62,85%	41,12%	1,45%	16,04%	0,63%	7,33%
8-ene-10	744.925.018,92	304.171.922,35	62,37%	40,83%	1,43%	15,92%	0,70%	8,12%
8-feb-10	743.081.904,42	302.891.409,39	61,90%	40,76%	1,41%	15,71%	0,17%	2,07%
8-mar-10	741.233.383,45	300.122.393,54	61,43%	40,49%	1,40%	15,59%	0,67%	7,72%
8-abr-10	739.379.440,15	297.807.053,26	60,96%	40,28%	1,39%	15,45%	0,52%	6,09%
8-may-10	737.520.058,62	295.608.835,47	60,50%	40,08%	1,38%	15,31%	0,49%	5,70%
8-jun-10	735.655.222,91	293.760.620,91	60,04%	39,93%	1,36%	15,16%	0,37%	4,39%
8-jul-10	733.787.447,69	291.341.154,99	59,58%	39,70%	1,35%	15,04%	0,57%	6,64%
8-ago-10	731.914.193,66	289.072.708,07	59,13%	39,50%	1,34%	14,92%	0,52%	6,12%
8-sep-10	730.035.444,76	287.255.851,54	58,68%	39,35%	1,32%	14,78%	0,37%	4,38%
8-oct-10	728.151.184,86	286.099.404,91	58,24%	39,29%	1,31%	14,61%	0,14%	1,72%
8-nov-10	726.261.397,79	284.751.082,83	57,80%	39,21%	1,29%	14,45%	0,21%	2,52%
8-dic-10	724.366.067,35	281.674.551,27	57,36%	38,89%	1,29%	14,38%	0,82%	9,43%
8-ene-11	722.468.266,09	278.838.334,02	56,92%	38,60%	1,28%	14,31%	0,75%	8,60%
8-feb-11	720.564.897,95	277.785.066,79	56,49%	38,55%	1,26%	14,14%	0,11%	1,37%
8-mar-11	718.655.946,59	275.983.701,22	56,06%	38,40%	1,25%	14,02%	0,38%	4,52%
8-abr-11	716.741.395,64	274.448.612,53	55,64%	38,29%	1,24%	13,90%	0,29%	3,43%
8-may-11	714.821.228,68	273.778.936,22	55,21%	38,30%	1,22%	13,73%	-0,02%	-0,29%
8-jun-11	712.895.429,22	271.621.942,31	54,80%	38,10%	1,21%	13,63%	0,52%	6,06%
8-jul-11	710.965.191,30	270.217.689,41	54,38%	38,01%	1,20%	13,51%	0,25%	2,92%
8-ago-11	709.029.291,35	269.318.086,88	53,97%	37,98%	1,19%	13,36%	0,06%	0,73%
8-sep-11	707.087.712,76	268.147.150,38	53,56%	37,92%	1,18%	13,23%	0,16%	1,92%
8-oct-11	705.140.438,88	267.183.876,05	53,15%	37,89%	1,16%	13,09%	0,08%	1,00%

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



Fecha	Saldo antes de Pago	Saldo Real	vector de Prepago	Remanencia final de mes	mortalidad Mensual	CPR	mortalidad Mensual	CPR
Date	Outstanding before prepayment	Real outstanding	Prepayment vector	Remaining at the end of the month	Average single monthly mortality	CPR	Monthly single monthly mortality	CPR
			0,76%					4,37%
8-ago-16	583.807.652,18	194.629.344,46	34,18%	33,34%	0,78%	8,93%	0,27%	3,24%
8-sep-16	581.568.598,03	193.258.870,10	33,92%	33,23%	0,77%	8,89%	0,32%	3,79%
8-oct-16	579.322.975,99	192.149.295,98	33,66%	33,17%	0,77%	8,84%	0,19%	2,24%
8-nov-16	577.070.766,80	190.838.799,89	33,40%	33,07%	0,77%	8,81%	0,29%	3,48%
8-dic-16	574.811.951,12	189.280.007,29	33,15%	32,93%	0,76%	8,78%	0,43%	5,01%
8-ene-17	572.555.085,34	187.291.480,89	32,90%	32,71%	0,76%	8,78%	0,66%	7,64%
8-feb-17	570.291.599,43	185.567.790,61	32,65%	32,54%	0,76%	8,76%	0,53%	6,14%
8-mar-17	568.021.473,95	184.049.194,44	32,40%	32,40%	0,76%	8,73%	0,42%	4,95%

DECRECIMIENTO SERIE B 1,4%  
 SUSPEN.DECREC.SERIE B 1,4%  
 SERIE C  
 DECRECIMIENTO SERIE C 5,4%  
 SUSPEN.DECREC.SERIE C  
 VIDA RESIDUAL DESDE 8-mar-17 3,54 5,51 5,51

Fecha	Principal disponible antes prepago	Principal Disponible	Amortización de principal	Serie A	Serie B	Serie C	Amortización Serie A	Vida Media Serie A	Amortización Serie B	Vida Media Serie B	Amortización Serie C	Vida Media Serie C
								3,54		5,51		5,51
Date	Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	Average Life Class A	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C
	850.000.000,00											
8-dic-04	848.447.342,89			821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00						
8-ene-05	846.889.973,92	0,00	0,00	821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-05	845.328.036,68	0,00	0,00	821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-05	843.761.517,75	786.900.260,82	63.099.739,18	821.100.000,00	6.000.000,00	22.900.000,00	63.099.739,18	-27656615682594,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-05	842.190.403,70	0,00	0,00	758.000.260,82	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-05	840.614.681,05	0,00	0,00	758.000.260,82	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-05	839.034.336,28	732.993.980,46	53.906.280,36	758.000.260,82	6.000.000,00	22.900.000,00	53.906.280,36	-23131184902476,10%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-05	837.448.355,83	0,00	0,00	704.093.980,46	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-05	835.859.726,10	0,00	0,00	704.093.980,46	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-sep-05	834.265.433,46	682.206.195,00	50.787.785,46	704.093.980,46	6.000.000,00	22.900.000,00	50.787.785,46	-21325791114654,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-oct-05	832.666.464,23	0,00	0,00	653.306.195,00	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-nov-05	831.062.804,69	0,00	0,00	653.306.195,00	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-dic-05	829.454.441,08	633.873.172,63	48.333.022,37	653.306.195,00	6.000.000,00	22.900.000,00	48.333.022,37	-19855205589596,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ene-06	827.841.359,61	0,00	0,00	604.973.172,63	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-06	826.223.546,43	0,00	0,00	604.973.172,63	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-06	824.600.987,66	584.239.740,88	49.633.431,75	604.973.172,63	6.000.000,00	22.900.000,00	49.633.431,75	-19942712877150,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-06	822.973.669,39	0,00	0,00	555.339.740,88	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-06	821.341.577,65	0,00	0,00	555.339.740,88	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-06	819.704.698,44	536.851.732,28	47.388.008,60	555.339.740,88	6.000.000,00	22.900.000,00	47.388.008,60	-18604532176360,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-06	818.063.017,72	0,00	0,00	507.951.732,28	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-06	816.416.521,41	0,00	0,00	507.951.732,28	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-sep-06	814.765.195,37	497.832.455,51	39.019.276,77	507.951.732,28	6.000.000,00	22.900.000,00	39.019.276,77	-14959990713618,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-oct-06	813.109.025,44	0,00	0,00	468.932.455,51	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-nov-06	811.447.987,41	0,00	0,00	468.932.455,51	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-dic-06	809.782.097,03	470.277.417,04	27.555.038,47	468.932.455,51	6.000.000,00	22.900.000,00	27.555.038,47	-10313850899321,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ene-07	808.111.707,58	0,00	0,00	441.377.417,04	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-07	806.436.418,33	0,00	0,00	441.377.417,04	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-07	804.756.214,89	440.907.144,06	29.370.272,98	441.377.417,04	6.000.000,00	22.900.000,00	29.370.272,98	-10728960719594,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-07	803.071.082,85	0,00	0,00	412.007.144,06	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-07	801.381.007,76	0,00	0,00	412.007.144,06	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-07	799.685.975,11	412.121.707,46	28.785.436,60	412.007.144,06	6.000.000,00	22.900.000,00	28.785.436,60	-10250493973260,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-07	797.986.907,49	0,00	0,00	383.221.707,46	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-07	796.282.855,93	0,00	0,00	383.221.707,46	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-sep-07	794.573.805,82	391.376.030,13	20.745.677,33	383.221.707,46	6.000.000,00	22.900.000,00	20.745.677,33	-7196675465776,99%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-oct-07	792.859.742,50	0,00	0,00	362.476.030,13	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-nov-07	791.140.651,25	0,00	0,00	362.476.030,13	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-dic-07	789.416.517,34	374.085.117,49	17.290.912,64	362.476.030,13	6.000.000,00	22.900.000,00	17.290.912,64	-5840870289792,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ene-08	787.694.525,33	0,00	0,00	345.185.117,49	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-08	785.967.462,14	0,00	0,00	345.185.117,49	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-08	784.235.372,95	361.954.516,26	12.130.601,23	345.185.117,49	6.000.000,00	22.900.000,00	12.130.601,23	-3987328624300,99%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-08	782.498.182,91	0,00	0,00	333.054.516,26	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-08	780.755.897,12	0,00	0,00	333.054.516,26	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-08	779.008.500,62	348.169.826,92	13.784.689,34	333.054.516,26	6.000.000,00	22.900.000,00	13.784.689,34	-4404208244129,99%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-08	777.259.527,22	0,00	0,00	319.269.826,92	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-08	775.505.423,51	0,00	0,00	319.269.826,92	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-sep-08	773.746.174,42	341.634.083,80	6.535.743,12	319.269.826,92	6.000.000,00	22.900.000,00	6.535.743,12	-2028041090136,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-oct-08	771.981.764,88	0,00	0,00	312.734.083,80	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-nov-08	770.212.179,73	0,00	0,00	312.734.083,80	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-dic-08	768.437.403,79	333.970.278,42	7.663.805,38	312.734.083,80	6.000.000,00	22.900.000,00	7.663.805,38	-2308338180456,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ene-09	766.659.103,76	0,00	0,00	305.070.278,42	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-09	764.875.587,37	0,00	0,00	305.070.278,42	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-09	763.086.839,34	328.476.806,46	5.493.471,96	305.070.278,42	6.000.000,00	22.900.000,00	5.493.471,96	-1605192506712,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-09	761.292.844,32	0,00	0,00	299.576.806,46	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-09	759.493.586,90	0,00	0,00	299.576.806,46	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-09	757.689.051,57	321.386.971,51	7.089.834,95	299.576.806,46	6.000.000,00	22.900.000,00	7.089.834,95	-2006423290850,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-09	755.881.308,93	0,00	0,00	292.486.971,51	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-09	754.068.263,48	0,00	0,00	292.486.971,51	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00

Date		Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	3.54		5.51		5.51	
									Average Life Class A	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C	
8-sep-09	1	752.249.899,76	314.354.974,81	7.031.996,70	292.486.971,51	6.000.000,00	22.900.000,00	7.031.996,70	-1925360696460,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-oct-09	0	750.426.202,17	0,00	0,00	285.454.974,81	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-nov-09	0	748.597.155,07	0,00	0,00	285.454.974,81	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-dic-09	1	746.762.742,76	307.081.056,36	7.273.919,45	285.454.974,81	6.000.000,00	22.900.000,00	7.273.919,45	-1925406478415,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ene-10	0	744.925.018,92	0,00	0,00	278.181.055,36	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-feb-10	0	743.081.904,42	0,00	0,00	278.181.055,36	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-mar-10	1	741.233.383,45	300.122.393,54	6.958.661,82	278.181.055,36	6.000.000,00	22.900.000,00	6.958.661,82	-1779329827374,01%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-abr-10	0	739.379.440,15	0,00	0,00	271.222.393,54	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-may-10	0	737.520.058,62	0,00	0,00	271.222.393,54	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jun-10	1	735.655.222,91	293.760.620,91	6.361.772,63	271.222.393,54	6.000.000,00	22.900.000,00	6.361.772,63	-1568176953294,98%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jul-10	0	733.787.447,69	0,00	0,00	264.860.620,91	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ago-10	0	731.914.153,66	0,00	0,00	264.860.620,91	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-sep-10	1	730.035.444,76	287.255.851,54	6.504.769,37	264.860.620,91	6.000.000,00	22.900.000,00	6.504.769,37	-1543581771501,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-oct-10	0	728.151.184,86	0,00	0,00	258.355.851,54	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-nov-10	0	726.261.397,79	0,00	0,00	258.355.851,54	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-dic-10	1	724.366.067,35	281.674.551,27	5.581.300,27	258.355.851,54	6.000.000,00	22.900.000,00	5.581.300,27	-1273652721614,01%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ene-11	0	722.468.266,09	0,00	0,00	252.774.551,27	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-feb-11	0	720.564.897,95	0,00	0,00	252.774.551,27	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-mar-11	1	718.655.946,58	275.983.701,22	5.690.850,05	252.774.551,27	6.000.000,00	22.900.000,00	5.690.850,05	-1247434330969,99%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-abr-11	0	716.741.395,64	0,00	0,00	247.083.701,22	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-may-11	0	714.821.228,68	0,00	0,00	247.083.701,22	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jun-11	1	712.895.429,22	271.621.942,31	4.361.758,91	247.083.701,22	6.000.000,00	22.900.000,00	4.361.758,91	-915969371100,01%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jul-11	0	710.965.191,30	0,00	0,00	242.721.942,31	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ago-11	0	709.029.291,35	0,00	0,00	242.721.942,31	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-sep-11	1	707.087.712,76	268.147.150,38	3.474.791,93	242.721.942,31	6.000.000,00	22.900.000,00	3.474.791,93	-69773219544,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-oct-11	0	705.140.438,68	0,00	0,00	239.247.150,38	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-nov-11	0	703.187.452,66	0,00	0,00	239.247.150,38	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-dic-11	1	701.228.738,34	264.288.500,39	3.858.649,99	239.247.150,38	6.000.000,00	22.900.000,00	3.858.649,99	-739703203083,01%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ene-12	0	699.269.967,10	0,00	0,00	235.388.500,39	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-feb-12	0	697.305.450,14	0,00	0,00	235.388.500,39	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-mar-12	1	695.335.170,59	260.588.400,21	3.700.100,18	235.388.500,39	6.000.000,00	22.900.000,00	3.700.100,18	-675638292867,99%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-abr-12	0	693.359.111,56	0,00	0,00	231.688.400,21	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-may-12	0	691.377.256,08	0,00	0,00	231.688.400,21	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jun-12	1	689.389.587,16	257.436.239,31	3.152.240,33	231.688.400,21	6.000.000,00	22.900.000,00	3.152.240,33	-546584700069,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jul-12	0	687.399.418,55	0,00	0,00	228.536.239,31	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ago-12	0	685.403.412,10	0,00	0,00	228.536.239,31	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-sep-12	1	683.401.550,70	254.189.633,03	3.246.606,28	228.536.239,31	6.000.000,00	22.900.000,00	3.246.606,28	-533092751176,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-oct-12	0	681.393.817,18	0,00	0,00	225.289.633,03	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-nov-12	0	679.380.194,30	0,00	0,00	225.289.633,03	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-dic-12	1	677.360.664,80	251.163.845,27	3.025.787,76	225.289.633,03	6.000.000,00	22.900.000,00	3.025.787,76	-469299681576,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ene-13	0	675.341.971,78	0,00	0,00	222.263.845,27	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-feb-13	0	673.317.357,86	0,00	0,00	222.263.845,27	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-mar-13	1	671.286.803,87	247.478.924,29	3.684.920,98	222.263.845,27	6.000.000,00	22.900.000,00	3.684.920,98	-538366955178,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-abr-13	0	669.250.294,19	0,00	0,00	218.578.924,29	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-may-13	0	667.207.810,75	0,00	0,00	218.578.924,29	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jun-13	1	665.159.336,02	243.923.229,33	3.555.694,96	218.578.924,29	6.000.000,00	22.900.000,00	3.555.694,96	-486774640024,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jul-13	0	663.111.616,14	0,00	0,00	215.023.229,33	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ago-13	0	661.057.889,62	0,00	0,00	215.023.229,33	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-sep-13	1	658.998.138,63	240.513.483,03	3.409.746,31	215.023.229,33	6.000.000,00	22.900.000,00	3.409.746,31	-435424603787,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-oct-13	0	656.932.346,11	0,00	0,00	211.613.483,02	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-nov-13	0	654.860.493,73	0,00	0,00	211.613.483,02	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-dic-13	1	652.782.563,92	236.956.654,81	3.556.828,21	211.613.483,02	6.000.000,00	22.900.000,00	3.556.828,21	-421839825706,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ene-14	0	650.703.792,43	0,00	0,00	208.056.654,81	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-feb-14	0	648.618.923,21	0,00	0,00	208.056.654,81	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-mar-14	1	646.527.938,38	233.088.807,16	3.867.847,65	208.056.654,81	6.000.000,00	22.900.000,00	3.867.847,65	-423916102440,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-abr-14	0	644.430.819,89	0,00	0,00	204.188.807,16	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-may-14	0	642.327.550,05	0,00	0,00	204.188.807,16	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jun-14	1	640.218.110,52	229.708.916,49	3.379.890,67	204.188.807,16	6.000.000,00	22.900.000,00	3.379.890,67	-339341023268,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-jul-14	0	638.109.627,99	0,00	0,00	200.808.916,49	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ago-14	0	635.994.960,57	0,00	0,00	200.808.916,49	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-sep-14	1	633.874.090,14	225.192.852,10	4.516.064,39	200.808.916,49	6.000.000,00	22.900.000,00	4.516.064,39	-411865072368,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-oct-14	0	631.746.998,48	0,00	0,00	196.292.852,10	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-nov-14	0	629.613.867,35	0,00	0,00	196.292.852,10	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-dic-14	1	627.474.078,45	221.379.343,87	3.813.508,23	196.292.852,10	6.000.000,00	22.900.000,00	3.813.508,23	-313089025683,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-ene-15	0	625.339.624,04	0,00	0,00	192.479.343,87	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-feb-15	0	623.198.908,55	0,00	0,00	192.479.343,87	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-mar-15	1	621.051.913,64	217.271.524,92	4.107.818,95	192.479.343,87	6.000.000,00	22.900.000,00	4.107.818,95	-300281565245,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
8-abr-15	0	618.898.620,87	0,00	0,00	188.371.524,92	6.000.000,00	2							

Date	Principal Available before prepayment	Principal Available	Principal Redemption	Class A	Class B	Class C	Redemption Class A	3,54		5,51		5,51	
								Average Life Class A	Redemption Class B	Average Life Class B	Redemption Class C	Average Life Class C	
8-sep-17	1	554.278.130,68	171.575.439,31	6.147.522,07	148.822.961,38	6.000.000,00	22.900.000,00	6.147.522,07	113114406015,88%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-oct-17	0	551.966.993,18	0,00	0,00	142.675.439,31	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-nov-17	0	549.649.076,35	0,00	0,00	142.675.439,31	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-dic-17	1	547.324.360,30	165.596.540,18	5.978.899,13	142.675.439,31	6.000.000,00	22.900.000,00	5.978.899,13	164419726116,22%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ene-18	0	545.022.656,16	0,00	0,00	136.696.540,18	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-18	0	542.674.141,74	0,00	0,00	136.696.540,18	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-18	1	540.338.796,98	159.790.787,44	5.805.752,75	136.696.540,18	6.000.000,00	22.900.000,00	5.805.752,75	211909975269,18%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-18	0	537.996.601,88	0,00	0,00	130.890.787,44	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-18	0	535.647.536,34	0,00	0,00	130.890.787,44	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-18	1	533.291.580,21	154.144.991,12	5.645.796,31	130.890.787,44	6.000.000,00	22.900.000,00	5.645.796,31	258012891590,17%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-18	0	530.937.947,54	0,00	0,00	125.244.991,12	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-18	0	528.577.410,87	0,00	0,00	125.244.991,12	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-sep-18	1	526.209.949,96	148.662.985,64	5.482.005,48	125.244.991,12	6.000.000,00	22.900.000,00	5.482.005,48	300962100616,38%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-oct-18	0	523.835.544,50	0,00	0,00	119.762.985,64	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-nov-18	0	521.454.174,11	0,00	0,00	119.762.985,64	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-dic-18	1	519.065.818,38	143.332.715,93	5.330.269,72	119.762.985,64	6.000.000,00	22.900.000,00	5.330.269,72	341137261769,80%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ene-19	0	516.677.835,93	0,00	0,00	114.432.715,93	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-19	0	514.282.848,73	0,00	0,00	114.432.715,93	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-19	1	511.880.836,23	138.156.357,67	5.176.358,26	114.432.715,93	6.000.000,00	22.900.000,00	5.176.358,26	377874152700,97%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-19	0	509.471.777,84	0,00	0,00	109.256.357,67	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-19	0	507.055.652,87	0,00	0,00	109.256.357,67	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-19	1	504.632.440,60	133.123.974,41	5.032.383,26	109.256.357,67	6.000.000,00	22.900.000,00	5.032.383,26	413661904295,57%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-19	0	502.221.183,66	0,00	0,00	104.223.974,41	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-19	0	499.802.853,70	0,00	0,00	104.223.974,41	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-sep-19	1	497.377.429,98	128.246.726,25	4.877.248,16	104.223.974,41	6.000.000,00	22.900.000,00	4.877.248,16	445780482147,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-oct-19	0	494.944.891,68	0,00	0,00	99.346.726,25	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-nov-19	0	492.505.217,93	0,00	0,00	99.346.726,25	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-dic-19	1	490.058.387,81	123.505.740,93	4.740.985,31	99.346.726,25	6.000.000,00	22.900.000,00	4.740.985,31	476469024012,33%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ene-20	0	487.648.819,99	0,00	0,00	94.605.740,93	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-20	0	485.232.184,09	0,00	0,00	94.605.740,93	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-20	1	482.808.459,40	118.930.513,51	4.575.227,42	94.605.740,93	6.000.000,00	22.900.000,00	4.575.227,42	501444925026,06%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-20	0	480.377.625,12	0,00	0,00	90.030.513,51	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-20	0	477.939.660,39	0,00	0,00	90.030.513,51	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-20	1	475.494.544,30	114.483.544,29	4.446.969,23	90.030.513,51	6.000.000,00	22.900.000,00	4.446.969,23	528299944344,34%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-20	0	473.072.712,19	0,00	0,00	85.583.544,29	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-20	0	470.943.776,03	0,00	0,00	85.583.544,29	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-sep-20	1	468.207.715,00	110.183.153,58	4.300.390,71	85.583.544,29	6.000.000,00	22.900.000,00	4.300.390,71	550450010577,85%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-oct-20	0	465.764.508,19	0,00	0,00	81.283.153,58	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-nov-20	0	463.314.134,64	0,00	0,00	81.283.153,58	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-dic-20	1	460.856.573,33	106.003.821,89	4.179.331,69	81.283.153,58	6.000.000,00	22.900.000,00	4.179.331,69	572986374511,56%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ene-21	0	458.394.156,08	0,00	0,00	77.103.821,89	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-21	0	455.924.515,75	0,00	0,00	77.103.821,89	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-21	1	453.447.831,13	101.944.072,64	4.059.749,25	77.103.821,89	6.000.000,00	22.900.000,00	4.059.749,25	593129366047,78%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-21	0	450.963.480,99	0,00	0,00	73.044.072,64	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-21	0	448.472.044,01	0,00	0,00	73.044.072,64	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-21	1	445.973.298,81	97.999.261,82	3.944.810,82	73.044.072,64	6.000.000,00	22.900.000,00	3.944.810,82	612629120294,68%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-21	0	443.470.820,37	0,00	0,00	69.099.261,82	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-21	0	440.961.001,33	0,00	0,00	69.099.261,82	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-sep-21	1	438.443.820,15	94.168.793,16	3.830.468,66	69.099.261,82	6.000.000,00	22.900.000,00	3.830.468,66	630112094308,81%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-oct-21	0	435.919.255,24	0,00	0,00	65.268.793,16	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-nov-21	0	433.381.284,95	0,00	0,00	65.268.793,16	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-dic-21	1	430.847.887,53	90.447.407,72	3.721.385,44	65.268.793,16	6.000.000,00	22.900.000,00	3.721.385,44	646032512422,79%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ene-22	0	428.303.896,47	0,00	0,00	61.547.407,72	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-feb-22	0	425.752.443,04	0,00	0,00	61.547.407,72	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-mar-22	1	423.193.505,34	86.834.089,54	3.613.318,17	61.547.407,72	6.000.000,00	22.900.000,00	3.613.318,17	659791898473,16%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-abr-22	0	420.627.061,43	0,00	0,00	57.934.089,54	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-may-22	0	418.053.089,27	0,00	0,00	57.934.089,54	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jun-22	1	415.471.566,81	83.324.299,93	3.509.789,61	57.934.089,54	6.000.000,00	22.900.000,00	3.509.789,61	673177647867,99%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-jul-22	0	412.981.381,82	0,00	0,00	54.424.299,93	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-ago-22	0	410.303.628,30	0,00	0,00	54.424.299,93	6.000.000,00	22.900.000,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
8-sep-22	1	407.708.284,03	0,00	0,00	54.424.299,93	6.000.000,00	22.900.000,00	54.424.299,93	10899284285900,00%	6.000.000,00	12.060.000.000,00	22.900.000,00	46.029.000.000,00