

F.T.A UCI 16

**SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.
CALLE JUAN IGNACIO LUCA DE TENA 9-11
28027 MADRID**

santanderdetitulizacion@gruposantander.es

DENOMINACION DEL FONDO: F.T.A UCI 16

INFORMACIÓN CORRESPONDIENTE AL: TRIMESTRE/SEMESTRE: 16/09/2022 - 16/12/2022 AÑO: 2022

Personas que asumen la responsabilidad de esta información y cargos que ocupan: JUAN CARLOS BERZAL VALERO - DIRECTOR GENERAL Firma:

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	18 octubre 2006	Agencia de pago de Bonos	BANCO SANTANDER	
Fecha de Desembolso BT's	23 octubre 2006	Negociación Mercado	AJAF	
Fecha Final Amortización	16 junio 2049	Agencias de calificación	FITCH RATINGS STANDARD & POORS	
Sociedad Gestora	SANTANDER DE TITULIZACION, S.G.F.T, S.A.	Calificación	Inicial	Actual
	UNIÓN DE CRÉDITOS INMOBILIARIOS, S.A.	B.T.A'S SERIE A1	---	---
		B.T.A'S SERIE A2	AAA/AAA	A / A+
		B.T.A'S SERIE B	A/A-	BB - / BB -
		B.T.A'S SERIE C	BBB/BBB	CCC / CCC +
		B.T.A'S SERIE D	BB+/BB	CC / CCC
		B.T.A'S SERIE E	CCC/CCC-	CC / D

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 A1 ES0338186002	4.300	Nominal Unitario	100.000,00	0,00	
		Nominal Total	430.000.000,00	0,00	0,00 %
B.T.A'S SERIE A2 ES0338186010	12.476	Nominal Unitario	100.000,00	23.299,28	
		Nominal Total	1.247.600.000,00	290.681.817,28	23,30%
B.T.A'S SERIE B ES0338186028	720	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	72.000.000,00	72.000.000,00	100,00 %
B.T.A'S SERIE C ES0338186036	414	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	41.400.000,00	41.400.000,00	100,00 %
B.T.A'S SERIE D ES0338186044	90	Nominal Unitario	100.000,00	100.000,00	
		Nominal Total	9.000.000,00	9.000.000,00	100,00 %
B.T.A'S SERIE E ES0338186051	198	Nominal Unitario	100.000,00	72.727,28	
		Nominal Total	19.800.000,00	14.400.001,44	72,73%

AMORTIZACION E INTERESES BONOS					
Actual			Próximo		
Fecha Amortización Período Actual 16 de diciembre de 2022			Fecha Próximo Cupón 16 de marzo de 2023		
	Amortización de los Bonos	Intereses Brutos Bonos	Tipo de Interés	Importe Bruto Próximo Cupón	Importe Neto Próximo Cupón
B.T.A'S SERIE A1	---	---	---	---	---
B.T.A'S SERIE A2	1.178,00 €	71,96 €	2,231%	129,95 €	105,26 €
B.T.A'S SERIE B	0,00 €	331,90 €	2,381%	595,25 €	482,15 €
B.T.A'S SERIE C	0,00 €	395,09 €	2,631%	657,75 €	532,78 €
B.T.A'S SERIE D	0,00 €	824,81 €	4,331%	1.082,75 €	877,03 €
B.T.A'S SERIE E	0,00 €	609,06 €	4,381%	796,55 €	645,21 €
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	16.195	6.500
Saldo Pendiente de Amortizar Derechos	1.800.000.051,25 €	452.388.700,83 €
Importes Unitarios Derechos Vivos	111.145,42 €	69.598,26 €
Tipos de Interés	4,24 %	2,34%

TASAS DE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA	SITUACIÓN ACTUAL
Tasa mensual actual anualizada:	11,13%
Tasa últimos 12 meses anualizada:	8,85%
Tasa anualizada desde Constitución del Fondo	6,06%

MOROSIDAD ACTUAL	Hasta 1 mes	De 1 a 6 meses	Mayor de 6 meses
Deuda Vencida(Principal+Intereses)	50.242,09 €	335.911,70 €	9.128.026,70 €
Deuda Pendiente de vencimiento	0,00 €	0,00 €	446.462.396,91 €
Deuda Total	50.242,09 €	335.911,70 €	455.590.423,61 €

F.T.A UCI 16**INFORME TRIMESTRAL BONOS DE TITULIZACIÓN**

16 de diciembre de 2022

BONOS TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. PRINCIPAL

Saldo anterior	442.178.546,72 €
Amortizaciones	14.696.728,00 €
Saldo actual	427.481.818,72 €
% sobre saldo inicial	23,49%
Amortización devengada no pagada	0,00 €

DATOS

Fecha de determinación	09/12/2022
Fecha de Pago de Cupón Actual	16/12/2022
Fecha de Pago de Cupón Anterior	16/09/2022
Número de días	91
Tipo de referencia (%)	2,081%
Próxima Fecha de Pago	16/03/2023

BONOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS. INTERESES

Intereses pagados Serie A1	0,00 €
Intereses pagados Serie A2	897.772,96 €
Intereses pagados Serie B	238.968,00 €
Intereses pagados Serie C	163.567,26 €
Intereses pagados Serie D	74.232,90 €
Intereses pagados Serie E	120.593,88 €
Intereses devengados no pagados	0,00 €

VIDA RESIDUAL (AÑOS)

	INICIAL	16-dic-22
B.T.A'S SERIE A1	0,70	0,00
B.T.A'S SERIE A2	4,71	3,92
B.T.A'S SERIE B	6,29	7,01
B.T.A'S SERIE C	6,29	7,01
B.T.A'S SERIE D	6,29	7,01
B.T.A'S SERIE E	6,53	7,01

F.T.A UCI 16**INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO****16 de diciembre de 2022**

DERECHOS DE CRÉDITO. PRINCIPAL	
Saldo anterior	470.422.063,34 €
Amortizaciones	18.033.362,51 €
Saldo actual	452.388.700,83 €
Número de derechos de crédito	6.500
LTV	43,26%

DERECHOS DE CRÉDITO CON RETRASOS EN EL PAGO					
	HASTA 30 DÍAS	30 A 60 DÍAS	60 A 90 DÍAS	90 A 180 DÍAS	MÁS DE 180 DÍAS
Principal	36.968,14 €	55.257,48 €	49.361,36 €	132.855,75 €	5.651.861,19 €
Intereses	13.273,95 €	24.397,00 €	21.184,64 €	52.855,47 €	3.476.165,51 €
Saldo de los derechos de crédito	11.885.099,15 €	8.263.929,23 €	4.735.808,61 €	7.326.853,63 €	18.385.936,83 €
Número de derechos de crédito	142	88	51	73	152
% sobre saldo de los derechos de crédito	2,63%	1,83%	1,05%	1,62%	4,06%

PRÉSTAMOS EN WRITE OFF	
Write Off acumulado Fecha Pago anterior	42.643.552,33 €
Write Off trimestre	-3.336.628,25 €
Write Off acumulados actuales	39.306.924,08 €

F.T.A UCI 16

INFORME TRIMESTRAL DERECHOS DE CREDITO

16 de diciembre de 2022

ADJUDICADOS	
Saldo anterior	0,00 €
Diferencia	20.117,20 €
Saldo actual	20.117,20 €
Número de adjudicados	1

PERDIDAS DE LA CARTERA	
Saldo anterior	158.499.183,75 €
Diferencia	998.293,24 €
Saldo actual	159.497.476,99 €

F.T.A UCI 16

ESTADO DE ORIGEN Y APLICACIÓN DE FONDOS Y CUENTA DE TESORERÍA

16 de diciembre de 2022

ORIGEN	20.183.404,20 €
PRINCIPAL COBRADO	
Amortización derechos de crédito	15.514.514,98 €
INTERESES COBRADOS	
Intereses de derechos de crédito	2.660.238,33 €
Intereses de reinversión	24.921,61 €
INGRESOS/GASTOS DE ADJUDICADOS	1.952.349,58 €
INGRESOS/GASTOS DE IMPORTES ASEGURADOS	31.900,00 €
OTROS	-520,30 €

ESTADO CUENTA DE TESORERÍA	14.684.045,56 €
FONDO DE RESERVA	
Saldo anterior	14.400.000,00 €
Diferencia	0,00 €
Saldo actual	14.400.000,00 €
RETENCIÓN A CUENTA DEL IRPF	284.045,56 €

APLICACIÓN	20.183.404,20 €
GASTOS ORDINARIOS	16.322,90 €
COMISIÓN S.G.F.T.	22.048,35 €
INTERESES B.T.A'S SERIE A1	0,00 €
INTERESES B.T.A'S SERIE A2	897.772,96 €
INTERESES B.T.A'S SERIE B	238.968,00 €
INTERESES B.T.A'S SERIE C	163.567,26 €
INTERESES B.T.A'S SERIE D	74.232,90 €
FONDOS DISPONIBLES AMORTIZACIÓN A2	14.696.728,00 €
INTERESES B.T.A'S SERIE E	120.593,88 €
AMORTIZACIÓN B.T.A'S SERIE E	0,00 €
INTERESES PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB + SAN	0,00 €
AMORTIZACION PRÉSTAMO SUBORDINADO SANTANDER	0,00 €
AMORTIZACION PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB	0,00 €
COMISIÓN FIJA	6.000,00 €
COMISIÓN VARIABLE	3.947.169,95 €
FONDO DE RESERVA	0,00 €
REMANENTE	0,00 €

F.T.A UCI 16

MEJORA CREDITICIA Y PRÉSTAMO SUBORDINADO

16 de diciembre de 2022

MEJORA DE CRÉDITO		
CONCEPTOS	INICIAL	16 de diciembre de 2022
EMISIÓN SUBORDINADA	122.400.000,00 € (6,80%)	122.400.000,00 € (27,06%)
FONDO DE RESERVA	19.800.000,00 € (1,10 %)	14.400.000,00 € 3,18%

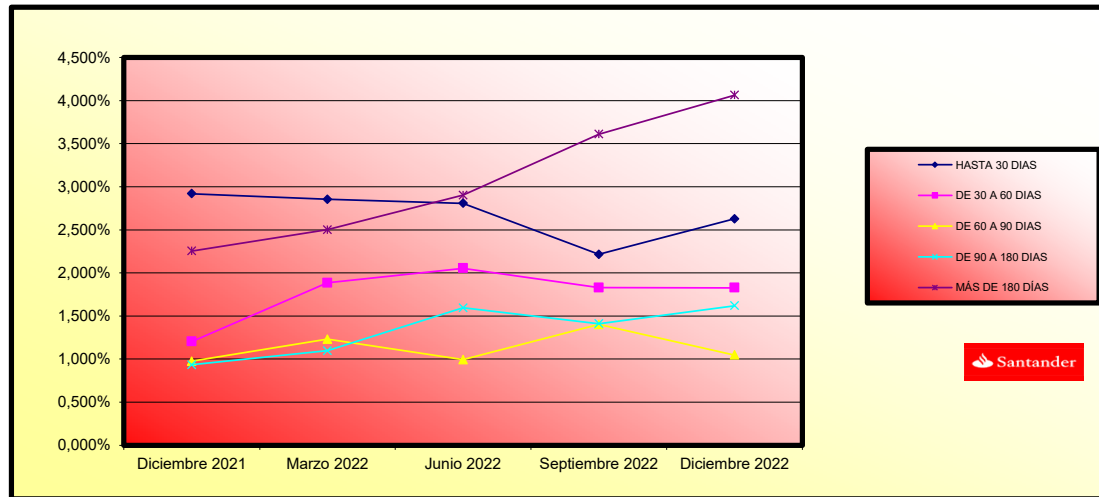
PRÉSTAMOS SUBORDINADOS		
CONCEPTOS	INICIAL	16 de diciembre de 2022
PRÉSTAMO SUBORDINADO SCH		
Saldo vivo	950.000,00 €	0,00 €
Tipo de interés	5,900 %	---
PRÉSTAMO SUBORDINADO UCB		
Saldo vivo	950.000,00 €	0,00 €
Tipo de interés	5,900 %	---

ESTADÍSTICO DE VALORES DE TASACIÓN SOBRE SALDOS VIVOS				
INTERVALO	SALDO	% SALDOS VIVOS	Nº PRÉSTAMOS	% Nº PRÉSTAMOS
0,00 - 39,99	125.561.491,52 €	29,07%	2.054	41,65%
40,00 - 49,99	78.392.047,86 €	18,15%	810	16,43%
50,00 - 59,99	107.106.726,72 €	24,80%	1069	21,68%
60,00 - 69,99	66.232.286,55 €	15,34%	591	11,99%
70,00 - 79,99	39.902.487,42 €	9,24%	311	6,31%
> 80,00	14.665.828,80 €	3,40%	96	1,95%
	431.860.868,87 €	100,00%	4.931	100,00%

FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS
UCI 16

INFORME DE MOROSIDAD
16 DE DICIEMBRE DE 2022

MOROSIDAD HISTÓRICA					
	Diciembre 2021	Marzo 2022	Junio 2022	Septiembre 2022	Diciembre 2022
HASTA 30 DIAS	2,921%	2,854%	2,808%	2,215%	2,627%
DE 30 A 60 DIAS	1,204%	1,885%	2,055%	1,829%	1,827%
DE 60 A 90 DIAS	0,975%	1,231%	0,992%	1,403%	1,047%
DE 90 A 180 DIAS	0,933%	1,096%	1,595%	1,411%	1,620%
MÁS DE 180 DÍAS	2,254%	2,502%	2,903%	3,611%	4,064%



**FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS
UCI 16**

**INFORMACIÓN RELATIVA A LOS TRIGGERS DEL FONDO
16 DE DICIEMBRE DE 2022**

TRIGGERS BONOS		
1. SI 1.a) ES MAYOR QUE 1.b) NO SE AMORTIZA LA SERIE B, C y D:		
1.a) MOROSIDAD SUPERIOR A 90 DÍAS		65.019.714,54 €
1.b) 2% SALDO VIVO DERECHOS DE CREDITO		9.047.774,02 €
NO SE AMORTIZAN LAS SERIES B, C y D.		

TRIGGERS FONDO DE RESERVA		
1. SI 1.a) ES INFERIOR QUE 1.b) NO SE AMORTIZA EL FONDO DE RESERVA:		
1.a) SALDO VIVO DE LOS ACTIVOS		452.388.700,83 €
1.b) 10% SALDO INICIAL DE LOS ACTIVOS		180.000.005,13 €
2. SI 2.a) ES INFERIOR QUE 2.b) NO SE AMORTIZA EL FONDO DE RESERVA:		
2.a) TIPO DE INTERÉS MEDIO PONDERADO DE LOS ACTIVOS		2,34%
2.b) TIPO DE INTERÉS MEDIO PONDERADO DE LOS BONOS + 0,40%		0,49%
3. SI EXISTE DÉFICIT DE AMORTIZACIÓN, NO SE AMORTIZA EL FONDO DE RESERVA		
		NO

NO SE HAN ALCANZADO LOS TRIGGERS.

NIVELES DEL FONDOS DE RESERVA SEGÚN LA MOROSIDAD		
MOROSIDAD ACTUAL < 0,75%	MAYOR DE	
	2,2% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO 0,40% DEL SALDO INICIAL BONOS	NA
MOROSIDAD ACTUAL ENTRE 0,75% y 1,25%	MAYOR DE	
	2,2% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO 0,70% DEL SALDO INICIAL BONOS	NA
MOROSIDAD ACTUAL > 1,25%	MAYOR DE	
	2,2% SALDO DERECHOS DE CRÉDITO 0,80% DEL SALDO INICIAL BONOS	14.400.000,00 €

**FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS
UCI 16**

**INFORMACIÓN RELATIVA A LOS TRIGGERS DEL FONDO
16 DE DICIEMBRE DE 2022**

POSTERGAMIENTO DE INTERESES DE LOS BONOS	
SI 1.a) ES MAYOR QUE 1.b)+1.c) LOS INTERESES DE LA SERIE B SE POSTERGARÁN:	
1.a) SALDO DE LA SERIE A1 y A2	305.378.545,28 €
1.b) SALDO VIVO DC's - MORA >18 MESES	409.254.211,10 €
1.c) REMANENTE FONDOS DISPONIBLES	33.408.291,99 €
SI 2.a) ES MAYOR QUE 2.b)+2.c) LOS INTERESES DE LA SERIE C SE POSTERGARÁN:	
2.a) SALDOS DE LAS SERIES A1, A2 y B	377.378.545,28 €
2.b) SALDO VIVO DC's - MORA >18 MESES	409.254.211,10 €
2.c) REMANENTE FONDOS DISPONIBLES	33.244.724,73 €
SI 3.a) ES MAYOR QUE 3.b)+3.c) LOS INTERESES DE LA SERIE D SE POSTERGARÁN:	
3.a) SALDOS DE LAS SERIES A1, A2, B y C	418.778.545,28 €
3.b) SALDO VIVO DC's - MORA >18 MESES	409.254.211,10 €
3.c) REMANENTE FONDOS DISPONIBLES	33.170.491,83 €

NO SE POSTERGARÁN LOS INTERESES DE LAS SERIES B, C Y D.

REMANENTE INTERESES	Importe
Saldo actual	1.272.247,57 €

SI 1.a) ES MAYOR QUE 9,60% SALDO INICIAL DC's, SE POSTERGARÁN LOS INTERESES DE LAS SERIES B, C ó D, EN SU CASO	NO
I.a) SALDO ACUMULADO DE PRÉSTAMOS FALLIDOS ES LA SUMA DE i) + ii)	44.381.489,07 €
i). SALDO DC's MOROSIDAD > 18 MESES	43.134.489,73 €
ii). SALDO DC's JUDICIALES CON MOROSIDAD < 18 MESES	1.246.999,34 €
PORCENTAJE ACTUAL	2,47%

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

(*) Rating Deposit
LA CONTRAPARTE SÍ TIENE EL RATING MÍNIMO EXIGIDO.

F.T.A UCI 16

DEFINICIONES

16 de diciembre de 2022

FECHA DE DETERMINACIÓN Será la fecha en que la Sociedad Gestora, en nombre del Fondo, realizará las 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).

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

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

01-12-14	1.512.678.018,57	862.231.349,40	60,03%	57,00%	0,57%	6,65%	0,23%	2,76%
01-01-15	1.509.225.107,78	854.950.231,91	59,72%	56,65%	0,57%	6,66%	0,62%	7,16%
01-02-15	1.505.759.997,38	850.236.061,70	59,41%	56,47%	0,57%	6,63%	0,32%	3,80%
01-03-15	1.502.282.644,28	845.890.396,47	59,10%	56,31%	0,57%	6,60%	0,28%	3,32%
01-04-15	1.498.793.005,21	840.300.191,42	58,79%	56,07%	0,57%	6,58%	0,43%	5,03%
01-05-15	1.495.291.036,77	835.864.102,65	58,49%	55,90%	0,56%	6,55%	0,29%	3,48%
01-06-15	1.491.776.695,39	831.663.560,25	58,18%	55,75%	0,56%	6,52%	0,27%	3,17%
01-07-15	1.488.253.014,95	824.722.224,33	57,88%	55,42%	0,56%	6,52%	0,60%	6,97%
01-08-15	1.484.716.884,85	819.336.830,57	57,58%	55,18%	0,56%	6,51%	0,42%	4,88%
01-09-15	1.481.168.261,13	814.017.462,24	57,28%	54,96%	0,56%	6,49%	0,41%	4,82%
01-10-15	1.477.607.099,62	809.422.168,69	56,98%	54,78%	0,56%	6,47%	0,32%	3,83%
01-11-15	1.474.033.356,05	805.147.258,33	56,69%	54,62%	0,55%	6,44%	0,29%	3,39%
01-12-15	1.470.446.985,95	799.975.426,97	56,39%	54,40%	0,55%	6,43%	0,40%	4,70%
01-01-16	1.466.857.616,88	794.987.504,50	56,10%	54,20%	0,55%	6,41%	0,38%	4,47%
01-02-16	1.463.255.566,07	789.286.978,37	55,81%	53,94%	0,55%	6,40%	0,37%	5,53%
01-03-16	1.459.640.788,72	784.146.465,20	55,52%	53,72%	0,55%	6,39%	0,41%	4,76%
01-04-16	1.456.013.239,87	777.989.021,12	55,23%	53,43%	0,55%	6,38%	0,54%	6,27%
01-05-16	1.452.372.874,39	771.935.839,49	54,94%	53,15%	0,55%	6,38%	0,53%	6,17%
01-06-16	1.448.719.647,00	767.340.361,65	54,66%	52,97%	0,55%	6,36%	0,34%	4,06%
01-07-16	1.445.111.439,81	761.375.647,66	54,37%	52,69%	0,55%	6,36%	0,53%	6,17%
01-08-16	1.441.490.484,32	757.251.879,37	54,09%	52,53%	0,54%	6,34%	0,29%	3,45%
01-09-16	1.437.856.735,50	753.733.209,99	53,81%	52,42%	0,54%	6,31%	0,21%	2,53%
01-10-16	1.434.210.148,15	748.889.945,52	53,53%	52,22%	0,54%	6,29%	0,39%	4,58%
01-11-16	1.430.550.676,91	744.160.293,90	53,25%	52,02%	0,54%	6,28%	0,38%	4,44%
01-12-16	1.426.878.276,25	740.056.485,67	52,98%	51,87%	0,54%	6,25%	0,30%	3,49%
01-01-17	1.423.200.587,27	735.323.017,52	52,70%	51,67%	0,54%	6,24%	0,38%	4,50%
01-02-17	1.419.509.904,50	730.281.059,63	52,43%	51,45%	0,53%	6,23%	0,43%	5,01%
01-03-17	1.415.806.182,05	725.593.324,60	52,15%	51,25%	0,53%	6,22%	0,38%	4,49%
01-04-17	1.412.089.373,83	725.513.017,88	51,88%	51,38%	0,53%	6,15%	-0,25%	-3,07%
01-05-17	1.408.359.433,63	716.308.257,57	51,61%	50,86%	0,53%	6,19%	1,01%	11,44%
01-06-17	1.404.616.315,03	711.898.221,76	51,35%	50,68%	0,53%	6,17%	0,35%	4,13%
01-07-17	1.400.868.619,93	708.016.371,92	51,08%	50,54%	0,53%	6,15%	0,28%	3,30%
01-08-17	1.397.107.683,71	702.743.375,67	50,81%	50,30%	0,53%	6,15%	0,48%	5,58%
01-09-17	1.393.333.459,58	698.186.836,93	50,55%	50,11%	0,53%	6,13%	0,38%	4,46%
01-10-17	1.389.545.900,60	694.860.827,31	50,29%	50,01%	0,52%	6,11%	0,21%	2,43%
01-11-17	1.385.744.959,66	690.689.192,70	50,03%	49,84%	0,52%	6,09%	0,33%	3,86%
01-12-17	1.381.930.589,48	687.837.035,15	49,77%	49,77%	0,52%	6,06%	0,14%	1,64%
01-01-18	1.378.115.907,51	683.273.297,22	49,51%	49,58%	0,52%	6,05%	0,39%	4,56%
01-02-18	1.374.287.747,76	679.912.268,59	49,25%	49,47%	0,52%	6,02%	0,21%	2,55%
01-03-18	1.370.446.062,58	677.108.413,23	49,00%	49,41%	0,51%	5,99%	0,13%	1,59%
01-04-18	1.366.590.804,21	671.923.095,47	48,74%	49,17%	0,51%	5,99%	0,49%	5,68%
01-05-18	1.362.721.924,69	667.013.668,96	48,49%	48,95%	0,51%	5,98%	0,45%	5,25%
01-06-18	1.358.839.375,88	663.409.724,06	48,24%	48,82%	0,51%	5,96%	0,26%	3,03%
01-07-18	1.354.965.111,33	658.087.274,85	47,99%	48,57%	0,51%	5,96%	0,52%	6,05%
01-08-18	1.351.077.158,47	653.151.314,02	47,74%	48,34%	0,51%	5,96%	0,46%	5,43%
01-09-18	1.347.175.468,95	650.526.703,37	47,49%	48,29%	0,51%	5,93%	0,11%	1,35%
01-10-18	1.343.259.994,22	644.850.299,30	47,24%	48,01%	0,51%	5,93%	0,58%	6,78%
01-11-18	1.339.330.685,58	639.376.979,17	47,00%	47,74%	0,51%	5,94%	0,56%	6,49%
01-12-18	1.335.387.494,16	636.169.025,82	46,75%	47,64%	0,51%	5,91%	0,21%	2,47%
01-01-19	1.331.436.127,06	630.727.587,18	46,51%	47,37%	0,51%	5,92%	0,56%	6,53%
01-02-19	1.327.470.799,24	627.625.438,70	46,27%	47,28%	0,50%	5,89%	0,19%	2,31%
01-03-19	1.323.491.461,37	623.295.226,03	46,03%	47,09%	0,50%	5,88%	0,39%	4,60%
01-04-19	1.319.498.063,96	617.566.245,90	45,79%	46,80%	0,50%	5,89%	0,62%	7,18%
01-05-19	1.315.490.557,33	612.155.826,32	45,55%	46,53%	0,51%	5,90%	0,57%	6,68%
01-06-19	1.311.468.891,63	608.468.696,94	45,31%	46,40%	0,50%	5,88%	0,30%	3,51%
01-07-19	1.307.445.030,56	603.026.129,42	45,08%	46,12%	0,50%	5,89%	0,59%	6,85%
01-08-19	1.303.406.952,65	599.988.568,97	44,84%	46,03%	0,50%	5,87%	0,20%	2,32%
01-09-19	1.299.354.607,65	596.994.568,35	44,61%	45,95%	0,50%	5,84%	0,19%	2,24%
01-10-19	1.295.287.945,16	593.157.317,46	44,38%	45,79%	0,50%	5,83%	0,33%	3,90%
01-11-19	1.291.206.914,60	588.608.806,81	44,15%	45,59%	0,50%	5,83%	0,45%	5,30%
01-12-19	1.287.111.465,19	586.086.962,20	43,92%	45,54%	0,50%	5,80%	0,11%	1,33%
01-01-20	1.283.007.586,80	582.011.393,68	43,69%	45,36%	0,50%	5,79%	0,38%	4,44%
01-02-20	1.278.899.208,85	576.900.815,91	43,46%	45,11%	0,50%	5,80%	0,56%	6,50%
01-03-20	1.274.756.280,10	574.255.387,33	43,24%	45,05%	0,49%	5,77%	0,14%	1,62%
01-04-20	1.270.608.749,15	570.688.147,14	43,01%	44,91%	0,49%	5,76%	0,30%	3,50%
01-05-20	1.266.446.564,41	566.899.012,06	42,79%	44,76%	0,49%	5,75%	0,34%	3,98%
01-06-20	1.262.269.674,09	564.474.457,19	42,57%	44,72%	0,49%	5,72%	0,10%	1,17%
01-07-20	1.258.090.161,65	561.357.456,49	42,35%	44,62%	0,49%	5,70%	0,22%	2,63%
01-08-20	1.253.895.882,42	558.415.452,38	42,13%	44,53%	0,49%	5,68%	0,19%	2,27%
01-09-20	1.249.686.784,23	555.831.826,54	41,91%	44,48%	0,48%	5,66%	0,13%	1,52%
01-10-20	1.245.462.814,71	552.224.976,93	41,69%	44,34%	0,48%	5,64%	0,31%	3,68%
01-11-20	1.241.223.921,34	549.392.523,18	41,47%	44,26%	0,48%	5,62%	0,17%	2,06%
01-12-20	1.236.970.051,37	532.199.398,40	41,26%	43,02%	0,49%	5,78%	2,80%	28,85%
01-01-21	1.232.754.393,68	528.454.372,18	41,04%	42,87%	0,49%	5,77%	0,36%	4,28%
01-02-21	1.228.523.841,49	522.117.949,28	40,83%	42,50%	0,50%	5,80%	0,86%	9,83%
01-03-21	1.224.278.342,19	516.348.767,80	40,62%	42,18%	0,50%	5,81%	0,76%	8,77%
01-04-21	1.220.017.842,95	507.919.508,93	40,41%	41,63%	0,50%	5,86%	1,29%	14,42%
01-05-21	1.215.742.290,78	503.697.566,16	40,20%	41,43%	0,50%	5,86%	0,48%	5,64%
01-06-21	1.211.451.632,51	499.689.955,11	39,99%	41,25%	0,50%	5,86%	0,44%	5,20%
01-07-21	1.207.292.210,08	495.056.871,96	39,78%	41,01%	0,50%	5,86%	0,59%	6,81%
01-08-21	1.203.118.091,85	489.891.248,36	39,58%	40,72%	0,50%	5,88%	0,70%	8,09%
01-09-21	1.198.929.225,89	487.030.705,77	39,37%	40,62%	0,50%	5,86%	0,24%	2,80%
01-10-21	1.194.725.560,08	482.355.398,07	39,17%	40,37%	0,50%	5,87%	0,61%	7,10%
01-11-21	1.190.507.042,15	478.934.661,94	38,96%	40,23%	0,50%	5,86%	0,36%	4,20%
01-12-21	1.186.273.619,62	474.096.323,40	38,76%	39,97%	0,50%	5,87%	0,66%	7,60%
01-01-22	1.182.033.383,75	469.843.612,98	38,56%	39,75%	0,50%	5,87%	0,54%	6,31%
01-02-22	1.177.778.166,53	464.824.760,52	38,36%	39,47%	0,50%	5,88%	0,71%	8,20%
01-03-22	1.173.507.915,06	461.458.584,00	38,16%	39,32%	0,50%	5,87%	0,36%	4,27%
01-04-22	1.169.222.576,20	456.483.342,49	37,96%	39,04%	0,50%	5,89%	0,72%	8,26%
01-05-22	1.164.922.096,65	452.252.910,56	37,76%	38,82%	0,50%	5,89%	0,56%	6,53%
01-06-22	1.160.606.422,91	445.274.371,58	37,57%	38,37%	0,51%	5,93%	1,18%	13,24%
01-07-22	1.156.289.870,03	438.464.604,30	37,37%	37,92%	0,51%	5,97%	1,16%	13,08%
01-08-22	1.151.958.066,17	434.072.494,98	37,18%	37,68%	0,51%	5,98%	0,63%	7,30%
01-09-22	1.147.610.957,45	427.778.511,01	36,98%	37,28%	0,52%	6,01%	1,08%	12,18%
01-10-22	1.143.248.489,80	423.955.585,11	36,79%	37,08%	0,52%	6,01%	0,52%	6,01%
01-11-22	1.138.870.608,96	418.778.466,52	36,60%	36,77%	0,52%	6,03%	0,84%	9,64%
01-12-22	1.134.477.260,46	413.081.776,75	36,41%	36,41%	0,52%	6,06%	0,98%	11,13%

fecna	Principal	Principal	Class A1	Class A2	Class B	Class C	Class D	Class E	Sum of all classes	% Class B	% Class C	% Class D	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	Redemption Class D	Average Life Class D	Redemption Class E	Average Life Class E	
Date	Principal available	Principal Redemption	Class A1	Class A2	Class B	Class C	Class D	Class E																	
09-11-27	231,844,946.25	0.00	0.00	111,986,596.19	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	234,386,596.19	30.718400%	17.663120%	3.838810%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-11-27	229,316,736.59	0.00	0.00	111,986,596.19	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	234,386,596.19	30.718400%	17.663120%	3.838810%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-12-27	226,807,868.36	7,578,712.81	0.00	111,986,596.19	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	234,386,596.19	30.718400%	17.663120%	3.838810%	0.00	0.00	7,578,712.81	13.838729	593	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-01-28	224,314,669.34	0.00	0.00	104,407,883.38	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	226,807,868.36	31.744928%	18.253334%	3.968116%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-02-28	221,837,021.42	0.00	0.00	104,407,883.38	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	226,807,868.36	31.744928%	18.253334%	3.968116%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-03-28	219,374,251.19	7,433,617.20	0.00	104,407,883.38	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	226,807,868.36	31.744928%	18.253334%	3.968116%	0.00	0.00	7,433,617.20	14.250244	167	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-04-28	216,926,733.27	0.00	0.00	96,974,266.18	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	219,374,251.19	32.820623%	18.871858%	4.102578%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-05-28	214,493,607.08	0.00	0.00	96,974,266.18	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	219,374,251.19	32.820623%	18.871858%	4.102578%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-06-28	212,075,570.55	7,296,660.61	0.00	96,974,266.18	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	219,374,251.19	32.820623%	18.871858%	4.102578%	0.00	0.00	7,296,660.61	14.663040	354	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-07-28	209,676,035.28	0.00	0.00	89,675,585.57	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	212,075,585.57	33.950160%	19.521342%	4.243770%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-08-28	207,291,143.19	0.00	0.00	89,675,585.57	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	212,075,585.57	33.950160%	19.521342%	4.243770%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-09-28	204,920,814.55	7,154,756.00	0.00	89,675,585.57	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	212,075,585.57	33.950160%	19.521342%	4.243770%	0.00	0.00	7,154,756.00	15.032142	307	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-10-28	202,564,970.00	0.00	0.00	82,520,829.57	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	204,920,829.57	35.135200%	20.202624%	4.391940%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-11-28	200,223,930.84	0.00	0.00	82,520,829.57	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	204,920,829.57	35.135200%	20.202624%	4.391940%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-12-28	197,896,418.43	7,024,396.12	0.00	82,520,829.57	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	204,920,829.57	35.135200%	20.202624%	4.391940%	0.00	0.00	7,024,396.12	15.397476	289	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-01-29	195,586,310.82	0.00	0.00	75,496,433.45	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	197,896,433.45	36.382687%	20.920033%	4.547833%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-02-29	193,290,355.38	0.00	0.00	75,496,433.45	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	197,896,433.45	36.382687%	20.920033%	4.547833%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-03-29	191,008,475.01	6,887,843.42	0.00	75,496,433.45	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	197,896,433.45	36.382687%	20.920033%	4.547833%	0.00	0.00	6,887,843.42	15.718286	881	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-04-29	188,740,592.96	0.00	0.00	68,608,490.03	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	191,008,490.03	37.694660%	21.674429%	4.711832%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-05-29	186,486,632.94	0.00	0.00	68,608,490.03	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	191,008,490.03	37.694660%	21.674429%	4.711832%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-06-29	184,246,519.02	6,761,955.99	0.00	68,608,490.03	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	191,008,490.03	37.694660%	21.674429%	4.711832%	0.00	0.00	6,761,955.99	16.052883	522	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-07-29	182,025,580.08	0.00	0.00	61,846,534.04	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	184,246,534.04	39.078076%	22.468894%	4.884759%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-08-29	179,819,096.75	0.00	0.00	61,846,534.04	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	184,246,534.04	39.078076%	22.468894%	4.884759%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-09-29	177,625,194.51	6,820,724.51	0.00	61,846,534.04	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	184,246,534.04	39.078076%	22.468894%	4.884759%	0.00	0.00	6,820,724.51	16.326706	631	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-10-29	175,445,999.28	0.00	0.00	55,225,809.53	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	177,625,809.53	40.534850%	23.307424%	5.068831%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-11-29	173,279,637.34	0.00	0.00	55,225,809.53	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	177,625,809.53	40.534850%	23.307424%	5.068831%	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
09-12-29	171,126,635.37	177,625,794.51	0.00	55,225,809.53	72,000,000.00	41,400,000.00	9,000,000.00	14,400,000.00	177,625,809.53	40.534850%	23.307424%	5.068831%	0.00	0.00	55,225,809.53	141.212394	978	72,000,000.00	184,104,000.00	41,400,000.00	105,859,800.00	9,000,000.00	23,013,000.00	14,400,000.00	36,820,800.00