

IM PASTOR 4, FTA

Información correspondiente al periodo: 24/06/2024 - 23/09/2024

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|----------------------------------|----------------------------|
| Fecha de Constitución del Fondo | 05/06/2006 |
| Fecha de Desembolso de los Bonos | 09/06/2006 |
| Agente Financiero | Banco Santander |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF de Renta Fija |

| Calificación Actual (*) | Moody's | S&P |
|-------------------------|---------|----------|
| Bonos A | B2 (sf) | B- (sf) |
| Bonos B | Ca (sf) | CCC-(sf) |
| Bonos C | C (sf) | CCC-(sf) |
| Bonos D | C (sf) | D(sf) |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Serie A | | Serie B | |
|---|---------------------|---|---------------------|
| Código ISIN | ES0347854004 | Código ISIN | ES0347854012 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 886.000.000,00 € | Nominal en circulación total (inicial) | 17.900.000,00 € |
| Nominal en circulación total (actual) | 69.013.995,40 € | Nominal en circulación total (actual) | 17.900.000,00 € |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € | Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 7.789,39 € | Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 € |
| Serie C | | Serie D | |
| Código ISIN | ES0347854020 | Código ISIN | ES0347854038 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 9.200.000,00 € | Nominal en circulación total (inicial) | 6.900.000,00 € |
| Nominal en circulación total (actual) | 9.200.000,00 € | Nominal en circulación total (actual) | 6.900.000,00 € |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € | Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 € | Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 € |

III. INFORMACIÓN INCLUIDA

Liquidación correspondiente al periodo: 24/06/2024 - 23/09/2024

Anuncio del Pago de los Bonos: 23/09/2024

Flujos de Caja del periodo: 24/06/2024 - 23/09/2024

(*) Calificación correspondiente a la fecha 09/09/2024. La calificación actualizada de los Bonos se puede consultar en nuestra página web www.imtitulizacion.com.

IM PASTOR 4, FTA
Liquidación del Período: 24/06/2024 - 23/09/2024
Fecha de Pago: 23/09/2024

| Recursos Disponibles (I+II+III+IV+V+VI): | 3.953.527,74 | | | |
|---|---------------------|--|--|---------------------------------------|
| I. Situación Inicial: | 84,44 | | | |
| II. Fondos recibidos del cedente: | 3.926.107,18 | | | |
| a) Principal regular | 1.682.096,88 | | | |
| b) Recuperación de Fallidos | 24.978,34 | | | |
| c) Intereses ordinarios | 848.259,79 | | | |
| d) Intereses de demora | 0,00 | | | |
| e) Amortización Anticipada | 1.370.772,17 | | | |
| III. Otros: | 0,00 | | | |
| IV. Intereses de las Cuentas: | 25.049,23 | | | |
| V. Cobro de la Liquidación del Swap: | 0,00 | | | |
| VI. Ingresos derivados de la venta y explotación de inmuebles: | 2.286,89 | | | |
| <hr/> | | | | |
| Aplicación de Fondos (Ref. 3.4.6.3 del Módulo Adicional) | Aplicado | Devengado en esta Fecha de Pago | Debido en la Fecha de Pago anterior | Debido tras esta Fecha de Pago |
| (i) Gastos periódicos (*) | 256.331,21 | 256.331,21 | 0,00 | 0,00 |
| (ii) Pago de la cantidad neta a pagar del Contrato de Permuta Financiera, y solamente en caso de resolución del contrato por circunstancias imputables al Fondo, la cantidad que corresponda al pago liquidativo: | 20.377,25 | 20.377,25 | 0,00 | 0,00 |
| (iii) Pago de intereses de los Bonos A: | 695.244,20 | 695.244,20 | 0,00 | 0,00 |
| (iv) Pago de intereses de los Bonos B si no concurren las circunstancias que determinan su posposición al número (viii) del Orden de Prelación de Pagos: | 176.012,49 | 176.012,49 | 0,00 | 0,00 |
| (v) Pago de intereses de los Bonos C si no concurren las circunstancias que determinan su posposición al número (ix) del Orden de Prelación de Pagos: | 97.673,64 | 97.673,64 | 0,00 | 0,00 |
| (vi) Pago de intereses de los Bonos D si no concurren las circunstancias que determinan su posposición al número (x) del Orden de Prelación de Pagos: | 97.673,64 | 97.673,64 | 0,00 | 0,00 |
| (vii) Retención de la Cantidad Disponible para amortización : | | | | |
| Amortización de los Bonos A | 2.610.156,00 | 2.610.156,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización de los Bonos B | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización de los Bonos C | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización de los Bonos D | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (viii) Pago de intereses de los Bonos B si concurren las circunstancias que determinan su posposición a este número del Orden de Prelación de Pagos: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (ix) Pago de intereses de los Bonos C si concurren las circunstancias que determinan su posposición a este número del Orden de Prelación de Pagos: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (x) Pago de intereses de los Bonos D si concurren las circunstancias que determinan su posposición a este número del Orden de Prelación de Pagos: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xi) Dotación del Fondo de Reserva hasta que alcance su Nivel Mínimo: | 0,00 | 5.520.000,00 | - | 5.520.000,00 |
| (xii) Pago de la cantidad a pagar por resolución de la Permuta Financiera de Intereses excepto en los supuestos contemplados en el lugar (ii) anterior: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xiii) Pago de intereses del Préstamo Subordinado GI: | 0,00 | 5.363,09 | 70.150,15 | 75.513,24 |
| (xiv) Pago de intereses del Préstamo Subordinado DI (completamente amortizado): | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xv) Pago de intereses del Préstamo Subordinado FR: | 0,00 | 86.510,67 | 2.654.478,97 | 2.740.989,64 |
| (xvi) Amortización del Préstamo Subordinado GI: | 0,00 | 0,00 | 530.415,30 | 530.415,30 |
| (xvii) Amortización del Préstamo Subordinado DI (completamente amortizado): | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xviii) Amortización del Préstamo Subordinado FR: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xix) Pago de la comisión de administración: | 0,00 | 931,85 | 233.491,62 | 234.423,47 |
| (xx) Pago en concepto de Comisión Variable: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | 3.953.468,43 | 9.566.274,04 | 3.488.536,04 | 9.101.341,65 |

(*) Incluye gastos repercutidos por la Sociedad Gestora al Fondo por la gestión no ordinaria de préstamos en ejecución e inmuebles adjudicados.

IM PASTOR 4, FTA

Liquidación del Período: 24/06/2024 - 23/09/2024

Fecha de Pago: 23/09/2024

Detalle del cálculo de la Cantidad Disponible de Principal

| | |
|--|----------------------|
| Cantidad Disponible para Amortización (Mínimo entre 1 y 2 siguientes) | 2.610.215,31 |
| 1. Cantidad Teórica de Amortización (Diferencia entre A y B siguientes): | 34.144.234,68 |
| A) Saldo Nominal Pendiente de los Bonos en Fecha de Pago anterior. | 105.624.151,40 |
| B) Saldo no vencido de los préstamos no fallidos | 71.479.916,72 |
| 2. Recursos Disponibles menos los conceptos (i) a (vi) del orden de prelación de pagos | 2.610.215,31 |
| Cantidad Aplicada | 2.610.156,00 |
| Resto por redondeo | 59,31 |
| Déficit de Principal | 31.534.019,37 |

Información sobre Impagados y Fallidos:

| | |
|---------------------------------|-----------|
| Impago de principal | |
| Trimestre anterior | 28.829,04 |
| Trimestre actual | 14.974,45 |
| Importe de Fallidos del Periodo | 0,00 |

Detalle del cálculo del Nivel Mínimo Requerido del Fondo de Reserva:

| Conceptos | % | No Cumple Condición Importe |
|---|-------|--------------------------------|
| 1. % Saldo Inicial de los Bonos | 0,600 | 5.520.000,00 |
| 2. % Saldo Actual de los Bonos | 1,200 | 1.236.167,94 |
| 3. Importe mínimo | | 4.600.000,00 |
| Nivel Mínimo Requerido=Max(3,Min(1,2)) (*) | | 5.520.000,00 |
| Dotación del Fondo de Reserva | | 0,00 |
| Deficit del Fondo de Reserva | | -5.520.000,00 |

(*) El Nivel Mínimo del Fondo de Reserva, en el caso de no cumplirse las condiciones para su reducción, será igual al importe del Nivel Mínimo del Fondo de Reserva correspondiente a la Fecha de Pago anterior.

Otros Pasivos:

| Préstamos Subordinados | Saldo Inicial | Saldo Nominal Pendiente | Saldo vivo no vencido | Cupón |
|-------------------------|---------------|----------------------------|-----------------------|---------|
| Préstamo Subordinado GI | 990.000,00 | 530.415,30 | 0,00 | 4,000 % |
| Préstamo Subordinado DI | 2.101.737,14 | 0,00 | 0,00 | - |
| Préstamo Subordinado FR | 5.520.000,00 | 5.520.000,00 | 5.520.000,00 | 6,200 % |

IM PASTOR 4, FTA
Anuncio de Pago
Fecha de Pago: 23/09/2024

| | Serie A | Serie B |
|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| Cod. ISIN | ES0347854004 | ES0347854012 |
| Periodo de Devengo | 24/06/2024 - 23/09/2024 | 24/06/2024 - 23/09/2024 |
| Tipo de Referencia Vigente | 3,700 % | 3,700 % |
| Margen | 0,140 % | 0,190 % |
| Cupón Vigente | 3,840 % | 3,890 % |
| Tipo mínimo | - | - |

| | TOTAL | POR BONO | TOTAL | POR BONO |
|---|----------------|-----------------|---------------|-----------------|
| Saldo Inicial | 886.000.000,00 | 100.000,00 | 17.900.000,00 | 100.000,00 |
| Saldo Inicial Antes del Pago | 71.624.151,40 | 8.083,99 | 17.900.000,00 | 100.000,00 |
| Pago de Principal | 2.610.156,00 | 294,60 | 0,00 | 0,00 |
| Principal debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Saldo Final después del Pago | 69.013.995,40 | 7.789,39 | 17.900.000,00 | 100.000,00 |
| % Pendiente de pago actual | 7,79 % | 7,79 % | 100,00 % | 100,00 % |
| Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Devengado | 695.244,20 | 78,47 | 176.012,49 | 983,31 |
| Interés Bruto Pagado | 695.244,20 | 78,47 | 176.012,49 | 983,31 |
| Interés Bruto Debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| | Serie C | Serie D |
|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| Cod. ISIN | ES0347854020 | ES0347854038 |
| Periodo de Devengo | 24/06/2024 - 23/09/2024 | 24/06/2024 - 23/09/2024 |
| Tipo de Referencia Vigente | 3,700 % | 3,700 % |
| Margen | 0,500 % | 1,900 % |
| Cupón Vigente | 4,200 % | 5,600 % |
| Tipo mínimo | - | - |

| | TOTAL | POR BONO | TOTAL | POR BONO |
|---|--------------|-----------------|--------------|-----------------|
| Saldo Inicial | 9.200.000,00 | 100.000,00 | 6.900.000,00 | 100.000,00 |
| Saldo Inicial Antes del Pago | 9.200.000,00 | 100.000,00 | 6.900.000,00 | 100.000,00 |
| Pago de Principal | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Principal debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Saldo Final después del Pago | 9.200.000,00 | 100.000,00 | 6.900.000,00 | 100.000,00 |
| % Pendiente de pago actual | 100,00 % | 100,00 % | 100,00 % | 100,00 % |
| Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Devengado | 97.673,64 | 1.061,67 | 97.673,64 | 1.415,56 |
| Interés Bruto Pagado | 97.673,64 | 1.061,67 | 97.673,64 | 1.415,56 |
| Interés Bruto Debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

Nota: El interés bruto de los Bonos podrá estar o no sujeto a retención de acuerdo con la legislación vigente.

IM PASTOR 4, FTA

Flujos de Caja del Periodo: 24/06/2024 - 23/09/2024

| Concepto | Importe | |
|---|----------------------------|----------------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| <u>I. Principal</u> | <u>3.077.847,39</u> | <u>2.610.156,00</u> |
| Amortización Préstamos Hipotecarios | 3.077.847,39 | |
| Amortización Bonos de Titulización | | 2.610.156,00 |
| Amortización Préstamos Subordinados | | 0,00 |
| <u>II. Intereses</u> | <u>1.676.266,67</u> | <u>1.889.938,87</u> |
| Intereses cobrados Préstamos Hipotecarios | 848.259,79 | |
| Intereses de las cuentas | 25.049,23 | |
| Contrato de Swap | 802.957,65 | 823.334,90 |
| Intereses pagados a los Bonos de Titulización | | 1.066.603,97 |
| Intereses de Préstamos Subordinados | | 0,00 |
| <u>III. Venta y explotación de inmuebles</u> | <u>2.286,89</u> | <u>0,00</u> |
| <u>IV. Gastos</u> | <u>0,00</u> | <u>256.331,21</u> |
| TOTAL INGRESOS/PAGOS | 4.756.400,95 | 4.756.426,08 |
| Saldo Inicial 24/06/2024 | 84,44 | |
| Recursos depositados para la próxima Fecha de Pago | | |
| Depósito de Principal | | 59,31 |
| TOTAL | 4.756.485,39 | 4.756.485,39 |
| Retenciones Practicadas el 23/09/2024 | 202.654,75 | |
| A Inversiones Temporales hasta el 21/10/2024 | | 202.654,75 |