

IM PASTOR 4, FTA

Información correspondiente al periodo: 22/03/2024 - 24/06/2024

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)	71.624.151,40 €	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)	8.083,99 €	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: 22/03/2024 - 24/06/2024

Anuncio del Pago de los Bonos: 24/06/2024

Flujos de Caja del periodo: 22/03/2024 - 24/06/2024

(*) Calificación correspondiente a la fecha 07/06/2024. La calificación actualizada de los Bonos se puede consultar en nuestra página web www.imtitulizacion.com.

IM PASTOR 4, FTA
Liquidación del Periodo: 22/03/2024 - 24/06/2024
Fecha de Pago: 24/06/2024

Recursos Disponibles (I+II+III+IV+V+VI):		6.110.006,02		
I. Situación Inicial:		7,50		
II. Fondos recibidos del cedente:		5.387.566,85		
a) Principal regular		1.733.347,11		
b) Recuperación de Fallidos		728.098,88		
c) Intereses ordinarios		975.931,15		
d) Intereses de demora		0,00		
e) Amortización Anticipada		1.950.189,71		
III. Otros:		0,00		
IV. Intereses de las Cuentas:		31.398,08		
V. Cobro de la Liquidación del Swap:		0,00		
VI. Ingresos derivados de la venta y explotación de inmuebles:		691.033,59		
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 (*)	323.973,29	323.973,29	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:	16.313,91	16.313,91	0,00	0,00
(iii) Pago de intereses de los Bonos A:	808.032,00	808.032,00	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:	192.190,51	192.190,51	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:	106.225,96	106.225,96	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:	104.893,11	104.893,11	0,00	0,00
(vii) Retención de la Cantidad Disponible para amortización :				
Amortización de los Bonos A	4.558.292,80	4.558.292,80	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	5.847,36	64.302,79	70.150,15
(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	92.562,43	2.561.916,54	2.654.478,97
(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	977,89	232.513,73	233.491,62
(xx) Pago en concepto de Comisión Variable:	0,00	0,00	0,00	0,00
Total	6.109.921,58	11.729.309,26	3.389.148,36	9.008.536,04

(*) 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: 22/03/2024 - 24/06/2024

Fecha de Pago: 24/06/2024

Detalle del cálculo de la Cantidad Disponible de Principal

Cantidad Disponible para Amortización (Mínimo entre 1 y 2 siguientes)	4.558.377,24
1. Cantidad Teórica de Amortización (Diferencia entre A y B siguientes):	35.663.513,02
A) Saldo Nominal Pendiente de los Bonos en Fecha de Pago anterior.	110.182.444,20
B) Saldo no vencido de los préstamos no fallidos	74.518.931,18
2. Recursos Disponibles menos los conceptos (i) a (vi) del orden de prelación de pagos	4.558.377,24
Cantidad Aplicada	4.558.292,80
Resto por redondeo	84,44
Déficit de Principal	31.105.135,78

Información sobre Impagados y Fallidos:

Impago de principal	
Trimestre anterior	32.450,08
Trimestre actual	28.829,04
Importe de Fallidos del Periodo	0,00

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

Información de Triggers: Reducción del Nivel Mínimo del Fondo de Reserva.		No Cumple Condición
Conceptos	%	Importe
1. % Saldo Inicial de los Bonos	0,600	5.520.000,00
2. % Saldo Actual de los Bonos	1,200	1.267.489,82
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	4,222 %
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	6,422 %

IM PASTOR 4, FTA
Anuncio de Pago
Fecha de Pago: 24/06/2024

	Serie A	Serie B
Cod. ISIN	ES0347854004	ES0347854012
Periodo de Devengo	22/03/2024 - 24/06/2024	22/03/2024 - 24/06/2024
Tipo de Referencia Vigente	3,922 %	3,922 %
Margen	0,140 %	0,190 %
Cupón Vigente	4,062 %	4,112 %
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	76.182.444,20	8.598,47	17.900.000,00	100.000,00
Pago de Principal	4.558.292,80	514,48	0,00	0,00
Principal debido	0,00	0,00	0,00	0,00
Saldo Final después del Pago	71.624.151,40	8.083,99	17.900.000,00	100.000,00
% Pendiente de pago actual	8,08 %	8,08 %	100,00 %	100,00 %
Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago	0,00	0,00	0,00	0,00
Interés Bruto Devengado	808.032,00	91,20	192.190,51	1.073,69
Interés Bruto Pagado	808.032,00	91,20	192.190,51	1.073,69
Interés Bruto Debido	0,00	0,00	0,00	0,00

	Serie C	Serie D
Cod. ISIN	ES0347854020	ES0347854038
Periodo de Devengo	22/03/2024 - 24/06/2024	22/03/2024 - 24/06/2024
Tipo de Referencia Vigente	3,922 %	3,922 %
Margen	0,500 %	1,900 %
Cupón Vigente	4,422 %	5,822 %
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	106.225,96	1.154,63	104.893,11	1.520,19
Interés Bruto Pagado	106.225,96	1.154,63	104.893,11	1.520,19
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: 22/03/2024 - 24/06/2024

Concepto	Importe	
	Ingresos	Pagos
<u>I. Principal</u>	<u>4.411.635,70</u>	<u>4.558.292,80</u>
Amortización Préstamos Hipotecarios	4.411.635,70	
Amortización Bonos de Titulización		4.558.292,80
Amortización Préstamos Subordinados		0,00
<u>II. Intereses</u>	<u>1.931.741,01</u>	<u>2.152.067,27</u>
Intereses cobrados Préstamos Hipotecarios	975.931,15	
Intereses de las cuentas	31.398,08	
Contrato de Swap	924.411,78	940.725,69
Intereses pagados a los Bonos de Titulización		1.211.341,58
Intereses de Préstamos Subordinados		0,00
<u>III. Venta y explotación de inmuebles</u>	<u>691.033,59</u>	<u>0,00</u>
<u>IV. Gastos</u>	<u>0,00</u>	<u>323.973,29</u>
TOTAL INGRESOS/PAGOS	7.034.410,30	7.034.333,36
Saldo Inicial 22/03/2024	7,50	
Recursos depositados para la próxima Fecha de Pago		
Depósito de Principal		84,44
TOTAL	7.034.417,80	7.034.417,80
Retenciones Practicadas el 24/06/2024	230.154,90	
A Inversiones Temporales hasta el 22/07/2024		230.154,90