

IM PASTOR 3, FTH

Información correspondiente al periodo: 22/06/2021 - 22/09/2021

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|----------------------------------|----------------------------|
| Fecha de Constitución del Fondo | 09/06/2005 |
| Fecha de Desembolso de los Bonos | 14/06/2005 |
| 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 | ES0347862007 | Código ISIN | ES0347862015 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 961.000.000,00 € | Nominal en circulación total (inicial) | 17.000.000,00 € |
| Nominal en circulación total (actual) | 95.746.448,10 € | Nominal en circulación total (actual) | 17.000.000,00 € |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € | Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 9.963,21 € | Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 € |

| Serie C | | Serie D | |
|---|-----------------|---|-----------------|
| Código ISIN | ES0347862023 | Código ISIN | ES0347862031 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 12.000.000,00 € | Nominal en circulación total (inicial) | 10.000.000,00 € |
| Nominal en circulación total (actual) | 12.000.000,00 € | Nominal en circulación total (actual) | 10.000.000,00 € |
| 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: 22/06/2021 - 22/09/2021

Anuncio del Pago de los Bonos: 22/09/2021

Flujos de Caja del periodo: 22/06/2021 - 22/09/2021

(*) Calificación correspondiente a la fecha 09/09/2021. La calificación actualizada de los Bonos se puede consultar en nuestra página web www.imtitulizacion.com.

IM PASTOR 3, FTH
Liquidación del Periodo: 22/06/2021 - 22/09/2021
Fecha de Pago: 22/09/2021

| Recursos Disponibles (I+II+III+IV+V+VI-II.f): | | | | |
|---|---------------------|---------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------|
| I. Situación Inicial: | | 4.753.816,68 | | |
| II. Fondos recibidos del cedente: | | 378.125,50 | | |
| a) Principal regular | | 4.227.781,00 | | |
| b) Recuperación de Fallidos | | 2.337.441,08 | | |
| c) Intereses ordinarios | | 510.763,98 | | |
| d) Intereses de demora | | 288.054,90 | | |
| e) Amortización Anticipada hasta el 31/07/2021 | | 0,00 | | |
| f) Amortización Anticipada del último mes | | 763.714,43 | | |
| III. Otros: | | 327.806,61 | | |
| IV. Intereses de las Cuentas: | | 0,00 | | |
| V. Cobro de la Liquidación del Swap: | | -7.966,00 | | |
| VI. Ingresos derivados de la venta y explotación de inmuebles: | | 0,00 | | |
| | | 483.682,79 | | |
| 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 (*) | 143.930,62 | 143.930,62 | 0,00 | 0,00 |
| (ii) Comisión de la Sociedad Gestora: | 7.384,95 | 7.384,95 | 0,00 | 0,00 |
| (iii) Pago, en su caso, de la Cantidad Neta del Contrato de Swap y solamente en caso de resolución del contrato por incumplimiento del Fondo, la cantidad que en su caso corresponda al pago liquidativo: | 201.242,03 | 201.242,03 | 0,00 | 0,00 |
| (iv) Pago de intereses de los Bonos de la Serie A: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (v) Pago de intereses de los Bonos de la Serie B salvo postergamiento de este pago al lugar (ix) del Orden de Prelación de Pagos: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (vi) Pago de intereses de los Bonos de la Serie C salvo postergamiento de este pago al lugar (x) del Orden de Prelación de Pagos: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (vii) Pago de intereses de los Bonos de la Serie D salvo postergamiento de este pago al lugar (xi) del Orden de Prelación de Pagos: | 1.431,00 | 1.431,00 | 0,00 | 0,00 |
| (viii) Retención de la Cantidad Disponible para amortización : | | | | |
| Amortización de los Bonos de la Serie A: | 4.399.746,30 | 4.399.746,30 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización de los Bonos de la Serie B: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización de los Bonos de la Serie C: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización de los Bonos de la Serie D: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (ix) Pago de intereses de los Bonos de la Serie B, si concurren las circunstancias que determinan su postergamiento a este número del Orden de Prelación: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (x) Pago de intereses de los Bonos de la Serie C, si concurren las circunstancias que determinan su postergamiento a este número del Orden de Prelación: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xi) Pago de intereses de los Bonos de la Serie D, si concurren las circunstancias que determinan su postergamiento a este número del Orden de Prelación: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xii) Dotación del Fondo de Reserva hasta que alcance su Nivel Mínimo: | 0,00 | 9.000.000,00 | - | 9.000.000,00 |
| (xiii) Pago de intereses del Préstamo Subordinado para Intereses del Primer Periodo (completamente amortizado): | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xiv) Pago de intereses del Préstamo Subordinado para Gastos Iniciales: | 0,00 | 0,00 | 64.162,80 | 64.162,80 |
| (xv) Pago de intereses del Préstamo Subordinado para Fondo de Reserva: | 0,00 | 44.988,00 | 3.718.944,42 | 3.763.932,42 |
| (xvi) Amortización del Préstamo Subordinado para Intereses del Primer Periodo (completamente amortizado): | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xvii) Amortización del Préstamo Subordinado para Gastos Iniciales: | 0,00 | 0,00 | 682.172,94 | 682.172,94 |
| (xviii) Pago de la cantidad a pagar por el Fondo, en su caso, que componga el pago liquidativo de la Permuta en el caso de que la resolución del contrato fuera por incumplimiento de la contraparte: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xix) Amortización del Préstamo Subordinado para Fondo de Reserva: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xx) Margen de Intermediación Financiera: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | 4.753.734,90 | 13.798.722,90 | 4.465.280,16 | 13.510.268,16 |

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

IM PASTOR 3, FTH

Liquidación del Período: 22/06/2021 - 22/09/2021

Fecha de Pago: 22/09/2021

Detalle del cálculo de la Cantidad Disponible de Principal

| | |
|--|----------------|
| Cantidad Disponible para Amortización (Mínimo entre 1 y 2 siguientes) | 4.399.828,08 |
| 1. Cantidad Teórica de Amortización (Diferencia entre A y B siguientes): | 49.038.512,48 |
| A) Saldo Nominal Pendiente de los Bonos en Fecha de Pago anterior. | 139.146.194,40 |
| B) Saldo no vencido actual de los préstamos no fallidos más Amortización anticipada del último mes | 90.107.681,92 |
| 2. Recursos Disponibles menos los conceptos (i) a (vii) del orden de prelación de pagos | 4.399.828,08 |
| Cantidad Aplicada | 4.399.746,30 |
| Resto por redondeo | 81,78 |
| Déficit de Principal | 44.638.684,40 |

Información sobre Impagados y Fallidos:

| | |
|---------------------------------|------------|
| Impago de principal | |
| Trimestre anterior | 76.143,61 |
| Trimestre actual | 149.498,54 |
| Importe de Fallidos del Período | 155.599,88 |

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 | 0,900 | 9.000.000,00 |
| 2. % Saldo Actual de los Bonos | 1,700 | 2.290.689,62 |
| 3. Importe mínimo | | 5.500.000,00 |
| Nivel Mínimo Requerido=Max(3,Min(1,2)) (*) | | 9.000.000,00 |
| Dotación del Fondo de Reserva | | 0,00 |
| Deficit del Fondo de Reserva | | -9.000.000,00 |

(*) 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 para Intereses del Primer Período | 1.500.000,00 | 0,00 | 0,00 | - |
| Préstamo Subordinado para Gastos Iniciales | 951.229,29 | 682.172,94 | 0,00 | 0,000 % |
| Préstamo Subordinado para el Fondo de Reserva | 9.000.000,00 | 9.000.000,00 | 9.000.000,00 | 1,956 % |

IM PASTOR 3, FTH
Anuncio de Pago
Fecha de Pago: 22/09/2021

| | Serie A | Serie B |
|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| Cod. ISIN | ES0347862007 | ES0347862015 |
| Periodo de Devengo | 22/06/2021 - 22/09/2021 | 22/06/2021 - 22/09/2021 |
| Tipo de Referencia Vigente | -0,544 % | -0,544 % |
| Margen | 0,140 % | 0,290 % |
| Cupón Vigente | 0,000 % | 0,000 % |
| Tipo mínimo | - | - |

| | TOTAL | POR BONO | TOTAL | POR BONO |
|---|----------------|------------|---------------|------------|
| Saldo Inicial | 961.000.000,00 | 100.000,00 | 17.000.000,00 | 100.000,00 |
| Saldo Inicial Antes del Pago | 100.146.194,40 | 10.421,04 | 17.000.000,00 | 100.000,00 |
| Pago de Principal | 4.399.746,30 | 457,83 | 0,00 | 0,00 |
| Principal debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Saldo Final después del Pago | 95.746.448,10 | 9.963,21 | 17.000.000,00 | 100.000,00 |
| % Pendiente de pago actual | 9,96 % | 9,96 % | 100,00 % | 100,00 % |
| Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Devengado | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Pagado | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| | Serie C | Serie D |
|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| Cod. ISIN | ES0347862023 | ES0347862031 |
| Periodo de Devengo | 22/06/2021 - 22/09/2021 | 22/06/2021 - 22/09/2021 |
| Tipo de Referencia Vigente | -0,544 % | -0,544 % |
| Margen | 0,370 % | 0,600 % |
| Cupón Vigente | 0,000 % | 0,056 % |
| Tipo mínimo | - | - |

| | TOTAL | POR BONO | TOTAL | POR BONO |
|---|---------------|------------|---------------|------------|
| Saldo Inicial | 12.000.000,00 | 100.000,00 | 10.000.000,00 | 100.000,00 |
| Saldo Inicial Antes del Pago | 12.000.000,00 | 100.000,00 | 10.000.000,00 | 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 | 12.000.000,00 | 100.000,00 | 10.000.000,00 | 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 | 0,00 | 0,00 | 1.431,00 | 14,31 |
| Interés Bruto Pagado | 0,00 | 0,00 | 1.431,00 | 14,31 |
| 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.

Nota: En aquellos casos en los que el resultado de la fórmula de fijación del tipo de interés de los Bonos es inferior a cero, la Sociedad Gestora ha fijado el Tipo de Interés Nominal para este Período de Devengo de Intereses en el 0%.

IM PASTOR 3, FTH
Flujos de Caja del Periodo: 22/06/2021 - 22/09/2021

| Concepto | Importe | |
|--|---------------------|---------------------|
| | Ingresos | Pagos |
| <u>I. Principal</u> | <u>3.939.726,10</u> | <u>4.399.746,30</u> |
| Amortización Participaciones hipotecarias | 3.939.726,10 | |
| Amortización Bonos de Titulización | | 4.399.746,30 |
| Amortización Préstamos Subordinados | | 0,00 |
| <u>II. Intereses</u> | <u>366.901,77</u> | <u>289.485,90</u> |
| Intereses cobrados Participaciones hipotecarias | 288.054,90 | |
| Intereses de las cuentas | -7.966,00 | |
| Contrato de Swap | 86.812,87 | 288.054,90 |
| Intereses pagados a los Bonos de Titulización | | 1.431,00 |
| Intereses de Préstamos Subordinados | | 0,00 |
| <u>III. Venta y explotación de inmuebles</u> | <u>483.682,79</u> | <u>0,00</u> |
| <u>IV. Gastos</u> | <u>0,00</u> | <u>151.315,57</u> |
| TOTAL INGRESOS/PAGOS | 4.790.310,66 | 4.840.547,77 |
| Saldo Inicial 22/06/2021 | 378.125,50 | |
| Recursos depositados para la próxima Fecha de Pago | | |
| Depósito de Principal | | 327.888,39 |
| TOTAL | 5.168.436,16 | 5.168.436,16 |
| Retenciones Practicadas el 22/09/2021 | 271,89 | |
| A Inversiones Temporales hasta el 20/10/2021 | | 271,89 |