

IM PASTOR 4, FTA

Información correspondiente al periodo: 22/12/2022 - 22/03/2023

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) | 93.574.712,80 € | 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) | 10.561,48 € | 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: 22/12/2022 - 22/03/2023

Anuncio del Pago de los Bonos: 22/03/2023

Flujos de Caja del periodo: 22/12/2022 - 22/03/2023

 (*) Calificación correspondiente a la fecha 14/03/2023. La calificación actualizada de los Bonos se puede consultar en nuestra página web www.imtitulizacion.com.

IM PASTOR 4, FTA
Liquidación del Periodo: 22/12/2022 - 22/03/2023
Fecha de Pago: 22/03/2023

| Recursos Disponibles (I+II+III+IV+V+VI): | | | | |
|---|---------------------|---------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------|
| I. Situación Inicial: | 40,95 | | | |
| II. Fondos recibidos del cedente: | 4.815.020,16 | | | |
| a) Principal regular | 2.281.589,55 | | | |
| b) Recuperación de Fallidos | 14.816,04 | | | |
| c) Intereses ordinarios | 421.899,42 | | | |
| d) Intereses de demora | 0,00 | | | |
| e) Amortización Anticipada | 2.096.715,15 | | | |
| III. Otros: | 0,00 | | | |
| IV. Intereses de las Cuentas: | 12.635,67 | | | |
| V. Cobro de la Liquidación del Swap: | 171.676,65 | | | |
| VI. Ingresos derivados de la venta y explotación de inmuebles: | 148.742,15 | | | |
| <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 (*) | 193.401,40 | 193.401,40 | 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: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (iii) Pago de intereses de los Bonos A: | 543.206,60 | 543.206,60 | 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: | 101.627,25 | 101.627,25 | 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: | 59.363,00 | 59.363,00 | 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: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (vii) Retención de la Cantidad Disponible para amortización : | | | | |
| Amortización de los Bonos A | 4.250.496,40 | 4.250.496,40 | 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 | 68.672,25 | 0,00 | 68.672,25 |
| (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 | 3.157,30 | 40.412,83 | 43.570,13 |
| (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 | 63.217,80 | 2.159.471,12 | 2.222.688,92 |
| (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 | 1.240,04 | 226.840,18 | 228.080,22 |
| (xx) Pago en concepto de Comisión Variable: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | 5.148.094,65 | 10.804.382,04 | 2.957.139,43 | 8.613.426,82 |

(*) 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: 22/12/2022 - 22/03/2023

Fecha de Pago: 22/03/2023

| Detalle del cálculo de la Cantidad Disponible de Principal | |
|--|----------------|
| Cantidad Disponible para Amortización (Mínimo entre 1 y 2 siguientes) | 4.250.517,33 |
| 1. Cantidad Teórica de Amortización (Diferencia entre A y B siguientes): | 37.043.109,96 |
| A) Saldo Nominal Pendiente de los Bonos en Fecha de Pago anterior. | 131.825.209,20 |
| B) Saldo no vencido de los préstamos no fallidos | 94.782.099,24 |
| 2. Recursos Disponibles menos los conceptos (i) a (vi) del orden de prelación de pagos | 4.250.517,33 |
| Cantidad Aplicada | 4.250.496,40 |
| Resto por redondeo | 20,93 |
| Déficit de Principal | 32.792.592,63 |

Información sobre Impagados y Fallidos:

| | |
|---------------------------------|-----------|
| Impago de principal | |
| Trimestre anterior | 45.826,89 |
| Trimestre actual | 40.792,72 |
| Importe de Fallidos del Periodo | 1.679,81 |

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 | 1.530.896,55 | |
| 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 | 2,381 % |
| 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 | 4,581 % |

IM PASTOR 4, FTA
Anuncio de Pago
Fecha de Pago: 22/03/2023

| | Serie A | Serie B |
|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| Cod. ISIN | ES0347854004 | ES0347854012 |
| Periodo de Devengo | 22/12/2022 - 22/03/2023 | 22/12/2022 - 22/03/2023 |
| Tipo de Referencia Vigente | 2,081 % | 2,081 % |
| Margen | 0,140 % | 0,190 % |
| Cupón Vigente | 2,221 % | 2,271 % |
| 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 | 97.825.209,20 | 11.041,22 | 17.900.000,00 | 100.000,00 |
| Pago de Principal | 4.250.496,40 | 479,74 | 0,00 | 0,00 |
| Principal debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Saldo Final después del Pago | 93.574.712,80 | 10.561,48 | 17.900.000,00 | 100.000,00 |
| % Pendiente de pago actual | 10,56 % | 10,56 % | 100,00 % | 100,00 % |
| Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Devengado | 543.206,60 | 61,31 | 101.627,25 | 567,75 |
| Interés Bruto Pagado | 543.206,60 | 61,31 | 101.627,25 | 567,75 |
| Interés Bruto Debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| | Serie C | Serie D |
|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| Cod. ISIN | ES0347854020 | ES0347854038 |
| Periodo de Devengo | 22/12/2022 - 22/03/2023 | 22/12/2022 - 22/03/2023 |
| Tipo de Referencia Vigente | 2,081 % | 2,081 % |
| Margen | 0,500 % | 1,900 % |
| Cupón Vigente | 2,581 % | 3,981 % |
| 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 | 59.363,00 | 645,25 | 68.672,25 | 995,25 |
| Interés Bruto Pagado | 59.363,00 | 645,25 | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Debido | 0,00 | 0,00 | 68.672,25 | 995,25 |

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: 22/12/2022 - 22/03/2023

| Concepto | Importe | |
|--|---------------------|---------------------|
| | Ingresos | Pagos |
| <u>I. Principal</u> | <u>4.393.120,74</u> | <u>4.250.496,40</u> |
| Amortización Préstamos Hipotecarios | 4.393.120,74 | |
| Amortización Bonos de Titulización | | 4.250.496,40 |
| Amortización Préstamos Subordinados | | 0,00 |
| <u>II. Intereses</u> | <u>1.017.105,61</u> | <u>1.115.090,72</u> |
| Intereses cobrados Préstamos Hipotecarios | 421.899,42 | |
| Intereses de las cuentas | 12.635,67 | |
| Contrato de Swap | 582.570,52 | 410.893,87 |
| Intereses pagados a los Bonos de Titulización | | 704.196,85 |
| Intereses de Préstamos Subordinados | | 0,00 |
| <u>III. Venta y explotación de inmuebles</u> | <u>148.742,15</u> | <u>0,00</u> |
| <u>IV. Gastos</u> | <u>0,00</u> | <u>193.401,40</u> |
| TOTAL INGRESOS/PAGOS | 5.558.968,50 | 5.558.988,52 |
| Saldo Inicial 22/12/2022 | 40,95 | |
| Recursos depositados para la próxima Fecha de Pago | | |
| Depósito de Principal | | 20,93 |
| TOTAL | 5.559.009,45 | 5.559.009,45 |
| Retenciones Practicadas el 22/03/2023 | 133.797,40 | |
| A Inversiones Temporales hasta el 20/04/2023 | | 133.797,40 |