
IM PASTOR 3, FTH
Información de la Cartera a 30/06/2006
Fecha de Cobro: 20/07/2006

INFORMACIÓN SOBRE LAS PARTICIPACIONES HIPOTECARIAS

| | |
|------------------------------------------------------|----------------|
| Saldo no vencido de las P.H. a 01/06/2006 | 798.830.683,10 |
| Saldo no vencido de las P.H. a 30/06/2006 | 780.626.897,63 |
| | |
| Tipo Medio Ponderado (%) | 3,78 |
| Vencimiento Residual Ponderado (meses) | 293 |
| | |
| Tasas de Amortización Anticipada (%) | |
| Último mes | 21,78 |
| Último trimestre | 20,45 |
| Último semestre | 20,96 |
| Últimos 12 meses | 18,77 |
| Desde el inicio de la vida del Fondo | 18,61 |
| | |
| Tasas de Impago (%) ⁽¹⁾ | |
| > 3 y <= 6 meses | 0,45 |
| > 6 y <= 11 meses | 0,37 |
| Fallidos | 0,16 |
| | |
| <i>Cuentas de reinversión del Fondo (30/06/2006)</i> | |
| Cuenta en Banco Pastor | 25.817.052,88 |

Destinatarios: CNMV; AIAF

IMT/PASTOR 3/Info jun06

(1) Las tasas de impago están calculadas como la suma del saldo vivo no vencido más el principal impagado de los préstamos con impago, sobre el saldo vivo no vencido más el principal impagado del total de la cartera no fallida.

La agrupación en meses de impago se realiza siguiendo el siguiente criterio,

1 mes: >0 <=30 días en impago

2 meses: >30 <=60 días en impago

3 meses: >60 <=90 días en impago

y así sucesivamente.