



24/10/2011

IM BANCO POPULAR MBS 1, FTA LIQUIDACIÓN ANTICIPADA

Información correspondiente al período: 26/07/2011 - 24/10/2011

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|------------------------------------|---|
| Fecha de Constitución del Fondo | 12/11/2008 |
| Fecha de Desembolso de los Bonos | 14/11/2008 |
| Sociedad Gestora | InterMoney Titulización, SGFT, S.A. |
| Cedente de los Derechos de Crédito | Banco Popular |
| Agente Financiero | Banco Popular |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencias de Calificación | Moody's Investors Service / Fitch Ratings |
| Calificación Actual | Bonos A (Aaa /AAA) Bonos B (A1 /A) Bonos C (Baa2 /BBB) |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| | |
|---|--------------------------|
| Serie A | |
| Código ISIN | ES0347543003 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 5.730.000.000,00 € |
| Nominal en circulación total (actual) | Completamente Amortizado |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € |
| Nominal en circulación unitario (actual) | Completamente Amortizado |
| Serie B | |
| Código ISIN | ES0347543011 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 180.000.000,00 € |
| Nominal en circulación total (actual) | Completamente Amortizado |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € |
| Nominal en circulación unitario (actual) | Completamente Amortizado |
| Serie C | |
| Código ISIN | ES0347543029 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 90.000.000,00 € |
| Nominal en circulación total (actual) | Completamente Amortizado |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € |
| Nominal en circulación unitario (actual) | Completamente Amortizado |

III. INFORMACIÓN INCLUIDA

Liquidación correspondiente al período: 26/07/2011 - 24/10/2011

Anuncio del Pago de los Bonos: 24/10/2011

Flujos de Caja del período: 26/07/2011 - 24/10/2011



IM BANCO POPULAR MBS 1, FTA
LIQUIDACIÓN ANTICIPADA
Liquidación del Periodo: 26/07/2011 - 24/10/2011
Fecha de Pago: 24/10/2011

| Concepto | Importe |
|--|-------------------------|
| <u>RECURSOS DISPONIBLES</u> | |
| I. Situación Inicial: | 233.910.923,12 |
| Saldo inicial de la Cuenta Tesorería | 233.910.923,12 |
| II. Fondos recibidos del Emisor: | 127.312.730,26 |
| II.1 Principal cobrado de los Préstamos Hipotecarios | 92.033.082,15 |
| Según calendario hasta 30/09/2011 | 54.358.366,71 |
| Amortización Anticipada | 32.033.844,82 |
| Recuperación de Préstamos Fallidos | 5.640.870,62 |
| II.2 Intereses cobrados de los Préstamos Hipotecarios | 35.115.978,92 |
| II.3 Otros | 163.669,19 |
| III. Subtotal a cuentas de Tesorería (I + II): | 361.223.653,38 |
| IV. Intereses de las cuentas de reinversión: | 1.200.403,03 |
| Intereses de la Cuenta de Tesorería | 1.200.403,03 |
| V. Cobro de la Liquidación del Swap: | 0,00 |
| VI. Recursos disponibles (III + IV + V): | 362.424.056,41 |
| VII. Importe de la venta de los Prestamos Hipotecarios (1): | 4.122.220.196,67 |
| VIII. Recursos disponibles para la Liquidación Anticipada del Fondo (VI + VII): | 4.484.644.253,08 |
| <u>PAGOS</u> | |
| (i) Reserva para hacer frente a los gastos finales de extinción y liquidación de orden tributario, administrativo o publicitario: | 19.517,00 |
| (ii) Gastos ordinarios y extraordinarios e impuestos del Fondo: | 1.642.047,68 |
| Gestora | 50.000,00 |
| Agente de Pagos | 3.750,00 |
| Administración | 1.564.838,24 |
| Iberclear | 1.239,00 |
| AIAF | 106,20 |
| Auditoría | 4.700,00 |
| Otros | 304,24 |
| Calificación | 17.110,00 |

| | |
|---|-------------------------|
| (iii) 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: | 9.703.006,77 |
| (iv) Pago de intereses de la Serie A: | 18.616.770,00 |
| Intereses debidos en la Fecha de Pago anterior | 0,00 |
| Intereses devengados en esta Fecha de Pago | 18.616.770,00 |
| Interés pagado | 18.616.770,00 |
| Interés debido | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos (2) | -3.537.129,00 |
| (v) Amortización de los Bonos A: | 3.902.901.831,00 |
| (vi) Pago de intereses de la Serie B: | 993.600,00 |
| Intereses debidos en la Fecha de Pago anterior | 0,00 |
| Intereses devengados en esta Fecha de Pago | 993.600,00 |
| Interés pagado | 993.600,00 |
| Interés debido | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos (2) | -188.784,00 |
| (vii) Amortización de los Bonos de la Serie B: | 180.000.000,00 |
| (viii) Pago de intereses de la Serie C | 586.800,00 |
| Intereses debidos en la Fecha de Pago anterior | 0,00 |
| Intereses devengados en esta Fecha de Pago | 586.800,00 |
| Interés pagado | 586.800,00 |
| Interés debido | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos (2) | -111.492,00 |
| (ix) Amortización de los Bonos C: | 90.000.000,00 |
| (x) Pago de la cantidad a pagar por resolución de la Permuta Financiera de Intereses excepto en los supuestos contemplados en el lugar (iii) anterior: | 0,00 |
| (xi) Pago de intereses del Préstamo Subordinado GI: | 22.254,49 |
| Intereses debidos en la Fecha de Pago anterior | 18.820,15 |
| Intereses devengados en esta Fecha de Pago | 3.434,34 |
| Interés pagado | 22.254,49 |
| Interés debido | 0,00 |
| (xii) Pago de intereses del Préstamo Subordinado FR: | 16.937.220,00 |
| Intereses debidos en la Fecha de Pago anterior | 14.472.420,00 |
| Intereses devengados en esta Fecha de Pago | 2.464.800,00 |
| Interés pagado | 16.937.220,00 |
| Interés debido | 0,00 |
| (xiii) Amortización del Préstamo Subordinado GI: | 442.000,00 |
| Amortización debida en la anterior Fecha de Pago | 182.000,00 |
| Amortización correspondiente a esta Fecha de Pago | 260.000,00 |
| Amortización pagada | 442.000,00 |
| Amortización debida | 0,00 |

| | |
|--|-----------------------|
| (xiv) Amortización del Préstamo Subordinado FR: | 240.000.000,00 |
| Amortización debida en la anterior Fecha de Pago | 0,00 |
| Amortización correspondiente a esta Fecha de Pago | 240.000.000,00 |
| Amortización pagada | 240.000.000,00 |
| Amortización debida | 0,00 |

(xv) Pago de la Comisión Variable (3): **22.779.206,14**

| | |
|--|-------------------------|
| (1) Importe de la venta de los Prestamos Hipotecarios: | 4.122.220.196,67 |
| Saldo Vivo de los Prestamos Hipotecarios No Fallidos: | 4.074.287.682,10 |
| Saldo Vivo de los Prestamos Hipotecarios Fallidos: | 47.932.514,57 |

(2) Reinvertido hasta el 21/11/2011

(3) En aplicación del punto 3.4.6.5. del Folleto de Emisión

Información sobre Impagados y Fallidos

| | |
|---------------------------------|---------------|
| Impago de principal | |
| Trimestre anterior | 1.955.777,40 |
| Trimestre actual | 2.051.815,53 |
| Importe de Fallidos del Período | 12.222.071,53 |

IMT/IM BANCO POPULAR MBS 1/ LIQUIDACIÓN ANTICIPADA

Destinatarios: Emisor; CNMV; AIAF



INTERMONEY TITULIZACIÓN S.G.F.T

Piza. Pablo Ruiz Picasso 1. Torre Picasso, Pita 23, 28020 Madrid. Tfno 34 914326488



11/10/2011

IM BANCO POPULAR MBS 1, FTA
ANUNCIO DE PAGO - LIQUIDACIÓN ANTICIPADA DEL FONDO
FECHA DE PAGO: 24/10/2011

| Cod. ISIN | BONOS A | | BONOS B | | BONOS C | |
|---|------------------|------------|----------------|------------|---------------|------------|
| | ES0347543003 | | ES0347543011 | | ES0347543029 | |
| Periodo de Devengo | 26/07/2011 | 24/10/2011 | 26/07/2011 | 24/10/2011 | 26/07/2011 | 24/10/2011 |
| Tipo de Referencia Vigente | 1,608% | | 1,608% | | 1,608% | |
| Margen | 0,300% | | 0,600% | | 1,000% | |
| Cupón vigente | 1,908% | | 2,208% | | 2,608% | |
| | TOTAL | POR BONO | TOTAL | POR BONO | TOTAL | POR BONO |
| Saldo Inicial | 5.730.000.000,00 | 100.000,00 | 180.000.000,00 | 100.000,00 | 90.000.000,00 | 100.000,00 |
| Saldo Inicial Antes del Pago | 3.902.901.831,00 | 68.113,47 | 180.000.000,00 | 100.000,00 | 90.000.000,00 | 100.000,00 |
| Pago de Principal | 3.902.901.831,00 | 68.113,47 | 180.000.000,00 | 100.000,00 | 90.000.000,00 | 100.000,00 |
| Saldo Final después del Pago | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| % Pendiente de vencimiento actual | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Devengado | 18.616.770,00 | 324,90 | 993.600,00 | 552,00 | 586.800,00 | 652,00 |
| Interés Bruto Pagado | 18.616.770,00 | 324,90 | 993.600,00 | 552,00 | 586.800,00 | 652,00 |
| Interés Bruto Debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Retención (19%) | 3.537.129,00 | 61,73 | 188.784,00 | 104,88 | 111.492,00 | 123,88 |
| Interés Neto | 15.079.641,00 | 263,17 | 804.816,00 | 447,12 | 475.308,00 | 528,12 |

IMT/IM BANCO POPULAR MBS 1/Anun Pago/Liquidación Anticipada



IM BANCO POPULAR MBS 1, FTA
LIQUIDACIÓN ANTICIPADA
Flujos de Caja del Período: 26/07/2011 - 24/10/2011

| Concepto | Importe | |
|---|--------------------------------|--------------------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| <u>I. Principal</u> | <u>4.214.253.278,82</u> | <u>4.413.343.831,00</u> |
| Amortización de los Préstamos Hipotecarios | 92.033.082,15 | |
| Amortización Bonos de Titulización | | 4.172.901.831,00 |
| Amortización Préstamo Subordinado GI | | 442.000,00 |
| Amortización Préstamo Subordinado FR | | 240.000.000,00 |
| Importe de la venta de los Prestamos Hipotecarios | 4.122.220.196,67 | |
| <u>II. Intereses</u> | <u>61.893.023,29</u> | <u>72.272.623,41</u> |
| Intereses cobrados de los Préstamos Hipotecarios | 35.115.978,92 | |
| Intereses de la Cuenta de Tesorería | 1.200.403,03 | |
| Otros | 163.669,19 | |
| Contrato de Swap | 25.412.972,15 | 35.115.978,92 |
| Intereses pagados a los Bonos de Titulización | | 20.197.170,00 |
| Intereses de Préstamo Subordinado GI | | 22.254,49 |
| Intereses de Préstamo Subordinado FR | | 16.937.220,00 |
| <u>III. Reserva para hacer frente a los gastos finales de extinción y liquidación de orden tributario, administrativo ó publicitario</u> | <u>0,00</u> | <u>19.517,00</u> |
| <u>IV. Gastos periódicos</u> | <u>0,00</u> | <u>24.421.253,82</u> |
| Gestora | | 50.000,00 |
| Agente de Pagos | | 3.750,00 |
| Iberclear | | 1.239,00 |
| Calificación | | 17.110,00 |
| AIAF | | 106,20 |
| Auditoría | | 4.700,00 |
| Otros | | 304,24 |
| Comisión de Administración | | 1.564.838,24 |
| Comisión Variable | | 22.779.206,14 |
| TOTAL INGRESOS/ PAGOS | 4.276.146.302,11 | 4.510.057.225,23 |
| Saldo Inicial de la Cuenta de Tesorería a 26/07/2011 | 233.910.923,12 | |
| TOTAL | 4.510.057.225,23 | 4.510.057.225,23 |
| Retenciones practicadas el 24/10/2011 | 3.837.405,00 | |
| A Inversiones Temporales hasta el 21/11/2011 | | 3.837.405,00 |