

IM GBP EMPRESAS V, FTA

Información correspondiente al periodo: 22/10/2015 - 22/01/2016

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|----------------------------------|----------------------------|
| Fecha de Constitución del Fondo | 27/02/2013 |
| Fecha de Desembolso de los Bonos | 06/03/2013 |
| Agente Financiero | Banco Popular Español |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF de Renta Fija |

| | | |
|------------------------------------|---------|----------------|
| Calificación Actual (*) | Moody's | DBRS |
| Bonos A (Completamente Amortizado) | | |
| Bonos B | A3 (sf) | BB (high) (sf) |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Serie A (Completamente Amortizado) | | Serie B | |
|---|--------------------|---|------------------|
| Código ISIN | ES0347547004 | Código ISIN | ES0347547012 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 1.987.500.000,00 € | Nominal en circulación total (inicial) | 662.500.000,00 € |
| Nominal en circulación total (actual) | 0,00 € | Nominal en circulación total (actual) | 444.024.725,00 € |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € | Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 0,00 € | Nominal en circulación unitario (actual) | 67.022,60 € |

III. INFORMACIÓN INCLUIDA

Liquidación correspondiente al periodo: 22/10/2015 - 22/01/2016

Anuncio del Pago de los Bonos: 22/01/2016

Flujos de Caja del periodo: 22/10/2015 - 22/01/2016

(*) Calificación correspondiente a la fecha 14/01/2016. La calificación actualizada de los Bonos se puede consultar en nuestra página web www.imtitulizacion.com.

IM GBP EMPRESAS V, FTA
Liquidación del Periodo: 22/10/2015 - 22/01/2016
Fecha de Pago: 22/01/2016

| | | | | |
|---|----------------------|---------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------|
| Recursos Disponibles (I+II+III+IV): | 87.905.972,56 | | | |
| I. Situación Inicial: | 0,00 | | | |
| II. Fondos recibidos del cedente: | 87.905.972,56 | | | |
| a) Principal regular | 58.216.604,13 | | | |
| b) Recuperación de Fallidos | 2.206.810,03 | | | |
| c) Intereses ordinarios | 5.347.917,52 | | | |
| d) Intereses de demora | 358.069,84 | | | |
| e) Amortización Anticipada | 21.776.571,04 | | | |
| III. Otros: | 0,00 | | | |
| IV. Intereses de las Cuentas: | 0,00 | | | |
| 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: | 244.108,42 | 244.108,42 | 0,00 | 0,00 |
| (ii) Pago de intereses de la Serie A: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (iii) Amortización de los Bonos A: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (iv) Retención del importe suficiente para mantener el nivel del Fondo de Reserva requerido a la Fecha de Pago correspondiente: | 0,00 | 0,00 | - | 0,00 |
| (v) Pago de intereses de la Serie B: | 467.923,75 | 467.923,75 | 0,00 | 0,00 |
| (vi) Amortización de los Bonos B: | 83.648.442,50 | 83.648.442,50 | 0,00 | 0,00 |
| (vii) Pago de intereses del Préstamo Subordinado GI: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (viii) Pago de Intereses del Préstamo Subordinado FR: | 192.317,76 | 192.317,76 | 0,00 | 0,00 |
| (ix) Amortización del Préstamo Subordinado GI: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (x) Amortización del Préstamo Subordinado FR: | 3.353.180,13 | 3.353.180,13 | 0,00 | 0,00 |
| (xi) Pago de la Comisión Variable: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | 87.905.972,56 | 87.905.972,56 | 0,00 | 0,00 |

| Detalle del cálculo de la amortización de los Bonos | |
|--|----------------|
| Cantidad Disponible para Amortización (Mínimo entre 1 y 2 siguientes) | 83.648.417,64 |
| 1. Cantidad Teórica de Amortización (Diferencia entre A y B siguientes): | 83.648.417,64 |
| A) Saldo Nominal Pendiente de los Bonos en Fecha de Pago anterior. | 527.673.167,50 |
| B) Saldo nominal pendiente de los préstamos no fallidos | 444.024.749,86 |
| 2. Recursos Disponibles menos los conceptos (i) a (ii) del orden de prelación de pagos | 87.661.864,14 |
| Cantidad Aplicada | 83.648.442,50 |
| Resto por redondeo | -24,86 |
| Déficit de Principal | 0,00 |

Información sobre Impagados y Fallidos:

| | |
|---------------------------------|--------------|
| Impago de principal | |
| Trimestre anterior | 4.485.325,41 |
| Trimestre actual | 3.504.472,68 |
| Importe de Fallidos del Período | 3.655.221,02 |

Detalle del cálculo del Nivel del Fondo de Reserva:

| Conceptos | Importe |
|------------------------------------|----------------|
| Nivel Inicial del Fondo de Reserva | 265.000.000,00 |
| Nivel actual del Fondo de Reserva | 265.000.000,00 |
| Disposiciones | 0,00 |
| Dotaciones | 0,00 |

Otros Pasivos:

| Préstamos Subordinados | Saldo Inicial | Saldo Nominal Pendiente | Saldo vivo no vencido | Cupón |
|-------------------------|----------------|-------------------------|-----------------------|---------|
| Préstamo Subordinado GI | 640.000,00 | 0,00 | 0,00 | - |
| Préstamo Subordinado FR | 265.000.000,00 | 165.002.019,05 | 165.002.019,05 | 0,447 % |

IM GBP EMPRESAS V, FTA

Anuncio de Pago

Fecha de Pago: 22/01/2016

| | Serie B |
|----------------------------|-------------------------|
| Cod. ISIN | ES0347547012 |
| Periodo de Devengo | 22/10/2015 - 22/01/2016 |
| Tipo de Referencia Vigente | -0,053 % |
| Margen | 0,400 % |
| Cupón Vigente | 0,347 % |

| | TOTAL | POR BONO |
|---|----------------|------------|
| Saldo Inicial | 662.500.000,00 | 100.000,00 |
| Saldo Inicial Antes del Pago | 527.673.167,50 | 79.648,78 |
| Pago de Principal | 83.648.442,50 | 12.626,18 |
| Principal debido | 0,00 | 0,00 |
| Saldo Final después del Pago | 444.024.725,00 | 67.022,60 |
| % Pendiente de vencimiento actual | 67,02 % | 67,02 % |
| Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Devengado | 467.923,75 | 70,63 |
| Interés Bruto Pagado | 467.923,75 | 70,63 |
| Interés Bruto Debido | 0,00 | 0,00 |
| Retención (19%) | 88.907,50 | 13,42 |
| Interés Neto | 379.016,25 | 57,21 |

ES0347547004 (SERIE A) Amortizada el 22/07/2015

Nota: La retención se devolverá, en su caso, de acuerdo con la legislación vigente.

IM GBP EMPRESAS V, FTA

Flujos de Caja del Periodo: 22/10/2015 - 22/01/2016

| Concepto | Importe | |
|--|-----------------------|-----------------------|
| | Ingresos | Pagos |
| <u>I. Principal</u> | <u>82.199.985,20</u> | <u>87.001.622,63</u> |
| Amortización Derechos de Crédito | 82.199.985,20 | |
| Amortización Bonos de Titulización | | 83.648.442,50 |
| Amortización Préstamos Subordinados | | 3.353.180,13 |
| <u>II. Intereses</u> | <u>5.705.987,36</u> | <u>660.241,51</u> |
| Intereses cobrados Derechos de Crédito | 5.705.987,36 | |
| Intereses de las cuentas | 0,00 | |
| Otros | 0,00 | |
| Intereses pagados a los Bonos de Titulización | | 467.923,75 |
| Intereses de Préstamos Subordinados | | 192.317,76 |
| <u>III. Gastos</u> | <u>0,00</u> | <u>244.108,42</u> |
| TOTAL INGRESOS/PAGOS | 87.905.972,56 | 87.905.972,56 |
| Saldo Inicial 22/10/2015 | 265.000.000,00 | |
| Recursos depositados para la próxima Fecha de Pago | | |
| Fondo de Reserva | | 265.000.000,00 |
| TOTAL | 352.905.972,56 | 352.905.972,56 |
| Retenciones Practicadas el 22/01/2016 | 88.907,50 | |
| A Inversiones Temporales hasta el 22/02/2016 | | 88.907,50 |