

IM CAJASTUR MBS 1, FTA

Información correspondiente al periodo: 22/07/2019 - 20/08/2019

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | | |
|----------------------------------|---------------------------------------|--------|
| Fecha de Constitución del Fondo | 22/11/2010 | |
| Fecha de Desembolso de los Bonos | 26/11/2010 | |
| Agente Financiero | BNP Paribas Securities Services, S.E. | |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF de Renta Fija | |
| Calificación Actual (*) | Moody's | Fitch |
| Bonos A | Aa1 (sf) | A (sf) |
| Bonos B | Aa1 (sf) | A (sf) |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Serie A | | Serie B | |
|---|------------------|---|------------------|
| Código ISIN | ES0347458004 | Código ISIN | ES0347458012 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 492.000.000,00 € | Nominal en circulación total (inicial) | 123.000.000,00 € |
| Nominal en circulación total (actual) | 180.211.334,40 € | Nominal en circulación total (actual) | 120.140.889,60 € |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € | Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 36.628,32 € | Nominal en circulación unitario (actual) | 97.675,52 € |

III. INFORMACIÓN INCLUIDA

Liquidación correspondiente al periodo: 22/07/2019 - 20/08/2019

Anuncio del Pago de los Bonos: 20/08/2019

Flujos de Caja del periodo: 22/07/2019 - 20/08/2019

 (*) Calificación correspondiente a la fecha 05/08/2019. La calificación actualizada de los Bonos se puede consultar en nuestra página web www.imtitulizacion.com.

IM CAJASTUR MBS 1, FTA
Liquidación del Periodo: 22/07/2019 - 20/08/2019
Fecha de Pago: 20/08/2019

| Recursos Disponibles (I+II+III+IV+V): | 84.262.892,15 | | | |
|--|----------------------|---------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------|
| I. Situación Inicial: | 81.727.418,88 | | | |
| II. Fondos recibidos del cedente: | 2.535.473,27 | | | |
| a) Principal regular | 1.653.408,03 | | | |
| b) Recuperación de Fallidos | 74.673,92 | | | |
| c) Intereses ordinarios | 136.682,72 | | | |
| d) Intereses de demora | 446,72 | | | |
| e) Amortización Anticipada | 670.261,88 | | | |
| III. Otros: | 0,00 | | | |
| IV. Intereses de las Cuentas: | 0,00 | | | |
| V. Cobro de la Liquidación del Swap: | 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: | 11.223,55 | 11.223,55 | 0,00 | 0,00 |
| (ii) Pago, en su caso, de la cantidad a pagar del Contrato de Permuta Financiera, y solamente en caso de resolución del contrato por circunstancias imputables a la Parte A, la cantidad neta que corresponda al pago liquidativo: | 38.118,98 | 38.118,98 | 0,00 | 0,00 |
| (iii) Pago de intereses de los Bonos de la Serie A: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (iv) Pago de intereses de los Bonos de la Serie B, si no concurren las circunstancias que determinan su posposición al número (vi) de este Orden de Prelación de Pagos: | 19.606,20 | 19.606,20 | 0,00 | 0,00 |
| (v) Retención de la Cantidad Disponible para amortización : | | | | |
| Amortización de los Bonos de la Serie A | 1.405.152,00 | 1.405.152,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización de los Bonos de la Serie B | 936.768,00 | 936.768,00 | 0,00 | 0,00 |
| (vi) Pago de intereses de los Bonos de la Serie 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 |
| (vii) Dotación del Fondo de Reserva hasta que alcance su Nivel Mínimo: | 81.095.100,48 | 81.095.100,48 | - | 0,00 |
| (viii) 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 |
| (ix) Pago de intereses de la Línea de Crédito: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (x) Pago de intereses del Préstamo Subordinado GI (completamente amortizado): | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xi) Pago de intereses del Préstamo Subordinado FR: | 6.649,43 | 6.649,43 | 0,00 | 0,00 |
| (xii) Reembolso de los saldos dispuestos de la Línea de Crédito conforme lo establecido en el apartado 3.4.3.3 del Módulo Adicional: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xiii) Amortización del Préstamo Subordinado GI (completamente amortizado): | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xiv) Amortización del Préstamo Subordinado FR: | 632.318,40 | 632.318,40 | 0,00 | 0,00 |
| (xv) Pago en concepto de Comisión Variable: | 117.955,11 | 117.955,11 | 0,00 | 0,00 |
| Total | 84.262.892,15 | 84.262.892,15 | 0,00 | 0,00 |

Detalle del cálculo de la Cantidad Disponible de Principal

| | |
|--|----------------|
| Cantidad Disponible para Amortización (Mínimo entre 1 y 2 siguientes) | 2.341.926,82 |
| 1. Cantidad Teórica de Amortización (Diferencia entre A y B siguientes): | 2.341.926,82 |
| A) Saldo Nominal Pendiente de los Bonos en Fecha de Pago anterior. | 302.694.144,00 |
| B) Saldo nominal pendiente de los préstamos no fallidos | 300.352.217,18 |
| 2. Fondos Disponibles menos los conceptos (i) al (iv) | 84.193.943,42 |
| Cantidad Aplicada | 2.341.920,00 |
| Resto por redondeo | 6,82 |
| Déficit de Principal | 0,00 |

Información sobre Impagados y Fallidos:

| | |
|---------------------------------|-----------|
| Impago de principal | |
| Mes anterior | 74.373,66 |
| Mes actual | 91.096,60 |
| Importe de Fallidos del Periodo | 18.271,97 |

Detalle del cálculo del Nivel Mínimo Requerido del Fondo de Reserva:

| Información de Triggers: Reducción del Nivel Mínimo del Fondo de Reserva. | | Si Cumple Condición |
|---|--------|---------------------|
| Conceptos | % | Importe |
| 1. % Saldo Inicial de los Bonos | 13,500 | 83.025.000,00 |
| 2. % Saldo Actual de los Bonos | 27,000 | 81.095.100,48 |
| 3. Importe mínimo | | 41.512.500,00 |
| Nivel Mínimo Requerido=Max(3,Min(1,2)) (*) | | 81.095.100,48 |
| Dotación del Fondo de Reserva | | 81.095.100,48 |
| Deficit del Fondo de Reserva | | 0,00 |

(*) 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.

Fondo Exigido

| | |
|--|------|
| Importe del Fondo Exigido en la anterior Fecha de Pago | 0,00 |
| Importe del Fondo Exigido en esta Fecha de Pago | 0,00 |
| Dispuesto de la Línea de Crédito en el periodo | 0,00 |

Otros Pasivos:

| Préstamos Subordinados | Saldo Inicial | Saldo Nominal Pendiente | Saldo vivo no vencido | Cupón |
|-------------------------|---------------|-------------------------|-----------------------|---------|
| Préstamo Subordinado GI | 595.000,00 | 0,00 | 0,00 | - |
| Préstamo Subordinado FR | 83.025.000,00 | 81.095.100,48 | 81.095.100,48 | 0,101 % |

IM CAJASTUR MBS 1, FTA

Anuncio de Pago

Fecha de Pago: 20/08/2019

| | Serie A |
|----------------------------|-------------------------|
| Cod. ISIN | ES0347458004 |
| Periodo de Devengo | 22/07/2019 - 20/08/2019 |
| Tipo de Referencia Vigente | -0,399 % |
| Margen | 0,300 % |
| Cupón Vigente | 0,000 % |
| Tipo mínimo | 0,000 % |

| | TOTAL | POR BONO |
|---|----------------|------------|
| Saldo Inicial | 492.000.000,00 | 100.000,00 |
| Saldo Inicial Antes del Pago | 181.616.486,40 | 36.913,92 |
| Pago de Principal | 1.405.152,00 | 285,60 |
| Principal debido | 0,00 | 0,00 |
| Saldo Final después del Pago | 180.211.334,40 | 36.628,32 |
| % Pendiente de pago actual | 36,63 % | 36,63 % |
| Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Devengado | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Pagado | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Debido | 0,00 | 0,00 |

| | Serie B |
|----------------------------|-------------------------|
| Cod. ISIN | ES0347458012 |
| Periodo de Devengo | 22/07/2019 - 20/08/2019 |
| Tipo de Referencia Vigente | -0,399 % |
| Margen | 0,600 % |
| Cupón Vigente | 0,201 % |
| Tipo mínimo | 0,000 % |

| | TOTAL | POR BONO |
|---|----------------|------------|
| Saldo Inicial | 123.000.000,00 | 100.000,00 |
| Saldo Inicial Antes del Pago | 121.077.657,60 | 98.437,12 |
| Pago de Principal | 936.768,00 | 761,60 |
| Principal debido | 0,00 | 0,00 |
| Saldo Final después del Pago | 120.140.889,60 | 97.675,52 |
| % Pendiente de pago actual | 97,68 % | 97,68 % |
| Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Devengado | 19.606,20 | 15,94 |
| Interés Bruto Pagado | 19.606,20 | 15,94 |
| Interés Bruto Debido | 0,00 | 0,00 |

Nota: El interés bruto de los Bonos podrá estar o no sujeto a retención de acuerdo con la legislación vigente.

IM CAJASTUR MBS 1, FTA
Flujos de Caja del Periodo: 22/07/2019 - 20/08/2019

| Concepto | Importe | |
|--|----------------------|----------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| <u>I. Principal</u> | <u>2.398.343,83</u> | <u>2.974.238,40</u> |
| Amortización Préstamos Hipotecarios | 2.398.343,83 | |
| Amortización Bonos de Titulización | | 2.341.920,00 |
| Amortización Préstamos Subordinados | | 632.318,40 |
| Amortización Línea de Crédito | | 0,00 |
| <u>II. Intereses</u> | <u>181.020,09</u> | <u>108.265,26</u> |
| Intereses cobrados Préstamos Hipotecarios | 137.129,44 | |
| Intereses de las cuentas | 0,00 | |
| Otros | 0,00 | |
| Contrato de Swap | 43.890,65 | 82.009,63 |
| Intereses pagados a los Bonos de Titulización | | 19.606,20 |
| Intereses de Préstamos Subordinados | | 6.649,43 |
| Intereses de Línea de Crédito | | 0,00 |
| <u>III. Gastos</u> | <u>0,00</u> | <u>129.178,66</u> |
| TOTAL INGRESOS/PAGOS | 2.579.363,92 | 3.211.682,32 |
| Saldo Inicial 22/07/2019 | 81.727.418,88 | |
| Recursos depositados para la próxima Fecha de Pago | | |
| Fondo de Reserva | | 81.095.100,48 |
| Fondo Exigido a 22/07/2019 | 0,00 | |
| Fondo Exigido a 20/08/2019 | | 0,00 |
| TOTAL | 84.306.782,80 | 84.306.782,80 |
| Retenciones Practicadas el 20/08/2019 | 3.725,18 | |
| A Inversiones Temporales hasta el 20/09/2019 | | 3.725,18 |