

IM GBP FTPYME I, FTA
LIQUIDACIÓN ANTICIPADA
Información correspondiente al periodo: 21/12/2015 - 21/03/2016

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	29/11/2006
Fecha de Desembolso de los Bonos	05/12/2006
Agente Financiero	BNP Paribas Securities Services, S.E.
Negociación Mercado	Mercado AIAF de Renta Fija

Calificación Actual (*)	Moody's	S&P
Bonos A1 (Completamente Amortizado)		
Bonos A2 (Completamente Amortizado)		
Bonos A3 (Completamente Amortizado)		
Bonos A4 (Completamente Amortizado)		
Bonos A5(G)	Aa2 (sf)	AA+ (sf)
Bonos B	Aa2 (sf)	AA- (sf)
Bonos C	Aa2 (sf)	A+(sf)
Bonos D	Aa3 (sf)	BBB+ (sf)
Bonos E	C	D

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

Serie A1 (Completamente Amortizado)		Serie A2 (Completamente Amortizado)	
Código ISIN	ES0347844005	Código ISIN	ES0347844013
Nominal en circulación total (inicial)	230.000.000,00 €	Nominal en circulación total (inicial)	250.000.000,00 €
Nominal en circulación total (actual)	0,00 €	Nominal en circulación total (actual)	0,00 €
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)	0,00 €

Serie A3 (Completamente Amortizado)		Serie A4 (Completamente Amortizado)	
Código ISIN	ES0347844021	Código ISIN	ES0347844039
Nominal en circulación total (inicial)	1.096.600.000,00 €	Nominal en circulación total (inicial)	150.000.000,00 €
Nominal en circulación total (actual)	0,00 €	Nominal en circulación total (actual)	0,00 €
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)	0,00 €

Serie A5(G) (Completamente Amortizado)		Serie B (Completamente Amortizado)	
Código ISIN	ES0347844047	Código ISIN	ES0347844054
Nominal en circulación total (inicial)	155.400.000,00 €	Nominal en circulación total (inicial)	30.000.000,00 €
Nominal en circulación total (actual)	0,00 €	Nominal en circulación total (actual)	0,00 €
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)	0,00 €

Serie C (Completamente Amortizado)		Serie D (Completamente Amortizado)	
Código ISIN	ES0347844062	Código ISIN	ES0347844070
Nominal en circulación total (inicial)	28.000.000,00 €	Nominal en circulación total (inicial)	60.000.000,00 €
Nominal en circulación total (actual)	0,00 €	Nominal en circulación total (actual)	0,00 €
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)	0,00 €

Serie E (Completamente Amortizado)	
Código ISIN	ES0347844088
Nominal en circulación total (inicial)	30.000.000,00 €
Nominal en circulación total (actual)	0,00 €
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 €
Nominal en circulación unitario (actual)	0,00 €

III. INFORMACIÓN INCLUIDA

Liquidación correspondiente al periodo: 21/12/2015 - 21/03/2016

Anuncio del Pago de los Bonos: 21/03/2016

Flujos de Caja del periodo: 21/12/2015 - 21/03/2016

(*) Calificación correspondiente a la fecha 10/03/2016. La calificación actualizada de los Bonos se puede consultar en nuestra página web www.imtitulizacion.com.

**IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I, FTA
LIQUIDACIÓN ANTICIPADA**

Liquidación del Período: 21/12/2015 - 21/03/2016
Fecha de Pago: 21/03/2016

Concepto	Total
<u>RECURSOS DISPONIBLES</u>	
I. Situación Inicial:	47.844.076,47
Saldo inicial de las Cuentas	47.844.076,47
II. Fondos recibidos del emisor:	11.213.558,32
II.1 Principal cobrado de los Derechos de Crédito hasta 29/02/2016	10.128.383,52
Según calendario	6.464.134,69
Amortización Anticipada	3.113.149,47
Recuperación de Fallidos	551.099,36
II.2 Intereses cobrados de los Derechos de Crédito hasta 29/02/2016	1.085.174,80
III. Disposiciones de la Línea de Liquidez:	0,00
IV. Subtotal a Cuentas (I + II + III):	59.057.634,79
V. Intereses de las Cuentas (*):	-55.323,63
VI. Cobro de la Liquidación del Swap:	0,00
VII. Recursos disponibles (IV + V + VI):	59.002.311,17
VIII. Importe de la venta de los Derechos de Crédito (1):	215.121.000,04
IX. Recursos disponibles para la Liquidación Anticipada del Fondo (VII + VIII):	274.123.311,20
<u>PAGOS</u>	
(i) Reserva para hacer frente a los gastos finales de extinción y liquidación de orden tributario, administrativo o publicitario:	14.618,00
(ii) Gastos periódicos:	101.037,10
Gestora	5.943,80
Agente de Pagos	2.250,00
Administración	68.510,53
Iberclear	2.178,00
Auditoría	8.027,97
Otros	2.313,17
AIAF	217,80
Calificación	11.595,83
(iii) Pago de intereses de la Línea de Liquidez:	0,00
(iv) Reembolso importes dispuestos Línea de Liquidez:	155.923,79
Devolucion Importe Máximo Disponible de la Línea de Liquidez depositado en la Cuenta Tesorería	4.844.076,21
(v) 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:	172.625,87
(vi) Pago de intereses de las Series A1, A2, A3, A4, A5(G) y reembolso al Estado de los importes que hubiere satisfecho al Fondo por la disposición del Aval para el pago de intereses de los Bonos de la Serie A5(G) avalada :	0,00
Serie A1	Amortizado
Serie A2	Amortizado
Serie A3	Amortizado
Serie A4	Amortizado
Serie A5 (G)	
Intereses debidos en la Fecha de Pago anterior	0,00
Intereses devengados en esta Fecha de Pago	0,00
Interés pagado	0,00
Interés debido	0,00
Retenciones practicadas a los bonos (2)	0,00
Reembolso al Estado de los importes que hubiere satisfecho al Fondo por la disposición del Aval para el pago de intereses de los Bonos de la Serie A5(G) avalada	0,00

(vii) Distribución de las cantidades necesarias para la amortización de los Bonos de las Series A1, A2, A3, A4 y A5(G) y reembolso al Estado de las cantidades debidas por las disposiciones del Aval para la amortización de los Bonos de la Serie A5(G):	62.060.885,88
Amortización de los Bonos A1	Amortizado
Amortización de los Bonos A2	Amortizado
Amortización de los Bonos A3	Amortizado
Amortización de los Bonos A4	Amortizado
Amortización de los Bonos A5(G)	62.060.885,88
(viii) Pago de intereses de la Serie B:	4.323,00
Intereses debidos en la Fecha de Pago anterior	0,00
Intereses devengados en esta Fecha de Pago	4.323,00
Interés pagado	4.323,00
Interés debido	0,00
Retenciones practicadas a los bonos (2)	-822,00
(ix) Amortización de los Bonos de la Serie B:	30.000.000,00
(x) Pago de intereses de la Serie C:	11.818,80
Intereses debidos en la Fecha de Pago anterior	0,00
Intereses devengados en esta Fecha de Pago	11.818,80
Interés pagado	11.818,80
Interés debido	0,00
Retenciones practicadas a los bonos (2)	-2.245,60
(xi) Amortización de los Bonos de la Serie C:	28.000.000,00
(xii) Pago de intereses de la Serie D:	63.246,00
Intereses debidos en la Fecha de Pago anterior	0,00
Intereses devengados en esta Fecha de Pago	63.246,00
Interés pagado	63.246,00
Interés debido	0,00
Retenciones practicadas a los bonos (2)	-12.018,00
(xiii) Amortización de los Bonos de la Serie D:	60.000.000,00
(xiv) Pago de intereses de la Serie E:	163.581,00
Intereses debidos en la Fecha de Pago anterior	0,00
Intereses devengados en esta Fecha de Pago	163.581,00
Interés pagado	163.581,00
Interés debido	0,00
Retenciones practicadas a los bonos (2)	-31.080,00
(xv) Amortización Bonos de la Serie E:	17.179.014,00
(xvi) Pago de la cantidad a pagar por resolución de la Permuta Financiera de Intereses excepto en los supuestos contemplados en el lugar (v) anterior:	0,00
(xvii) Pago de intereses del Préstamo Subordinado Gastos Iniciales :	200.349,88
Intereses debidos en la Fecha de Pago anterior	199.855,60
Intereses devengados en esta Fecha de Pago	494,28
Interés pagado	200.349,88
Interés debido	0,00
(xviii) Amortización del Préstamo Subordinado Gastos Iniciales :	1.170.893,00
Amortización debida en la anterior Fecha de Pago	995.259,05
Amortización correspondiente a esta Fecha de Pago	175.633,95
Amortización pagada	1.170.893,00
Amortización debida	0,00
(xix) Pago de la Comisión Variable (3):	69.980.918,67

(1) Importe de la venta de los Derechos de Crédito:	215.121.000,04
Saldo Vivo de los Derechos de Créditos No Fallidos:	168.962.544,85
Saldo Vivo de los Derechos de Crédito Fallidos:	46.158.455,19

(2) Reinvertido hasta el 20/04/2016

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

Información sobre la Línea de Liquidez:

Importe Máximo Disponible de la Línea de Liquidez depositado en la Cuenta Tesorería	5.000.000,00
Disposiciones de la Línea de Liquidez	0,00
Reembolso de los importes dispuestos de la Línea de Liquidez	155.923,79
 (*) Intereses generados por la Línea de Liquidez depositada en la Cuenta Tesorería a favor de BANCO POPULAR que no se consideran Recursos Disponibles:	 0,00

Información sobre Impagados y Fallidos

Impago de principal	
Trimestre anterior	626.219,58
Trimestre actual	630.513,06
Importe de Fallidos del Período	2.147.272,50

IMT/IM GBP FTPYME I/PAGO/ Liquidacion Anticipada

Destinatarios: Emisor; CNMV.

IM GBP FTPYME I, FTA

ANUNCIO DE PAGO - LIQUIDACIÓN ANTICIPADA DEL FONDO

Fecha de Pago: 21/03/2016

	Serie A5(G)	Serie B
Cod. ISIN	ES0347844047	ES0347844054
Periodo de Devengo	21/12/2015 - 21/03/2016	21/12/2015 - 21/03/2016
Tipo de Referencia Vigente	-0,133%	-0,133%
Margen	0,010%	0,190%
Cupón Vigente	0,000%	0,057%

	TOTAL	POR BONO	TOTAL	POR BONO
Saldo Inicial	155.400.000,00	100.000,00	30.000.000,00	100.000,00
Saldo Inicial Antes del Pago	62.060.885,88	39.936,22	30.000.000,00	100.000,00
Pago de Principal	62.060.885,88	39.936,22	30.000.000,00	100.000,00
Principal debido	0,00	0,00	0,00	0,00
Saldo Final después del Pago	0,00	0,00	0,00	0,00
% Pendiente de vencimiento actual	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
Interés Bruto Devengado	0,00	0,00	4.323,00	14,41
Interés Bruto Pagado	0,00	0,00	4.323,00	14,41
Interés Bruto Debido	0,00	0,00	0,00	0,00
Retención (19%)	0,00	0,00	822,00	2,74
Interés Neto	0,00	0,00	3.501,00	11,67

	Serie C	Serie D
Cod. ISIN	ES0347844062	ES0347844070
Periodo de Devengo	21/12/2015 - 21/03/2016	21/12/2015 - 21/03/2016
Tipo de Referencia Vigente	-0,133%	-0,133%
Margen	0,300%	0,550%
Cupón Vigente	0,167%	0,417%

	TOTAL	POR BONO	TOTAL	POR BONO
Saldo Inicial	28.000.000,00	100.000,00	60.000.000,00	100.000,00
Saldo Inicial Antes del Pago	28.000.000,00	100.000,00	60.000.000,00	100.000,00
Pago de Principal	28.000.000,00	100.000,00	60.000.000,00	100.000,00
Principal debido	0,00	0,00	0,00	0,00
Saldo Final después del Pago	0,00	0,00	0,00	0,00
% Pendiente de vencimiento actual	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
Interés Bruto Devengado	11.818,80	42,21	63.246,00	105,41
Interés Bruto Pagado	11.818,80	42,21	63.246,00	105,41
Interés Bruto Debido	0,00	0,00	0,00	0,00
Retención (19%)	2.245,60	8,02	12.018,00	20,03
Interés Neto	9.573,20	34,19	51.228,00	85,38

	Serie E
Cod. ISIN	ES0347844088
Periodo de Devengo	21/12/2015 - 21/03/2016
Tipo de Referencia Vigente	-0,133%
Margen	3,900%
Cupón Vigente	3,767%

	TOTAL	POR BONO
Saldo Inicial	30.000.000,00	100.000,00
Saldo Inicial Antes del Pago	17.179.014,00	57.263,38
Pago de Principal	17.179.014,00	57.263,38
Principal debido	0,00	0,00
Saldo Final después del Pago	0,00	0,00
% Pendiente de vencimiento actual	0,00%	0,00%
Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago	0,00	0,00
Interés Bruto Devengado	163.581,00	545,27
Interés Bruto Pagado	163.581,00	545,27
Interés Bruto Debido	0,00	0,00
Retención (19%)	31.080,00	103,60
Interés Neto	132.501,00	441,67

ES0347844005 (SERIE A1) Amortizada el 21/06/2007

ES0347844013 (SERIE A2) Amortizada el 25/03/2008

ES0347844021 (SERIE A3) Amortizada el 21/09/2012

ES0347844039 (SERIE A4) Amortizada el 22/09/2014

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

IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I, FTA

LIQUIDACIÓN ANTICIPADA
Flujos de Caja del Período: 21/12/2015 - 21/03/2016

Concepto

	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
I. Principal	<u>225.249.383,56</u>	<u>198.410.792,88</u>
Amortización Derechos de Crédito	10.128.383,52	
Amortización Bonos de Titulización		197.239.899,88
Amortización Préstamo Subordinado para Gastos Iniciales		1.170.893,00
Importe de la venta de los Derechos de Crédito	215.121.000,04	
II. Intereses	<u>943.668,51</u>	<u>5.529.761,88</u>
Intereses cobrados de los Derechos de Crédito	1.085.174,80	
Intereses de las Cuentas (*)	-55.323,63	
Contrato de Swap	-86.182,67	86.443,20
Intereses pagados a los Bonos de Titulización		242.968,80
Intereses Préstamo Subordinado para Gastos Iniciales		200.349,88
Disposiciones Línea de Liquidez	0,00	
Reembolso importes dispuestos Línea de Liquidez depositado en la Cuenta Tesorería		155.923,79
Intereses Línea de Liquidez		4.844.076,21
		0,00
de orden tributario, administrativo ó publicitario	<u>0,00</u>	<u>14.618,00</u>
IV. Gastos Periodicos	<u>0,00</u>	<u>70.081.955,77</u>
Gestora		5.943,80
Agente de Pagos		2.250,00
Administración		68.510,53
Iberclear		2.178,00
Auditoría		8.027,97
AIAF		217,80
Otros		2.313,17
Calificación		11.595,83
Gastos extraordinarios		0,00
Ingresos extraordinarios		0,00
Comisión Variable		69.980.918,67
TOTAL INGRESOS/ PAGOS	<u>226.193.052,06</u>	<u>274.037.128,53</u>
Saldo Inicial 21/12/2015	47.844.076,47	
TOTAL	<u>274.037.128,53</u>	<u>274.037.128,53</u>
Retenciones Practicadas el 21/03/2016	46.165,60	
A Inversiones Temporales hasta el 20/04/2016		46.165,60

IMT/IM GBP FTPYME I/Flujos Trim/ Liquidación Anticipada

Destinatarios: CNMV.