

IM PASTOR 2, FTH

Información correspondiente al periodo: 24/06/2024 - 23/09/2024

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	23/06/2004
Fecha de Desembolso de los Bonos	29/06/2004
Agente Financiero	BNP PARIBAS, S.A., SUCURSAL EN ESPAÑA
Negociación Mercado	Mercado AIAF de Renta Fija

Calificación Actual (*)	Moody's	S&P
Bonos A (Completamente Amortizado)		
Bonos B	Aa1 (sf)	AAA (sf)
Bonos C	Aa1 (sf)	AA (sf)
Bonos D	A1 (sf)	AA (sf)

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

Serie A (Completamente Amortizado)		Serie B	
Código ISIN	ES0347861009	Código ISIN	ES0347861017
Nominal en circulación total (inicial)	962.000.000,00 €	Nominal en circulación total (inicial)	17.300.000,00 €
Nominal en circulación total (actual)	0,00 €	Nominal en circulación total (actual)	4.801.476,60 €
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)	27.754,20 €

Serie C		Serie D	
Código ISIN	ES0347861025	Código ISIN	ES0347861033
Nominal en circulación total (inicial)	14.200.000,00 €	Nominal en circulación total (inicial)	6.500.000,00 €
Nominal en circulación total (actual)	14.200.000,00 €	Nominal en circulación total (actual)	6.500.000,00 €
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 €	Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 €
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 €	Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 €

III. INFORMACIÓN INCLUIDA

Liquidación correspondiente al periodo: 24/06/2024 - 23/09/2024

Anuncio del Pago de los Bonos: 23/09/2024

Flujos de Caja del periodo: 24/06/2024 - 23/09/2024

(*) Calificación correspondiente a la fecha 04/09/2024. La calificación actualizada de los Bonos se puede consultar en nuestra página web www.imtitulizacion.com.

IM PASTOR 2, FTH
Liquidación del Período: 24/06/2024 - 23/09/2024
Fecha de Pago: 23/09/2024

Recursos Disponibles (I+II+III+IV+V+VI-II.f):	7.169.781,36
I. Situación Inicial:	5.205.163,28
II. Fondos recibidos del cedente:	1.893.198,33
a) Principal regular	1.374.752,70
b) Recuperación de Fallidos	5.171,84
c) Intereses ordinarios	297.737,78
d) Intereses de demora	0,00
e) Amortización Anticipada hasta el 31/07/2024	154.747,71
f) Amortización Anticipada del último mes	60.788,30
III. Otros:	0,00
IV. Intereses de las Cuentas:	52.264,23
V. Cobro de la Liquidación del Swap:	49.932,93
VI. Ingresos derivados de la venta y explotación de inmuebles:	30.010,89

Aplicación de Fondos (Ref. Capítulo V.4.2.)	Aplicado	Devengado en esta Fecha de Pago	Debido en la Fecha de Pago anterior	Debido tras esta Fecha de Pago
(i) Gastos periódicos (*)	27.003,34	27.003,34	0,00	0,00
(ii) Comisión de la Sociedad Gestora:	1.856,34	1.856,34	0,00	0,00
(iii) Pago de la Cantidad Neta a pagar del Contrato de Swap, y solamente en caso de resolución del contrato por circunstancias imputables al Fondo, la cantidad que corresponda al pago liquidativo:	0,00	0,00	0,00	0,00
(iv) Pago de intereses de los Bonos A:	0,00	0,00	0,00	0,00
(v) Pago de intereses de los Bonos B si no concurren las circunstancias que determinan su posposición al número (ix) del Orden de Prelación de Pagos:	67.662,03	67.662,03	0,00	0,00
(vi) Pago de intereses de los Bonos C si no concurren las circunstancias que determinan su posposición al número (xi) del Orden de Prelación de Pagos:	163.319,88	163.319,88	0,00	0,00
(vii) Pago de intereses de los Bonos D si no concurren las circunstancias que determinan su posposición al número (xiii) del Orden de Prelación de Pagos:	106.798,90	106.798,90	0,00	0,00
(viii) Amortización de los Bonos A:	0,00	0,00	0,00	0,00
(ix) Pago de intereses de los Bonos 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
(x) Amortización de los Bonos B:	1.727.218,16	1.727.218,16	0,00	0,00
(xi) Pago de intereses de los Bonos C 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
(xii) Amortización de los Bonos C:	0,00	0,00	0,00	0,00
(xiii) Pago de intereses de los Bonos D 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
(xiv) Amortización de los Bonos D:	0,00	0,00	0,00	0,00
(xv) Dotación del Fondo de Reserva hasta que alcance su Nivel Mínimo:	5.000.000,00	5.000.000,00	-	0,00
(xvi) Pago de intereses del Préstamo Subordinado para Intereses del Primer Periodo (completamente amortizado):	0,00	0,00	0,00	0,00
(xvii) Pago de intereses del Préstamo Subordinado para Gastos Iniciales (completamente amortizado):	0,00	0,00	0,00	0,00
(xviii) Remuneración fija del Préstamo Participativo:	56.920,81	51.187,50	5.733,31	0,00
(xix) Amortización del Préstamo Subordinado para Intereses del Primer Periodo (completamente amortizado):	0,00	0,00	0,00	0,00
(xx) Amortización del Préstamo Subordinado para Gastos Iniciales (completamente amortizado):	0,00	0,00	0,00	0,00
(xxi) Remuneración variable del Préstamo Participativo:	19.002,00	19.002,00	0,00	0,00
(xxii) Amortización del Préstamo Participativo:	0,00	0,00	0,00	0,00
Total	7.169.781,46	7.164.048,15	5.733,31	0,00

(*) Incluye gastos repercutidos por la Sociedad Gestora al Fondo por la gestión no ordinaria de préstamos en ejecución e inmuebles adjudicados.

IM PASTOR 2, FTH

Liquidación del Período: 24/06/2024 - 23/09/2024

Fecha de Pago: 23/09/2024

Detalle del cálculo de la Cantidad Disponible de Principal

Cantidad Disponible para Amortización (Mínimo entre 1 y 2 siguientes)	1.727.218,06
1. Cantidad Teórica de Amortización (Diferencia entre A y B siguientes):	1.727.218,06
A) Saldo Nominal Pendiente de los Bonos en Fecha de Pago anterior.	27.228.694,76
B) Saldo no vencido de los préstamos no fallidos más Amortización anticipada del último mes	25.501.476,70
2. Recursos Disponibles menos los conceptos (i) a (vii) del orden de prelación de pagos	6.803.140,87
Cantidad Aplicada	1.727.218,16
Resto por redondeo	-0,10
Déficit de Principal	0,00

Información sobre Impagados y Fallidos:

Impago de principal	
Trimestre anterior	13.526,26
Trimestre actual	6.080,63
Importe de Fallidos del Periodo	0,00

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	0,900	9.000.000,00
2. % Saldo Actual de los Bonos	1,800	459.026,58
3. Importe mínimo		5.000.000,00
Nivel Mínimo Requerido=Max(3,Min(1,2)) (*)		5.000.000,00
Dotación del Fondo de Reserva		5.000.000,00
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.

Otros Pasivos:

Préstamos Subordinados	Saldo Inicial	Saldo Nominal Pendiente	Saldo vivo no vencido	Cupón
Préstamo Subordinado para Intereses del Primer Período	900.000,00	0,00	0,00	-
Préstamo Subordinado para Gastos Iniciales	895.103,93	0,00	0,00	-
Préstamo Participativo	9.000.000,00	5.000.000,00	5.000.000,00	4,050 %

IM PASTOR 2, FTH
Anuncio de Pago
Fecha de Pago: 23/09/2024

	Serie B	Serie C
Cod. ISIN	ES0347861017	ES0347861025
Periodo de Devengo	24/06/2024 - 23/09/2024	24/06/2024 - 23/09/2024
Tipo de Referencia Vigente	3,700 %	3,700 %
Margen	0,400 %	0,850 %
Cupón Vigente	4,100 %	4,550 %
Tipo mínimo	-	-

	TOTAL	POR BONO	TOTAL	POR BONO
Saldo Inicial	17.300.000,00	100.000,00	14.200.000,00	100.000,00
Saldo Inicial Antes del Pago	6.528.694,76	37.738,12	14.200.000,00	100.000,00
Pago de Principal	1.727.218,16	9.983,92	0,00	0,00
Principal debido	0,00	0,00	0,00	0,00
Saldo Final después del Pago	4.801.476,60	27.754,20	14.200.000,00	100.000,00
% Pendiente de pago actual	27,75 %	27,75 %	100,00 %	100,00 %
Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago	0,00	0,00	0,00	0,00
Interés Bruto Devengado	67.662,03	391,11	163.319,88	1.150,14
Interés Bruto Pagado	67.662,03	391,11	163.319,88	1.150,14
Interés Bruto Debido	0,00	0,00	0,00	0,00

	Serie D
Cod. ISIN	ES0347861033
Periodo de Devengo	24/06/2024 - 23/09/2024
Tipo de Referencia Vigente	3,700 %
Margen	2,800 %
Cupón Vigente	6,500 %
Tipo mínimo	-

	TOTAL	POR BONO
Saldo Inicial	6.500.000,00	100.000,00
Saldo Inicial Antes del Pago	6.500.000,00	100.000,00
Pago de Principal	0,00	0,00
Principal debido	0,00	0,00
Saldo Final después del Pago	6.500.000,00	100.000,00
% Pendiente de pago actual	100,00 %	100,00 %
Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago	0,00	0,00
Interés Bruto Devengado	106.798,90	1.643,06
Interés Bruto Pagado	106.798,90	1.643,06
Interés Bruto Debido	0,00	0,00

ES0347861009 (SERIE A) Amortizada el 22/06/2023

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

IM PASTOR 2, FTH
Flujos de Caja del Periodo: 24/06/2024 - 23/09/2024

Concepto	Importe	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
<u>I. Principal</u>	<u>1.595.460,55</u>	<u>1.727.218,16</u>
Amortización Participaciones hipotecarias	1.595.460,55	
Amortización Bonos de Titulización		1.727.218,16
Amortización Préstamos Subordinados		0,00
<u>II. Intereses</u>	<u>697.672,72</u>	<u>692.439,40</u>
Intereses cobrados Participaciones hipotecarias	297.737,78	
Intereses de las cuentas	52.264,23	
Contrato de Swap	347.670,71	297.737,78
Intereses pagados a los Bonos de Titulización		337.780,81
Intereses de Préstamos Subordinados		56.920,81
<u>III. Venta y explotación de inmuebles</u>	<u>30.010,89</u>	<u>0,00</u>
<u>IV. Gastos</u>	<u>0,00</u>	<u>47.861,68</u>
TOTAL INGRESOS/PAGOS	2.323.144,16	2.467.519,24
Saldo Inicial 24/06/2024	5.205.163,28	
Recursos depositados para la próxima Fecha de Pago		
Fondo de Reserva		5.000.000,00
Depósito de Principal		60.788,20
TOTAL	7.528.307,44	7.528.307,44
Retenciones Practicadas el 23/09/2024	64.178,35	
A Inversiones Temporales hasta el 21/10/2024		64.178,35