

IM PASTOR 2, FTH

Información correspondiente al periodo: 22/06/2023 - 22/09/2023

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) | 12.893.741,90 € |
| 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) | 74.530,30 € |

| 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: 22/06/2023 - 22/09/2023

Anuncio del Pago de los Bonos: 22/09/2023

Flujos de Caja del periodo: 22/06/2023 - 22/09/2023

(*) Calificación correspondiente a la fecha 07/09/2023. La calificación actualizada de los Bonos se puede consultar en nuestra página web www.imtitulizacion.com.

IM PASTOR 2, FTH
Liquidación del Periodo: 22/06/2023 - 22/09/2023
Fecha de Pago: 22/09/2023

| Recursos Disponibles (I+II+III+IV+V+VI-II.f): | | 8.131.349,30 | | |
|--|---------------------|---------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------|
| I. Situación Inicial: | | 5.490.111,15 | | |
| II. Fondos recibidos del cedente: | | 2.536.978,07 | | |
| a) Principal regular | | 1.625.873,80 | | |
| b) Recuperación de Fallidos | | 54.378,49 | | |
| c) Intereses ordinarios | | 273.837,80 | | |
| d) Intereses de demora | | 0,00 | | |
| e) Amortización Anticipada hasta el 31/07/2023 | | 477.526,83 | | |
| f) Amortización Anticipada del último mes | | 105.361,15 | | |
| III. Otros: | | 0,00 | | |
| IV. Intereses de las Cuentas: | | 61.798,66 | | |
| V. Cobro de la Liquidación del Swap: | | 147.807,68 | | |
| VI. Ingresos derivados de la venta y explotación de inmuebles: | | 14,89 | | |
| 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 (*) | 23.851,41 | 23.851,41 | 0,00 | 0,00 |
| (ii) Comisión de la Sociedad Gestora: | 2.294,40 | 2.294,40 | 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: | 157.815,79 | 157.815,79 | 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: | 161.013,80 | 161.013,80 | 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: | 106.094,95 | 106.094,95 | 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: | 2.595.124,56 | 2.595.124,56 | 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: | 50.306,11 | 50.306,11 | 0,00 | 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: | 34.847,43 | 34.847,43 | 0,00 | 0,00 |
| (xxii) Amortización del Préstamo Participativo: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | 8.131.348,45 | 8.131.348,45 | 0,00 | 0,00 |

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

Detalle del cálculo de la Cantidad Disponible de Principal

| | |
|---|---------------|
| Cantidad Disponible para Amortización (Mínimo entre 1 y 2 siguientes) | 2.595.125,41 |
| 1. Cantidad Teórica de Amortización (Diferencia entre A y B siguientes): | 2.595.125,41 |
| A) Saldo Nominal Pendiente de los Bonos en Fecha de Pago anterior. | 36.188.866,46 |
| B) Saldo no vencido de los préstamos no fallidos más Amortización anticipada del último mes | 33.593.741,05 |
| 2. Recursos Disponibles menos los conceptos (i) a (vii) del orden de prelación de pagos | 7.680.278,95 |
| Cantidad Aplicada | 2.595.124,56 |
| Resto por redondeo | 0,85 |
| Déficit de Principal | 0,00 |

Información sobre Impagados y Fallidos:

| | |
|---------------------------------|-----------|
| Impago de principal | |
| Trimestre anterior | 14.777,98 |
| Trimestre actual | 16.391,61 |
| 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 | 604.687,35 |
| 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 | 3,937 % |

IM PASTOR 2, FTH
Anuncio de Pago
Fecha de Pago: 22/09/2023

| | Serie B | Serie C |
|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| Cod. ISIN | ES0347861017 | ES0347861025 |
| Periodo de Devengo | 22/06/2023 - 22/09/2023 | 22/06/2023 - 22/09/2023 |
| Tipo de Referencia Vigente | 3,587 % | 3,587 % |
| Margen | 0,400 % | 0,850 % |
| Cupón Vigente | 3,987 % | 4,437 % |
| 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 | 15.488.866,46 | 89.531,02 | 14.200.000,00 | 100.000,00 |
| Pago de Principal | 2.595.124,56 | 15.000,72 | 0,00 | 0,00 |
| Principal debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Saldo Final después del Pago | 12.893.741,90 | 74.530,30 | 14.200.000,00 | 100.000,00 |
| % Pendiente de pago actual | 74,53 % | 74,53 % | 100,00 % | 100,00 % |
| Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Devengado | 157.815,79 | 912,23 | 161.013,80 | 1.133,90 |
| Interés Bruto Pagado | 157.815,79 | 912,23 | 161.013,80 | 1.133,90 |
| Interés Bruto Debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| | Serie D |
|----------------------------|-------------------------|
| Cod. ISIN | ES0347861033 |
| Periodo de Devengo | 22/06/2023 - 22/09/2023 |
| Tipo de Referencia Vigente | 3,587 % |
| Margen | 2,800 % |
| Cupón Vigente | 6,387 % |
| 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 | 106.094,95 | 1.632,23 |
| Interés Bruto Pagado | 106.094,95 | 1.632,23 |
| 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: 22/06/2023 - 22/09/2023

| Concepto | Importe | |
|--|---------------------|---------------------|
| | Ingresos | Pagos |
| <u>I. Principal</u> | <u>2.263.140,27</u> | <u>2.595.124,56</u> |
| Amortización Participaciones hipotecarias | 2.263.140,27 | |
| Amortización Bonos de Titulización | | 2.595.124,56 |
| Amortización Préstamos Subordinados | | 0,00 |
| <u>II. Intereses</u> | <u>757.281,94</u> | <u>749.068,45</u> |
| Intereses cobrados Participaciones hipotecarias | 273.837,80 | |
| Intereses de las cuentas | 61.798,66 | |
| Contrato de Swap | 421.645,48 | 273.837,80 |
| Intereses pagados a los Bonos de Titulización | | 424.924,54 |
| Intereses de Préstamos Subordinados | | 50.306,11 |
| <u>III. Venta y explotación de inmuebles</u> | <u>14,89</u> | <u>0,00</u> |
| <u>IV. Gastos</u> | <u>0,00</u> | <u>60.993,24</u> |
| TOTAL INGRESOS/PAGOS | 3.020.437,10 | 3.405.186,25 |
| Saldo Inicial 22/06/2023 | 5.490.111,15 | |
| Recursos depositados para la próxima Fecha de Pago | | |
| Fondo de Reserva | | 5.000.000,00 |
| Depósito de Principal | | 105.362,00 |
| TOTAL | 8.510.548,25 | 8.510.548,25 |
| Retenciones Practicadas el 22/09/2023 | 80.735,66 | |
| A Inversiones Temporales hasta el 20/10/2023 | | 80.735,66 |