

IM CAJAMAR 3, FTA

Información correspondiente al periodo: 22/09/2017 - 22/12/2017

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|----------------------------------|---------------------------------------|
| Fecha de Constitución del Fondo | 08/03/2006 |
| Fecha de Desembolso de los Bonos | 14/03/2006 |
| Agente Financiero | BNP Paribas Securities Services, S.E. |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF de Renta Fija |

| Calificación Actual (*) | Moody's | Fitch |
|------------------------------------|-----------|-----------|
| Bonos A | A1 (sf) | AA + (sf) |
| Bonos B | Ba1 (sf) | A+ |
| Bonos C | B2 (sf) | A- |
| Bonos D | Caa1 (sf) | BBB- |
| Bonos E (Completamente Amortizado) | | |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| | | | |
|---|--------------------|---|-----------------|
| Serie A | | Serie B | |
| Código ISIN | ES0347783005 | Código ISIN | ES0347783013 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 1.155.000.000,00 € | Nominal en circulación total (inicial) | 28.800.000,00 € |
| Nominal en circulación total (actual) | 294.349.786,50 € | Nominal en circulación total (actual) | 15.274.370,88 € |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € | Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 25.484,83 € | Nominal en circulación unitario (actual) | 53.036,01 € |
| Serie C | | Serie D | |
| Código ISIN | ES0347783021 | Código ISIN | ES0347783039 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 6.000.000,00 € | Nominal en circulación total (inicial) | 10.200.000,00 € |
| Nominal en circulación total (actual) | 3.182.160,60 € | Nominal en circulación total (actual) | 5.409.673,02 € |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € | Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 53.036,01 € | Nominal en circulación unitario (actual) | 53.036,01 € |
| Serie E (Completamente Amortizado) | | | |
| Código ISIN | ES0347783047 | | |
| Nominal en circulación total (inicial) | 15.600.000,00 € | | |
| 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: 22/09/2017 - 22/12/2017

Anuncio del Pago de los Bonos: 22/12/2017

Flujos de Caja del periodo: 22/09/2017 - 22/12/2017

(*) Calificación correspondiente a la fecha 13/12/2017. La calificación actualizada de los Bonos se puede consultar en nuestra página web www.imtitulizacion.com.

IM CAJAMAR 3, FTA
Liquidación del Periodo: 22/09/2017 - 22/12/2017
Fecha de Pago: 22/12/2017

| Recursos Disponibles (I+II+III+IV+V): | | | | |
|--|----------------------|---------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------|
| I. Situación Inicial: | | 20.299.324,41 | | |
| II. Fondos recibidos del cedente: | | 9.507.782,25 | | |
| a) Principal regular | | 10.809.794,18 | | |
| b) Recuperación de Fallidos | | 6.533.015,53 | | |
| c) Intereses ordinarios | | 717.161,27 | | |
| d) Intereses de demora | | 641.052,54 | | |
| e) Amortización Anticipada | | 0,00 | | |
| III. Otros: | | 2.918.564,84 | | |
| IV. Intereses de las Cuentas: | | 0,00 | | |
| V. Cobro de la Liquidación del Swap: | | -18.252,02 | | |
| | | 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: | 24.559,05 | 24.559,05 | 0,00 | 0,00 |
| (ii) 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: | 231.965,40 | 231.965,40 | 0,00 | 0,00 |
| (iii) Pago de intereses de la Serie A: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (iv) Pago de intereses de la Serie B si no concurren las circunstancias que determinan su posesión al número (ix) del Orden de Prelación de Pagos: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (v) Pago de intereses de la Serie C si no concurren las circunstancias que determinan su posesión al número (x) del Orden de Prelación de Pagos: | 1.251,60 | 1.251,60 | 0,00 | 0,00 |
| (vi) Pago de intereses de la Serie D si no concurren las circunstancias que determinan su posesión al número (xi) del Orden de Prelación de Pagos: | 23.542,62 | 23.542,62 | 0,00 | 0,00 |
| (vii) Pago de intereses de la Serie E si no concurren las circunstancias que determinan su posesión al número (xii) del Orden de Prelación de Pagos (Completamente amortizado): | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (viii) Retención de la Cantidad Disponible para amortización : | | | | |
| Amortización de los Bonos de la Serie A | 8.915.676,00 | 8.915.676,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización de los Bonos de la Serie B | 462.651,84 | 462.651,84 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización de los Bonos de la Serie C | 96.385,80 | 96.385,80 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización de los Bonos de la Serie D | 163.855,86 | 163.855,86 | 0,00 | 0,00 |
| (ix) Pago de intereses de los Bonos de la Serie B, si concurren las circunstancias que determinan su posesión a este número del Orden de Prelación de Pagos de acuerdo con lo establecido en el apartado 3.4.6.4 del Módulo Adicional: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (x) Pago de intereses de los Bonos de la Serie D, si concurren las circunstancias que determinan su posesión a este número del Orden de Prelación de Pagos de acuerdo con lo establecido en el apartado 3.4.6.4 del Módulo Adicional: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xi) Pago de intereses de los Bonos de la Serie C, si concurren las circunstancias que determinan su posesión a este número del Orden de Prelación de Pagos de acuerdo con lo establecido en el apartado 3.4.6.4 del Módulo Adicional: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xii) Pago de intereses de los Bonos de la Serie E, si concurren las circunstancias que determinan su posesión a este número del Orden de Prelación de Pagos de acuerdo con lo establecido en el apartado 3.4.6.4 del Módulo Adicional (Completamente amortizado): | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xiii) Dotación del Fondo de Reserva hasta que alcance su Nivel Mínimo: | 9.228.263,74 | 9.228.263,74 | - | 0,00 |
| (xiv) Amortización de los Bonos de la Serie E (Completamente amortizado): | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xv) 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 |
| (xvi) Pago de intereses del Préstamo Subordinado para Intereses del Primer Periodo: | 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) Amortización del Préstamo Subordinado para Intereses del Primer Periodo: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xix) Amortización del Préstamo Subordinado para Gastos Iniciales (Completamente amortizado): | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xx) Pago de la Comisión de Administración: | 4.100,72 | 4.100,72 | 0,00 | 0,00 |
| (xxi) Pago en concepto de Comisión Variable: | 1.147.071,78 | 1.147.071,78 | 0,00 | 0,00 |
| Total | 20.299.324,41 | 20.299.324,41 | 0,00 | 0,00 |

| Detalle del cálculo de la Cantidad Disponible de Principal | |
|--|----------------|
| Cantidad Disponible para Amortización (Mínimo entre 1 y 2 siguientes) | 9.638.514,41 |
| 1. Cantidad Teórica de Amortización (Diferencia entre A y B siguientes): | 9.638.514,41 |
| A) Saldo Nominal Pendiente de los Bonos en Fecha de Pago anterior. | 327.854.560,50 |
| B) Saldo no vencido de los préstamos no fallidos | 318.216.046,09 |
| 2. Fondos Disponibles menos los conceptos (i) al (vii) | 20.018.005,74 |
| Cantidad Aplicada | 9.638.569,50 |
| Resto por redondeo | -55,09 |
| Déficit de Principal | 0,00 |

Información sobre Impagados y Fallidos:

| | |
|---------------------------------|------------|
| Impago de principal | |
| Trimestre anterior | 202.601,31 |
| Trimestre actual | 200.090,68 |
| Importe de Fallidos del Período | 189.498,64 |

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 | 1,450 | 17.400.000,00 |
| 2. % Saldo Actual de los Bonos | 2,900 | 9.228.263,74 |
| 3. Importe mínimo | | 8.700.000,00 |
| Nivel Mínimo Requerido=Max(3,Min(1,2)) (*) | | 9.228.263,74 |
| Dotación del Fondo de Reserva | | 9.228.263,74 |
| 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 | 3.000.000,00 | 0,00 | 0,00 | - |
| Préstamo Subordinado para Gastos Iniciales | 1.650.000,00 | 0,00 | 0,00 | - |

IM CAJAMAR 3, FTA
Anuncio de Pago
Fecha de Pago: 22/12/2017

| | Serie A | Serie B |
|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| Cod. ISIN | ES0347783005 | ES0347783013 |
| Periodo de Devengo | 22/09/2017 - 22/12/2017 | 22/09/2017 - 22/12/2017 |
| Tipo de Referencia Vigente | -0,329 % | -0,329 % |
| Margen | 0,130 % | 0,260 % |
| Cupón Vigente | 0,000 % | 0,000 % |
| Tipo mínimo | - | - |

| | TOTAL | POR BONO | TOTAL | POR BONO |
|---|------------------|------------|---------------|------------|
| Saldo Inicial | 1.155.000.000,00 | 100.000,00 | 28.800.000,00 | 100.000,00 |
| Saldo Inicial Antes del Pago | 303.265.462,50 | 26.256,75 | 15.737.022,72 | 54.642,44 |
| Pago de Principal | 8.915.676,00 | 771,92 | 462.651,84 | 1.606,43 |
| Principal debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Saldo Final después del Pago | 294.349.786,50 | 25.484,83 | 15.274.370,88 | 53.036,01 |
| % Pendiente de pago actual | 25,48 % | 25,48 % | 53,04 % | 53,04 % |
| Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Devengado | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Pagado | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| | Serie C | Serie D |
|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| Cod. ISIN | ES0347783021 | ES0347783039 |
| Periodo de Devengo | 22/09/2017 - 22/12/2017 | 22/09/2017 - 22/12/2017 |
| Tipo de Referencia Vigente | -0,329 % | -0,329 % |
| Margen | 0,480 % | 2,000 % |
| Cupón Vigente | 0,151 % | 1,671 % |
| Tipo mínimo | - | - |

| | TOTAL | POR BONO | TOTAL | POR BONO |
|---|--------------|------------|---------------|------------|
| Saldo Inicial | 6.000.000,00 | 100.000,00 | 10.200.000,00 | 100.000,00 |
| Saldo Inicial Antes del Pago | 3.278.546,40 | 54.642,44 | 5.573.528,88 | 54.642,44 |
| Pago de Principal | 96.385,80 | 1.606,43 | 163.855,86 | 1.606,43 |
| Principal debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Saldo Final después del Pago | 3.182.160,60 | 53.036,01 | 5.409.673,02 | 53.036,01 |
| % Pendiente de pago actual | 53,04 % | 53,04 % | 53,04 % | 53,04 % |
| Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Devengado | 1.251,60 | 20,86 | 23.542,62 | 230,81 |
| Interés Bruto Pagado | 1.251,60 | 20,86 | 23.542,62 | 230,81 |
| Interés Bruto Debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

ES0347783047 (SERIE E) Amortizada el 22/09/2014

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

Nota: En aquellos casos en los que el resultado de la fórmula de fijación del tipo de interés de los Bonos es inferior a cero, la Sociedad Gestora ha fijado el Tipo de Interés Nominal para este Período de Devengo de Intereses en el 0%.

IM CAJAMAR 3, FTA
Flujos de Caja del Periodo: 22/09/2017 - 22/12/2017

| Concepto | Importe | |
|--|----------------------|----------------------|
| | Ingresos | Pagos |
| <u>I. Principal</u> | <u>10.168.741,64</u> | <u>9.638.569,50</u> |
| Amortización Préstamos Hipotecarios | 10.168.741,64 | |
| Amortización Bonos de Titulización | | 9.638.569,50 |
| Amortización Préstamos Subordinados | | Amortizados |
| <u>II. Intereses</u> | <u>354.425,33</u> | <u>-11.615,57</u> |
| Intereses cobrados Préstamos Hipotecarios | 641.052,54 | |
| Intereses de las cuentas | -18.252,02 | |
| Otros | 0,00 | |
| Contrato de Swap | -268.375,19 | -36.409,79 |
| Intereses pagados a los Bonos de Titulización | | 24.794,22 |
| Intereses de Préstamos Subordinados | | Amortizados |
| <u>III. Gastos</u> | <u>0,00</u> | <u>1.175.731,55</u> |
| TOTAL INGRESOS/PAGOS | 10.523.166,97 | 10.802.685,48 |
| Saldo Inicial 22/09/2017 | 9.507.782,25 | |
| Recursos depositados para la próxima Fecha de Pago | | |
| Fondo de Reserva | | 9.228.263,74 |
| TOTAL | 20.030.949,22 | 20.030.949,22 |
| Retenciones Practicadas el 22/12/2017 | 4.710,90 | |
| A Inversiones Temporales hasta el 22/01/2018 | | 4.710,90 |