

IM CAJA LABORAL 1, FTA
 Información correspondiente al periodo: 25/10/2021 - 24/01/2022

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|----------------------------------|---------------------------------------|
| Fecha de Constitución del Fondo | 04/12/2006 |
| Fecha de Desembolso de los Bonos | 13/12/2006 |
| Agente Financiero | BNP Paribas Securities Services, S.E. |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF de Renta Fija |

| Calificación Actual (*) | Moody's | Fitch |
|-------------------------|----------|-----------|
| Bonos A | Aa1 (sf) | AAA (sf) |
| Bonos B | Aa3 (sf) | AAA (sf) |
| Bonos C | A2(sf) | AA + (sf) |
| Bonos D | Ba1 (sf) | A (sf) |
| Bonos E | Ca | CCC |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Serie A | | Serie B | |
|---|------------------|---|-----------------|
| Código ISIN | ES0347565006 | Código ISIN | ES0347565014 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 856.300.000,00 € | Nominal en circulación total (inicial) | 10.800.000,00 € |
| Nominal en circulación total (actual) | 116.635.252,92 € | Nominal en circulación total (actual) | 3.100.283,64 € |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € | Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 13.620,84 € | Nominal en circulación unitario (actual) | 28.706,33 € |

| Serie C | | Serie D | |
|---|-----------------|---|-----------------|
| Código ISIN | ES0347565022 | Código ISIN | ES0347565030 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 14.900.000,00 € | Nominal en circulación total (inicial) | 18.000.000,00 € |
| Nominal en circulación total (actual) | 4.275.806,81 € | Nominal en circulación total (actual) | 5.167.139,40 € |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € | Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 28.696,69 € | Nominal en circulación unitario (actual) | 28.706,33 € |

| Serie E | |
|---|-----------------|
| Código ISIN | ES0347565048 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 10.800.000,00 € |
| Nominal en circulación total (actual) | 5.400.000,00 € |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 50.000,00 € |

III. INFORMACIÓN INCLUIDA

Liquidación correspondiente al periodo: 25/10/2021 - 24/01/2022

Anuncio del Pago de los Bonos: 24/01/2022

Flujos de Caja del periodo: 25/10/2021 - 24/01/2022

 (*) Calificación correspondiente a la fecha 05/01/2022. La calificación actualizada de los Bonos se puede consultar en nuestra página web www.imtitulizacion.com.

IM CAJA LABORAL 1, FTA
Liquidación del Periodo: 25/10/2021 - 24/01/2022
Fecha de Pago: 24/01/2022

| Recursos Disponibles (I+II+III+IV+V): | | | | |
|---|----------------------|---------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------|
| I. Situación Inicial: | 5.400.001,00 | | | |
| II. Fondos recibidos del cedente: | 6.919.639,81 | | | |
| a) Principal regular | 4.407.379,10 | | | |
| b) Recuperación de Fallidos | 192.810,64 | | | |
| c) Intereses ordinarios | 95.865,02 | | | |
| d) Intereses de demora | 0,00 | | | |
| e) Amortización Anticipada | 2.223.585,05 | | | |
| III. Otros: | 0,00 | | | |
| IV. Intereses de las Cuentas: | -14.582,82 | | | |
| 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: | 26.510,55 | 26.510,55 | 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: | 20.955,47 | 20.955,47 | 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 posposición al número (viii) 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 posposición al número (ix) del Orden de Prelación de Pagos: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (vi) Pago de intereses de la Serie D si no concurren las circunstancias que determinan su posposición al número (x) del Orden de Prelación de Pagos: | 28,80 | 28,80 | 0,00 | 0,00 |
| (vii) Retención de la Cantidad Disponible para amortización : | | | | |
| Amortización de los Bonos A | 5.436.991,22 | 5.436.991,22 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización de los Bonos B | 293.785,92 | 293.785,92 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización de los Bonos C | 405.181,66 | 405.181,66 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización de los Bonos D | 489.643,20 | 489.643,20 | 0,00 | 0,00 |
| (viii) 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 |
| (ix) Pago de intereses de los Bonos de la Serie 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 |
| (x) Pago de intereses de los Bonos de la Serie 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 |
| (xi) Dotación del Fondo de Reserva hasta que alcance su Nivel Mínimo: | 5.400.000,00 | 5.400.000,00 | - | 0,00 |
| (xii) Pago de intereses de los Bonos de la Serie E: | 127.538,28 | 40.294,80 | 87.243,48 | 0,00 |
| (xiii) Amortización de los Bonos de la Serie E: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xiv) 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 |
| (xv) Pago de intereses del Préstamo Subordinado para Gastos Iniciales (completamente amortizado): | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 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) Amortización del Préstamo Subordinado para Gastos Iniciales (completamente amortizado): | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xviii) Pago de la Comisión de Administración: | 11.359,33 | 1.698,08 | 9.661,25 | 0,00 |
| (xix) Amortización del Préstamo Subordinado para Intereses del Primer Periodo (completamente amortizado): | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xx) Pago en concepto de Comisión Variable: | 93.063,56 | 93.063,56 | 0,00 | 0,00 |
| Total | 12.305.057,99 | 12.208.153,26 | 96.904,73 | 0,00 |

| Detalle del cálculo de la Cantidad Disponible de Principal | |
|--|----------------|
| Cantidad Disponible para Amortización (Mínimo entre 1 y 2 siguientes) | 6.625.609,57 |
| 1. Cantidad Teórica de Amortización (Diferencia entre A y B siguientes): | 6.625.609,57 |
| A) Saldo Nominal Pendiente de los Bonos en Fecha de Pago anterior. | 135.804.084,77 |
| B) Saldo no vencido de los préstamos no fallidos | 129.178.475,20 |
| 2. Recursos Disponibles menos los conceptos (i) a (vi) del orden de prelación de pagos | 12.257.563,17 |
| Cantidad Aplicada | 6.625.602,00 |
| Resto por redondeo | 7,57 |
| Déficit de Principal | 0,00 |

Información sobre Impagados y Fallidos:

| | |
|---------------------------------|-----------|
| Impago de principal | |
| Trimestre anterior | 42.194,55 |
| Trimestre actual | 36.826,58 |
| 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 | 1,200 | 10.800.000,00 |
| 2. % Saldo Actual de los Bonos | 2,400 | 3.100.283,59 |
| 3. Importe mínimo | | 5.400.000,00 |
| Nivel Mínimo Requerido=Max(3,Min(1,2)) (*) | | 5.400.000,00 |
| Dotación del Fondo de Reserva | | 5.400.000,00 |
| 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 Gastos Iniciales | 1.179.853,00 | 0,00 | 0,00 | - |
| Préstamo Subordinado para Intereses del Primer Período | 4.000.000,00 | 0,00 | 0,00 | - |

IM CAJA LABORAL 1, FTA
Anuncio de Pago
Fecha de Pago: 24/01/2022

| | Serie A | Serie B |
|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| Cod. ISIN | ES0347565006 | ES0347565014 |
| Periodo de Devengo | 25/10/2021 - 24/01/2022 | 25/10/2021 - 24/01/2022 |
| Tipo de Referencia Vigente | -0,548 % | -0,548 % |
| Margen | 0,150 % | 0,200 % |
| Cupón Vigente | 0,000 % | 0,000 % |
| Tipo mínimo | - | - |

| | TOTAL | POR BONO | TOTAL | POR BONO |
|---|----------------|------------|---------------|------------|
| Saldo Inicial | 856.300.000,00 | 100.000,00 | 10.800.000,00 | 100.000,00 |
| Saldo Inicial Antes del Pago | 122.072.244,14 | 14.255,78 | 3.394.069,56 | 31.426,57 |
| Pago de Principal | 5.436.991,22 | 634,94 | 293.785,92 | 2.720,24 |
| Principal debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Saldo Final después del Pago | 116.635.252,92 | 13.620,84 | 3.100.283,64 | 28.706,33 |
| % Pendiente de pago actual | 13,62 % | 13,62 % | 28,71 % | 28,71 % |
| 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 | ES0347565022 | ES0347565030 |
| Periodo de Devengo | 25/10/2021 - 24/01/2022 | 25/10/2021 - 24/01/2022 |
| Tipo de Referencia Vigente | -0,548 % | -0,548 % |
| Margen | 0,350 % | 0,550 % |
| Cupón Vigente | 0,000 % | 0,002 % |
| Tipo mínimo | - | - |

| | TOTAL | POR BONO | TOTAL | POR BONO |
|---|---------------|------------|---------------|------------|
| Saldo Inicial | 14.900.000,00 | 100.000,00 | 18.000.000,00 | 100.000,00 |
| Saldo Inicial Antes del Pago | 4.680.988,47 | 31.416,03 | 5.656.782,60 | 31.426,57 |
| Pago de Principal | 405.181,66 | 2.719,34 | 489.643,20 | 2.720,24 |
| Principal debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Saldo Final después del Pago | 4.275.806,81 | 28.696,69 | 5.167.139,40 | 28.706,33 |
| % Pendiente de pago actual | 28,70 % | 28,70 % | 28,71 % | 28,71 % |
| Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Devengado | 0,00 | 0,00 | 28,80 | 0,16 |
| Interés Bruto Pagado | 0,00 | 0,00 | 28,80 | 0,16 |
| Interés Bruto Debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| | |
|----------------------------|-------------------------|
| | Serie E |
| Cod. ISIN | ES0347565048 |
| Periodo de Devengo | 25/10/2021 - 24/01/2022 |
| Tipo de Referencia Vigente | -0,548 % |
| Margen | 3,500 % |
| Cupón Vigente | 2,952 % |
| Tipo mínimo | - |

| | TOTAL | POR BONO |
|---|---------------|------------|
| Saldo Inicial | 10.800.000,00 | 100.000,00 |
| Saldo Inicial Antes del Pago | 5.400.000,00 | 50.000,00 |
| Pago de Principal | 0,00 | 0,00 |
| Principal debido | 0,00 | 0,00 |
| Saldo Final después del Pago | 5.400.000,00 | 50.000,00 |
| % Pendiente de pago actual | 50,00 % | 50,00 % |
| Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago | 87.243,48 | 807,81 |
| Interés Bruto Devengado | 40.294,80 | 373,10 |
| Interés Bruto Pagado | 127.538,28 | 1.180,91 |
| 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.

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 Periodo de Devengo de Intereses en el 0%.

IM CAJA LABORAL 1, FTA
Flujos de Caja del Periodo: 25/10/2021 - 24/01/2022

| Concepto | Importe | |
|--|----------------------|----------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| <u>I. Principal</u> | <u>6.823.774,79</u> | <u>6.625.602,00</u> |
| Amortización Préstamos Hipotecarios | 6.823.774,79 | |
| Amortización Bonos de Titulización | | 6.625.602,00 |
| Amortización Préstamos Subordinados | | Amortizados |
| <u>II. Intereses</u> | <u>-104.869,38</u> | <u>-37.629,03</u> |
| Intereses cobrados Préstamos Hipotecarios | 95.865,02 | |
| Intereses de las cuentas | -14.582,82 | |
| Contrato de Swap | -186.151,58 | -165.196,11 |
| Intereses pagados a los Bonos de Titulización | | 127.567,08 |
| Intereses de Préstamos Subordinados | | Amortizados |
| <u>III. Gastos</u> | <u>0,00</u> | <u>130.933,44</u> |
| TOTAL INGRESOS/PAGOS | 6.718.905,41 | 6.718.906,41 |
| Saldo Inicial 25/10/2021 | 5.400.001,00 | |
| Recursos depositados para la próxima Fecha de Pago | | |
| Fondo de Reserva | | 5.400.000,00 |
| TOTAL | 12.118.906,41 | 12.118.906,41 |
| Retenciones Practicadas el 24/01/2022 | 24.237,75 | |
| A Inversiones Temporales hasta el 21/02/2022 | | 24.237,75 |