

IM CAJA LABORAL 2, FTA
 Información correspondiente al periodo: 24/01/2022 - 25/04/2022

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|----------------------------------|---------------------------------------|
| Fecha de Constitución del Fondo | 23/05/2008 |
| Fecha de Desembolso de los Bonos | 02/06/2008 |
| 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 | | A+ (sf) |
| Bonos C | | BB-(sf) |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Serie A | | Serie B | |
|---|------------------|---|-----------------|
| Código ISIN | ES0347552004 | Código ISIN | ES0347552012 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 524.400.000,00 € | Nominal en circulación total (inicial) | 42.000.000,00 € |
| Nominal en circulación total (actual) | 186.827.778,24 € | Nominal en circulación total (actual) | 34.967.759,40 € |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € | Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 35.626,96 € | Nominal en circulación unitario (actual) | 83.256,57 € |

| Serie C | |
|---|-----------------|
| Código ISIN | ES0347552020 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 33.600.000,00 € |
| Nominal en circulación total (actual) | 27.974.207,52 € |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 € |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 83.256,57 € |

III. INFORMACIÓN INCLUIDA

Liquidación correspondiente al periodo: 24/01/2022 - 25/04/2022

Anuncio del Pago de los Bonos: 25/04/2022

Flujos de Caja del periodo: 24/01/2022 - 25/04/2022

 (*) Calificación correspondiente a la fecha 05/04/2022. La calificación actualizada de los Bonos se puede consultar en nuestra página web www.imtitulizacion.com.

IM CAJA LABORAL 2, FTA
Liquidación del Periodo: 24/01/2022 - 25/04/2022
Fecha de Pago: 25/04/2022

| Recursos Disponibles (I+II+III+IV+V): | | | | |
|---|----------------------|------------------------------------|--|-----------------------------------|
| | 27.763.852,58 | | | |
| I. Situación Inicial: | 21.009.374,46 | | | |
| II. Fondos recibidos del cedente: | 6.792.652,08 | | | |
| a) Principal regular | 3.429.736,44 | | | |
| b) Recuperación de Fallidos | 237.796,68 | | | |
| c) Intereses ordinarios | 121.309,02 | | | |
| d) Intereses de demora | 0,00 | | | |
| e) Amortización Anticipada | 3.003.809,94 | | | |
| III. Otros: | 0,00 | | | |
| IV. Intereses de las Cuentas: | -38.173,96 | | | |
| 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: | 44.553,11 | 44.553,11 | 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: | 40.293,01 | 40.293,01 | 0,00 | 0,00 |
| (iii) Pago de intereses de los Bonos A: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (iv) Pago de intereses de los Bonos B si no concurren las circunstancias que determinan su posposición al número (vii) del Orden de Prelación de Pagos: | 4.263,00 | 4.263,00 | 0,00 | 0,00 |
| (v) Pago de intereses de los Bonos C si no concurren las circunstancias que determinan su posposición al número (viii) del Orden de Prelación de Pagos: | 32.424,00 | 32.424,00 | 0,00 | 0,00 |
| (vi) Retención de la Cantidad Disponible para amortización : | | | | |
| Amortización de los Bonos A | 4.818.711,60 | 4.818.711,60 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización de los Bonos B | 901.903,80 | 901.903,80 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización de los Bonos C | 721.523,04 | 721.523,04 | 0,00 | 0,00 |
| (vii) 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 |
| (viii) 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 |
| (ix) Dotación del Fondo de Reserva hasta que alcance su Nivel Mínimo: | 20.481.119,10 | 20.481.119,10 | - | 0,00 |
| (x) 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 |
| (xi) Pago de intereses del Préstamo Subordinado para Gastos Iniciales: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xii) Pago de intereses del Préstamo Subordinado para Intereses del Primer Periodo: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xiii) Pago de intereses del Préstamo Subordinado para Fondo de Reserva: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xiv) Amortización del Préstamo Subordinado para Gastos Iniciales: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xv) Pago de la Comisión de Administración: | 3.203,13 | 3.203,13 | 0,00 | 0,00 |
| (xvi) Amortización del Préstamo Subordinado para Intereses del Primer Periodo: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (xvii) Amortización del Préstamo Subordinado para Fondo de Reserva: | 715.858,79 | 715.858,79 | 0,00 | 0,00 |
| (xviii) Pago en concepto de Comisión Variable: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | 27.763.852,58 | 27.763.852,58 | 0,00 | 0,00 |

Detalle del cálculo de la Cantidad Disponible de Principal

| | |
|---|----------------|
| Cantidad Disponible para Amortización (Mínimo entre 1 y 2 siguientes) | 6.442.159,06 |
| 1. Cantidad Teórica de Amortización (Diferencia entre A y B siguientes): | 6.442.159,06 |
| A) Saldo Nominal Pendiente de los Bonos en Fecha de Pago anterior. | 256.211.883,60 |
| B) Saldo no vencido de los préstamos no fallidos | 249.769.724,54 |
| 2. Recursos Disponibles menos los conceptos (i) a (v) del orden de prelación de pagos | 27.642.319,46 |
| Cantidad Aplicada | 6.442.138,44 |
| Resto por redondeo | 20,62 |
| Déficit de Principal | 0,00 |

Información sobre Impagados y Fallidos:

| | |
|---------------------------------|-----------|
| Impago de principal | |
| Trimestre anterior | 38.160,79 |
| Trimestre actual | 46.758,44 |
| Importe de Fallidos del Período | 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 | 4,100 | 24.600.000,00 |
| 2. % Saldo Actual de los Bonos | 8,200 | 20.481.119,10 |
| 3. Importe mínimo | | 12.300.000,00 |
| Nivel Mínimo Requerido=Max(3,Min(1,2)) (*) | | 20.481.119,10 |
| Dotación del Fondo de Reserva | | 20.481.119,10 |
| 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 | 386.000,00 | 0,00 | 0,00 | - |
| Préstamo Subordinado para Intereses del Primer Período | 3.600.000,00 | 0,00 | 0,00 | - |
| Préstamo Subordinado para el Fondo de Reserva | 24.600.000,00 | 20.413.145,21 | 20.413.145,21 | 0,000 % |

IM CAJA LABORAL 2, FTA
Anuncio de Pago
Fecha de Pago: 25/04/2022

| | Serie A | Serie B |
|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| Cod. ISIN | ES0347552004 | ES0347552012 |
| Periodo de Devengo | 24/01/2022 - 25/04/2022 | 24/01/2022 - 25/04/2022 |
| Tipo de Referencia Vigente | -0,553 % | -0,553 % |
| Margen | 0,300 % | 0,600 % |
| Cupón Vigente | 0,000 % | 0,047 % |
| Tipo mínimo | 0,000 % | 0,000 % |

| | TOTAL | POR BONO | TOTAL | POR BONO |
|---|----------------|------------|---------------|------------|
| Saldo Inicial | 524.400.000,00 | 100.000,00 | 42.000.000,00 | 100.000,00 |
| Saldo Inicial Antes del Pago | 191.646.489,84 | 36.545,86 | 35.869.663,20 | 85.403,96 |
| Pago de Principal | 4.818.711,60 | 918,90 | 901.903,80 | 2.147,39 |
| Principal debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Saldo Final después del Pago | 186.827.778,24 | 35.626,96 | 34.967.759,40 | 83.256,57 |
| % Pendiente de pago actual | 35,63 % | 35,63 % | 83,26 % | 83,26 % |
| Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Devengado | 0,00 | 0,00 | 4.263,00 | 10,15 |
| Interés Bruto Pagado | 0,00 | 0,00 | 4.263,00 | 10,15 |
| Interés Bruto Debido | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| | Serie C |
|----------------------------|-------------------------|
| Cod. ISIN | ES0347552020 |
| Periodo de Devengo | 24/01/2022 - 25/04/2022 |
| Tipo de Referencia Vigente | -0,553 % |
| Margen | 1,000 % |
| Cupón Vigente | 0,447 % |
| Tipo mínimo | 0,000 % |

| | TOTAL | POR BONO |
|---|---------------|------------|
| Saldo Inicial | 33.600.000,00 | 100.000,00 |
| Saldo Inicial Antes del Pago | 28.695.730,56 | 85.403,96 |
| Pago de Principal | 721.523,04 | 2.147,39 |
| Principal debido | 0,00 | 0,00 |
| Saldo Final después del Pago | 27.974.207,52 | 83.256,57 |
| % Pendiente de pago actual | 83,26 % | 83,26 % |
| Interés Bruto Debido en la anterior Fecha de Pago | 0,00 | 0,00 |
| Interés Bruto Devengado | 32.424,00 | 96,50 |
| Interés Bruto Pagado | 32.424,00 | 96,50 |
| 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.

IM CAJA LABORAL 2, FTA
Flujos de Caja del Periodo: 24/01/2022 - 25/04/2022

| Concepto | Importe | |
|--|----------------------|----------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| <u>I. Principal</u> | <u>6.671.343,06</u> | <u>7.157.997,23</u> |
| Amortización Préstamos Hipotecarios | 6.671.343,06 | |
| Amortización Bonos de Titulización | | 6.442.138,44 |
| Amortización Préstamos Subordinados | | 715.858,79 |
| <u>II. Intereses</u> | <u>-266.858,61</u> | <u>-273.013,66</u> |
| Intereses cobrados Préstamos Hipotecarios | 121.309,02 | |
| Intereses de las cuentas | -38.173,96 | |
| Contrato de Swap | -349.993,67 | -309.700,66 |
| Intereses pagados a los Bonos de Titulización | | 36.687,00 |
| Intereses de Préstamos Subordinados | | 0,00 |
| <u>III. Gastos</u> | <u>0,00</u> | <u>47.756,24</u> |
| TOTAL INGRESOS/PAGOS | 6.404.484,45 | 6.932.739,81 |
| Saldo Inicial 24/01/2022 | 21.009.374,46 | |
| Recursos depositados para la próxima Fecha de Pago | | |
| Fondo de Reserva | | 20.481.119,10 |
| TOTAL | 27.413.858,91 | 27.413.858,91 |
| Retenciones Practicadas el 25/04/2022 | 6.970,53 | |
| A Inversiones Temporales hasta el 20/05/2022 | | 6.970,53 |