

TDA CAM 5 - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 26/10/23 - 26/01/24

	Euros
I. Situación al 26/10/23:	11.000.000,00
Saldo inicial Cta. Reinversión	11.000.000,00
II. Fondos recibidos del emisor	11.628.413,18
Principal:	
Según calendario hasta 31/12/23:	5.880.435,37
Amort. Anticipada hasta 31/12/23:	3.539.471,60
Intereses:	2.208.054,77
Ingresos de Inmuebles:	451,44
III. Subtotal a Cuenta de reinversión (I + II):	22.628.413,18
IV. Total intereses de la reinversión:	206.946,57
Intereses de la Cta. De Reinversión	205.488,68
Intereses de la Cta. De Tesorería	1.454,18
Intereses de la Cta. Operativa Inmuebles	3,71
V. Recursos disponibles (III + IV):	22.835.359,75
VI. Varios:	178.279,78
VII. Liquidación SWAP:	440.844,11
Cantidad a Pagar por la Parte A (Fondo):	2.208.054,77
Cantidad a Pagar por la Parte B (JP MORGAN):	2.648.898,88
VIII. Pago a los Bonos:	11.823.583,20
Bonos A:	
Intereses correspondientes al 26/01/24:	1.716.746,40
Retenciones practicadas a los bonos:	-326.181,82
Amortización correspondiente al 26/01/24:	9.492.746,40
Bonos B:	
Intereses correspondientes al 26/01/24:	614.090,40
Retenciones practicadas a los bonos:	-116.677,18
Amortización correspondiente al 26/01/24:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones:	442.859,00
IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII):	11.274.340,88
Distribución del saldo disponible:	11.138.897,00
Fondo de Reserva 26/10/23:	11.000.000,00
Aportación al Fondo de Reserva	0,00
Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada	138.897,00
Amortización Préstamo Participativo	0,00
Remuneración Variable Préstamo Participativo	135.443,88
Fondo de Reseva 26/01/24:	11.000.000,00

Destinatario: CNMV; AIAF.



Nº: 218/24

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

<http://www.tda-sgft.com>

TDACAM5\liq.trim\Ene24

Fondo de Titulización de Activos

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 26 de Enero de 2024

Importes en euros

I. BONOS A ES0377992005	Sobre 19440 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (10/10/05):	1.944.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	165.423.319,20 €	8.509,43 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	1.716.746,40 €	88,31 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	9.492.746,40 €	488,31 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	155.930.572,80 €	8.021,12 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	8,021120%	8,021120%

II. BONOS B ES0377992013	Sobre 560 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (10/10/05):	56.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	56.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	614.090,40 €	1.096,59 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	56.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

III. EL FONDO	Importes en euros
1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/12/23:	
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:	211.930.504,03 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:	30.908.042,45 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:	212.034.366,58 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:	37.195.621,93 €
2. Amortización del período 30/09/23 a 31/12/23:	9.419.906,97 €
a) Según calendario:	5.880.435,37 €
b) Amortización anticipada hasta 31/12/23:	3.539.471,60 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):	
a) Ultimo año:	6,64%
b) Ultimo semestre:	6,10%
c) Ultimo trimestre:	6,24%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:	0,58%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:	0,02%
6. Porcentaje de fallidos (1):	14,92%
7. Nivel de Impago (2)	0,33%

(1) Saldo pendiente de las participaciones hipotecarias fallidas según definición del Folleto de Emisión (retraso de 12 meses y otras causas), sobre el saldo pendiente total.

(2) Importe de principal de las Participaciones Hipotecarias con morosidad superior a 90 días en la Fecha de Cobro inmediata anterior a la Fecha de Pago en curso, sobre el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias.

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF.



Nº: 219/24

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58
28020 Madrid

Tel.: 917020808

<http://www.tda-sgft.com>
TDACAM5\Infoinver.trim\Ene24

TDA CAM 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 26/10/23-26/01/24

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	5 de octubre de 2005
Fecha Emisión BTH	5 de octubre de 2005
Fecha Final Amortización BTH (6,64% TAA)	28 de julio de 2025
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias	Banco de Sabadell (CAM)
Agente de Pagos	Société Générale, Sucursal en España
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Moody's Investors Service / Fitch Ibc
Calificación	Bonos A: (M) Aa1 (sf) / (F) AAA (sf) Bonos B: (M) Ba2 (sf) / (F) A (sf)

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

Nombre	Bonos de Titulización TDA CAM 5
Serie A:	
Código ISIN	ES0377992005
Nominal en circulación total (inicial)	1.944.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	155.930.572,80 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	8.021,12 Euros
Serie B:	
Código ISIN	ES0377992013
Nominal en circulación total (inicial)	56.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	56.000.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA

* Liquidación del Período:26/10/23-26/01/24
* Flujos de Caja del Período:26/10/23-26/01/24
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 26 de Enero de 2024

TDA CAM 5**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 26/10/23 - 26/01/24**

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip.		9.492.746,40
Amortización Participaciones Hip.	9.419.906,97	
Ingresos por venta	451,44	
Amortización Ptmos. Subordinados		0,00
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH		2.330.836,80
Intereses recibidos de las PHs	2.208.054,77	
Intereses Ptmos. Subordinados		138.897,00
Intereses Inversiones Temporales	206.946,57	
III. GASTOS		
Comisiones Periódicas:		178.279,78
Neto SWAP a favor de la Parte A (Fondo)	440.844,11	
Remuneración variable Préstamo Participativo		135.443,88
Total Ingresos/Pagos	12.276.203,86	12.276.203,86
Saldo inicial 26/10/23	11.000.000,00	
A Inversiones Temporales		11.000.000,00
Total	23.276.203,86	23.276.203,86
Retenciones practicadas el 26/01/24	442.859,00	
A Inversiones Temporales		442.859,00

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 225 / 24**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

<http://www.tda-sgft.com>

TDACAM5fluj.trim\Ene24