

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FONDO DE TITULIZACION
Número de registro del Fondo: 11362
NIF Fondo: V75446435
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2026

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:
(sólo se cumplimentará en el supuesto de que se produzca el reenvío con alguna modificación de la información periódica)

S.01
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2026

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2026		Periodo anterior 31/12/2025
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	3.157.325	1001	3.307.320
I. Activos financieros a largo plazo	0002	3.157.325	1002	3.307.320
1. Activos titulizados	0003	2.934.025	1003	3.084.020
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	2.927.501	1005	3.080.912
1.3 Préstamos hipotecarios	0006	0	1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007	0	1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008	0	1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009	0	1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010	0	1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011	0	1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012	0	1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013	0	1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014	0	1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015	0	1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016	0	1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017	0	1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018	0	1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019	0	1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020	0	1020	0
1.18 Bonos de titulización	0021	0	1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022	0	1022	0
1.20 Otros	0023	0	1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024	0	1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	6.789	1025	3.373
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-265	1027	-265
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	223.300	1029	223.300
2.1 Derivados de cobertura	0030	223.300	1030	223.300
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

	S.01
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2026		Periodo anterior 31/12/2025
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	378.625	1041	390.572
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	155.943	1043	157.266
1. Activos titulizados	0044	120.977	1044	122.582
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	119.397	1046	121.241
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048	0	1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049	0	1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050	0	1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051	0	1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052	0	1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053	0	1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054	0	1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055	0	1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056	0	1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057	0	1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058	0	1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060	0	1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061	0	1061	0
1.18 Bonos de titulización	0062	0	1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063	0	1063	0
1.20 Otros	0064	0	1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	817	1065	861
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	345	1066	300
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	409	1067	191
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	51	1068	31
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-42	1069	-42
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	21.830	1071	21.830
2.1 Derivados de cobertura	0072	21.830	1072	21.830
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	13.136	1074	12.853
3.1 Valores representativos de deuda	0075	0	1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076	0	1076	0
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	13.136	1077	12.853
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	0
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	222.682	1085	233.306
1. Tesorería	0086	222.682	1086	233.306
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	3.535.950	1088	3.697.892

S.01
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2026

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2026		Periodo anterior 31/12/2025
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	3.166.474	1089	3.326.002
I. Provisiones a largo plazo	0090	24.836	1090	18.286
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	24.836	1092	18.286
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	3.141.638	1094	3.307.717
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	2.980.841	1095	3.140.860
1.1 Series no subordinadas	0096	2.910.841	1096	3.070.860
1.2 Series subordinadas	0097	70.000	1097	70.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	0	1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	160.797	1101	166.857
2.1 Préstamo subordinado	0102	160.797	1102	166.857
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	0	1105	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108	0	1108	0
3.1 Derivados de cobertura	0109	0	1109	0
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

	S.01
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2026		Periodo anterior 31/12/2025
B) PASIVO CORRIENTE	0117	129.236	1117	130.869
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118	0	1118	0
V. Provisiones a corto plazo	0119	0	1119	0
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	0
2. Provisión por margen de intermediación	0121	0	1121	0
3. Otras provisiones	0122	0	1122	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	129.222	1123	130.848
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	128.721	1124	130.352
1.1 Series no subordinadas	0125	119.806	1125	121.432
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	8.915	1128	8.919
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	0	1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	501	1131	496
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133	0	1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134	0	1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	0	1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	501	1136	496
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	0	1139	0
3.1 Derivados de cobertura	0140	0	1140	0
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	14	1148	21
1. Comisiones	0149	14	1149	15
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	13	1150	14
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	1	1152	1
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	0	1157	6
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	240.240	1158	241.021
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	240.240	1160	241.021
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	3.535.950	1162	3.697.892

S.02

Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2026

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2026		Acumulado anterior 30/06/2025
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	20.611	1201	24.919	2201	41.670	3201	37.260
1.1 Activos titulizados	0202	19.327	1202	23.734	2202	39.205	3202	35.649
1.2 Otros activos financieros	0203	1.283	1203	1.184	2203	2.464	3203	1.611
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-24.022	1204	-28.638	2204	-47.963	3204	-40.046
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-22.744	1205	-27.161	2205	-45.419	3205	-37.983
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1.278	1206	-1.478	2206	-2.544	3206	-2.063
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	6.956	1208	13.619	2208	13.144	3208	16.590
A) MARGEN DE INTERESES	0209	3.544	1209	9.900	2209	6.850	3209	13.804
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210	0	3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211	0	3211	0
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212	0	3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213	0	3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214	0	3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-119	1217	-212	2217	-299	3217	-861
7.1 Servicios exteriores	0218	-3	1218	-119	2218	-63	3218	-627
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-3	1219	-119	2219	-63	3219	-627
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-116	1224	-93	2224	-236	3224	-235
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-37	1225	-39	2225	-75	3225	-114
7.3.2 Comisión administrador	0226	-76	1226	-52	2226	-156	3226	-85
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-2	1227	-2	2227	-5	3227	-3
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228	0	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-1	1230	0	2230	-1	3230	-34
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	0	1231	0	2231	0	3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	0	2232	0	3232	0
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	-3.426	1234	-9.688	2234	-6.551	3234	-12.942
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	-3.426	1236	-9.688	2236	-6.551	3236	-12.942
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238	0	3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	0	1239	0	2239	0	3239	0
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

S.03
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2026

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2026		Acumulado anterior 30/06/2025
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	3.462	1300	8.963	2300	5.812	3300	19.290
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	3.577	1301	9.089	2301	6.048	3301	19.415
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	19.327	1302	24.268	2302	39.183	3302	34.168
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-21.978	1303	-28.648	2303	-45.424	3303	-28.648
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	6.180	1304	13.833	2304	12.363	3304	13.833
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	3305	0
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	1.283	1306	1.184	2306	2.464	3306	1.611
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	-1.235	1307	-1.549	2307	-2.539	3307	-1.549
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-115	1309	-126	2309	-236	3309	-126
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-37	1310	-39	2310	-76	3310	-39
2.2 Comisión administrador	0311	-76	1311	-85	2311	-156	3311	-85
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-2	1312	-2	2312	-5	3312	-2
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	0	1315	0	2315	0	3315	0
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-8.934	1322	11.618	2322	-16.436	3322	215.865
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	3.500.000
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	-3.500.000
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	-5.437	1325	14.499	2325	-10.306	3325	43.346
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	26.876	1326	28.924	2326	55.031	3326	31.412
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	46.647	1327	56.895	2327	92.527	3327	82.576
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.909	1328	1.712	2328	3.781	3328	2.389
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-80.868	1331	-73.032	2331	-161.646	3331	-73.032
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-3.497	1332	-2.880	2332	-6.130	3332	172.518
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	176.000
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	-3.487	1334	-2.761	2334	-6.060	3334	-2.761
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-10	1336	-119	2336	-70	3336	-720
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-5.472	1337	20.581	2337	-10.624	3337	235.154
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	228.154	1338	214.573	2338	233.306	3338	0
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	222.682	1339	235.154	2339	222.682	3339	235.154

Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2026

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2026		Acumulado anterior 30/06/2025
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	6.180	1357	13.833	2357	12.363	3357	13.833
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	6.180	1358	13.833	2358	12.363	3358	13.833
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359	0	3359	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	-6.956	1360	-13.619	2360	-13.144	3360	-16.590
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361	0	3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0362	776	1362	-214	2362	781	3362	2.757
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el periodo	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

S.05.1

Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2026

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2026								Situación cierre anual anterior 31/12/2025								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	0,24	0401	0,00	0421	0,00	0441	6,06	1381	0,11	1401	0,00	1421	0,00	1441	5,54	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	7,00
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1															
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT															
Denominación del compartimento:															
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.															
Estados agregados: NO															
Fecha: 30/06/2026															
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL															

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	1.723	0467	506	0474	295	0481	0	0488	802	0495	207.416	0502	0	0509	208.218
De 1 a 3 meses	0461	106	0468	71	0475	49	0482	0	0489	120	0496	12.301	0503	0	0510	12.421
De 3 a 6 meses	0462	20	0469	35	0476	18	0483	8	0490	61	0497	2.916	0504	0	0511	2.977
De 6 a 9 meses	0463	20	0470	61	0477	17	0484	30	0491	108	0498	2.374	0505	0	0512	2.482
De 9 a 12 meses	0464	11	0471	26	0478	8	0485	21	0492	54	0499	946	0506	0	0513	1.000
Más de 12 meses	0465	7	0472	33	0479	8	0486	24	0493	65	0500	807	0507	0	0514	872
Total	0466	1.887	0473	732	0480	396	0487	83	0494	1.211	0501	226.760	0508	0	1515	227.971

Impagados con garantía real (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total		Valor garantía		Valor Garantía con Tasación > 2 años		% Deuda / v. Tasación	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total													
Hasta 1 mes	0515	1.723	0522	506	0529	295	0536	0	0543	802	0550	207.416	0557	0	0564	208.218	0571	273.429	0578	273.429	0584	76,15
De 1 a 3 meses	0516	106	0523	71	0530	49	0537	0	0544	120	0551	12.301	0558	0	0565	12.421	0572	15.370	0579	15.370	0585	80,81
De 3 a 6 meses	0517	20	0524	35	0531	18	0538	8	0545	61	0552	2.916	0559	0	0566	2.977	0573	3.789	0580	3.789	0586	78,57
De 6 a 9 meses	0518	20	0525	61	0532	17	0539	30	0546	108	0553	2.374	0560	0	0567	2.482	0574	2.586	0581	2.586	0587	95,98
De 9 a 12 meses	0519	11	0526	26	0533	8	0540	21	0547	54	0554	946	0561	0	0568	1.000	0575	931	0582	931	0588	107,43
Más de 12 meses	0520	7	0527	33	0534	8	0541	24	0548	65	0555	807	0562	0	0569	872	0576	736	0583	736	0589	118,55
Total	0521	1.887	0528	732	0535	396	0542	83	0549	1.211	0556	226.760	0563	0	0570	227.971	0577	296.841			0590	76,80

S.05.1
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2026
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 20/02/2025	
Inferior a 1 año	0600	105	1600	117	2600	33
Entre 1 y 2 años	0601	286	1601	346	2601	395
Entre 2 y 3 años	0602	499	1602	426	2602	475
Entre 3 y 4 años	0603	1.339	1603	937	2603	543
Entre 4 y 5 años	0604	3.263	1604	2.485	2604	1.320
Entre 5 y 10 años	0605	58.888	1605	46.011	2605	35.074
Superior a 10 años	0606	2.989.716	1606	3.155.395	2606	3.462.161
Total	0607	3.054.095	1607	3.205.717	2607	3.500.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	21,85	1608	22,33	2608	23,54

Antigüedad	Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 20/02/2025	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	10,72	1609	10,28	2609	9,44

TDA SABADELL RMBS 5, FT

	S.05.1
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2026				Situación cierre anual anterior 31/12/2025				Situación inicial 20/02/2025			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.957	0630	150.616	1620	1.885	1630	146.859	2620	1.747	2630	134.411
40% - 60%	0621	2.397	0631	356.993	1621	2.298	1631	345.464	2621	2.196	2631	347.780
60% - 80%	0622	7.429	0632	1.033.085	1622	6.324	1632	938.552	2622	3.996	2632	713.492
80% - 100%	0623	7.630	0633	865.259	1623	8.978	1633	1.047.741	2623	11.593	2633	1.411.923
100% - 120%	0624	2.870	0634	313.751	1624	3.132	1634	346.015	2624	3.724	2634	422.760
120% - 140%	0625	1.508	0635	167.062	1625	1.667	1635	188.129	2625	1.963	2635	225.294
140% - 160%	0626	731	0636	82.434	1626	843	1636	96.216	2626	1.060	2636	123.936
superior al 160%	0627	725	0637	84.895	1627	821	1637	96.743	2627	1.001	2637	120.403
Total	0628	25.247	0638	3.054.095	1628	25.948	1638	3.205.717	2628	27.280	2638	3.500.000
Media ponderada (%)	0639	84,37	0649		1639	86,15	1649		2639	89,07	2649	

TDA SABADELL RMBS 5, FT

	S.05.1
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 20/02/2025	
Tipo de interés medio ponderado	0650	2,55	1650	2,74	2650	2,97
Tipo de interés nominal máximo	0651	7,25	1651	7,05	2651	8,37
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,00	2652	0,00

	S.05.1
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2026				Situación cierre anual anterior 31/12/2025				Situación inicial 20/02/2025			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	2.105	0683	242.288	1660	2.171	1683	255.575	2660	2.290	2683	278.400
Aragón	0661	437	0684	45.855	1661	444	1684	47.590	2661	462	2684	51.431
Asturias	0662	844	0685	87.001	1662	860	1685	90.711	2662	901	2685	98.854
Baleares	0663	464	0686	65.435	1663	479	1686	69.316	2663	510	2686	77.831
Canarias	0664	441	0687	47.519	1664	448	1687	48.982	2664	471	2687	52.847
Cantabria	0665	66	0688	7.445	1665	67	1688	7.796	2665	70	2688	8.395
Castilla-León	0666	466	0689	45.764	1666	473	1689	47.703	2666	494	2689	51.811
Castilla La Mancha	0667	686	0690	70.912	1667	710	1690	74.914	2667	761	2690	82.684
Cataluña	0668	8.108	0691	1.148.961	1668	8.349	1691	1.207.389	2668	8.795	2691	1.321.011
Ceuta	0669	10	0692	1.478	1669	10	1692	1.504	2669	10	2692	1.551
Extremadura	0670	178	0693	14.770	1670	185	1693	15.541	2670	193	2693	16.796
Galicia	0671	536	0694	63.001	1671	546	1694	65.221	2671	563	2694	70.432
Madrid	0672	2.439	0695	421.637	1672	2.502	1695	441.594	2672	2.611	2695	479.999
Melilla	0673	22	0696	3.053	1673	24	1696	3.419	2673	26	2696	3.800
Murcia	0674	2.253	0697	200.601	1674	2.300	1697	209.156	2674	2.417	2697	227.194
Navarra	0675	49	0698	6.234	1675	50	1698	6.474	2675	56	2698	7.600
La Rioja	0676	43	0699	4.505	1676	44	1699	4.681	2676	46	2699	4.921
Comunidad Valenciana	0677	5.827	0700	533.215	1677	6.003	1700	561.033	2677	6.311	2700	613.608
País Vasco	0678	273	0701	44.422	1678	283	1701	47.120	2678	293	2701	50.838
Total España	0679	25.247	0702	3.054.095	1679	25.948	1702	3.205.717	2679	27.280	2702	3.500.000
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	25.247	0705	3.054.095	1682	25.948	1705	3.205.717	2682	27.280	2705	3.500.000

TDA SABADELL RMBS 5, FT

	S.05.1
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2026				Situación cierre anual anterior 31/12/2025				Situación inicial 20/02/2025			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,38			1710	0,37			2710	0,36		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

TDA SABADELL RMBS 5, FT

S.05.2									
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT									
Denominación del compartimento:									
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.									
Estados agregados: NO									
Periodo de la declaración: 30/06/2026									
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF									

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2026			Situación cierre anual anterior 31/12/2025			Situación Inicial 20/02/2025		
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722
ES0305874002	BONO A	34.300	88.357	3.030.646	34.300	93.070	3.192.292	34.300	100.000	3.430.000
ES0305874010	BONO B	700	100.000	70.000	700	100.000	70.000	700	100.000	70.000
Total		0723	35.000	0724	1723	35.000	1724	2723	35.000	2724

TDA SABADELL RMBS 5, FT

S.05.2											
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT											
Denominación del compartimento:											
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.											
Estados agregados: NO											
Periodo de la declaración: 30/06/2026											
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF											

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses							Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas					
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados		Intereses impagados		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado								
		0730													0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736
ES0305874002	BONO A	NS	EURIBOR 3M	0,75	2,95	8.704		0		SI	3.030.646		0		3.039.350		0				
ES0305874010	BONO B	S	EURIBOR 3M	0,90	3,10	211		0		SI	70.000		0		70.211		0				
Total						0740	8.915	0741	0			0743	3.100.646	0744	0		0745	3.109.562	0746	0	

	Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 20/02/2025	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	2,82	0748	2,98	0749	3,27

TDA SABADELL RMBS 5, FT

	S.05.2
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Periodo de la declaración: 30/06/2026	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2026								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2025							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750		0751		0752		0753		1750		1751		1752		1753	
ES0305874002	BONO A	80.868		399.354		21.469		119.563		73.032		73.032		28.049		28.049	
ES0305874010	BONO B	0		0		509		2.686		0		0		599		599	
Total		0754	80.868	0755	399.354	0756	21.978	0757	122.249	1754	73.032	1755	73.032	1756	28.648	1757	28.648

TDA SABADELL RMBS 5, FT

	S.05.2
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Periodo de la declaración: 30/06/2026	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
		0760	0761	Situación actual 30/06/2026	Situación cierre anual anterior 31/12/2025	Situación inicial 20/02/2025
		0760	0761	0762	0763	0764
ES0305874002	BONO A	19/02/2026	DBRS	AA (low)	A	A
ES0305874002	BONO A	02/12/2025	MDY	Aa1	Aa1	Aa3
ES0305874010	BONO B	19/02/2026	DBRS	A	BBB	BBB
ES0305874010	BONO B	25/02/2025	MDY	Ba3	Ba3	Ba3

TDA SABADELL RMBS 5, FT

	S.05.2
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Periodo de la declaración: 30/06/2026	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 20/02/2025	
Inferior a 1 año	0765	132.893	1765	137.409	2765	126.816
Entre 1 y 2 años	0766	122.045	1766	123.747	2766	130.100
Entre 2 y 3 años	0767	124.943	1767	126.715	2767	133.246
Entre 3 y 4 años	0768	127.884	1768	129.788	2768	136.371
Entre 4 y 5 años	0769	130.671	1769	132.844	2769	139.527
Entre 5 y 10 años	0770	688.544	1770	703.305	2770	733.248
Superior a 10 años	0771	1.773.668	1771	1.908.483	2771	2.100.692
Total	0772	3.100.646	1772	3.262.292	2772	3.500.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	21,67	1773	22,17	2773	20,20

TDA SABADELL RMBS 5, FT

	S.05.3
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo		Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 20/02/2025	
1	Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	175.000	1775	175.000	2775	175.000
1.1	Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	175.000	1776	175.000	2776	175.000
1.2	Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	5,64	1777	5,36	2777	5,00
1.3	Denominación de la contrapartida	0778	Banco sabadell, S.A.	1778	Banco sabadell, S.A.	2778	Banco sabadell, S.A.
1.4	Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5	Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2	Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781		1781		2781	
2.1	Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782		1782		2782	
2.2	Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	
2.3	Rating de la contrapartida	0784		1784		2784	
2.4	Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3	Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786		1786		2786	
3.1	Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787		1787		2787	
3.2	Denominación de la entidad avalista	0788		1788		2788	
3.3	Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4	Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4	Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1	Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	97,74	1792	97,85	2792	98,00
5	Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1	Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2	Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3	Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

TDA SABADELL RMBS 5, FT

S.05.3									
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT									
Denominación del compartimento:									
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.									
Estados agregados: NO									
Fecha: 30/06/2026									

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS			Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)						Otras características
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 20/02/2025		
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806		1806		2806		
Permuta Financiera de Intereses	Banco Sabadell, S.A.	TRIMESTRAL	Tipos Interés de la cartera	Ver Nota S.06	Tipo Rerefencia de los Bonos + MMP + 0,5%	Ver Nota S.06	245.131		245.131				
Total							0808	245.131	0809	245.131	0810		

S.05.3													
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT													
Denominación del compartimento:													
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.													
Estados agregados: NO													
Fecha: 30/06/2026													

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
Naturaleza riesgo cubierto	Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 20/02/2025		Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 20/02/2025			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4															
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT															
Denominación del compartimento:															
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.															
Estados agregados: NO															
Fecha: 30/06/2026															

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

					Importe impagado acumulado				Ratio						Ref. Folleto	
Concepto	Meses impago		Días impago		Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Última Fecha Pago			
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	6.024	7006	3.564	7009	0,20	7012	0,11	7015	0,14		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	6.024	7008	3.564	7011	0,20	7014	0,11	7017	0,14	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	1.249	7024	0	7027	0,04	7030	0,00	7033	0,02		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	1.249	7026	0	7029	0,04	7032	0,00	7035	0,02	7036	Glosario de Términos

	Ratio						Ref. Folleto	
Otras ratios relevantes	Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Última Fecha Pago			
	0850		1850		2850		3850	
	0851		1851		2851		3851	
	0852		1852		2852		3852	
	0853		1853		2853		3853	

TDA SABADELL RMBS 5, FT

	S.05.4
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		5,64	5,50	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento
Contiene  Información adicional en fichero adjunto

TDA SABADELL RMBS 5, FT

S.05.5																
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT																
Denominación del compartimento:																
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.																
Estados agregados: NO																
Fecha: 30/06/2026																

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862		2862	Saldo nominal pendiente de cobro	3862	0,004	4862	45	5862	18	6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	Banco Sabadel, S.A.	1863		2863	Saldo nominal pendiente de cobro al final del periodo	3863	0,010	4863		5863		6863	TRIMESTRAL	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	Banco Sabadel, S.A.	1864	2	2864		3864		4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

	S.05.5
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo												Total
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872													
Margen de intereses	0873													
Deterioro de activos financieros (neto)	0874													
Dotaciones a provisiones (neto)	0875													
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876													
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877													
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878													
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879													
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880													
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881													
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882													
Comisión variable pagada	0883													
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884													

TDA SABADELL RMBS 5, FT

	S.05.5
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo												Total
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885	26/02/2026	26/05/2026											
Saldo inicial	0886	175.002	175.000											
Cobros del periodo	0887	102.095	101.514											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-181	-125											
Pagos por derivados	0889	6.183	6.180											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-175.000	-175.000											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-104.223	-102.847											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-3.877	-4.722											
Resto pagos/retenciones	0893	0	0											
Saldo disponible	0894	0	0											
Liquidación de comisión variable	0895	0	0											0

	S.06
Denominación Fondo: TDA SABADELL RMBS 5, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

NOTAS EXPLICATIVAS	
Contiene  Información adicional en fichero adjunto	

INFORME DE AUDITOR

INFORME SOBRE EL CUMPLIMIENTO DE LAS POLÍTICAS DE GESTIÓN DE ACTIVOS Y DE RIESGOS
