

TDA IBERCAJA 5 - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACIÓN DEL PERIODO: 26/11/21 - 28/02/22

| | Euros |
|--|----------------------|
| I. Situación al 26/11/21: | 6.000.000,00 |
| Saldo inicial Cta. Reinversión | 6.000.000,00 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 11.189.224,12 |
| Principal: | |
| Según calendario hasta 31/01/22: | 7.284.728,66 |
| Amort. Anticipada hasta 31/01/22: | 3.728.829,76 |
| Intereses: | 175.665,70 |
| III. Subtotal a Cuenta de reinversión (I + II): | 17.189.224,12 |
| IV. Total intereses de la reinversión: | -16.641,86 |
| Intereses de la Cta. De Reinversión | -16.356,61 |
| Intereses de la Cta. De Tesorería | -285,25 |
| V. Recursos disponibles (III + IV): | 17.172.582,26 |
| VI. Gastos: | 26.055,64 |
| VII. Liquidación SWAP: | -137.895,20 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (Fondo): | 175.665,70 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Banco Santander): | 37.770,50 |
| VIII. Pago a los Bonos: | 9.995.378,96 |
| Bonos A2: | |
| Intereses correspondientes al 28/02/22: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 28/02/22: | 9.041.046,00 |
| Bonos B: | |
| Intereses correspondientes al 28/02/22: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 28/02/22: | 597.174,12 |
| Bonos C: | |
| Intereses correspondientes al 28/02/22: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 28/02/22: | 199.058,04 |
| Bonos D: | |
| Intereses correspondientes al 28/02/22: | 9.927,84 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 1.886,29 |
| Amortización correspondiente al 28/02/22: | 98.556,96 |
| Bonos E: | |
| Intereses correspondientes al 28/02/22: | 49.616,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 9.427,04 |
| Amortización correspondiente al 28/02/22: | 0,00 |
| Reinversión o devolución de las retenciones: | -11.313,33 |
| IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII): | 7.013.252,46 |
| Distribución del saldo disponible: | |
| Fondo de Reserva 26/11/21: | 6.000.000,00 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 0,00 |
| Otros recursos: | 0,00 |
| Margen de intermediación financiera | 1.013.252,46 |
| Fondo de Reserva 28/02/22: | 6.000.000,00 |

Destinatario: CNMV, AIAF



Nº: 653/22

Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

TDA IBERCAJA 5 liq.trimFeb22

TDA IBERCAJA 5

Fondo de Titulización de Activos

INFORMACION A LOS INVERSORES

Fecha de pago: 28 de Febrero de 2022

| I. BONOS A2 ES0377967015 | | |
|---|--------------------|--------------|
| | Sobre 10020 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (17/05/2007): | 1.002.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 249.669.542,40 € | 24.917,12 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 9.041.046,00 € | 902,30 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 240.628.496,40 € | 24.014,82 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 24,014820% | 24,014820% |

| II. BONOS B ES0377967023 | | |
|---|-----------------|--------------|
| | Sobre 324 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (17/05/2007): | 32.400.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 16.491.036,24 € | 50.898,26 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 597.174,12 € | 1.843,13 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 15.893.862,12 € | 49.055,13 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 49,055130% | 49,055130% |

| III. BONOS C ES0377967031 | | |
|---|-----------------|--------------|
| | Sobre 108 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (17/05/2007): | 10.800.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 5.497.012,08 € | 50.898,26 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 199.058,04 € | 1.843,13 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 5.297.954,04 € | 49.055,13 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 49,055130% | 49,055130% |

| IV. BONOS D ES0377967049 | | |
|---|----------------|--------------|
| | Sobre 48 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (17/05/2007): | 4.800.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 2.721.661,92 € | 56.701,29 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 9.927,84 € | 206,83 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 98.556,96 € | 2.053,27 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 2.623.104,96 € | 54.648,02 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 54,648020% | 54,648020% |

| V. BONOS E ES0377967056 | | |
|---|----------------|--------------|
| | Sobre 70 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (17/05/2007): | 7.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 6.000.000,30 € | 85.714,29 € |
| 3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago: | 49.616,00 € | 708,80 € |
| 4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago: | 49.616,00 € | 708,80 € |
| 5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 6.000.000,30 € | 85.714,29 € |
| 8. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 85,714290% | 85,714290% |

| VII. EL FONDO | | Importes en euros |
|--|--|-------------------|
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/01/22: | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas: | | 264.443.434,70 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas: | | 2.202.856,66 € |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas: | | 264.632.741,47 € |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidas: | | 3.847.740,18 € |
| 2. Amortización del período 31/10/21 a 31/01/22: | | |
| a) Según calendario: | | 7.284.728,66 € |
| b) Amortización anticipada hasta 31/01/22: | | 3.728.829,76 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | |
| a) Último año: | | 4,60% |
| b) Último semestre: | | 5,01% |
| c) Último trimestre: | | 5,33% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | | |
| 0,53% | | |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 17 meses: | | |
| 0,16% | | |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | | |
| 1,43% | | |
| 7. Nivel de Impago (2): | | |
| 0,31% | | |

(1) Saldo pendiente de las participaciones hipotecarias fallidas según definición del Folleto de Emisión (retraso de 18 meses y otras causas), sobre el saldo pendiente total.

(2) Importe de principal de las Participaciones Hipotecarias impagadas durante el período de tiempo comprendido entre el segundo y el noveno mes inmediatamente anteriores a la Fecha de Pago respecto al saldo nominal pendiente de las Participaciones Hipotecarias

Destinatarios: Cedente, CNMV; AIAF.



Nº: 654/22

Orense, 58
28020 Madrid
Tel.: 917020808

<http://www.tda-sgft.com>
TDA IBERCAJA 5\Infoinver.trim\Feb22

TDA IBERCAJA 5, FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS
INFORMACIÓN CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 26/11/21-28/02/22
I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|--|---|
| Fecha de Constitución del Fondo | 11 de Mayo de 2007 |
| Fecha Emisión BTH | 11 de Mayo de 2007 |
| Fecha Final Amortización Bonos (4,6%TAA) | 26 de febrero de 2027 |
| Sociedad Gestora | Titulización de Activos, SGFT,S.A. |
| Emisor de Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca | Ibercaja Banco |
| Agente de Pagos | SOCIETE GENERALE |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencia de Calificación | Moody's, Standard & Poor's |
| Calificación | Bono A2: (M) Aa1 (sf) / (S&P) AA+ (sf) Bono B: (M) Baa2 (sf) / (S&P) A+ (sf) Bono C: (M) B1 (sf) / (S&P) A- (sf) Bono D: (M) Caa2 (sf) / (S&P) BBB- (sf) Bono E: (S&P) D (sf) |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Nombre | Bonos de Titulización TDA IBERCAJA 5 |
|---|--------------------------------------|
| Serie A2: | |
| Código ISIN | ES0377967015 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 1.002.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 240.628.496,40 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 24.014,82 Euros |

TDA IBERCAJA 5\INFO.trim\Feb22

| II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.) | |
|--|---|
| Nombre | Bonos de Titulización TDA IBERCAJA 5 |
| Serie B: | |
| Código ISIN | ES0377967023 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 32.400.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 15.893.862,12 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 49.055,13 Euros |
| Serie C: | |
| Código ISIN | ES0377967031 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 10.800.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 5.297.954,04 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 49.055,13 Euros |
| Serie D: | |
| Código ISIN | ES0377967049 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 4.800.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 2.623.104,96 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 54.648,02 Euros |
| Serie E: | |
| Código ISIN | ES0377967056 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 7.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 6.000.000,30 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 85.714,29 Euros |

| III. INFORMACIÓN INCLUIDA |
|--|
| * Liquidación del Período:26/11/21-28/02/22 |
| * Flujos de Caja del Período:26/11/21-28/02/22 |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 28 de Febrero de 2022 |

TDA IBERCAJA 5\INFO.trim\Feb22

TDA IBERCAJA 5**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO 26/11/21 - 28/02/22:**

| | Euros | |
|---|----------------------|----------------------|
| | Ingresos | Pagos |
| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | | |
| Amortización Bonos Titulización Hip. | | 9.935.835,12 |
| Amortización Participaciones Hip. | 11.013.558,42 | |
| Amortización Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados a los BTH | | 59.543,84 |
| Intereses recibidos de las PHs | 175.665,70 | |
| Intereses Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| Intereses Inversiones Temporales | -16.641,86 | |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones y gastos: | | 26.055,64 |
| Neto SWAP a favor de la Parte B (Banco Santander) | | 137.895,20 |
| Margen de intermediación financiera | | 1.013.252,46 |
| Total Ingresos/Pagos | 11.172.582,26 | 11.172.582,26 |
| Saldo inicial 26/11/21 | 6.000.000,00 | |
| A Inversiones Temporales | | 6.000.000,00 |
| Otros Recursos | | 0,00 |
| Total | 17.172.582,26 | 17.172.582,26 |
| Retenciones practicadas el 28/02/2022 | 11.313,33 | |
| A Inversiones Temporales | | 11.313,33 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 660/22**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA IBERCAJA 5fluj.trim\Feb22