

TDA 22-MIXTO - Fondo de Titulización de Activos
LIQUIDACION DEL PERIODO: 30/06/25 - 29/09/25

| EUROS | GRUPO 1 | GRUPO 2 | TOTAL FONDO |
|---|-------------------|---------------------|---------------------|
| I. Situación al 30/06/25 : | 4,55 | 2.879.200,00 | 2.879.204,55 |
| Saldo inicial Cta. Tesorería | 4,55 | 2.879.200,00 | 2.879.204,55 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 667.356,32 | 1.119.492,80 | 1.786.849,12 |
| Principal: | | | |
| Según calendario hasta 31/08/25: | 366.087,18 | 545.704,70 | 911.791,88 |
| Amort. Anticipada hasta 31/08/25: | 171.635,19 | 372.915,38 | 544.550,57 |
| Intereses: | 88.515,04 | 176.281,90 | 264.796,94 |
| Ingreso por venta de inmuebles | 41.118,91 | 24.590,82 | 65.709,73 |
| III. Subtotal Recursos disponibles (I + II): | 667.360,87 | 3.998.692,80 | 4.666.053,67 |
| IV. Total intereses de la reinversión: | 2.685,54 | 14.593,17 | 17.278,71 |
| Intereses de la Cta. De Tesorería | 1.490,58 | 12.579,05 | 14.069,63 |
| Intereses de la Cta. De Cobros | 1.194,96 | 2.014,12 | 3.209,08 |
| V. Total Recursos disponibles (III + IV): | 670.046,41 | 4.013.285,97 | 4.683.332,38 |
| VI. Varios: | 55.368,75 | 30.596,32 | 85.965,07 |
| VII. Liquidación SWAP: | -24.178,39 | -27.851,27 | -52.029,66 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (JP Morgan Chase): | 49.799,43 | 100.162,85 | 149.962,28 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo): | 73.977,82 | 128.014,12 | 201.991,94 |
| VIII. Pago a los Bonos: | 590.497,55 | 1.077.249,49 | 1.667.747,04 |
| Bonos A1b / A2b: | | | |
| Intereses correspondientes al 29/09/25: | 13.603,49 | 0,00 | 13.603,49 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -2.584,66 | 0,00 | -2.584,66 |
| Amortización correspondiente al 29/09/25: | 486.634,72 | 0,00 | 486.634,72 |
| Bonos B1 / B2: | | | |
| Intereses correspondientes al 29/09/25: | 27.325,27 | 63.928,86 | 91.254,13 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -5.191,80 | -12.146,49 | -17.338,29 |
| Amortización correspondiente al 29/09/25: | 0,00 | 909.559,56 | 909.559,56 |
| Bonos C1 / C2: | | | |
| Intereses correspondientes al 29/09/25: | 25.533,08 | 34.501,68 | 60.034,76 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -4.851,29 | -6.555,32 | -11.406,61 |
| Amortización correspondiente al 29/09/25: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Bonos D1 / D2: | | | |
| Intereses correspondientes al 29/09/25: | 37.400,99 | 69.259,39 | 106.660,38 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -7.106,19 | -13.159,29 | -20.265,48 |
| Amortización correspondiente al 29/09/25: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Reinversión o devolución de las retenciones: | 19.733,94 | 31.861,10 | 51.595,04 |
| IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII): | 1,72 | 2.877.588,89 | 2.877.590,61 |
| Distribución del saldo disponible: | | | |
| Fondo de Reserva (30/06/25) | 0,00 | 2.879.200,00 | 2.879.200,00 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 0,00 | -1.611,11 | -1.611,11 |
| Intereses préstamo subordinado G.I. pagados | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización préstamo subordinado G.I. | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Intereses préstamo subordinado Desfase pagados | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización préstamo subordinado Desfase | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización Préstamo Participativo | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Recursos para el próximo pago | 1,72 | 0,00 | 1,72 |
| Margen de Intermediación Financiera | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Fondo de Reserva (29/09/25) | 0,00 | 2.877.588,89 | 2.877.588,89 |

| | | | |
|--|----------|-----------|-----------|
| Importe préstamos fallidos del periodo: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Principal vencido y no cobrado no fallido: | 265,27 | 615,46 | 880,73 |
| Trimestre anterior | 6.562,83 | 10.230,50 | 16.793,33 |
| Trimestre actual | 6.828,10 | 10.845,96 | 17.674,06 |



Nº: 2860/25

Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

http://www.tda-sgft.com

TDA22liq.trim1Sep25

INFORMACION A LOS INVERSORES (GRUPO 1)

FECHA DE PAGO: 29 de Septiembre de 2025

| I. BONOS A1b ES0377983012 | | Sobre 572 bonos | Por Bono |
|--|--|-------------------|----------------|
| 1. Saldo inicial (9/12/04): | | 57.200.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | | 2.457.352,04 € | 4.296,07 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | | 13.603,49 € | 23,7823 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | | 486.634,72 € | 850,76 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | | 1.970.717,32 € | 3.445,31 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | | 3,445310% | 3,445310% |
| II. BONOS B1 ES0377983020 | | Sobre 46 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (9/12/04): | | 4.600.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | | 4.600.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | | 27.325,27 € | 594,0278 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | | 4.600.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | | 100,000000% | 100,000000% |
| III. BONOS C1 ES0377983038 | | Sobre 37 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (9/12/04): | | 3.700.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | | 3.700.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | | 25.533,08 € | 690,0833 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | | 3.700.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | | 100,000000% | 100,000000% |
| IV. BONOS D1 ES0377983046 | | Sobre 27 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (9/12/04): | | 2.700.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | | 2.700.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | | 37.400,99 € | 1.385,2222 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | | 2.700.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | | 100,000000% | 100,000000% |
| V. EL FONDO | | Importes en euros | |
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/08/25: | | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias No Fallidas: | | | 8.640.571,26 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias Fallidas: | | | 4.352.600,08 € |
| c) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias No Fallidas: | | | 8.647.399,36 € |
| d) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias Fallidas: | | | 8.209.470,42 € |
| 2. Amortización del período 31/05/25 a 31/08/25: | | | |
| a) Según calendario: | | | 366.087,18 € |
| b) Amortización anticipada hasta 31/08/25: | | | 171.635,19 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | | |
| b) Último año: | | | 4,25% |
| c) Último semestre: | | | 4,83% |
| d) Último trimestre: | | | 7,29% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | | | |
| | | | 0,79% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses: | | | |
| | | | 0,00% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | | | |
| | | | 48,70% |
| 7. Nivel de Impago(2): | | | |
| | | | 0,79% |

(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 no fallidas 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: 2861/25

Titulización de Activos, (SGFT),S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA22\Infoinver.trim\Sep25

INFORMACION A LOS INVERSORES (GRUPO 2)

FECHA DE PAGO: 29 de Septiembre de 2025

| I. BONOS B2 ES0377983079 | | Sobre 146 bonos | Por Bono |
|--|-----------------|--------------------------|-----------------|
| 1. Saldo inicial (9/12/04): | 14.600.000,00 € | | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 10.407.630,44 € | | 71.285,14 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 63.928,86 € | | 437,8690 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 909.559,56 € | | 6.229,86 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 9.498.070,88 € | | 65.055,28 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 65,055280% | | 65,05528% |
| II. BONOS C2 ES0377983087 | | Sobre 60 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (9/12/04): | 6.000.000,00 € | | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 4.822.975,20 € | | 80.382,92 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 34.501,68 € | | 575,0281 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 4.822.975,20 € | | 80.382,92 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 80,382920% | | 80,382920% |
| III. BONOS D2 ES0377983095 | | Sobre 57 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (9/12/04): | 5.700.000,00 € | | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 4.581.826,44 € | | 80.382,92 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 69.259,39 € | | 1.215,0772 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 4.581.826,44 € | | 80.382,92 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 80,382920% | | 80,382920% |
| IV. EL FONDO | | Importes en euros | |
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/08/25: | | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias No Fallidas: | | | 18.902.872,74 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias Fallidas: | | | 2.624.939,31 € |
| c) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias No Fallidas: | | | 18.913.718,70 € |
| d) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias Fallidas: | | | 5.020.951,25 € |
| 2. Amortización del periodo 31/05/25 a 31/08/25: | | | |
| a) Según calendario: | | | 545.704,70 € |
| b) Amortización anticipada hasta 31/08/25: | | | 372.915,38 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | | |
| b) Ultimo año: | | | 5,92% |
| c) Ultimo semestre: | | | 6,89% |
| d) Ultimo trimestre: | | | 7,32% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | | | |
| | | | 0,27% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses: | | | |
| | | | 0,41% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | | | |
| | | | 20,98% |
| 7. Nivel de Impago(2): | | | |
| | | | 0,68% |

(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 no fallidas 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: 2861/25

Titulización de Activos, (SGFT),S.A.

**Oronse, 58
28020 Madrid
Tel.:917020808**

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

TDA22\Infoinver.trim\Sep25

TDA 22-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 30/06/25-29/09/25
I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|---|---|
| Fecha de Constitución del Fondo | 1 de diciembre de 2004 |
| Fecha Emisión BTH | 1 de diciembre de 2004 |
| Fecha Final Amortización BTH: (4,25% TAA Grupo 1 / 5,92% TAA Grupo 2) | 29 de diciembre de 2025 |
| Sociedad Gestora | Titulización de Activos, SGFT,S.A. |
| Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca | BANKIA (Caja Granada), CaixaBank (Caja Navarra), Credifimo |
| | BBVA (Caixa Terrasa), BBVA (Caixa Tarragona) |
| Agente de Pagos | BNP PARIBAS |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencia de Calificación | Moody's Investors Service |
| Calificación | Bono A1b: Aa1 (sf) Bono B1: Baa1 (sf) Bono B2: Aa1 (sf) Bono C1: Caa3 (sf) Bono C2: Aa1 (sf) Bono D1: Ca (sf) Bono D2: Ba2 (sf) |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Nombre | Bonos de Titulización TDA 22- MIXTO |
|---|-------------------------------------|
| Serie A1b: | |
| Código ISIN | ES0377983012 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 57.200.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 1.970.717,32 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 3.445,31 Euros |
| Serie B1: | |
| Código ISIN | ES0377983020 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 4.600.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 4.600.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |
| Serie C1: | |
| Código ISIN | ES0377983038 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 3.700.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 3.700.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |
| Serie D1: | |
| Código ISIN | ES 0377983046 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 2.700.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 2.700.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)

| Nombre | Bonos de Titulización TDA 22- MIXTO |
|---|-------------------------------------|
| Serie B2: | |
| Código ISIN | ES0377983079 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 14.600.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 9.498.070,88 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 65.055,28 Euros |
| Serie C2: | |
| Código ISIN | ES 0377983087 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 6.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 4.822.975,20 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 80.382,92 Euros |
| Serie D2: | |
| Código ISIN | ES 0377983095 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 5.700.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 4.581.826,44 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 80.382,92 Euros |

III. INFORMACION INCLUIDA

* Liquidación del Período:30/06/25-29/09/25

* Flujos de Caja del Período:30/06/25-29/09/25

* Información a los inversores. Fecha de Pago: 29 de Septiembre de 2025

TDA 22-MIXTO

Fondo de Titulización de Activos

FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 30/06/25 - 29/09/25

| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | Euros | |
|--------------------------------------|---------------------|---------------------|
| | Ingresos | Pagos |
| Amortización Bonos Titulización Hip. | | 1.396.194,28 |
| Amortización Participaciones Hip. | 1.456.342,45 | |
| Amortización Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| Ingresos por venta de inmuebles | 65.709,73 | |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados a los BTH | | 271.552,76 |
| Intereses recibidos de las PHs | 264.796,94 | |
| Intereses Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| Intereses Inversiones Temporales | 17.278,71 | |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones Periódicas: | | 85.965,07 |
| Neto SWAP | | 52.029,66 |
| Total Ingresos/Pagos | 1.804.127,83 | 1.805.741,77 |
| Saldo inicial 30/06/25 | 2.879.204,55 | |
| A Inversiones Temporales | | 2.877.590,61 |
| Total | 4.683.332,38 | 4.683.332,38 |
| Retenciones practicadas el 29/09/25 | 51.595,04 | |
| A Inversiones Temporales | | 51.595,04 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 2867/25**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA22 Mixto\fluj.trim\Sep25