

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: TDA 22 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 7118
NIF Fondo: V84175744
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento: 7118
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: 30/06/2024

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)

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	11.129	1001	12.151
I. Activos financieros a largo plazo	0002	11.129	1002	12.151
1. Activos titulizados	0003	11.129	1003	12.151
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	9.825	1004	10.661
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	0	1005	0
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	1.305	1025	1.489
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	0	1027	0
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
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

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	6.838	1041	7.265
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	2.874	1042	3.170
V. Activos financieros a corto plazo	0043	3.644	1043	3.731
1. Activos titulizados	0044	3.028	1044	3.096
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	1.490	1045	1.532
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	0	1046	0
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	32	1065	36
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	2	1066	2
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	1.478	1067	1.499
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	25	1068	27
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	0	1069	0
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	616	1074	636
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	616	1077	634
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	2
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
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	320	1085	364
1. Tesorería	0086	320	1086	364
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	17.967	1088	19.416

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	13.012	1089	13.300
I. Provisiones a largo plazo	0090	395	1090	683
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	395	1092	683
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	12.617	1094	12.617
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	11.000	1095	11.000
1.1 Series no subordinadas	0096	0	1096	0
1.2 Series subordinadas	0097	11.000	1097	11.000
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	1.409	1101	1.409
2.1 Préstamo subordinado	0102	1.409	1102	1.409
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	208	1108	208
3.1 Derivados de cobertura	0109	208	1109	208
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

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) PASIVO CORRIENTE	0117	5.208	1117	6.368
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	5.144	1123	6.319
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	4.582	1124	5.793
1.1 Series no subordinadas	0125	4.578	1125	5.786
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	4	1128	7
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	516	1131	482
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	0	1136	1
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	516	1137	481
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	45	1139	45
3.1 Derivados de cobertura	0140	45	1140	45
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	64	1148	48
1. Comisiones	0149	0	1149	0
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	0	1150	0
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
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	64	1157	48
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-252	1158	-252
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-252	1160	-252
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	17.967	1162	19.416

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2024		Acumulado anterior 30/06/2023
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	148	1201	144	2201	303	3201	240
1.1 Activos titulizados	0202	142	1202	138	2202	290	3202	230
1.2 Otros activos financieros	0203	6	1203	5	2203	13	3203	10
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-213	1204	-196	2204	-436	3204	-353
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-196	1205	-182	2205	-401	3205	-328
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-17	1206	-14	2206	-35	3206	-25
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	3	1208	-9	2208	3	3208	-35
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-62	1209	-62	2209	-130	3209	-147
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	-74	1217	-64	2217	-138	3217	-120
7.1 Servicios exteriores	0218	-60	1218	-49	2218	-108	3218	-91
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-60	1219	-49	2219	-108	3219	-91
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	-15	1224	-15	2224	-29	3224	-29
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-15	1225	-15	2225	-29	3225	-29
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227	0	3227	0
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	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	3	1231	36	2231	4	3231	37
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	3	1232	36	2232	4	3232	37
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	136	1234	98	2234	289	3234	239
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	136	1236	98	2236	289	3236	239
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	-3	1238	-9	2238	-25	3238	-9
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

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2024		Acumulado anterior 30/06/2023
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-61	1300	-48	2300	-104	3300	-137
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-47	1301	-33	2301	-75	3301	-108
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	145	1302	136	2302	294	3302	228
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-199	1303	-184	2303	-404	3303	-328
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	3	1304	0	2304	3	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	-9	2305	0	3305	-35
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	4	1306	8	2306	15	3306	12
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	16	2308	17	3308	16
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-15	1309	-15	2309	-30	3309	-30
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-15	1310	-15	2310	-30	3310	-30
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	0
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	-153	1322	409	2322	60	3322	344
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	-94	1325	458	2325	168	3325	434
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	157	1326	546	2326	720	3326	1.076
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	146	1327	286	2327	200	3327	644
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	63	1328	113	2328	182	3328	169
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	3	1329	0	2329	4	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	32	1330	50	2330	270	3330	50
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-494	1331	-538	2331	-1.208	3331	-1.505
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-60	1332	-49	2332	-108	3332	-90
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-60	1336	-49	2336	-108	3336	-90
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-215	1337	361	2337	-44	3337	206
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	535	1338	137	2338	364	3338	292
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	320	1339	498	2339	320	3339	498

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2024		Acumulado anterior 30/06/2023
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 período	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	3	1357	-9	2357	3	3357	-35
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	3	1358	-9	2358	3	3358	-35
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	-3	1360	9	2360	-3	3360	35
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361	0	3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	0	1362	0	2362	0	3362	1
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 período	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 período	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

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: BBVA, CAIXABANK, CREDIFIMO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2024								Situación cierre anual anterior 31/12/2023								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	19,74	0400	16,02	0420	0,25	0440	3,78	1380	19,68	1400	15,07	1420	0,17	1440	6,15	2380	0,00	2400	0,00	2420	0,00	2440	10,00
Certificados de transmisión de hipoteca	0381		0401		0421		0441		1381		1401		1421		1441		2381		2401		2421		2441	
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	

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: BBVA, CAIXABANK, CREDIFIMO

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	16	0467	4	0474	1	0481	0	0488	4	0495	276	0502	0	0509	280
De 1 a 3 meses	0461	5	0468	4	0475	2	0482	0	0489	5	0496	260	0503	0	0510	265
De 3 a 6 meses	0462	0	0469	0	0476	0	0483	0	0490	0	0497	0	0504	0	0511	0
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	1	0477	0	0484	0	0491	1	0498	6	0505	0	0512	7
De 9 a 12 meses	0464	0	0471	0	0478	0	0485	0	0492	0	0499	0	0506	0	0513	0
Más de 12 meses	0465	33	0472	1.293	0479	25	0486	615	0493	1.933	0500	1.483	0507	0	0514	3.416
Total	0466	55	0473	1.302	0480	27	0487	615	0494	1.944	0501	2.024	0508	0	1515	3.968

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	16	0522	4	0529	1	0536	0	0543	4	0550	276	0557	0	0564	280	0571	1.860	0578	1.860	0584	15,07
De 1 a 3 meses	0516	5	0523	4	0530	2	0537	0	0544	5	0551	260	0558	0	0565	265	0572	857	0579	857	0585	30,94
De 3 a 6 meses	0517	0	0524	0	0531	0	0538	0	0545	0	0552	0	0559	0	0566	0	0573	0	0580	0	0586	0,00
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	1	0532	0	0539	0	0546	1	0553	6	0560	0	0567	7	0574	56	0581	56	0587	12,89
De 9 a 12 meses	0519	0	0526	0	0533	0	0540	0	0547	0	0554	0	0561	0	0568	0	0575	0	0582	0	0588	0,00
Más de 12 meses	0520	33	0527	1.293	0534	25	0541	615	0548	1.933	0555	1.483	0562	0	0569	3.416	0576	5.451	0583	5.451	0589	62,66
Total	0521	55	0528	1.302	0535	27	0542	615	0549	1.944	0556	2.024	0563	0	0570	3.968	0577	8.224			0590	48,26

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: BBVA, CAIXABANK, CREDIFIMO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 30/11/2004	
Inferior a 1 año	0600	194	1600	234	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	114	1601	113	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	175	1602	289	2602	85
Entre 3 y 4 años	0603	1.095	1603	698	2603	244
Entre 4 y 5 años	0604	818	1604	1.345	2604	260
Entre 5 y 10 años	0605	11.669	1605	11.000	2605	12.738
Superior a 10 años	0606	33	1606	1.503	2606	272.673
Total	0607	14.097	1607	15.182	2607	286.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	7,98	1608	8,31	2608	22,64

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 30/11/2004	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	21,25	1609	20,78	2609	2,48

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: BBVA, CAIXABANK, CREDIFIMO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 30/11/2004			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	430	0630	11.741	1620	446	1630	12.739	2620	372	2630	20.969
40% - 60%	0621	8	0631	604	1621	8	1631	644	2621	1.132	2631	77.909
60% - 80%	0622	17	0632	1.752	1622	18	1632	1.800	2622	2.061	2632	186.449
80% - 100%	0623	0	0633	0	1623	0	1633	0	2623	4	2633	432
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	2	2634	241
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	455	0638	14.097	1628	472	1638	15.182	2628	3.571	2638	286.000
Media ponderada (%)	0639	31,45	0649		1639	31,87	1649		2639	64,26	2649	

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: BBVA, CAIXABANK, CREDIFIMO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 30/11/2004	
Tipo de interés medio ponderado	0650	4,66	1650	3,72	2650	3,71
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,72	1651	5,86	2651	6,00
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,14	1652	0,14	2652	2,25

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: BBVA, CAIXABANK, CREDIFIMO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 30/11/2004			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	198	0683	4.302	1660	208	1683	4.791	2660	2.328	2683	155.799
Aragón	0661	0	0684	0	1661	0	1684	0	2661	0	2684	0
Asturias	0662	0	0685	0	1662	0	1685	0	2662	0	2685	0
Baleares	0663	0	0686	0	1663	0	1686	0	2663	0	2686	0
Canarias	0664	46	0687	2.209	1664	47	1687	2.323	2664	205	2687	20.189
Cantabria	0665	0	0688	0	1665	0	1688	0	2665	1	2688	83
Castilla-León	0666	0	0689	0	1666	0	1689	0	2666	0	2689	0
Castilla La Mancha	0667	4	0690	227	1667	4	1690	237	2667	31	2690	3.466
Cataluña	0668	143	0691	3.710	1668	149	1691	4.093	2668	580	2691	56.633
Ceuta	0669	0	0692	0	1669	0	1692	0	2669	0	2692	0
Extremadura	0670	12	0693	413	1670	12	1693	423	2670	52	2693	3.955
Galicia	0671	1	0694	51	1671	1	1694	53	2671	2	2694	161
Madrid	0672	48	0695	3.104	1672	48	1695	3.176	2672	344	2695	43.513
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	3	2696	288
Murcia	0674	0	0697	0	1674	0	1697	0	2674	0	2697	0
Navarra	0675	0	0698	0	1675	0	1698	0	2675	0	2698	0
La Rioja	0676	0	0699	0	1676	0	1699	0	2676	0	2699	0
Comunidad Valenciana	0677	3	0700	82	1677	3	1700	88	2677	25	2700	1.913
País Vasco	0678	0	0701	0	1678	0	1701	0	2678	0	2701	0
Total España	0679	455	0702	14.097	1679	472	1702	15.182	2679	3.571	2702	286.000
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	455	0705	14.097	1682	472	1705	15.182	2682	3.571	2705	286.000

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: BBVA, CAIXABANK, CREDIFIMO

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 30/11/2004			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	7,09			1710	6,54			2710	1,02		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2024			Situación cierre anual anterior 31/12/2023			Situación inicial 30/11/2004					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0377983004	Serie A1a	2.178	0	0	2.178	0	0	2.178	100.000	217.800			
ES0377983012	Serie A1b	572	8.004	4.578	572	10.115	5.786	572	100.000	57.200			
ES0377983020	Serie B1	46	100.000	4.600	46	100.000	4.600	46	100.000	4.600			
ES0377983038	Serie C1	37	100.000	3.700	37	100.000	3.700	37	100.000	3.700			
ES0377983046	Serie D1	27	100.000	2.700	27	100.000	2.700	27	100.000	2.700			
ES0377983103	Valor IO-1	572	0	0	572	0	0	572	4.330	2.477			
Total		0723	3.432	0724	15.578	1723	3.432	1724	16.786	2723	3.432	2724	288.477

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2024

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		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
									0730	0731	0732	0733			0734	0735	0742
ES0377983004	Serie A1a	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
ES0377983012	Serie A1b	NS	EURIBOR 3 m	0,21	3,93	1	0	NO	4.578	0	0	4.579	0	0			
ES0377983020	Serie B1	S	EURIBOR 3 m	0,37	4,09	1	0	NO	4.600	0	0	4.601	0	0			
ES0377983038	Serie C1	S	EURIBOR 3 m	0,75	4,47	1	0	NO	3.700	0	0	3.701	0	0			
ES0377983046	Serie D1	S	EURIBOR 3 m	3,50	7,22	1	0	NO	2.700	0	0	2.701	0	0			
ES0377983103	Valor IO-1	NS	1,5% del SNP Bono A1b	0,00	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
Total						0740	4	0741	0	0743	15.578	0744	0	0745	15.582	0746	0

	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 30/11/2004	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	4,89	0748	4,27	0749	2,37

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2024								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2023							
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								
ES0377983004	Serie A1a	0	217.800	0	18.668	0	217.800	0	18.668	0	217.800	0	18.668	0	18.668		
ES0377983012	Serie A1b	494	52.622	53	12.776	538	50.095	63	12.526	538	50.095	63	12.526	63	12.526		
ES0377983020	Serie B1	0	0	50	1.378	0	0	40	1.182	0	0	40	1.182	40	1.182		
ES0377983038	Serie C1	0	0	44	1.376	0	0	36	1.203	0	0	36	1.203	36	1.203		
ES0377983046	Serie D1	0	0	51	2.477	0	0	45	2.276	0	0	45	2.276	45	2.276		
ES0377983103	Valor IO-1	0	2.477	0	145	0	2.477	0	145	0	2.477	0	145	0	145		
Total		0754	494	0755	272.898	0756	199	0757	36.820	1754	538	1755	270.371	1756	184	1757	36.000

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2024

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		
				Situación actual 30/06/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 30/11/2004
				0762	0763	0764
ES0377983004	Serie A1a	20/05/2011	MDY	A3	A3	Aaa
ES0377983012	Serie A1b	29/06/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0377983020	Serie B1	14/05/2016	MDY	Baa3	Baa3	A2
ES0377983038	Serie C1	24/02/2020	MDY	Caa3	Caa3	Baa2
ES0377983046	Serie D1	24/02/2020	MDY	Ca	Ca	Ba2
ES0377983103	Valor IO-1	01/12/2004	MDY	Aaa	Aaa	Aaa

S.05.2
Denominación Fondo: TDA 22, FTA
Denominación del compartimento: 7118
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2024
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 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 30/11/2004	
Inferior a 1 año	0765	15.578	1765	16.786	2765	12.414
Entre 1 y 2 años	0766	0	1766	0	2766	11.350
Entre 2 y 3 años	0767	0	1767	0	2767	11.725
Entre 3 y 4 años	0768	0	1768	0	2768	11.416
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769	0	2769	11.518
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770	0	2770	60.575
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	169.478
Total	0772	15.578	1772	16.786	2772	288.477
Vida residual media ponderada (años)	0773	0,25	1773	0,25	2773	16,33

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 30/11/2004	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	0	1775	0	2775	3.003
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	3.003	1776	3.003	2776	3.003
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	0,00	1777	0,00	2777	1,04
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Ver Nota S.06	1778	Ver Nota S.06	2778	Ver Nota S.06
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	29,39	1792	34,47	2792	96,19
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	

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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 30/06/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 30/11/2004	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap de Bases	JP MORGAN SECURITIES PLC	TRIMESTRAL	Media de los EURIBOR 12 M en cada Fecha de Referencia	Saldo Nominal Pendiente de los Bonos (por grupo) en la proporción que represente el Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones o Certificados en base al periodo de revisión del tipo de interés (anual y semestral)	Tipo de Referencia de los Bonos + Diferencial (0,01% G1 / 0,02% G2)	Saldo Nominal Pendiente de los Bonos (por grupo) en la proporción que represente el Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones o Certificados en base al periodo de revisión del tipo de interés (anual y semestral)	-508	-508		
Total							0808 -508	0809 -508	0810	

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)			Valor en libros (miles de euros)			Otras características	
	Situación actual 30/06/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 30/11/2004	Situación actual 30/06/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 30/11/2004		
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	

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	7	7006	82	7009	0,07	7012	0,69	7015	0,07		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	7	7008	82	7011	0,07	7014	0,69	7017	0,07	7018	Apartado II.11.2.1.
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	7.459	7024	7.987	7027	40,36	7030	39,90	7033	40,14		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	124	7025	124	7028	0,67	7031	0,62	7034	0,66		
Total Fallidos					7023	7.583	7026	8.111	7029	41,03	7032	40,51	7035	40,81	7036	Apartado III.5.2

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto			
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Última Fecha Pago	
Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a 90 días	0850	0,070	1850	0,690	2850	0,070	3850	Apartado V.3.7. (i)
	0851		1851		2851		3851	
	0852		1852		2852		3852	
	0853		1853		2853		3853	

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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
Serie D1 - ES0377983046	1,50	0,07	0,07	II.11.2.1 Capítulo II
Serie B1 - ES0377983020	7,63	70,61	68,44	II.11.2.1 Capítulo II
Serie C1 - ES0377983038	1,50	0,07	0,07	II.11.2.1 Capítulo II
Serie C1 - ES0377983038	10,00	6,91	6,97	II.11.2.1 Capítulo II
Serie D1 - ES0377983046	10,00	6,91	6,97	II.11.2.1 Capítulo II
Serie C1 - ES0377983038	7,63	70,61	68,44	II.11.2.1 Capítulo II
Serie B1 - ES0377983020	1,50	0,07	0,07	II.11.2.1 Capítulo II
Serie A1a - ES0377983004	6,00	0,07	0,07	II.11.2.2 Capítulo II
Serie A1b - ES0377983012	6,00	0,07	0,07	II.11.2.2 Capítulo II
Serie D1 - ES0377983046	7,63	70,61	68,44	II.11.2.1 Capítulo II
Serie B1 - ES0377983020	10,00	6,91	6,97	II.11.2.1 Capítulo II
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		0,00	0,00	Apartado V.3.7. (i)
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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	29	2862	Saldo Nominal Pendiente de vencimiento de las Participaciones y Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,032	4862		5862		6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864		1864		2864		3864		4864		5864		6864		7864		8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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	Integrado en el pago de los intereses de los bonistas
Contrapartida	0870	Bonista
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Cláusula 13.4 Intereses de los Bonos Iniciales

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															

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)	Fecha cálculo										Total	
	0885	28/03/2024	28/06/2024									
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885											
Saldo inicial	0886	0	0									
Cobros del periodo	0887	983	764									
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-64	-74									
Pagos por derivados	0889	0	3									
Retención importe Fondo de Reserva	0890	0	0									
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-919	-693									
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0									
Resto pagos/retenciones	0893	0	0									
Saldo disponible	0894	0	0									
Liquidación de comisión variable	0895	0	0									0

Denominación Fondo: TDA 22, FTA

Denominación del compartimento: 7118

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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