

TDA 22-MIXTO - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO: 28/03/14 - 30/06/14

| EUROS | CAIXABANK (CREDIFIMO) | BMN (CAJA GRANADA) | CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANRESA (C.TARRAGONA) | TOTAL GRUPO 1 |
|--|-----------------------|---------------------|--|---------------------|
| I. Situación al 28/03/14 : | 0,30 | 0,61 | 0,35 | 1,26 |
| Saldo inicial Cta. Tesorería | 0,30 | 0,61 | 0,35 | 1,26 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 452.356,70 | 1.377.815,66 | 325.590,85 | 2.155.763,21 |
| Principal: | | | | |
| Según calendario hasta 31/05/14: | 172.900,76 | 869.408,04 | 213.730,22 | 1.256.039,02 |
| Amort. Anticipada hasta 31/05/14: | 98.959,04 | 277.784,41 | 62.678,09 | 439.421,54 |
| Intereses: | 180.496,90 | 230.623,21 | 49.182,54 | 460.302,65 |
| Ingreso por venta de inmuebles | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| III. Subtotal Recursos disponibles (I + II): | 452.357,00 | 1.377.816,27 | 325.591,20 | 2.155.764,47 |
| IV. Total intereses de la reinversión: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Intereses de la Cta. De Tesorería | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Intereses de la Cta. De Cobros | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| V. Total Recursos disponibles (III + IV): | 452.357,00 | 1.377.816,27 | 325.591,20 | 2.155.764,47 |
| VI. Varios: | 48.444,16 | 6.606,76 | 6.547,35 | 61.598,27 |
| VII. Liquidación SWAP: | -158.769,22 | -85.520,60 | 0,00 | -244.289,82 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (JP Morgan Chase): | 20.180,03 | 21.133,87 | 0,00 | 41.313,90 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo): | 178.949,25 | 106.654,47 | 0,00 | 285.603,72 |
| VIII. Pago a los Bonos: | 161.606,58 | 1.287.851,21 | 400.414,31 | 1.849.872,10 |
| Bonos A1a: | | | | |
| Intereses correspondientes al 30/06/14: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 30/06/14: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Bonos A1b: | | | | |
| Intereses correspondientes al 30/06/14: | 22.263,91 | 31.226,69 | 20.120,08 | 73.610,68 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -4.674,57 | -6.556,42 | -4.224,45 | -15.455,44 |
| Amortización correspondiente al 30/06/14: | 125.607,49 | 1.237.359,99 | 367.881,64 | 1.730.849,12 |
| Bonos B1: | | | | |
| Intereses correspondientes al 30/06/14: | 2.488,47 | 3.490,24 | 2.248,85 | 8.227,56 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -522,57 | -732,94 | -472,25 | -1.727,76 |
| Amortización correspondiente al 30/06/14: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Bonos C1: | | | | |
| Intereses correspondientes al 30/06/14: | 3.111,95 | 4.364,72 | 2.812,29 | 10.288,96 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -653,55 | -916,64 | -590,61 | -2.160,80 |
| Amortización correspondiente al 30/06/14: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Bonos D1: | | | | |
| Intereses correspondientes al 30/06/14: | 8.134,76 | 11.409,57 | 7.351,45 | 26.895,78 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -1.708,30 | -2.396,02 | -1.543,81 | -5.648,13 |
| Amortización correspondiente al 30/06/14: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Reinversión o devolución de las retenciones (1): | 7.558,99 | 10.602,02 | 6.831,12 | 24.992,13 |
| IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII + X - XI): | 0,31 | 3,06 | 0,91 | 4,28 |
| Distribución del saldo disponible: | | | | |
| Fondo de Reserva (28/03/14) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Intereses préstamo subordinado G.I. pagados | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización préstamo subordinado G.I. | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Intereses préstamo subordinado Desfase pagados | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización préstamo subordinado Desfase | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización Préstamo Participativo | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Recursos para el próximo pago | 0,31 | 3,06 | 0,91 | 4,28 |
| Margen de Intermediación Financiera | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (X) Recursos cedidos / utilizados para el Orden de Prelación de Pagos común a 28/03/14: | -6.791.586,82 | 3.499.214,77 | 3.292.372,05 | 0,00 |
| (XI) Recursos cedidos / utilizados para el Orden de Prelación de Pagos común a 30/06/14: | -6.708.050,09 | 3.497.049,41 | 3.211.000,68 | 0,00 |
| Fondo de Reserva (30/06/14) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| | | | | |
|--|------------|------------|------------|------------|
| Importe préstamos fallidos del período: | 332.339,00 | 101.054,02 | 0,00 | 433.393,02 |
| Principal vencido y no cobrado no fallido: | -4.785,01 | -7.152,93 | 91.473,90 | 79.535,96 |
| Trimestre anterior | 30.048,89 | 90.590,18 | 10.560,18 | 131.199,25 |
| Trimestre actual | 25.263,88 | 83.437,25 | 102.034,08 | 210.735,21 |



Nº: 3657/14

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.:917020808

http://www.tda-sgft.com

TDA22liq.trimJun14

Destinatarios: CNMV; AIAF

TDA 22-MIXTO - Fondo de Titulación de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO: 28/03/14 - 30/06/14

| EUROS | CAIXABANK (CREDIFIMO) | BMN (CAJA GRANADA) | CAIXABANK (CAJA NAVARRA) | BBVA (C. TERRASSA) | TOTAL GRUPO 2 |
|--|-----------------------|--------------------|--------------------------|---------------------|---------------------|
| I. Situación al 28/03/14 : | 0,00 | 320.139,47 | 2.401.046,05 | 1.240.540,46 | 3.961.725,98 |
| Saldo inicial Cta. Tesorería | 0,00 | 320.139,47 | 2.401.046,05 | 1.240.540,46 | 3.961.725,98 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 197.397,21 | 172.672,82 | 1.255.283,67 | 600.030,86 | 2.225.384,56 |
| Principal: | | | | | |
| Según calendario hasta 31/05/14: | 84.425,70 | 46.332,60 | 713.517,62 | 528.920,38 | 1.373.196,30 |
| Amort. Anticipada hasta 31/05/14: | 16.058,38 | 97.161,05 | 330.011,88 | 0,00 | 443.231,31 |
| Intereses: | 96.913,13 | 29.179,17 | 211.754,17 | 71.110,48 | 408.956,95 |
| Ingreso por venta de inmuebles | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| III. Subtotal Recursos disponibles (I + II): | 197.397,21 | 492.812,29 | 3.656.329,72 | 1.840.571,32 | 6.187.110,54 |
| IV. Total Intereses de la reinversión: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Intereses de la Cta. De Tesorería | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Intereses de la Cta. De Cobros | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| V. Total Recursos disponibles (III + IV): | 197.397,21 | 492.812,29 | 3.656.329,72 | 1.840.571,32 | 6.187.110,54 |
| VI. Varios: | 12.567,16 | 892,28 | 8.744,64 | 6.176,29 | 28.380,37 |
| VII. Liquidación SWAP: | -66.861,20 | -2.734,15 | -35.956,75 | -33.944,50 | -139.496,60 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (JP Morgan Chase): | 10.099,97 | 3.084,93 | 39.575,40 | 18.317,86 | 71.078,16 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo): | 76.961,17 | 5.819,08 | 75.532,15 | 52.262,36 | 210.574,76 |
| VIII. Pago a los Bonos: | 250.420,05 | 249.416,04 | 1.352.578,10 | 755.701,69 | 2.608.115,88 |
| Bonos A2a: | | | | | |
| Intereses correspondientes al 30/06/14: | 810,14 | 348,24 | 4.458,06 | 2.017,84 | 7.634,28 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -170,27 | -73,20 | -936,98 | -424,10 | -1.604,55 |
| Amortización correspondiente al 30/06/14: | 230.258,38 | 240.749,54 | 1.241.632,14 | 705.484,35 | 2.418.124,41 |
| Bonos A2b: | | | | | |
| Intereses correspondientes al 30/06/14: | 7.504,82 | 3.225,95 | 41.297,67 | 18.692,52 | 70.720,96 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -1.575,85 | -677,37 | -8.671,60 | -3.925,02 | -14.849,84 |
| Amortización correspondiente al 30/06/14: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Bonos B2: | | | | | |
| Intereses correspondientes al 30/06/14: | 3.094,80 | 1.330,30 | 17.030,09 | 7.708,31 | 29.163,50 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -649,95 | -279,38 | -3.576,53 | -1.618,84 | -6.124,70 |
| Amortización correspondiente al 30/06/14: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Bonos C2: | | | | | |
| Intereses correspondientes al 30/06/14: | 1.936,82 | 832,54 | 10.657,95 | 4.824,09 | 18.251,40 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -406,73 | -174,84 | -2.238,17 | -1.013,06 | -3.832,80 |
| Amortización correspondiente al 30/06/14: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Bonos D2: | | | | | |
| Intereses correspondientes al 30/06/14: | 6.815,09 | 2.929,47 | 37.502,19 | 16.974,58 | 64.221,33 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | -1.431,14 | -615,17 | -7.875,30 | -3.564,59 | -13.486,20 |
| Amortización correspondiente al 30/06/14: | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Reinversión o devolución de las retenciones (1): | 4.233,94 | 1.819,96 | 23.298,58 | 10.545,61 | 39.898,09 |
| IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII + X - XI): | 0,00 | 275.645,87 | 2.067.344,06 | 1.068.127,76 | 3.411.117,69 |
| Distribución del saldo disponible: | | | | | |
| Fondo de Reserva (28/03/14) | 0,00 | 320.139,47 | 2.401.046,05 | 1.240.540,46 | 3.961.725,98 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 0,00 | -44.493,60 | -333.701,99 | -172.412,70 | -550.608,29 |
| Intereses préstamo subordinado G.I. pagados | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización préstamo subordinado G.I. | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Intereses préstamo subordinado Desfase pagados | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización préstamo subordinado Desfase | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización Préstamo Participativo | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Recursos para el próximo pago | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Margen de Intermediación Financiera | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| (X) Recursos cedidos / utilizados para el Orden de Prelación de Pagos común a 28/03/14: | -2.419.192,06 | 478.745,31 | 1.540.725,70 | 399.721,05 | 0,00 |
| (XI) Recursos cedidos / utilizados para el Orden de Prelación de Pagos común a 30/06/14: | -2.551.643,26 | 442.869,26 | 1.732.431,87 | 376.342,13 | 0,00 |
| Fondo de Reserva (30/06/14) | 0,00 | 275.645,87 | 2.067.344,06 | 1.068.127,76 | 3.411.117,69 |

| | | | | | |
|--|------------|-----------|------------|------------|--------------|
| Importe préstamos fallidos del periodo: | 137.226,96 | 96.673,68 | 307.490,68 | 534.027,63 | 1.075.418,95 |
| Principal vencido y no cobrado no fallido: | -3.145,26 | 582,38 | -12.091,41 | -13.651,44 | -28.305,73 |
| Trimestre anterior | 12.401,10 | 10.581,35 | 20.382,15 | 19.841,22 | 63.205,82 |
| Trimestre actual | 9.255,84 | 11.163,73 | 8.290,74 | 6.189,78 | 34.900,09 |

Destinatarios: CNMV; AIAF



Nº: 3657/14

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.:917020808

http://www.tda-sgft.com

TDA22liq.trim/Jun14

INFORMACION A LOS INVERSORES (GRUPO 1)

FECHA DE PAGO: 30 de Junio de 2014

Importes en euros

| 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: | | 53.695.704,92 € | 93.873,61 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | | 73.610,68 € | 128,69 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | | 1.730.849,12 € | 3.025,96 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | | 51.964.855,80 € | 90.847,65 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | | 90,847650% | 90,847650% |
| 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: | | 8.227,56 € | 178,86 € |
| 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: | | 10.288,96 € | 278,08 € |
| 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: | | 26.895,78 € | 996,14 € |
| 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 31/05/14: | | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias No Fallidas: | | | 61.106.075,47 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias Fallidas: | | | 9.211.713,71 € |
| c) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias No Fallidas: | | | 61.316.810,68 € |
| d) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias Fallidas: | | | 9.995.286,26 € |
| 2. Amortización del período 28/02/14 a 31/05/14: | | | |
| a) Según calendario: | | | 1.256.039,02 € |
| b) Amortización anticipada hasta 31/05/14: | | | 439.421,54 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | | |
| b) Ultimo año: | | | 3,95% |
| c) Ultimo semestre: | | | 3,83% |
| d) Ultimo trimestre: | | | 2,75% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | | | 2,53% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses: | | | 0,94% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | | | 14,02% |
| 7. Nivel de Impago(2): | | | 2,55% |

(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: 3658/14

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.: 917020808

http://www.tda-sgft.com

TDA22\Infoinver.trim\Jun14

INFORMACION A LOS INVERSORES (GRUPO 2)

FECHA DE PAGO: 30 de Junio de 2014

| Importes en euros | | |
|--|--------------------------|-----------------|
| I. BONOS A2a ES0377983053 | Sobre 1689 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (9/12/04): | 168.900.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 6.157.992,66 € | 3.645,94 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 7.634,28 € | 4,52 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 2.418.124,41 € | 1.431,69 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 3.739.868,25 € | 2.214,25 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 2,214250% | 2,214250% |
| II. BONOS A2b ES0377983061 | Sobre 488 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (9/12/04): | 48.800.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 48.800.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 70.720,96 € | 144,92 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 48.800.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |
| III. 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: | 14.600.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 29.163,50 € | 199,75 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 14.600.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |
| IV. 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: | 6.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 18.251,40 € | 304,19 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 6.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |
| V. 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: | 5.700.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 64.221,33 € | 1.126,69 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 5.700.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |
| VI. EL FONDO | Importes en euros | |
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/05/14: | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias No Fallidas: | | 78.839.863,54 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias Fallidas: | | 5.556.232,13 € |
| c) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias No Fallidas: | | 78.874.763,63 € |
| d) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias Fallidas: | | 6.289.111,49 € |
| 2. Amortización del periodo 28/02/14 a 31/05/14: | | 1.816.427,61 € |
| a) Según calendario: | | 1.373.196,30 € |
| b) Amortización anticipada hasta 31/05/14: | | 443.231,31 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | |
| b) Último año: | | 2,02% |
| c) Último semestre: | | 2,12% |
| d) Último trimestre: | | 2,16% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | | 1,25% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses: | | 0,19% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | | 7,38% |
| 7. Nivel de Impago(2): | | 1,15% |

(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: 3658/14

Titulización de Activos, (SGFT).S.A.

Orense, 69
28020 Madrid
Tel.: 917020808

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

TDA22\Infoinver.trim\Jun14

TDA 22-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 28/03/14-30/06/14
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: (3,95% TAA Grupo 1 / 2,02% TAA Grupo 2) | 28 de marzo de 2022 |
| Sociedad Gestora | Titulización de Activos, SGFT,S.A. |
| Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca | BMN (Caja Granada), CaixaBank (Caja Navarra), Credifimo |
| | BBVA (Caixa Terrasa), CatalunyaBank (Caixa Tarragona) |
| Agente de Pagos | BNP PARIBAS |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencia de Calificación | Moody's Investors Service |
| Calificación | Bono A1a: - (sf) Bono A2a: A1 (sf) Bono A1b: Baa2 (sf) Bono A2b: A1 (sf) Bono B1: B1 (sf) Bono B2: Ba1 (sf) Bono C1: Caa2 (sf) Bono C2: B2 (sf) Bono D1: Caa3 (sf) Bono D2: Caa1 (sf) |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)

| Nombre | Bonos de Titulización TDA 22- MIXTO |
|---|-------------------------------------|
| Serie A2a: | |
| Código ISIN | ES 0377983053 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 168.900.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 3.739.868,25 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 2.214,25 Euros |
| Serie A2b: | |
| Código ISIN | ES0377983061 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 48.800.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 48.800.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |
| Serie B2: | |
| Código ISIN | ES0377983079 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 14.600.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 14.600.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |
| Serie C2: | |
| Código ISIN | ES 0377983087 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 6.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 6.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |
| Serie D2: | |
| Código ISIN | ES 0377983095 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 5.700.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 5.700.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |

III. INFORMACION INCLUIDA

- * Liquidación del Período:28/03/14-30/06/14
- * Flujos de Caja del Período:28/03/14-30/06/14
- * Información a los inversores. Fecha de Pago: 30 de Junio de 2014

TDA 22-MIXTO**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 28/03/14 - 30/06/14**

| | Euros | |
|--|---------------------|---------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | | |
| Amortización Bonos Titulización Hip. | | 4.148.973,53 |
| Amortización Participaciones Hip. | 3.511.888,17 | |
| Amortización Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| Ingresos por venta de inmuebles | 0,00 | |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados a los BTH | | 309.014,45 |
| Intereses recibidos de las PHs | 869.259,60 | |
| Intereses Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| Intereses Inversiones Temporales | 0,00 | |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones Periódicas: | | 89.978,64 |
| Neto SWAP | | 383.786,42 |
| Remun. Variable Préstamo Participativo/ Remun. Por Intermediación Financiera | | 0,00 |
| Total Ingresos/Pagos | <u>4.381.147,77</u> | <u>4.931.753,04</u> |
| Saldo inicial 28/03/14 | 3.961.727,24 | |
| A Inversiones Temporales | | 3.411.121,97 |
| Total | <u>8.342.875,01</u> | <u>8.342.875,01</u> |
| Retenciones practicadas el 30/06/14 | 64.890,22 | |
| A Inversiones Temporales | | 64.890,22 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 3664/14**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA22 Mixto\fluj.trim\Jun14