

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8474
NIF Fondo: V84764588
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: SI
Fecha: 31/03/2021

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 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2021		Periodo anterior 31/12/2020
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	107.172	1001	111.641
I. Activos financieros a largo plazo	0002	107.172	1002	111.641
1. Activos titulizados	0003	107.172	1003	111.641
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	84.377	1004	87.872
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	19.149	1005	19.727
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	3.646	1025	4.041
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 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	25.293	1041	25.253
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	12.581	1043	13.191
1. Activos titulizados	0044	12.581	1044	12.899
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	9.273	1045	9.722
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	1.486	1046	1.573
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	53	1065	59
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	3	1066	3
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	1.685	1067	1.459
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	80	1068	82
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	0	1074	292
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	0	1077	292
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
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	12.712	1085	12.062
1. Tesorería	0086	12.712	1086	12.062
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	132.465	1088	136.894

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2021		Periodo anterior 31/12/2020
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	119.527	1089	123.993
I. Provisiones a largo plazo	0090	6.612	1090	6.735
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	6.612	1092	6.735
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	112.915	1094	117.258
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	112.763	1095	117.105
1.1 Series no subordinadas	0096	91.287	1096	95.074
1.2 Series subordinadas	0097	21.475	1097	22.031
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	0	1101	0
2.1 Préstamo subordinado	0102	0	1102	0
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	153	1108	153
3.1 Derivados de cobertura	0109	153	1109	153
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 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) PASIVO CORRIENTE	0117	13.241	1117	13.212
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	12.882	1123	13.193
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	12.480	1124	12.791
1.1 Series no subordinadas	0125	12.445	1125	12.754
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	35	1128	37
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	8	1131	8
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	8	1136	8
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	393	1139	393
3.1 Derivados de cobertura	0140	393	1140	393
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	2	1143	2
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	2	1146	2
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	359	1148	19
1. Comisiones	0149	13	1149	14
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	8	1150	9
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	5	1152	5
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	345	1157	6
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-303	1158	-311
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-303	1160	-311
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	132.465	1162	136.894

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2021		Acumulado anterior 31/03/2020
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	270	1201	309	2201	270	3201	309
1.1 Activos titulizados	0202	270	1202	309	2202	270	3202	309
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-66	1204	-71	2204	-66	3204	-71
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-52	1205	-56	2205	-52	3205	-56
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	0	1206	0	2206	0	3206	0
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-15	1207	-15	2207	-15	3207	-15
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-221	1208	-199	2208	-221	3208	-199
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-18	1209	39	2209	-18	3209	39
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	-106	1217	-152	2217	-106	3217	-152
7.1 Servicios exteriores	0218	-2	1218	-2	2218	-2	3218	-2
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-2	1219	-2	2219	-2	3219	-2
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	-104	1224	-150	2224	-104	3224	-150
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-14	1225	-14	2225	-14	3225	-14
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-7	1227	-7	2227	-7	3227	-7
7.3.4 Comisión variable	0228	-84	1228	-129	2228	-84	3228	-129
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	0	1231	0	2231	0	3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	0	2232	0	3232	0
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	124	1234	112	2234	124	3234	112
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	124	1236	112	2236	124	3236	112
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238	0	3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	0	1239	0	2239	0	3239	0
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2021		Acumulado anterior 31/03/2020
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-107	1300	-135	2300	-107	3300	-135
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-2	1301	15	2301	-2	3301	15
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	279	1302	313	2302	279	3302	313
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-53	1303	-56	2303	-53	3303	-56
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-213	1305	-228	2305	-213	3305	-228
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
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	-15	1308	-15	2308	-15	3308	-15
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-105	1309	-150	2309	-105	3309	-150
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-14	1310	-14	2310	-14	3310	-14
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-7	1312	-7	2312	-7	3312	-7
2.4 Comisión variable	0313	-84	1313	-129	2313	-84	3313	-129
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	757	1322	-81	2322	757	3322	-81
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	758	1325	-79	2325	758	3325	-79
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	3.371	1326	3.129	2326	3.371	3326	3.129
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.665	1327	1.491	2327	1.665	3327	1.491
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	375	1328	96	2328	375	3328	96
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-4.652	1331	-4.795	2331	-4.652	3331	-4.795
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-2	1332	-2	2332	-2	3332	-2
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	-2	1336	-2	2336	-2	3336	-2
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	650	1337	-216	2337	650	3337	-216
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	12.062	1338	12.938	2338	12.062	3338	12.938
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	12.712	1339	12.722	2339	12.712	3339	12.722

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2021		Acumulado anterior 31/03/2020
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	-213	1357	-228	2357	-213	3357	-228
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-213	1358	-228	2358	-213	3358	-228
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	221	1360	199	2360	221	3360	199
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	-8	1362	29	2362	-8	3362	29
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 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL, BANCA MARCH

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/03/2021								Situación cierre anual anterior 31/12/2020								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	5,31	0400	0,05	0420	0,00	0440	4,94	1380	5,26	1400	0,05	1420	0,00	1440	4,77	2380	0,00	2400	0,00	2420	0,00	2440	13,00
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	0,38	0401	0,00	0421	0,00	0441	4,20	1381	0,37	1401	0,00	1421	0,00	1441	3,31	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	13,00
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL, BANCA MARCH

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	21	0467	6	0474	1	0481	0	0488	7	0495	1.313	0502	0	0509	1.321
De 1 a 3 meses	0461	14	0468	12	0475	2	0482	0	0489	14	0496	800	0503	0	0510	814
De 3 a 6 meses	0462	5	0469	9	0476	1	0483	0	0490	11	0497	208	0504	0	0511	219
De 6 a 9 meses	0463	3	0470	15	0477	1	0484	3	0491	19	0498	234	0505	0	0512	253
De 9 a 12 meses	0464	3	0471	37	0478	17	0485	4	0492	58	0499	280	0506	0	0513	338
Más de 12 meses	0465	51	0472	1.165	0479	60	0486	425	0493	1.651	0500	3.383	0507	0	0514	5.034
Total	0466	97	0473	1.244	0480	83	0487	432	0494	1.759	0501	6.218	0508	0	1515	7.978

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	21	0522	6	0529	1	0536	0	0543	7	0550	1.313	0557	0	0564	1.321	0571	4.577	0578	4.577	0584	28,85
De 1 a 3 meses	0516	14	0523	12	0530	2	0537	0	0544	14	0551	800	0558	0	0565	814	0572	2.636	0579	2.636	0585	30,86
De 3 a 6 meses	0517	5	0524	9	0531	1	0538	0	0545	11	0552	208	0559	0	0566	219	0573	827	0580	827	0586	26,47
De 6 a 9 meses	0518	3	0525	15	0532	1	0539	3	0546	19	0553	234	0560	0	0567	253	0574	948	0581	948	0587	26,71
De 9 a 12 meses	0519	3	0526	37	0533	17	0540	4	0547	58	0554	280	0561	0	0568	338	0575	867	0582	867	0588	38,95
Más de 12 meses	0520	51	0527	1.165	0534	60	0541	425	0548	1.651	0555	3.383	0562	0	0569	5.034	0576	12.128	0583	12.128	0589	41,50
Total	0521	97	0528	1.244	0535	83	0542	432	0549	1.759	0556	6.218	0563	0	0570	7.978	0577	21.983			0590	36,29

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL, BANCA MARCH

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 04/07/2006	
Inferior a 1 año	0600	359	1600	358	2600	65
Entre 1 y 2 años	0601	627	1601	636	2601	61
Entre 2 y 3 años	0602	1.189	1602	1.124	2602	170
Entre 3 y 4 años	0603	3.587	1603	3.109	2603	1.108
Entre 4 y 5 años	0604	3.530	1604	4.725	2604	1.912
Entre 5 y 10 años	0605	37.717	1605	38.524	2605	32.547
Superior a 10 años	0606	72.608	1606	75.920	2606	864.137
Total	0607	119.617	1607	124.395	2607	900.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	11,53	1608	11,72	2608	22,97

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 04/07/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	16,26	1609	16,01	2609	1,76

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL, BANCA MARCH

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/03/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 04/07/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.635	0630	76.884	1620	1.651	1630	78.865	2620	1.798	2630	133.421
40% - 60%	0621	446	0631	41.039	1621	470	1631	43.563	2621	2.136	2631	247.829
60% - 80%	0622	14	0632	1.694	1622	16	1632	1.967	2622	3.033	2632	446.129
80% - 100%	0623	0	0633	0	1623	0	1633	0	2623	501	2633	72.621
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	0	2634	0
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	2.095	0638	119.617	1628	2.137	1638	124.395	2628	7.468	2638	900.000
Media ponderada (%)	0639	33,53	0649		1639	34,07	1649		2639	60,94	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL, BANCA MARCH

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 04/07/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,87	1650	0,89	2650	3,54
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,00	1651	4,00	2651	6,92
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,00	2652	2,47

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL, BANCA MARCH

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/03/2021			Situación cierre anual anterior 31/12/2020			Situación inicial 04/07/2006					
	Nº de activos vivos	Principal pendiente		Nº de activos vivos	Principal pendiente		Nº de activos vivos	Principal pendiente				
Andalucía	0660	159	0683	9.783	1660	161	1683	10.183	2660	473	2683	70.253
Aragón	0661	9	0684	646	1661	9	1684	658	2661	39	2684	5.037
Asturias	0662	1	0685	30	1662	1	1685	31	2662	4	2685	516
Baleares	0663	609	0686	35.189	1663	618	1686	36.154	2663	1.621	2686	182.117
Canarias	0664	367	0687	16.100	1664	376	1687	17.251	2664	1.280	2687	120.110
Cantabria	0665	11	0688	410	1665	12	1688	454	2665	34	2688	3.842
Castilla-León	0666	49	0689	2.627	1666	51	1689	2.755	2666	133	2689	15.993
Castilla La Mancha	0667	24	0690	1.593	1667	24	1690	1.624	2667	127	2690	17.692
Cataluña	0668	130	0691	10.322	1668	131	1691	10.598	2668	539	2691	84.807
Ceuta	0669	0	0692	0	1669	0	1692	0	2669	0	2692	0
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	0	1693	0	2670	3	2693	151
Galicia	0671	2	0694	62	1671	2	1694	64	2671	6	2694	412
Madrid	0672	254	0695	18.911	1672	261	1695	19.800	2672	1.040	2695	148.701
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	11	0697	431	1674	11	1697	444	2674	48	2697	5.142
Navarra	0675	25	0698	1.589	1675	25	1698	1.625	2675	134	2698	17.688
La Rioja	0676	9	0699	347	1676	10	1699	360	2676	42	2699	4.281
Comunidad Valenciana	0677	223	0700	10.118	1677	227	1700	10.468	2677	1.060	2700	112.674
País Vasco	0678	212	0701	11.459	1678	218	1701	11.924	2678	885	2701	110.585
Total España	0679	2.095	0702	119.617	1679	2.137	1702	124.395	2679	7.468	2702	900.000
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	2.095	0705	119.617	1682	2.137	1705	124.395	2682	7.468	2705	900.000

S.05.1
Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 31/03/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL, BANCA MARCH

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/03/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 04/07/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	2,46			1710	2,39			2710	39,65		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/03/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2021			Situación cierre anual anterior 31/12/2020			Situación inicial 04/07/2006					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente			
		0720	Nominal unitario (€) 0721	0722	1720	Nominal unitario (€) 1721	1722	2720	Nominal unitario (€) 2721	2722			
ES0377953007	SERIE 1 A1	1.650	0	0	1.650	0	0	1.650	100.000	165.000			
ES0377953015	SERIE 1 A2	6.364	13.408	85.328	6.364	13.960	88.842	6.364	100.000	636.400			
ES0377953023	SERIE 1 B	182	47.267	8.603	182	49.213	8.957	182	100.000	18.200			
ES0377953031	SERIE 1 C	54	50.764	2.741	54	52.854	2.854	54	100.000	5.400			
ES0377953049	SERIE 1 D	62	100.000	6.200	62	100.000	6.200	62	100.000	6.200			
ES0377953056	SERIE 2 A	701	26.253	18.404	701	27.083	18.985	701	100.000	70.100			
ES0377953064	SERIE 2 B	49	57.273	2.806	49	59.084	2.895	49	100.000	4.900			
ES0377953072	SERIE 2 C	19	59.211	1.125	19	59.211	1.125	19	100.000	1.900			
Total		0723	9.081	0724	125.207	1723	9.081	1724	129.859	2723	9.081	2724	908.100

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/03/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas					
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado							
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739					
ES0377953007	SERIE 1 A1	NS	EURIBOR 3 m	0,04	0,00	0	0	NO	0	0	0	0					
ES0377953015	SERIE 1 A2	NS	EURIBOR 3 m	0,14	0,00	0	0	NO	85.328	0	85.328	0					
ES0377953023	SERIE 1 B	S	EURIBOR 3 m	0,35	0,00	0	0	NO	8.603	0	8.603	0					
ES0377953031	SERIE 1 C	S	EURIBOR 3 m	0,50	0,00	0	0	NO	2.741	0	2.741	0					
ES0377953049	SERIE 1 D	S	EURIBOR 3 m	3,50	2,96	32	0	NO	6.200	0	6.232	0					
ES0377953056	SERIE 2 A	NS	EURIBOR 3 m	0,16	0,00	0	0	NO	18.404	0	18.404	0					
ES0377953064	SERIE 2 B	S	EURIBOR 3 m	0,37	0,00	0	0	NO	2.806	0	2.806	0					
ES0377953072	SERIE 2 C	S	EURIBOR 3 m	2,50	1,96	4	0	NO	1.125	0	1.129	0					
Total						0740	35	0741	0	0743	125.207	0744	0	0745	125.243	0746	0

	Situación actual 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 04/07/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,17	0748	0,17	0749	3,26

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/03/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2021								Situación periodo comparativo anterior 31/03/2020							
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								
ES0377953007	SERIE 1 A1	0	165.000	0	5.450	0	165.000	0	5.450	0	165.000	0	5.450	0	5.450		
ES0377953015	SERIE 1 A2	3.514	551.072	0	91.137	3.545	536.936	0	91.137	3.545	536.936	0	91.137	0	91.137		
ES0377953023	SERIE 1 B	354	9.597	0	3.425	357	8.172	0	3.421	357	8.172	0	3.421	0	3.421		
ES0377953031	SERIE 1 C	113	2.659	0	1.139	114	2.205	1	1.135	114	2.205	1	1.135	1	1.135		
ES0377953049	SERIE 1 D	0	0	47	4.064	0	0	49	3.867	0	0	49	3.867	49	3.867		
ES0377953056	SERIE 2 A	582	51.696	0	9.469	676	49.610	0	9.469	676	49.610	0	9.469	0	9.469		
ES0377953064	SERIE 2 B	89	2.094	0	948	103	1.775	0	946	103	1.775	0	946	0	946		
ES0377953072	SERIE 2 C	0	775	6	746	0	775	6	722	0	775	6	722	6	722		
Total		0754	4.652	0755	782.893	0756	53	0757	116.378	1754	4.795	1755	764.473	1756	56	1757	116.148

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/03/2021

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 31/03/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 04/07/2006
				0762	0763	0764
ES0377953007	SERIE 1 A1	05/07/2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0377953007	SERIE 1 A1	05/07/2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0377953015	SERIE 1 A2	29/03/2017	FCH	A+	A+	AAA
ES0377953015	SERIE 1 A2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0377953023	SERIE 1 B	13/02/2018	FCH	A+	A+	A
ES0377953023	SERIE 1 B	10/10/2019	MDY	Aa1	Aa1	Aa3
ES0377953031	SERIE 1 C	08/06/2020	FCH	A	A	BBB
ES0377953031	SERIE 1 C	10/10/2019	MDY	A3	A3	Baa1
ES0377953049	SERIE 1 D	05/07/2006	FCH	CCC	CCC	CCC
ES0377953049	SERIE 1 D	23/03/2011	MDY	C	C	Ca
ES0377953056	SERIE 2 A	29/03/2017	FCH	A+	A+	AAA
ES0377953064	SERIE 2 B	23/01/2019	FCH	A-	A-	A-
ES0377953072	SERIE 2 C	05/07/2006	FCH	CCC	CCC	CCC

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/03/2021

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 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 04/07/2006	
Inferior a 1 año	0765	8.310	1765	8.673	2765	39.839
Entre 1 y 2 años	0766	6.448	1766	6.732	2766	34.171
Entre 2 y 3 años	0767	6.448	1767	6.732	2767	35.245
Entre 3 y 4 años	0768	104.001	1768	6.732	2768	35.951
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769	100.991	2769	36.538
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770	0	2770	187.607
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	538.749
Total	0772	125.207	1772	129.859	2772	908.100
Vida residual media ponderada (años)	0773	3,83	1773	4,33	2773	20,42

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 04/07/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	7.325	1775	7.325	2775	8.100
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	7.325	1776	7.325	2776	8.100
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	5,85	1777	5,64	2777	0,89
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	82,82	1792	83,01	2792	95,97
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 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

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 31/03/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 04/07/2006			
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806		
Pago interés recibido cartera/Recibo interes sobre importe bonos	HSBC	TRIMESTRAL	Tipos Interés de la cartera	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los préstamos al inicio del periodo correspondiente a Banca March	Tipo Rerefencia de los Bonos+ MMP + 0,55%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Bonos atribuible a Banca March	-545	-545				
Pago interés recibido cartera/Recibo interes sobre importe bonos	CREDIT AGRICOLE	TRIMESTRAL	Tipos Interés de la cartera	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los préstamos al inicio del periodo correspondiente a Guipuzcoano	Tipo Rerefencia de los Bonos+ MMP + 0,55%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Bonos atribuible a Guipuzcoano						
Total							0808	-545	0809	-545	0810	

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

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 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 04/07/2006		Situación actual 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 04/07/2006			
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 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

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 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación actual 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Última Fecha Pago
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002		7003		7006		7009		7012		7015		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016		
Total Morosos					7005		7008		7011		7014		7017		7018
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019		7020		7021		7024		7027		7030		7033		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022		7025		7028		7031		7034		
Total Fallidos					7023		7026		7029		7032		7035		7036

Otras ratios relevantes	Ratio						Ref. Folleto	
	Situación actual 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Última Fecha Pago			
	0850		1850		2850		3850	
	0851		1851		2851		3851	
	0852		1852		2852		3852	
	0853		1853		2853		3853	

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
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 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862		2862	Saldo Nominal pendiente de las Participaciones y de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,015	4862		5862	12	6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, S.E.	1864	6	2864	Saldo Nominal pendiente de vencimiento de las Participaciones y de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3864	0,003	4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Multicedente
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo Adicional 3.4.6.5

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 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885	28/01/2021											
Saldo inicial	0886	7.325											
Cobros del periodo	0887	5.025											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-23											
Pagos por derivados	0889	-213											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-7.325											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-4.705											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0											
Resto pagos/retenciones	0893	0											
Saldo disponible	0894	84											
Liquidación de comisión variable	0895	84											84

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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