

TDA 26-MIXTO - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 29/07/13 - 28/10/13

EUROS	BANCA MARCH		SABADELL (GUIPUZCOANO)		TOTAL GRUPO1		BANCA MARCH		SABADELL (GUIPUZCOANO)		TOTAL GRUPO 2		TOTAL FONDO	
I. Situación al 29/07/13:														
Fondo de Reserva	2.179.393,94	1.279.714,05	3.459.107,99	969.252,99	225.000,00	1.194.252,99	4.653.360,98							
II. Fondos recibidos del emisor	3.906.702,30	5.331.735,18	9.238.437,48	576.850,14	320.311,17	897.161,31	10.135.598,79							
Principal:														
Según calendario hasta 30/09/13:	2.618.608,09	2.637.703,14	5.256.311,23	374.751,59	76.189,24	450.940,83	5.707.252,06							
Amort. Anticipada hasta 30/09/13:	541.244,33	1.498.799,30	2.040.043,63	30.000,00	199.429,60	229.429,60	2.269.473,23							
Intereses:	746.849,88	1.195.232,74	1.942.082,62	172.098,55	44.692,33	216.790,88	2.158.873,50							
III. Subtotal a Cuenta de reinversión (I + II):	6.086.096,24	6.611.449,23	12.697.545,47	1.546.103,13	545.311,17	2.091.414,30	14.788.959,77							
IV. Total Intereses de la reinversión:	4.031,36	2.966,02	6.997,38	594,86	181,84	776,70	7.774,08							
Intereses de la Cta. De Tesorería	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00							
Intereses de la Cta. De Reinversión	4.031,36	2.966,02	6.997,38	594,86	181,84	776,70	7.774,08							
V. Recursos disponibles (III + IV):	6.090.127,60	6.614.415,25	12.704.542,85	1.546.697,99	545.493,01	2.092.191,00	14.796.733,85							
VI. Gastos:	13.906,11	17.591,19	31.497,30	4.216,71	635,72	4.852,43	36.349,73							
VII. Liquidación del Swap	-472.230,83	-785.816,54	-1.258.047,37	-86.516,56	-29.215,67	-115.732,23	-1.373.779,60							
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	746.849,88	1.195.232,74	1.942.082,62	172.098,55	44.692,33	216.790,88	2.158.873,50							
Cantidad a Pagar por la Parte A (HSBC / Crédit Agricole CIB):	274.619,05	409.416,20	684.035,25	85.581,99	15.476,66	101.058,65	785.093,90							
VIII. Pago a los Bonos:	2.917.046,87	5.744.772,19	8.661.819,06	556.925,69	289.680,61	846.606,30	9.508.425,36							
Bonos 1-A2:														
Intereses correspondientes al 28/10/13:	99.029,85	147.638,79	246.668,64	0,00	0,00	0,00	246.668,64							
Retenciones practicadas a los bonos:	20.797,29	31.005,67	51.802,96	0,00	0,00	0,00	51.802,96							
Amortización correspondiente al 28/10/13:	2.804.155,86	5.576.468,46	8.380.624,32	0,00	0,00	0,00	8.380.624,32							
Bonos 1-B:														
Intereses correspondientes al 28/10/13:	9.888,21	14.741,85	24.630,06	0,00	0,00	0,00	24.630,06							
Retenciones practicadas a los bonos:	2.076,58	3.095,86	5.172,44	0,00	0,00	0,00	5.172,44							
Amortización correspondiente al 28/10/13:	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00							
Bonos 1-C:														
Intereses correspondientes al 28/10/13:	3.972,95	5.923,09	9.896,04	0,00	0,00	0,00	9.896,04							
Retenciones practicadas a los bonos:	834,22	1.243,70	2.077,92	0,00	0,00	0,00	2.077,92							
Amortización correspondiente al 28/10/13:	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00							
Bonos 1-D:														
Intereses debidos hasta 29/07/13:	215.897,96	398.294,50	614.192,46	0,00	0,00	0,00	614.192,46							
Intereses devengados desde 29/07/13 hasta 28/10/13:	20.521,17	37.858,03	58.379,20	0,00	0,00	0,00	58.379,20							
Intereses correspondientes al 28/10/13:	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00							
Intereses debidos tras actual fecha de pago:	236.419,13	436.152,53	672.571,66	0,00	0,00	0,00	672.571,66							
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00							
Amortización correspondiente al 28/10/13:	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00							
Bonos 2-A:														
Intereses correspondientes al 28/10/13:	0,00	0,00	0,00	30.281,84	5.476,17	35.758,01	35.758,01							
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00	0,00	0,00	6.357,94	1.149,77	7.507,71	7.507,71							
Amortización correspondiente al 28/10/13:	0,00	0,00	0,00	490.289,62	275.938,43	766.228,05	766.228,05							
Bonos 2-B:														
Intereses correspondientes al 28/10/13:	0,00	0,00	0,00	6.240,98	1.128,62	7.369,60	7.369,60							
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00	0,00	0,00	1.310,44	236,98	1.547,42	1.547,42							
Amortización correspondiente al 28/10/13:	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00							
Bonos 2-C:														
Intereses debidos hasta 29/07/13:	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00							
Intereses devengados desde 29/07/13 hasta 28/10/13:	0,00	0,00	0,00	6.557,11	1.669,13	8.226,24	8.226,24							
Intereses correspondientes al 28/10/13:	0,00	0,00	0,00	6.557,11	1.669,13	8.226,24	8.226,24							
Intereses debidos tras actual fecha de pago:	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00							
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00	0,00	0,00	1.376,97	350,51	1.727,48	1.727,48							
Amortización correspondiente al 28/10/13:	0,00	0,00	0,00	23.556,14	5.468,26	29.024,40	29.024,40							
Reinversión de las retenciones (1):	-23.708,09	-35.345,23	-59.053,32	-9.045,35	-1.737,26	-10.782,61	-69.835,93							
IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII):	2.686.943,79	66.235,33	2.753.179,12	899.039,03	225.961,01	1.125.000,04	3.878.179,16							
Distribución del saldo disponible:														
Fondo de Reserva previo(29/07/13):	2.179.393,94	1.279.714,05	3.459.107,99	969.252,99	225.000,00	1.194.252,99	4.653.360,98							
Aportación al Fondo de Reserva	0,00	-705.928,87	-705.928,87	-69.252,99	0,00	-69.252,99	-775.181,86							
Intereses pagados Préstamo Gastos Iniciales	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00							
Amortización Préstamo Gastos Iniciales	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00							
Otros recursos	0,00	0,00	0,00	0,00	0,04	0,04	0,04							
Margen de Intermediación Financiera	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00							
Recursos cedidos / utilizados para el Orden de Prelación de Pagos común a 29/07/13:	1.513.349,15	-1.513.349,15	0,00	-36.583,41	36.583,41	0,00	0,00							
Recursos cedidos / utilizados para el Orden de Prelación de Pagos común a 28/10/13:	2.020.899,00	-2.020.899,00	0,00	-37.544,38	37.544,38	0,00	0,00							
Fondo de Reserva (28/10/13):	2.179.393,94	573.785,18	2.753.179,12	900.000,00	225.000,00	1.125.000,00	3.878.179,12							

(1) Hasta el 20/11/13

Destinatarios: CNMV, AIAF.

INFORMACION A LOS INVERSORES
FECHA DE PAGO: 28 de Octubre de 2013

Importes en euros

I. BONOS 1-A2 ES0377953015		
	Sobre 6364 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (11/07/06):	636.400.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	267.383.269,08 €	42.014,97 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	246.668,64 €	38,76 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	8.380.624,32 €	1.316,88 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	259.002.644,76 €	40.698,09 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	40,698090%	40,698090%
II. BONOS 1-B ES0377953023		
	Sobre 182 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (11/07/06):	18.200.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	16.946.229,30 €	93.111,15 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	24.630,06 €	135,33 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	16.946.229,30 €	93.111,15 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	93,111150%	93,111150%
III. BONOS 1-C ES0377953031		
	Sobre 54 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (11/07/06):	5.400.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	5.400.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	9.896,04 €	183,26 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	5.400.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
IV. BONOS 1-D ES0377953049		
	Sobre 62 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (11/07/06):	6.200.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	6.200.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	58.379,20 €	941,60 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Intereses debidos en esta Fecha de Pago:	672.571,66 €	10.847,93 €
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	6.200.000,00 €	100.000,00 €
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
V. BONOS 2-A ES0377953056		
	Sobre 701 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (11/07/06):	70.100.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	36.745.046,04 €	52.418,04 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	35.758,01 €	51,01 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	766.228,05 €	1.093,05 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	35.978.817,99 €	51.324,99 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	51,324990%	51,324990%
VI. BONOS 2-B ES0377953064		
	Sobre 49 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (11/07/06):	4.900.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	4.900.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	7.369,60 €	150,40 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	4.900.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
VII. BONOS 2-C ES0377953072		
	Sobre 19 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (11/07/06):	1.900.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de pago en la anterior Fecha de Pago:	1.194.252,98 €	62.855,42 €
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	8.226,24 €	432,96 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	8.226,24 €	432,96 €
5. Principal vencido en esta Fecha de Pago:	69.252,91 €	3.644,89 €
6. Principal amortizado en esta Fecha de Pago:	29.024,40 €	1.527,60 €
7. Principal debido tras esta Fecha de Pago:	40.228,51 €	2.117,29 €
8. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	1.125.000,07 €	59.210,53 €
9. Porcentaje pendiente de vencimiento:	59,210530%	59,210530%
10. Pendiente de pago tras esta Fecha de Pago:	1.165.228,58 €	61.327,82 €
11. Porcentaje pendiente de pago:	61,327820%	61,327820%
VIII. EL FONDO		
	Importes en euros	
	GRUPO1	GRUPO2
1. Saldo de participaciones hipotecarias a 30/09/13:		
a) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias No Fallidas:	281.348.899,40 €	40.878.820,20 €
b) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias Fallidas:	9.789.694,91 €	371.746,56 €
c) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias No Fallidas:	281.619.863,40 €	40.894.773,38 €
d) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias Fallidas:	10.031.343,58 €	376.312,64 €
2. Amortización del período 30/06/13 a 30/09/13:	7.296.354,86 €	680.370,43 €
a) Según calendario:	5.256.311,23 €	450.940,83 €
b) Amortización anticipada hasta 30/09/13:	2.040.043,63 €	229.429,60 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):		
a) Último año:	3,87%	2,64%
b) Último semestre:	3,82%	1,78%
c) Último trimestre:	2,79%	2,19%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:	2,41%	1,29%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:	0,64%	0,46%
6. Porcentaje de fallidos (1):	3,44%	0,91%
7. Nivel de Impago(2):	1,47%	0,82%

(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 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: Cedentes; Agente de Pagos; CNMV; AIAF.



Nº: 7170/13

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.
Orense, 69
28020 Madrid
Tel.: 917020808
http://www.tda-sgft.com
TDA26info@inver.ttm.com Oct13

TDA 26-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 29/07/13-28/10/13
I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	5 de julio de 2006
Fecha Emisión BTH	5 de julio de 2006
Fecha Final Amortización BTH (teórica) (13% TAA)	28 de octubre de 2019
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisor Participaciones Hipotecarias	Banco Sabadell (Banco Guipuzcoano) Banca March
Agente de Pagos	BNP Paribas
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Moody's Investors Service / Fitch Ratings
Calificación	Bonos 1 A2: (M) Baa1 (sf) / (F) AA- (sf) Bonos 1 B: (M) B1 (sf) / (F) BBB (sf) Bonos 1 C: (M) Caa2 (sf) / (F) BB+ (sf) Bonos 1 D: (M) C (sf) / (F) CCC (sf) Bonos 2 A: (M) - (sf) / (F) A (sf) Bonos 2 B: (M) - (sf) / (F) BBB (sf) Bonos 2 C: (M) - (sf) / (F) CCC (sf)

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

Nombre	Bonos de Titulización TDA 26-MIXTO
Serie 1 A2:	
Código ISIN	ES0377953015
Nominal en circulación total (inicial)	636.400.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	259.002.644,76 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	40.698,09 Euros

TDA26-MIXTO\INFO.trim\Oct13

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)	
Nombre	Bonos de Titulización TDA 26-MIXTO
Serie 1 B:	
Código ISIN	ES0377953023
Nominal en circulación total (inicial)	18.200.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	16.946.229,30 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	93.111,15 Euros
Serie 1 C:	
Código ISIN	ES0377953031
Nominal en circulación total (inicial)	5.400.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	5.400.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie 1 D:	
Código ISIN	ES0377953049
Nominal en circulación total (inicial)	6.200.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	6.200.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie 2 A:	
Código ISIN	ES0377953056
Nominal en circulación total (inicial)	70.100.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	35.978.817,99 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	51.324,99 Euros
Serie 2 B:	
Código ISIN	ES0377953064
Nominal en circulación total (inicial)	4.900.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	4.900.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros

TDA26-MIXTO\INFO.trim\Oct13

Serie 2 C:	
Código ISIN	ES0377953072
Nominal en circulación total (inicial)	1.900.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual pend. vto.)	1.125.000,07 Euros
Nominal en circulación total (actual pend. cobro)	1.165.228,58 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual pend. vto.)	59.210,53 Euros
Nominal en circulación unitario (actual pend. cobro)	61.327,82 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA

* Liquidación del Período: 29/07/13-28/10/13

* Flujos de Caja del Período: 29/07/13-28/10/13

* Información a los inversores. Fecha de Pago: 28 de Octubre de 2013

TDA 26-MIXTO, FTA**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 29/07/13 - 28/10/13**

	Euros	
	Ingresos	Pagos
I. INVERSIONES/FINANCIACIONES		
Amortización Bonos Titulización Hip.		9.175.876,77
Amortización Participaciones Hip.	7.976.725,29	
Amortización Préstamo Subordinado		0,00
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH		332.548,59
Intereses recibidos de las PHs	2.158.873,50	
Intereses Ptmo. Subordinado		0,00
Intereses Inversiones Temporales	7.774,08	
Neto swap a favor de la contraparte		1.373.779,60
III. GASTOS		
Comisiones Periódicas:		36.349,73
Remuneración variable del Préstamo Participativo		0,00
Total Ingresos/Pagos	<u>10.143.372,87</u>	<u>10.918.554,69</u>
Saldo inicial 29/07/13	4.653.360,98	
A Inversiones Temporales		3.878.179,16
Total	<u>14.796.733,85</u>	<u>14.796.733,85</u>
Retenciones practicadas el 28/10/13	69.835,93	
A Inv.Temporales hasta el 20/11/13		69.835,93

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 7179/13**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA 26\fluj.trim\Oct13