

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: 31/12/2023

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: 31/12/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	63.679	1001	78.074
I. Activos financieros a largo plazo	0002	63.679	1002	78.074
1. Activos titulizados	0003	63.679	1003	78.074
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	48.915	1004	60.129
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	12.293	1005	14.875
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	2.471	1025	3.071
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: 31/12/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	21.421	1041	23.965
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	10.250	1043	11.665
1. Activos titulizados	0044	9.785	1044	11.408
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	6.767	1045	8.114
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	1.196	1046	1.478
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	204	1065	86
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	9	1066	3
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	1.540	1067	1.653
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	70	1068	74
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	179
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	179
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	464	1074	79
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	429	1077	60
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	35	1079	19
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	11.171	1085	12.299
1. Tesorería	0086	11.171	1086	12.299
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	85.100	1088	102.039

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	74.773	1089	90.313
I. Provisiones a largo plazo	0090	5.157	1090	5.917
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	5.157	1092	5.917
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	69.616	1094	84.395
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	69.616	1095	84.395
1.1 Series no subordinadas	0096	50.474	1096	65.253
1.2 Series subordinadas	0097	19.143	1097	19.143
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	0	1108	0
3.1 Derivados de cobertura	0109	0	1109	0
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: 31/12/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) PASIVO CORRIENTE	0117	10.132	1117	11.613
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	10.112	1123	11.592
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	10.106	1124	11.585
1.1 Series no subordinadas	0125	9.502	1125	11.245
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	603	1128	339
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	0	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	0	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	6	1139	0
3.1 Derivados de cobertura	0140	6	1140	0
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	20	1148	20
1. Comisiones	0149	14	1149	14
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	9	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	6	1157	6
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	196	1158	114
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	196	1160	114
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	85.100	1162	102.039

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2023

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2023		Acumulado anterior 31/12/2022
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	896	1201	357	2201	2.945	3201	907
1.1 Activos titulizados	0202	792	1202	322	2202	2.597	3202	900
1.2 Otros activos financieros	0203	104	1203	35	2203	348	3203	7
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-890	1204	-388	2204	-3.120	3204	-619
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-890	1205	-388	2205	-3.120	3205	-619
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	0	1206	0	2206	0	3206	0
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	78	1208	134	2208	600	3208	-145
A) MARGEN DE INTERESES	0209	83	1209	103	2209	425	3209	143
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	-210	1217	-230	2217	-1.186	3217	-395
7.1 Servicios exteriores	0218	-2	1218	-8	2218	-30	3218	-28
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-2	1219	-8	2219	-30	3219	-28
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	-208	1224	-222	2224	-1.156	3224	-367
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-16	1225	-15	2225	-62	3225	-60
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	-27	3227	-27
7.3.4 Comisión variable	0228	-179	1228	-195	2228	-1.060	3228	-273
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-6	1230	-6	2230	-6	3230	-6
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	126	1234	127	2234	761	3234	253
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	126	1236	127	2236	761	3236	253
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: 31/12/2023

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2023		Acumulado anterior 31/12/2022
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-43	1300	-46	2300	-330	3300	-314
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	158	1301	170	2301	819	3301	45
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	780	1302	295	2302	2.476	3302	857
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-899	1303	-169	2303	-2.856	3303	-416
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	177	1304	21	2304	867	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	3305	-383
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	101	1306	24	2306	331	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	0	1308	0	2308	0	3308	-13
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-202	1309	-216	2309	-1.149	3309	-360
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-16	1310	-15	2310	-62	3310	-59
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-7	1312	-7	2312	-27	3312	-27
2.4 Comisión variable	0313	-179	1313	-195	2313	-1.060	3313	-273
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	60	1322	767	2322	-798	3322	906
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	61	1325	775	2325	-761	3325	940
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	1.816	1326	2.346	2326	7.786	3326	10.162
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.436	1327	1.997	2327	7.017	3327	6.432
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	117	1328	341	2328	957	3328	1.046
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	-3.308	1331	-3.909	2331	-16.522	3331	-16.699
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-2	1332	-8	2332	-37	3332	-34
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	-8	2336	-37	3336	-34
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	16	1337	721	2337	-1.128	3337	591
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	11.155	1338	11.578	2338	12.299	3338	11.708
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	11.171	1339	12.299	2339	11.171	3339	12.299

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2023

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2023		Acumulado anterior 31/12/2022
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	-8	1357	360	2357	682	3357	-44
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-8	1358	360	2358	682	3358	-44
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	-78	1360	-134	2360	-600	3360	145
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	86	1362	-226	2362	-82	3362	-102
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: 31/12/2023

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2023								Situación cierre anual anterior 31/12/2022								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	6,52	0400	0,08	0420	0,00	0440	8,26	1380	6,30	1400	0,07	1420	0,00	1440	6,94	2380	0,00	2400	0,00	2420	0,00	2440	13,00
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	0,93	0401	0,00	0421	0,00	0441	10,32	1381	0,82	1401	0,00	1421	0,00	1441	5,29	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: 31/12/2023

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	31	0467	12	0474	5	0481	0	0488	17	0495	1.758	0502	0	0509	1.774
De 1 a 3 meses	0461	15	0468	11	0475	4	0482	0	0489	15	0496	646	0503	0	0510	661
De 3 a 6 meses	0462	3	0469	6	0476	2	0483	1	0490	9	0497	166	0504	0	0511	175
De 6 a 9 meses	0463	4	0470	7	0477	1	0484	2	0491	9	0498	66	0505	0	0512	75
De 9 a 12 meses	0464	2	0471	10	0478	1	0485	4	0492	15	0499	146	0506	0	0513	161
Más de 12 meses	0465	45	0472	967	0479	66	0486	379	0493	1.413	0500	2.642	0507	0	0514	4.056
Total	0466	100	0473	1.013	0480	79	0487	386	0494	1.478	0501	5.424	0508	0	1515	6.902

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	31	0522	12	0529	5	0536	0	0543	17	0550	1.758	0557	0	0564	1.774	0571	6.901	0578	6.901	0584	25,71
De 1 a 3 meses	0516	15	0523	11	0530	4	0537	0	0544	15	0551	646	0558	0	0565	661	0572	2.957	0579	2.957	0585	22,35
De 3 a 6 meses	0517	3	0524	6	0531	2	0538	1	0545	9	0552	166	0559	0	0566	175	0573	524	0580	524	0586	33,30
De 6 a 9 meses	0518	4	0525	7	0532	1	0539	2	0546	9	0553	66	0560	0	0567	75	0574	474	0581	474	0587	15,78
De 9 a 12 meses	0519	2	0526	10	0533	1	0540	4	0547	15	0554	146	0561	0	0568	161	0575	475	0582	475	0588	34,02
Más de 12 meses	0520	45	0527	967	0534	66	0541	379	0548	1.413	0555	2.642	0562	0	0569	4.056	0576	10.021	0583	10.021	0589	40,47
Total	0521	100	0528	1.013	0535	79	0542	386	0549	1.478	0556	5.424	0563	0	0570	6.902	0577	21.352			0590	32,32

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: 31/12/2023

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 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 04/07/2006	
Inferior a 1 año	0600	982	1600	462	2600	65
Entre 1 y 2 años	0601	1.050	1601	1.488	2601	61
Entre 2 y 3 años	0602	1.054	1602	2.026	2602	170
Entre 3 y 4 años	0603	1.205	1603	1.290	2603	1.108
Entre 4 y 5 años	0604	2.534	1604	1.844	2604	1.912
Entre 5 y 10 años	0605	22.008	1605	26.974	2605	32.547
Superior a 10 años	0606	44.349	1606	55.235	2606	864.137
Total	0607	73.182	1607	89.320	2607	900.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	9,54	1608	10,26	2608	22,97

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 04/07/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	18,96	1609	17,98	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: 31/12/2023

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 31/12/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				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	1.470	0630	62.413	1620	1.559	1630	69.097	2620	1.798	2630	133.421
40% - 60%	0621	110	0631	9.594	1621	218	1631	18.835	2621	2.136	2631	247.829
60% - 80%	0622	9	0632	1.174	1622	11	1632	1.387	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	1.589	0638	73.182	1628	1.788	1638	89.320	2628	7.468	2638	900.000
Media ponderada (%)	0639	28,52	0649		1639	30,17	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: 31/12/2023

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 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 04/07/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,32	1650	0,90	2650	3,54
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,00	1651	4,38	2651	6,92
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,48	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: 31/12/2023

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 31/12/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				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	115	0683	5.974	1660	132	1683	7.277	2660	473	2683	70.253
Aragón	0661	5	0684	171	1661	5	1684	198	2661	39	2684	5.037
Asturias	0662	0	0685	0	1662	0	1685	0	2662	4	2685	516
Baleares	0663	471	0686	22.564	1663	519	1686	26.870	2663	1.621	2686	182.117
Canarias	0664	268	0687	9.881	1664	306	1687	11.965	2664	1.280	2687	120.110
Cantabria	0665	7	0688	234	1665	9	1688	286	2665	34	2688	3.842
Castilla-León	0666	37	0689	1.556	1666	42	1689	1.862	2666	133	2689	15.993
Castilla La Mancha	0667	22	0690	1.032	1667	23	1690	1.241	2667	127	2690	17.692
Cataluña	0668	107	0691	6.764	1668	117	1691	8.105	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	1	0694	35	1671	2	1694	46	2671	6	2694	412
Madrid	0672	196	0695	11.767	1672	220	1695	14.144	2672	1.040	2695	148.701
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	8	0697	162	1674	9	1697	215	2674	48	2697	5.142
Navarra	0675	19	0698	1.036	1675	21	1698	1.178	2675	134	2698	17.688
La Rioja	0676	7	0699	180	1676	8	1699	240	2676	42	2699	4.281
Comunidad Valenciana	0677	169	0700	5.837	1677	191	1700	7.399	2677	1.060	2700	112.674
País Vasco	0678	157	0701	5.989	1678	184	1701	8.291	2678	885	2701	110.585
Total España	0679	1.589	0702	73.182	1679	1.788	1702	89.320	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	1.589	0705	73.182	1682	1.788	1705	89.320	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: 31/12/2023

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 04/07/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	3,47			1710	2,96			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: 31/12/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			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	7.515	47.829	6.364	9.718	61.845	6.364	100.000	636.400			
ES0377953023	SERIE 1 B	182	39.930	7.267	182	39.930	7.267	182	100.000	18.200			
ES0377953031	SERIE 1 C	54	42.884	2.316	54	42.884	2.316	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	17.329	12.147	701	20.903	14.653	701	100.000	70.100			
ES0377953064	SERIE 2 B	49	45.602	2.234	49	45.602	2.234	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	79.118	1723	9.081	1724	95.641	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: 31/12/2023

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	4,09	337	0	NO	47.829	0	48.166	0					
ES0377953023	SERIE 1 B	S	EURIBOR 3 m	0,35	4,30	54	0	NO	7.267	0	7.321	0					
ES0377953031	SERIE 1 C	S	EURIBOR 3 m	0,50	4,45	18	0	NO	2.316	0	2.334	0					
ES0377953049	SERIE 1 D	S	EURIBOR 3 m	3,50	7,45	80	0	NO	6.200	0	6.280	0					
ES0377953056	SERIE 2 A	NS	EURIBOR 3 m	0,16	4,11	86	0	NO	12.147	0	12.233	0					
ES0377953064	SERIE 2 B	S	EURIBOR 3 m	0,37	4,32	17	0	NO	2.234	0	2.251	0					
ES0377953072	SERIE 2 C	S	EURIBOR 3 m	2,50	6,45	13	0	NO	1.125	0	1.138	0					
Total						0740	603	0741	0	0743	79.118	0744	0	0745	79.722	0746	0

	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 04/07/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	3,77	0748	0,72	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: 31/12/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2023								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2022							
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	165.000	0	5.450
ES0377953015	SERIE 1 A2	2.710	588.571	509	92.816	2.668	574.555	58	91.195	2.668	574.555	58	91.195	58	91.195	58	91.195
ES0377953023	SERIE 1 B	0	10.933	77	3.666	313	10.933	11	3.436	313	10.933	11	3.436	11	3.436	11	3.436
ES0377953031	SERIE 1 C	0	3.084	25	1.221	100	3.084	4	1.144	100	3.084	4	1.144	4	1.144	4	1.144
ES0377953049	SERIE 1 D	0	0	117	4.797	0	0	59	4.402	0	0	59	4.402	59	4.402	59	4.402
ES0377953056	SERIE 2 A	598	57.953	129	9.886	718	55.447	15	9.484	718	55.447	15	9.484	15	9.484	15	9.484
ES0377953064	SERIE 2 B	0	2.666	24	1.022	109	2.666	3	951	109	2.666	3	951	3	951	3	951
ES0377953072	SERIE 2 C	0	775	18	848	0	775	19	788	0	775	19	788	19	788	19	788
Total		0754	3.308	0755	828.982	0756	899	0757	119.705	1754	3.909	1755	812.459	1756	169	1757	116.850

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: 31/12/2023

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 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	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	06/05/2021	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0377953015	SERIE 1 A2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0377953023	SERIE 1 B	06/05/2021	FCH	AAA	AAA	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	26/10/2023	MDY	Aa1	A1	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	21/04/2022	FCH	A	A	A-
ES0377953072	SERIE 2 C	05/07/2006	FCH	CCC	CCC	CCC

S.05.2
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: 31/12/2023
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 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 04/07/2006	
Inferior a 1 año	0765	79.118	1765	95.641	2765	39.839
Entre 1 y 2 años	0766	0	1766	0	2766	34.171
Entre 2 y 3 años	0767	0	1767	0	2767	35.245
Entre 3 y 4 años	0768	0	1768	0	2768	35.951
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769	0	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	79.118	1772	95.641	2772	908.100
Vida residual media ponderada (años)	0773	0,08	1773	0,08	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: 31/12/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		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	9,26	1777	7,66	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	75,76	1792	79,95	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: 31/12/2023

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 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	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	-6	179				
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	-6	0809	179	0810	

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2023

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 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 04/07/2006		Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		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: 31/12/2023

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 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022				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 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		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: 31/12/2023

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: 31/12/2023

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	14	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: 31/12/2023

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: 31/12/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo						Total
		30/01/2023	28/04/2023	28/07/2023	30/10/2023			
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885							
Saldo inicial	0886	7.325	7.325	7.325	7.325			
Cobros del periodo	0887	5.050	4.990	5.424	4.233			
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-26	-35	-41	-24			
Pagos por derivados	0889	236	219	235	177			
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-7.325	-7.325	-7.325	-7.325			
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-4.959	-4.758	-5.454	-4.207			
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0	0			
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0	0			
Saldo disponible	0894	301	416	164	179			
Liquidación de comisión variable	0895	301	416	164	179			1.060

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2023

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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