

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.00

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: **TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Número de registro del Fondo: **8474**

NIF Fondo: **V-84764588**

Denominación del compartimento:

Número de registro del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

NIF gestora: **A-80352750**

Estados agregados: **Si**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2014**

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA



Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
Estados agregados: Si
Periodo: 1er Semestre
Ejercicio: 2014

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2014		Periodo Anterior 31/12/2013
--------------------------	--	------------------------------	--	--------------------------------

ACTIVO				
---------------	--	--	--	--

A) ACTIVO NO CORRIENTE	0008	285.944	1008	302.455
-------------------------------	------	---------	------	---------

I. Activos financieros a largo plazo	0010	285.944	1010	302.455
1. Valores representativos de deuda	0100	0	1100	0
1.1 Bancos centrales	0101	0	1101	0
1.2 Administraciones Públicas españolas	0102	0	1102	0
1.3 Entidades de crédito	0103	0	1103	0
1.4 Otros sectores residentes	0104	0	1104	0
1.5 Administraciones Públicas no residentes	0105	0	1105	0
1.6 Otros sectores no residentes	0106	0	1106	0
1.7 Activos dudosos	0107	0	1107	0
1.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0108		1108	
1.9 Intereses y gastos devengados no vencidos	0109	0	1109	0
1.10 Ajustes por operaciones de cobertura	0110	0	1110	0
2. Derechos de crédito	0200	285.944	1200	302.455
2.1 Participaciones hipotecarias	0201	235.650	1201	251.278
2.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0202	36.711	1202	38.179
2.3 Préstamos hipotecarios	0203	0	1203	0
2.4 Cédulas Hipotecarias	0204	0	1204	0
2.5 Préstamos a promotores	0205	0	1205	0
2.6 Préstamos a PYMES	0206	0	1206	0
2.7 Préstamos a empresas	0207	0	1207	0
2.8 Préstamos Corporativos	0208	0	1208	0
2.9 Cédulas territoriales	0209	0	1209	0
2.10 Bonos de Tesorería	0210	0	1210	0
2.11 Deuda Subordinada	0211	0	1211	0
2.12 Créditos AAPP	0212	0	1212	0
2.13 Préstamos Consumo	0213	0	1213	0
2.14 Préstamos automoción	0214	0	1214	0
2.15 Cuotas de Arrendamiento financiero (leasing)	0215	0	1215	0
2.16 Cuentas a cobrar	0216	0	1216	0
2.17 Derechos de crédito futuros	0217	0	1217	0
2.18 Bonos de titulación	0218	0	1218	0
2.19 Otros	0219	0	1219	0
2.20 Activos dudosos	0220	13.587	1220	13.002
2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0221	-4	1221	-4
2.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0222	0	1222	0
2.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0223	0	1223	0
3. Derivados	0230	0	1230	0
3.1 Derivados de cobertura	0231	0	1231	0
3.2 Derivados de negociación	0232	0	1232	0
4. Otros activos financieros	0240	0	1240	0
4.1 Garantías financieras	0241	0	1241	0
4.2 Otros	0242	0	1242	0

II. Activos por impuesto diferido	0250	0	1250	0
--	------	---	------	---

III. Otros activos no corrientes	0260	0	1260	0
---	------	---	------	---

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: **TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **Si**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2014**

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2014		Periodo Anterior 31/12/2013
B) ACTIVO CORRIENTE	0270	35.093	1270	37.436
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0280	0	1280	0
V. Activos financieros a corto plazo	0290	20.635	1290	21.331
1. Deudores y otras cuentas a cobrar	0300	0	1300	0
2. Valores representativos de deuda	0310	0	1310	0
2.1 Bancos centrales	0311	0	1311	0
2.2 Administraciones Públicas españolas	0312	0	1312	0
2.3 Entidades de crédito	0313	0	1313	0
2.4 Otros sectores residentes	0314	0	1314	0
2.5 Administraciones Públicas no residentes	0315	0	1315	0
2.6 Otros sectores no residentes	0316	0	1316	0
2.7 Activos dudosos	0317	0	1317	0
2.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0318		1318	
2.9 Intereses y gastos devengados no vencidos	0319	0	1319	0
2.10 Ajustes por operaciones de cobertura	0320	0	1320	0
2.11 Intereses vencidos e impagados	0330	0	1330	0
3. Derechos de crédito	0400	20.629	1400	21.326
3.1 Participaciones hipotecarias	0401	17.079	1401	17.811
3.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0402	1.811	1402	1.824
3.3 Préstamos hipotecarios	0403	0	1403	0
3.4 Cédulas Hipotecarias	0404	0	1404	0
3.5 Préstamos a promotores	0405	0	1405	0
3.6 Préstamos a PYMES	0406	0	1406	0
3.7 Préstamos a empresas	0407	0	1407	0
3.8 Préstamos Corporativos	0408	0	1408	0
3.9 Cédulas territoriales	0409	0	1409	0
3.10 Bonos de Tesorería	0410	0	1410	0
3.11 Deuda Subordinada	0411	0	1411	0
3.12 Créditos AAPP	0412	0	1412	0
3.13 Préstamos Consumo	0413	0	1413	0
3.14 Préstamos automoción	0414	0	1414	0
3.15 Arrendamiento financiero	0415	0	1415	0
3.16 Cuentas a cobrar	0416	0	1416	0
3.17 Derechos de crédito futuros	0417	0	1417	0
3.18 Bonos de titulización	0418	0	1418	0
3.19 Otros	0419	0	1419	0
3.20 Activos dudosos	0420	1.170	1420	1.063
3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0421	-18	1421	-18
3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0422	414	1422	460
3.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0423	0	1423	0
3.24 Intereses vencidos e impagados	0424	173	1424	186
4. Derivados	0430	0	1430	0
4.1 Derivados de cobertura	0431	0	1431	0
4.2 Derivados de negociación	0432	0	1432	0
5. Otros activos financieros	0440	6	1440	5
5.1 Garantías financieras	0441	0	1441	0
5.2 Otros	0442	6	1442	5
VI. Ajustes por periodificaciones	0450	1	1450	4
1. Comisiones	0451	0	1451	0
2. Otros	0452	1	1452	4
VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes	0460	14.457	1460	16.101
1. Tesorería	0461	14.457	1461	16.101
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462	0	1462	0

TOTAL ACTIVO	0500	321.037	1500	339.891
--------------	------	---------	------	---------

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.				
Estados agregados: Si				
Periodo: 1er Semestre				
Ejercicio: 2014				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2014		Periodo Anterior 31/12/2013
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0650	293.841	1650	311.169
I. Provisiones a largo plazo	0660	0	1660	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0700	293.841	1700	311.169
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	290.183	1710	308.894
1.1 Series no subordinadas	0711	255.572	1711	274.283
1.2 Series subordinadas	0712	34.611	1712	34.611
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0713		1713	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0714	0	1714	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0715	0	1715	0
2. Deudas con entidades de crédito	0720	45	1720	45
2.1 Préstamo subordinado	0721	45	1721	45
2.2 Crédito línea de liquidez	0722	0	1722	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0723	0	1723	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0724		1724	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0725	0	1725	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0726	0	1726	0
3. Derivados	0730	3.613	1730	2.230
3.1 Derivados de cobertura	0731	3.613	1731	2.230
3.2 Derivados de negociación	0732	0	1732	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0733		1733	
4. Otros pasivos financieros	0740	0	1740	0
4.1 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0741		1741	
4.2 Otros	0742	0	1742	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0750	0	1750	0
B) PASIVO CORRIENTE	0760	31.242	1760	31.149
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0770	0	1770	0
V. Provisiones a corto plazo	0780	0	1780	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0800	22.886	1800	23.305
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	0	1810	0
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	21.180	1820	21.641
2.1 Series no subordinadas	0821	20.060	1821	20.699
2.2 Series subordinadas	0822	0	1822	0
2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0823		1823	
2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0824	313	1824	269
2.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0825	0	1825	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0826	807	1826	673
3. Deudas con entidades de crédito	0830	9	1830	9
3.1 Préstamo subordinado	0831	0	1831	0
3.2 Crédito línea de liquidez	0832	0	1832	0
3.3 Otras deudas con entidades de crédito	0833	0	1833	0
3.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0834		1834	
3.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0835	7	1835	7
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836	0	1836	0
3.7 Intereses vencidos e impagados	0837	2	1837	2
4. Derivados	0840	1.697	1840	1.655
4.1 Derivados de cobertura	0841	1.697	1841	1.655
4.2 Derivados de negociación	0842	0	1842	0
4.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0843		1843	
5. Otros pasivos financieros	0850	0	1850	0
5.1 Importe bruto	0851	0	1851	0
5.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0852		1852	

VII. Ajustes por periodificación	0900	8.356	1900	7.844
1. Comisiones	0910	7.959	1910	7.328
1.1 Comisión sociedad gestora	0911	8	1911	9
1.2 Comisión administrador	0912	0	1912	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0913	6	1913	6
1.4 Comisión variable - resultados realizados	0914	7.945	1914	7.313
1.5 Comisión variable - resultados no realizados	0915	0	1915	0
1.6 Otras comisiones del cedente	0916	0	1916	0
1.7 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0917		1917	
1.8 Otras comisiones	0918	0	1918	0
2. Otros	0920	397	1920	516
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0930	-4.046	1930	-2.427
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0940	0	1940	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0950	-4.046	1950	-2.427
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0960	0	1960	0
XI. Gastos de constitución en transición	0970		1970	
TOTAL PASIVO	1000	321.037	2000	339.891

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.02

Denominación del Fondo: TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.

Estados agregados: Si

Periodo: 1er Semestre

Ejercicio: 2014

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. Corriente Actual 2º semestre		P. Corriente Anterior 2º semestre		Acumulado Actual 30/06/2014		Acumulado Anterior 30/06/2013
1. Intereses y rendimientos asimilados	0100		1100		2100	3.686	3100	4.520
1.1 Valores representativos de deuda	0110		1110		2110	0	3110	0
1.2 Derechos de crédito	0120		1120		2120	3.667	3120	4.503
1.3 Otros activos financieros	0130		1130		2130	19	3130	17
2. Intereses y cargas asimiladas	0200		1200		2200	-859	3200	-781
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210		1210		2210	-859	3210	-781
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220		1220		2220		3220	
2.3 Otros pasivos financieros	0230		1230		2230		3230	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0240		1240		2240	-2.142	3240	-3.032
A) MARGEN DE INTERESES	0250		1250		2250	685	3250	707
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0300		1300		2300	-1	3300	-1
4.1 Ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0310		1310		2310	0	3310	0
4.2 Activos financieros disponibles para la venta	0320		1320		2320	0	3320	0
4.3 Otros	0330		1330		2330	-1	3330	-1
5. Diferencias de cambio (neto)	0400		1400		2400	0	3400	0
6. Otros ingresos de explotación	0500		1500		2500	0	3500	0
7. Otros gastos de explotación	0600		1600		2600	-684	3600	-697
7.1 Servicios exteriores	0610		1610		2610	-8	3610	-36
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611		1611		2611	-8	3611	-36
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0612		1612		2612		3612	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0613		1613		2613		3613	
7.1.4 Otros servicios	0614		1614		2614		3614	
7.2 Tributos	0620		1620		2620	0	3620	0
7.3 Otros gastos de gestión corrientes	0630		1630		2630	-676	3630	-661
7.3.1 Comisión de sociedad gestora	0631		1631		2631	-27	3631	-27
7.3.2 Comisión administrador	0632		1632		2632		3632	
7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos	0633		1633		2633	-17	3633	-18
7.3.4 Comisión variable - resultados realizados (neto)	0634		1634		2634	-632	3634	-616
7.3.5 Comisión variables - resultados no realizados (neto)	0635		1635		2635	0	3635	0
7.3.6 Otras comisiones del cedente	0636		1636		2636		3636	
7.3.7 Otros gastos	0637		1637		2637	0	3637	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0700		1700		2700	0	3700	-9
8.1 Deterioro neto de valores representativos de deuda	0710		1710		2710	0	3710	0
8.2 Deterioro neto de derechos de crédito	0720		1720		2720	0	3720	-9
8.3 Deterioro neto de derivados	0730		1730		2730	0	3730	0
8.4 Deterioro neto de otros activos financieros	0740		1740		2740	0	3740	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0750		1750		2750	0	3750	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0800		1800		2800	0	3800	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0850		1850		2850	0	3850	0
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0900		1900		2900	0	3900	0
12. Impuesto sobre beneficios	0950		1950		2950	0	3950	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	3000		4000		5000	0	6000	0

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.03

Denominación del Fondo: TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
Estados agregados: Si
Periodo: 1er Semestre
Ejercicio: 2014

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2014		Mismo Periodo año Anterior 30/06/2013
A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN	8000	682	9000	1.495
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	8100	727	9100	644
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	3.725	9110	4.650
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-681	9120	-678
1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados	8130	-2.335	9130	-3.345
1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras	8140	18	9140	17
1.5 Intereses pagados por préstamos y créditos en entidades de crédito	8150		9150	
1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	8160	0	9160	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo	8200	-46	9200	-45
2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora	8210	-28	9210	-27
2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados	8220		9220	
2.3 Comisiones pagadas al agente financiero	8230	-18	9230	-18
2.4 Comisiones variables pagadas	8240		9240	
2.5 Otras comisiones	8250		9250	
3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo	8300	1	9300	896
3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos	8310	0	9310	0
3.2 Pagos de provisiones	8320		9320	
3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta	8325		9325	
3.4 Otros	8330	1	9330	896
B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION	8350	-2.326	9350	-2.241
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	8400	0	9400	0
4.1 Cobros por emisión de valores de titulización	8410	0	9410	0
4.2 Pagos por emisión de valores de titulización (aseguramiento colocación)	8420		9420	
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	8500		9500	
5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito	8510		9510	
5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras	8520		9520	
6. Flujos de caja netos por amortizaciones	8600	-2.312	9600	-2.199
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	17.038	9610	18.835
6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados	8620	0	9620	0
6.3 Pagos por amortización de valores de titulización	8630	-19.350	9630	-21.034
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	8700	-14	9700	-42
7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos	8710	0	9710	0
7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos	8720		9720	
7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso	8730	0	9730	0
7.4 Administraciones públicas - Pasivo	8740	0	9740	0
7.5 Otros deudores y acreedores	8750	-14	9750	-42
7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras	8770	0	9770	0
7.7 Cobros de Subvenciones	8780	0	9780	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	8800	-1.644	9800	-746
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	16.101	9900	17.600
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	14.457	9990	16.854

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.04

Denominación del Fondo: **TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **Si**
 Periodo: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2014**

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2014		Mismo Periodo año Anterior 30/06/2013
1 Activos financieros disponibles para la venta				
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6010	0	7010	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6020	0	7020	0
1.1.2 Efecto fiscal	6021	0	7021	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6022	0	7022	0
1.3 Otras reclasificaciones	6030	0	7030	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6040	0	7040	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	6100	0	7100	0
2 Cobertura de los flujos de efectivo				
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6110	-3.761	7110	-7.367
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6120	-3.761	7120	-7.367
2.1.2 Efecto fiscal	6121	0	7121	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6122	2.142	7122	3.032
2.3 Otras reclasificaciones	6130	0	7130	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6140	1.619	7140	4.335
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	6200	0	7200	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 periodo	6310	0	7310	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6320	0	7320	0
3.1.2 Efecto fiscal	6321	0	7321	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6322	0	7322	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6330	0	7330	0
Total Ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	6400	0	7400	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	6500	0	7500	0

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **SI**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2014**

Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANCO GUIPUZCOANO, S.A. - BANCA MARCH, S.A.**

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

Tipología de activos titulizados	Situación actual 30/06/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Situación inicial 05/07/2006			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)	Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)	Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)	Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)				
Participaciones hipotecarias	0001	3.467	0030	266.947	0060	3.581	0090	282.518	0120	6.924	0150	825.000
Certificados de transmisión hipotecaria	0002	361	0031	39.061	0061	364	0091	40.640	0121	544	0151	75.000
Préstamos hipotecarios	0003		0032		0062		0092		0122		0152	
Cédulas hipotecarias	0004		0033		0063		0093		0123		0153	
Préstamos a promotores	0005		0034		0064		0094		0124		0154	
Préstamos a PYMES	0007		0036		0066		0096		0126		0156	
Préstamos a empresas	0008		0037		0067		0097		0127		0157	
Préstamos Corporativos	0009		0038		0068		0098		0128		0158	
Cédulas territoriales	0010		0039		0069		0099		0129		0159	
Bonos de tesorería	0011		0040		0070		0100		0130		0160	
Deuda subordinada	0012		0041		0071		0101		0131		0161	
Créditos AAPP	0013		0042		0072		0102		0132		0162	
Préstamos consumo	0014		0043		0073		0103		0133		0163	
Préstamos automoción	0015		0044		0074		0104		0134		0164	
Arrendamiento financiero	0016		0045		0075		0105		0135		0165	
Cuentas a cobrar	0017		0046		0076		0106		0136		0166	
Derechos de crédito futuros	0018		0047		0077		0107		0137		0167	
Bonos de titulización	0019		0048		0078		0108		0138		0168	
Otros	0020		0049		0079		0109		0139		0169	
Total	0021	3.828	0050	306.008	0080	3.945	0110	323.158	0140	7.468	0170	900.000

(1) Entendido como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **SI**
 Periodo: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2014**
 Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANCO GUIPUZCOANO, S.A. - BANCA MARCH, S.A.**

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO B

Movimiento de la cartera de activos titulizados/Tasa de amortización anticipada	Situación actual 30/06/2014		Situación cierre anual anterior 31/12/2013	
	Código	Importe	Código	Importe
Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior	0196		0206	-45
Derechos de crédito dados de baja por dación/adjudicación de bienes desde el cierre anual anterior	0197		0207	
Amortización ordinaria desde el cierre anual anterior	0200	-9.816	0210	-21.741
Amortización anticipada desde el cierre anual anterior	0201	-7.334	0211	-14.466
Total importe amortizado acumulado, incluyendo adjudicaciones y otros pagos en especie, desde el origen del Fondo	0202	-594.649	0212	-577.499
Importe de principal pendiente de amortización de los nuevos activos incorporados en el periodo (1)	0203	0	0213	0
Principal pendiente cierre del periodo (2)	0204	306.008	0214	323.158
Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)	0205	4,12	0215	4,02

(1) En fondos abiertos, importe de principal pendiente de reembolso en la fecha de presentación de la información de los nuevos activos incorporados en el periodo

(2) Importe del principal pendiente de reembolso de la totalidad de los activos (incluidas las nuevas incorporaciones del periodo) a fecha del informe

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.

Estados agregados: Si

Periodo: 1er Semestre

Ejercicio: 2014

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO GUIPUZCOANO, S.A. - BANCA MARCH, S.A.

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO C

Total Impagados (1)	Nº de activos	Importe impagado							Principal pendiente no vencido	Deuda Total		
		Principal pendiente vencido		Intereses ordinarios (2)		Total						
Hasta 1 mes	0700	103	0710	34	0720	12	0730	46	0740	10.029	0750	10.075
De 1 a 3 meses	0701	94	0711	97	0721	41	0731	138	0741	8.763	0751	8.901
De 3 a 6 meses	0703	11	0713	24	0723	14	0733	38	0743	1.027	0753	1.065
De 6 a 9 meses	0704	15	0714	37	0724	25	0734	62	0744	1.443	0754	1.505
De 9 a 12 meses	0705	6	0715	26	0725	26	0735	52	0745	956	0755	1.008
De 12 meses a 2 años	0706	43	0716	170	0726	109	0736	279	0746	4.385	0756	4.664
Más de 2 años	0708	55	0718	192	0728	225	0738	417	0748	6.497	0758	6.914
Total	0709	327	0719	580	0729	452	0739	1.032	0749	33.100	0759	34.132

(1) La distribución de los activos vencidos impagados entre los distintos tramos señalados se realizará en función de la antigüedad de la primera cuota vencida y no cobrada. Los intervalos se entenderán excluido el de inicio e incluido el final (p.e. De 1 a 3 meses, esto es: superior a 1 mes y menor o igual a 3 meses)

(2) Importe de intereses cuyo devengo, en su caso, se ha interrumpido conforme lo establecido en el apartado 12 de la norma 13ª de la Circular(p.e. De 1 a 3 meses, esto es: superior a 1 mes y menor o igual a 3 meses)

Impagados con garantía real (2)	Nº de activos	Importe impagado							Principal pendiente no vencido	Deuda Total	Valor garantía (3)	Valor Garantía con Tasación > 2 años (4)	% Deuda/v. Tasación			
		Principal pendiente vencido		Intereses ordinarios		Total										
Hasta 1 mes	0772	103	0782	34	0792	12	0802	46	0812	10.029	0822	10.075	0832	23.669	0842	42,56
De 1 a 3 meses	0773	94	0783	97	0793	41	0803	138	0813	8.763	0823	8.901	0833	21.214	0843	41,95
De 3 a 6 meses	0774	11	0784	24	0794	14	0804	38	0814	1.027	0824	1.065	0834	2.354	0844	45,24
De 6 a 9 meses	0775	15	0785	37	0795	25	0805	62	0815	1.443	0825	1.505	0835	2.512	0845	59,88
De 9 a 12 meses	0776	6	0786	26	0796	26	0806	52	0816	956	0826	1.008	0836	1.791	0846	56,33
De 12 meses a 2 años	0777	43	0787	170	0797	109	0807	279	0817	4.385	0827	4.664	0837	8.976	0847	51,96
Más de 2 años	0778	55	0788	192	0798	225	0808	417	0818	6.497	0828	6.914	0838	13.896	0848	49,75
Total	0779	327	0789	580	0799	452	0809	1.032	0819	33.100	0829	34.132	0839	74.412	0849	45,87

(2) La distribución de los activos vencidos impagados entre los distintos tramos señalados se realizará en función de la antigüedad de la primera cuota vencida y no cobrada. Los intervalos se entenderán excluido el de inicio e incluido el final (p.e. De 1 a 2 meses, estos es: superior a 1 mes y menor o igual a 2 meses)

(3) Cumplimentar con la última valoración disponible de tasación del inmueble o valor razonable de la garantía real (acciones o deuda pignoralas, etc.) si el valor de las mismas se ha considerado en el momento inicial del Fondo

(4) Se incluirá el valor de las garantías que tengan una tasación superior a dos años

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **Si**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2014**

Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANCO GUIPUZCOANO, S.A. - BANCA MARCH, S.A.**

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

CUADRO D	Situación actual 30/06/2014						Situación cierre anual anterior 31/12/2013						Escenario inicial					
	Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)		Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)		Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)	
Ratios de morosidad (1) (%)																		
Participaciones hipotecarias	0850	5,33	0868	0,34	0886	0,00	0904	4,75	0922	0,32	0940	0,00	0958	0,00	0976	0,00	0994	0,00
Certificados de transmisión de hipoteca	0851	1,38	0869	0,00	0887	0,00	0905	1,57	0923	0,00	0941	0,00	0959	0,00	0977	0,00	0995	0,00
Préstamos hipotecarios	0852		0870		0888		0906		0924		0942		0960		0978		0996	
Cédulas Hipotecarias	0853		0871		0889		0907		0925		0943		0961		0979		0997	
Préstamos a promotores	0854		0872		0890		0908		0926		0944		0962		0980		0998	
Préstamos a PYMES	0855		0873		0891		0909		0927		0945		0963		0981		0999	
Préstamos a empresas	0856		0874		0892		0910		0928		0946		0964		0982		1000	
Préstamos Corporativos	0857		0875		0893		0911		0929		0947		0965		0983		1001	
Cédulas Territoriales	1066		1084		1102		1120		1138		1156		1174		1192		1210	
Bonos de Tesorería	0858		0876		0894		0912		0930		0948		0966		0984		1002	
Deuda subordinada	0859		0877		0895		0913		0931		0949		0967		0985		1003	
Créditos AAPP	0860		0878		0896		0914		0932		0950		0968		0986		1004	
Préstamos Consumo	0861		0879		0897		0915		0933		0951		0969		0987		1005	
Préstamos automoción	0862		0880		0898		0916		0934		0952		0970		0988		1006	
Cuotas arrendamiento financiero	0863		0881		0899		0917		0935		0953		0971		0989		1007	
Cuentas a cobrar	0864		0882		0900		0918		0936		0954		0972		0990		1008	
Derechos de crédito futuros	0865		0883		0901		0919		0937		0955		0973		0991		1009	
Bonos de titulización	0866		0884		0902		0920		0938		0956		0974		0992		1010	
Otros	0867		0885		0903		0921		0939		0957		0975		0993		1011	

(1) Estos ratios se referirán exclusivamente a la cartera de activos cedidos al Fondo(presentados en el balance en la partida de "derechos de crédito") y se expresaran en términos porcentuales

(A) Determinada por el cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos a la fecha de presentación de la información, y el principal pendiente (sin incluir intereses, e incluyendo principales impagados) del total activos dados de alta en el balance a la fecha de presentación de la información. La clasificación como dudosos se realizará con arreglo a lo previsto en las Normas 13ª y 23ª

(B) Determinada por el cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos a la fecha de presentación de la información, y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en el balance a la fecha de presentación de la información más el principal de los activos clasificados como fallidos. Se considerará la definición de fallidos recogida en la Circular (no necesariamente coincidentes con la definición de la escritura o folleto, recogidas en el estado 5.4)

(D) Determinada por el cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo periodo del año anterior y el importe de principal de activos clasificados como fallidos al cierre del mismo periodo del año anterior

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **SI**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2014**

Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANCO GUIPUZCOANO, S.A. - BANCA MARCH, S.A.**

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO E Vida residual de los activos cedidos al Fondo (1)	Situación actual 30/06/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Situación inicial 05/07/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior a 1 año	1300	109	1310	494	1320	81	1330	346	1340	9	1350	65
Entre 1 y 2 años	1301	62	1311	555	1321	104	1331	1.116	1341	5	1351	61
Entre 2 y 3 años	1302	64	1312	1.139	1322	55	1332	909	1342	8	1352	170
Entre 3 y 5 años	1303	221	1313	5.978	1323	185	1333	4.739	1343	69	1353	3.020
Entre 5 y 10 años	1304	660	1314	29.621	1324	665	1334	30.052	1344	526	1354	32.547
Superior a 10 años	1305	2.712	1315	268.220	1325	2.855	1335	285.995	1345	6.851	1355	864.137
Total	1306	3.828	1316	306.007	1326	3.945	1336	323.157	1346	7.468	1356	900.000
Vida residual media ponderada (años)	1307	16,34			1327	16,70			1347	22,97		

(1) Los intervalos se entenderán excluido el inicio del mismo e incluido el final (p.e. Entre 1 y 2 años: superior a 1 año y menor o igual a 2 años)

Antigüedad	Situación actual 30/06/2014		Situación cierre anual anterior 31/12/2013		Situación inicial 05/07/2006	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	9,64	0632	9,14	0634	1,76

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **SI**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2014**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)

Serie (2)	Denominación serie	Situación actual 30/06/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Escenario inicial 05/07/2006			
		Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)
		0001	0002	0003	0004	0005	0006	0007	0008	0009	0070	0080	0090
ES0377953007	SERIE 1 A1	1.650	0	0	0,00	1.650	0	0	0,00	1.650	100	165.000	0,76
ES0377953015	SERIE 1 A2	6.364	38	241.087	5,01	6.364	41	259.003	4,78	6.364	100	636.400	5,84
ES0377953023	SERIE 1 B	182	93	16.946	8,44	182	93	16.946	8,75	182	100	18.200	8,04
ES0377953031	SERIE 1 C	54	100	5.400	9,11	54	100	5.400	8,75	54	100	5.400	7,20
ES0377953049	SERIE 1 D	62	100	6.200	9,11	62	100	6.200	8,75	62	100	6.200	11,70
ES0377953056	SERIE 2 A	701	49	34.544	5,98	701	51	35.979	6,31	701	100	70.100	5,84
ES0377953064	SERIE 2 B	49	100	4.900	9,11	49	100	4.900	9,76	49	100	4.900	8,39
ES0377953072	SERIE 2 C	19	59	1.165	9,00	19	59	1.165	0,00	19	100	1.900	7,88
Total		8006	9.081	8025	310.242	8045	9.081	8065	329.593	8085	9.081	8105	908.100

(1) Importes en años. En caso de ser estimado se indicará en las notas explicativas las hipótesis de estimación

(2) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **TD A 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **SI**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2014**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)

CUADRO B																			
Serie (1)	Denominación serie	Grado de subordinación (2)	Índice de referencia (3)	Margen (4)	Tipo aplicado	Intereses				Principal pendiente		Corrección de valor por repercusión de pérdidas							
						Base de cálculo de intereses		Días Acumulados (5)	Intereses Acumulados (6)	Intereses impagados	Principal no vencido	Principal impagado	Total pendiente						
						9950	9960	9970	9980	9990	9991	9993	9997	9994	9995	9998	9955		
ES0377953007	SERIE 1 A1	NS	EURIBOR 3 m	0,04	0,00	360		63	0	0	0	0	0						
ES0377953015	SERIE 1 A2	NS	EURIBOR 3 m	0,14	0,48	360		63	201	0	241.087	0	241.288						
ES0377953023	SERIE 1 B	S	EURIBOR 3 m	0,35	0,69	360		63	20	0	16.946	0	16.966						
ES0377953031	SERIE 1 C	S	EURIBOR 3 m	0,50	0,84	360		63	8	0	5.400	0	5.408						
ES0377953049	SERIE 1 D	S	EURIBOR 3 m	3,50	3,84	360		63	42	790	6.200	0	7.032						
ES0377953056	SERIE 2 A	NS	EURIBOR 3 m	0,16	0,50	360		63	30	0	34.544	0	34.574						
ES0377953064	SERIE 2 B	S	EURIBOR 3 m	0,37	0,71	360		63	6	0	4.900	0	4.906						
ES0377953072	SERIE 2 C	S	EURIBOR 3 m	2,50	2,84	360		63	6	16	1.125	40	1.187						
Total									9228	313	9105	806	9085	310.202	9095	40	9115	311.361	9227

(1) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

(2) La gestora deberá indicar si la serie es subordinada o no subordinada (S=Subordinada; NS=No subordinada)

(3) La gestora deberá cumplimentar el índice de referencia que corresponda en cada caso (EURIBOR un año, EURIBOR a tres meses...). En el caso de tipos fijos esta columna se cumplimentará con el término "fijo"

(4) En el caso de tipos fijos esta columna no se cumplimentará

(5) Días acumulados desde la última fecha de pago

(6) Intereses acumulados desde la última fecha de pago

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **TD A 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **SI**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2014**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)

CUADRO C			Situación actual 30/06/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013											
			Amortización principal		Intereses		Amortización principal		Intereses									
Serie (1)	Denominación serie	Fecha final (2)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)								
		7290	7300	7310	7320	7330	7340	7350	7360	7370								
ES0377953007	SERIE 1 A1	28-04-2008	0	165.000	0	5.450	0	165.000	0	5.450								
ES0377953015	SERIE 1 A2	28-01-2049	17.915	395.313	516	90.229	37.049	377.398	998	89.713								
ES0377953023	SERIE 1 B	28-01-2049	0	1.254	52	3.265	0	1.254	96	3.213								
ES0377953031	SERIE 1 C	28-01-2049	0	0	21	1.045	0	0	39	1.024								
ES0377953049	SERIE 1 D	28-01-2049	0	0	0	1.880	0	0	0	1.880								
ES0377953056	SERIE 2 A	28-01-2049	1.435	35.557	76	9.325	3.195	34.122	142	9.249								
ES0377953064	SERIE 2 B	28-01-2049	0	0	16	898	0	0	29	882								
ES0377953072	SERIE 2 C	28-01-2049	0	734	0	553	45	734	63	553								
Total			7305	19.350	7315	597.858	7325	681	7335	112.645	7345	40.289	7355	578.508	7365	1.367	7375	111.964

(1) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

(2) Entendiendo como fecha final aquella que de acuerdo con la documentación contractual determine la extinción del Fondo, siempre que no se haya producido previamente una causa de liquidación anticipada

(3) Total de pagos realizados desde el último cierre anual

(4) Total de pagos realizados desde la fecha de constitución del Fondo

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **SI**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2014**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

CUADRO D

Serie (1)	Denominación serie	Calificación				
		Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Situación actual	Situación anual cierre anterior	Situación inicial
		3310	3330	3350	3360	3370
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	08-06-2012	FCH	AA-	AA-	AAA
ES0377953015	SERIE 1 A2	23-11-2012	MDY	Baa1	Baa1	Aaa
ES0377953023	SERIE 1 B	17-05-2013	FCH	BBB	BBB	A
ES0377953023	SERIE 1 B	23-11-2012	MDY	B1	B1	Aa3
ES0377953031	SERIE 1 C	17-05-2013	FCH	BB+	BB+	BBB
ES0377953031	SERIE 1 C	21-05-2013	MDY	Caa2	Caa2	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	17-05-2013	FCH	A	A	AAA
ES0377953064	SERIE 2 B	23-04-2014	FCH	BB	BBB	A-
ES0377953072	SERIE 2 C	05-07-2006	FCH	CCC	CCC	CCC

(1) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

(2) La gestora deberá cumplimentar la calificación crediticia otorgada por cda agencia de rating, cuya denominación también deberá ser cumplimentada, para serie - MDY para Moody's; SYP para Standard & Poors; FCH para Fitch; DBRS para Dominion Bond Rating Service -

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.3

Denominación del Fondo: TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS Denominación del compartimento: Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. Estados agregados: Si Periodo: 1er Semestre Ejercicio: 2014
--

INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS <i>(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)</i>		Situación actual 30/06/2014		Situación cierre anual anterior 31/12/2013
---	--	--	--	---

1. Importe del Fondo de Reserva	0010		1010	
2. Porcentaje que representa el Fondo de Reserva, u otras mejoras equivalentes, sobre el total de activos titulizados	0020		1020	
3. Exceso de spread (%) (1)	0040		1040	
4. Permuta financiera de intereses (S/N)	0050	No	1050	No
5. Permuta financiera de tipos de cambio (S/N)	0070	No	1070	No
6. Otras permutas financieras (S/N)	0080	No	1080	No
7. Importe disponible de la línea/s de liquidez (2)	0090		1090	
8. Subordinación de series (S/N)	0110	No	1110	No
9. Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total de bonos (3)	0120		1120	
10. Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales	0150		1150	
11. Porcentaje que representa el aval sobre el total de los pasivos emitidos	0160		1160	
12. Importe máximo de riesgo cubierto por derivados de crédito u otras garantías financieras adquiridas	0170		1170	
13. Otros (S/N) (4)	0180	No	1180	No

(1) Diferencial existente entre los tipos de interés medios ponderados percibidos de la cartera de activos titulizados conforme se establece en el Cuadro 5.5.E y el tipo de interés medio de los pasivos emitidos cuya finalidad ha sido la adquisición de los activos

(2) Se incluirá el importe total disponible de las distintas líneas de liquidez en caso de que haya más de una

(3) Entendiendo como no subordinadas aquellas series que en la fecha se encuentren, respecto a las demás, en una posición anterior para el cobro de capital conforme al orden de prelación de pagos

(4) La gestora deberá incluir una descripción de dichas mejoras crediticias en las notas explicativas en caso de que las consideren relevantes

Información sobre contrapartes de las mejoras crediticias		NIF		Denominación
Contraparte del Fondo de Reserva u otras mejores equivalentes (5)	0200		1210	N/A
Permutas financieras de tipos de interés	0210		1220	N/A
Permutas financieras de tipos de cambio	0220		1230	N/A
Otras permutas financieras	0230		1240	N/A
Contraparte de la Línea de Liquidez	0240		1250	N/A
Entidad Avalista	0250		1260	N/A
Contraparte del derivado de crédito	0260		1270	N/A

(5) Si el Fondo de Reserva se ha constituido a través de títulos emitidos y se desconoce el titular de esos títulos no se cumplimentará

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.4

Denominación del Fondo: **TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **Si**
 Período: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2014**

CIRCUNSTANCIAS ESPECÍFICAS ESTABLECIDAS CONTRACTUALMENTE EN EL FONDO

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

Concepto (1)	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio (2)				Ref. Folleto
	0100	0200	0300	0400	Situación actual	Periodo anterior	Situación actual	Periodo anterior	Situación actual	Periodo anterior	Última Fecha Pago		
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	0010		0030		0100	0200	0300	0400	0400	1120			
2. Activos Morosos por otras razones					0110	0210	0310	0410	1130				
Total Morosos					0120	0220	0320	0420	1140		1280		
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	0050		0060		0130	0230	0330	0430	1050				
4. Activos Fallidos por otras razones					0140	0240	0340	0440	1160				
Total Fallidos					0150	0250	0350	0450	1200		1290		

(1) En caso de existir definiciones adicionales a las recogidas en la presente tabla (moros cualificadas, fallidos subjetivos, etc) respecto a las que se establezca algún trigger se indicarán en la tabla de Otros ratios relevantes, indicando el nombre del ratio

(2) Los ratios se corresponden al importe total de activos fallidos o morosos entre el saldo vivo de los activos cedidos al fondo según se defina en la documentación contractual. En la columna Ref. Folleto se indicará el epígrafe o capítulo del folleto en el que el concepto esté definido

Otros ratios relevantes	Ratio (2)				Ref. Folleto
	Situación actual	periodo anterior	Última Fecha Pago		
N/A	0160	0260	0360	0460	

TRIGGERS (3)	Límite	% Actual	Última Fecha Pago		Ref. Folleto
			0540	0572	
Amortización secuencial: series (4)	0500	0520	0540		0560
N/A N/A					
Diferimiento/postergamiento intereses: series (5)	0506	0526	0546		0566
N/A N/A					
No Reducción del Fondo de Reserva (6)	0512	0532	0552	0572	
OTROS TRIGGERS (3)	0513	0523	0553		0573
N/A					

(3) En caso de existir triggers adicionales a los recogidos en la presente tabla se indicarán su nombre o concepto debajo de OTROS TRIGGERS. Si los triggers recogidos expresamente en la tabla no están previstos en el Fondo, no se cumplimentarán

(4) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto al modo de amortización (prorrata/secuencial) de algunas de las series se indicarán las series afectadas indicando su ISIN, y en su defecto el nombre, el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

(5) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto al diferimiento o postergamiento de intereses de algunas de las series se indicarán las series afectadas indicando su ISIN o nombre, el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

(6) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto a la no reducción del fondo de reserva se indicará el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

--

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **Si**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2014**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO A Distribución geográfica de activos titulizados	Situación actual 30/06/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Situación inicial 05/07/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)	
Andalucía	0400	264	0426	24.221	0452	269	0478	25.648	0504	473	0530	70.253
Aragón	0401	17	0427	1.563	0453	19	0479	1.701	0505	39	0531	5.037
Asturias	0402	1	0428	94	0454	1	0480	96	0506	4	0532	516
Baleares	0403	996	0429	76.616	0455	1.028	0481	80.232	0507	1.621	0533	182.117
Canarias	0404	680	0430	43.618	0456	699	0482	46.178	0508	1.280	0534	120.110
Cantabria	0405	18	0431	1.164	0457	18	0483	1.208	0509	34	0535	3.842
Castilla-León	0406	75	0432	6.410	0458	76	0484	6.656	0510	133	0536	15.993
Castilla La Mancha	0407	46	0433	4.835	0459	47	0485	4.999	0511	127	0537	17.692
Cataluña	0408	224	0434	24.704	0460	234	0486	26.201	0512	539	0538	84.807
Ceuta	0409	0	0435	0	0461	0	0487	0	0513	0	0539	0
Extremadura	0410	2	0436	64	0462	2	0488	68	0514	3	0540	151
Galicia	0411	4	0437	167	0463	4	0489	192	0515	6	0541	412
Madrid	0412	456	0438	45.264	0464	473	0490	48.264	0516	1.040	0542	148.701
Meilla	0413	0	0439	0	0465	0	0491	0	0517	0	0543	0
Murcia	0414	25	0440	1.573	0466	26	0492	1.650	0518	48	0544	5.142
Navarra	0415	50	0441	4.121	0467	53	0493	4.441	0519	134	0545	17.688
La Rioja	0416	25	0442	1.366	0468	25	0494	1.440	0520	42	0546	4.281
Comunidad Valenciana	0417	496	0443	34.003	0469	512	0495	36.077	0521	1.060	0547	112.674
País Vasco	0418	449	0444	36.226	0470	459	0496	38.107	0522	885	0548	110.585
Total España	0419	3.828	0445	306.009	0471	3.945	0497	323.158	0523	7.468	0549	900.001
Otros países Unión europea	0420	0	0446	0	0472	0	0498	0	0524	0	0550	0
Resto	0422	0	0448	0	0474	0	0500	0	0526	0	0552	0
Total general	0425	3.828	0450	306.009	0475	3.945	0501	323.158	0527	7.468	0553	900.001

(1) Entendiendo como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **SI**
 Período: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2014**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

Divisa/Activos titulizados	Situación actual 30/06/2014						Situación cierre anual anterior 31/12/2013						Situación inicial 05/07/2006					
	Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)	
Euro - EUR	0571	3.828	0577	306.008	0583	306.008	0600	3.945	0606	323.158	0611	323.158	0620	7.468	0626	900.000	0631	900.000
EEUU Dólar - USD	0572	0	0578	0	0584	0	0601	0	0607	0	0612	0	0621	0	0627	0	0632	0
Japón Yen - JPY	0573	0	0579	0	0585	0	0602	0	0608	0	0613	0	0622	0	0628	0	0633	0
Reino Unido Libra - GBP	0574	0	0580	0	0586	0	0603	0	0609	0	0614	0	0623	0	0629	0	0634	0
Otras	0575	0			0587	0	0604	0			0615	0	0624	0			0635	0
Total	0576	3.828			0588	306.008	0605	3.945			0616	323.158	0625	7.468			0636	900.000

(1) Entendiendo como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **Si**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2014**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO C

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (1)	Situación actual 30/06/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Situación inicial 05/07/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	1100	2.026	1110	105.482	1120	2.036	1130	107.382	1140	1.798	1150	133.421
40% - 60%	1101	1.186	1111	124.403	1121	1.216	1131	129.574	1141	2.136	1151	247.829
60% - 80%	1102	607	1112	74.916	1122	681	1132	84.512	1142	3.033	1152	446.129
80% - 100%	1103	9	1113	1.207	1123	12	1133	1.690	1143	501	1153	72.621
100% - 120%	1104	0	1114	0	1124	0	1134	0	1144	0	1154	0
120% - 140%	1105	0	1115	0	1125	0	1135	0	1145	0	1155	0
140% - 160%	1106	0	1116	0	1126	0	1136	0	1146	0	1156	0
superior al 160%	1107	0	1117	0	1127	0	1137	0	1147	0	1157	0
Total	1108	3.828	1118	306.008	1128	3.945	1138	323.158	1148	7.468	1158	900.000
Media ponderada (%)			1119	46,21			1139	47,04			1159	60,94

(1) Distribución según el valor de la razón entre el importe pendiente de amortizar de los préstamos con garantía real y la última valoración disponible de tasación de los inmuebles hipotecados, o valor razonable de otras garantías reales, siempre que el valor de las mismas se haya considerado en el momento inicial del Fondo, expresada en porcentaje

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **Si**
 Período: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2014**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO D

Rendimiento índice del periodo	Número de activos		Principal Pendiente	Margen ponderado s/ índice de referencia		Tipo de interés medio ponderado (2)	
	vivos						
Índice de referencia (1)	1400		1410		1420		1430
MIBOR		25		409		1,35	2,02
IRPH		180		14.480		0,18	3,64
EURIBOR		3.623		291.118		0,78	2,50
Total	1405	3.828	1415	306.007	1425	0,75	1435

(1) La gestora deberá cumplimentar el índice de referencia que corresponda en cada caso (EURIBOR un año, LIBRO, etc.)

(2) En el caso de tipos fijos no se cumplimentará la columna de margen ponderado y se indicará el tipo de interés medio ponderado de los activos a tipo fijo en la columna "tipo de interés medio ponderado"

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **Si**
 Periodo: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2014**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO E Tipo de interés nominal	Situación actual 30/06/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Situación inicial 05/07/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior al 1%	1500	131	1521	14.247	1542	116	1563	12.112	1584	0	1605	0
1% - 1,49%	1501	868	1522	76.447	1543	392	1564	37.780	1585	0	1606	0
1,5% - 1,99%	1502	92	1523	6.372	1544	590	1565	49.842	1586	0	1607	0
2% - 2,49%	1503	57	1524	5.187	1545	72	1566	6.625	1587	1	1608	106
2,5% - 2,99%	1504	326	1525	28.443	1546	345	1567	31.398	1588	985	1609	134.899
3% - 3,49%	1505	1.386	1526	120.805	1547	1.420	1568	126.982	1589	2.017	1610	264.563
3,5% - 3,99%	1506	211	1527	16.872	1548	219	1569	17.159	1590	2.300	1611	288.535
4% - 4,49%	1507	754	1528	37.340	1549	789	1570	40.976	1591	1.959	1612	193.816
4,5% - 4,99%	1508	2	1529	36	1550	1	1571	25	1592	194	1613	17.137
5% - 5,49%	1509	1	1530	260	1551	1	1572	260	1593	9	1614	604
5,5% - 5,99%	1510	0	1531	0	1552	0	1573	0	1594	1	1615	164
6% - 6,49%	1511	0	1532	0	1553	0	1574	0	1595	0	1616	0
6,5% - 6,99%	1512	0	1533	0	1554	0	1575	0	1596	2	1617	177
7% - 7,49%	1513	0	1534	0	1555	0	1576	0	1597	0	1618	0
7,5% - 7,99%	1514	0	1535	0	1556	0	1577	0	1598	0	1619	0
8% - 8,49%	1515	0	1536	0	1557	0	1578	0	1599	0	1620	0
8,5% - 8,99%	1516	0	1537	0	1558	0	1579	0	1600	0	1621	0
9% - 9,49%	1517	0	1538	0	1559	0	1580	0	1601	0	1622	0
9,5% - 9,99%	1518	0	1539	0	1560	0	1581	0	1602	0	1623	0
Superior al 10%	1519	0	1540	0	1561	0	1582	0	1603	0	1624	0
Total	1520	3.828	1541	306.009	1562	3.945	1583	323.159	1604	7.468	1625	900.001
Tipo de interés medio ponderado de los activos(%)			9542	2,55			9584	2,63			1626	3,54
Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%)			9543	0,51			9585	0,45			1627	3,26

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **SI**
 Periodo: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2014**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

CUADRO F

Concentración	Situación actual 30/06/2014			Situación cierre anual anterior 31/12/2013			Situación inicial 05/07/2006		
	Porcentaje		CNAE (2)	Porcentaje		CNAE (2)	Porcentaje		CNAE (2)
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	2000	1,60		2030	1,55		2060	39,65	
Sector: (1)	2010		2020	2040		2050	2070		2080

(1) Indíquese denominación del sector con mayor concentración

(2) Incluir código CNAE con dos niveles de agregación

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **SI**
 Periodo: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2014**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO G

Divisa/Pasivos emitidos por el fondo	Situación actual 30/06/2014						Situación inicial 05/07/2006					
	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros		Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros	
Euro - EUR	3000	9.081	3060	310.242	3110	310.242	3170	9.081	3230	908.100	3250	908.100
EEUU Dólar - USDR	3010	0	3070	0	3120	0	3180	0	3240	0	3260	0
Japón Yen - JPY	3020	0	3080	0	3130	0	3190	0	3250	0	3270	0
Reino Unido Libra - GBP	3030	0	3090	0	3140	0	3200	0	3260	0	3280	0
Otras	3040	0			3150	0	3210	0			3290	0
Total	3050	9.081			3160	310.242	3220	9.081			3300	908.100

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.06

Denominación del Fondo: **TDA 26 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
Estados agregados: **Si**
Periodo: **1er Semestre**
Ejercicio: **2014**

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene
Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

N/A