

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: 200900034
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2021

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:
(sólo se cumplimentará en el supuesto de que se produzca el reenvío con alguna modificación de la información periódica)

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	18.577	1001	19.776
I. Activos financieros a largo plazo	0002	18.577	1002	19.776
1. Activos titulizados	0003	18.577	1003	19.776
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	18.476	1005	19.727
1.3 Préstamos hipotecarios	0006	0	1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007	0	1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008	0	1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009	0	1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010	0	1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011	0	1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012	0	1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013	0	1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014	0	1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015	0	1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016	0	1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017	0	1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018	0	1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019	0	1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020	0	1020	0
1.18 Bonos de titulización	0021	0	1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022	0	1022	0
1.20 Otros	0023	0	1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024	0	1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	101	1025	49
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: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	6.840	1041	6.990
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	4.825	1043	5.613
1. Activos titulizados	0044	1.520	1044	1.614
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	1.474	1046	1.573
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048	0	1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049	0	1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050	0	1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051	0	1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052	0	1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053	0	1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054	0	1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055	0	1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056	0	1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057	0	1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058	0	1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060	0	1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061	0	1061	0
1.18 Bonos de titulización	0062	0	1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063	0	1063	0
1.20 Otros	0064	0	1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	7	1065	9
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	0	1066	0
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	38	1067	30
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	1	1068	1
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	0	1069	0
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	3.305	1074	4.000
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	3.305	1077	4.000
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	2.015	1085	1.377
1. Tesorería	0086	2.015	1086	1.377
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	25.417	1088	26.767

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	25.417	1089	26.761
I. Provisiones a largo plazo	0090	3.719	1090	3.728
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	3.719	1092	3.728
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	21.698	1094	23.033
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	21.670	1095	23.006
1.1 Series no subordinadas	0096	17.827	1096	18.985
1.2 Series subordinadas	0097	3.843	1097	4.020
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	28	1108	28
3.1 Derivados de cobertura	0109	28	1109	28
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: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) PASIVO CORRIENTE	0117	208	1117	206
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	205	1123	203
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	6	1124	4
1.1 Series no subordinadas	0125	0	1125	0
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	4	1128	4
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	2	1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	0	1131	0
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	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	199	1139	199
3.1 Derivados de cobertura	0140	199	1140	199
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	3	1148	3
1. Comisiones	0149	2	1149	2
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	1	1150	1
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	1	1152	1
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	1	1157	1
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-208	1158	-201
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-208	1160	-201
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	25.417	1162	26.767

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2021		Acumulado anterior 30/06/2020
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	24	1201	34	2201	50	3201	70
1.1 Activos titulizados	0202	24	1202	34	2202	50	3202	70
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-6	1204	-7	2204	-15	3204	-17
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-6	1205	-7	2205	-11	3205	-13
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	-4	3207	-4
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-14	1208	-6	2208	-31	3208	-22
A) MARGEN DE INTERESES	0209	4	1209	21	2209	5	3209	31
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	-8	1217	-18	2217	-14	3217	-32
7.1 Servicios exteriores	0218	-2	1218	-2	2218	-3	3218	-2
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-2	1219	-2	2219	-3	3219	-2
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-6	1224	-16	2224	-12	3224	-29
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-2	1225	-2	2225	-5	3225	-5
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-1	1227	-1	2227	-3	3227	-2
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	-11	2228	-5	3228	-22
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-2	1230	-2	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	0	1231	0	2231	0	3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	0	2232	0	3232	0
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	3	1234	-3	2234	9	3234	0
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	3	1236	-3	2236	9	3236	0
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: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2021		Acumulado anterior 30/06/2020
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-1	1300	-4	2300	-11	3300	-9
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	3	1301	10	2301	1	3301	20
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	25	1302	34	2302	52	3302	72
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-4	1303	-6	2303	-9	3303	-12
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-17	1305	-16	2305	-38	3305	-37
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-2	1308	-2	2308	-4	3308	-3
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-4	1309	-14	2309	-12	3309	-29
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-2	1310	-2	2310	-5	3310	-5
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-1	1312	-1	2312	-3	3312	-2
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	-11	2313	-5	3313	-22
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	271	1322	322	2322	648	3322	78
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	273	1325	324	2325	651	3325	81
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	708	1326	634	2326	1.487	3326	1.070
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	229	1327	209	2327	494	3327	298
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	2	1328	9	2328	5	3328	19
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	-665	1331	-528	2331	-1.335	3331	-1.307
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-2	1332	-2	2332	-3	3332	-2
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-2	1336	-2	2336	-3	3336	-2
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	271	1337	318	2337	638	3337	69
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	1.744	1338	1.562	2338	1.377	3338	1.811
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	2.015	1339	1.879	2339	2.015	3339	1.879

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2021		Acumulado anterior 30/06/2020
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-17	1357	-16	2357	-38	3357	-37
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-17	1358	-16	2358	-38	3358	-37
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	14	1360	6	2360	31	3360	22
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	2	1362	11	2362	8	3362	14
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: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2021								Situación cierre anual anterior 31/12/2020								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	0,69	0401	0,00	0421	0,00	0441	4,41	1381	0,37	1401	0,00	1421	0,00	1441	3,31	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	13,00
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	1	0467	0	0474	0	0481	0	0488	0	0495	54	0502	0	0509	54
De 1 a 3 meses	0461	1	0468	1	0475	0	0482	0	0489	1	0496	79	0503	0	0510	80
De 3 a 6 meses	0462	1	0469	1	0476	0	0483	0	0490	2	0497	58	0504	0	0511	60
De 6 a 9 meses	0463	0	0470	0	0477	0	0484	0	0491	0	0498	0	0505	0	0512	0
De 9 a 12 meses	0464	0	0471	0	0478	0	0485	0	0492	0	0499	0	0506	0	0513	0
Más de 12 meses	0465	1	0472	28	0479	1	0486	4	0493	32	0500	52	0507	0	0514	84
Total	0466	4	0473	30	0480	1	0487	4	0494	35	0501	244	0508	0	1515	279

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	1	0522	0	0529	0	0536	0	0543	0	0550	54	0557	0	0564	54	0571	109	0578	109	0584	49,61
De 1 a 3 meses	0516	1	0523	1	0530	0	0537	0	0544	1	0551	79	0558	0	0565	80	0572	152	0579	152	0585	52,83
De 3 a 6 meses	0517	1	0524	1	0531	0	0538	0	0545	2	0552	58	0559	0	0566	60	0573	112	0580	112	0586	53,54
De 6 a 9 meses	0518	0	0525	0	0532	0	0539	0	0546	0	0553	0	0560	0	0567	0	0574	0	0581	0	0587	0,00
De 9 a 12 meses	0519	0	0526	0	0533	0	0540	0	0547	0	0554	0	0561	0	0568	0	0575	0	0582	0	0588	0,00
Más de 12 meses	0520	1	0527	28	0534	1	0541	4	0548	32	0555	52	0562	0	0569	84	0576	137	0583	137	0589	61,40
Total	0521	4	0528	30	0535	1	0542	4	0549	35	0556	244	0563	0	0570	279	0577	511			0590	54,60

S.05.1

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 04/07/2006	
Inferior a 1 año	0600	13	1600	18	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	30	1601	17	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	35	1602	69	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	311	1603	103	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	122	1604	315	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	3.549	1605	3.709	2605	362
Superior a 10 años	0606	16.029	1606	17.149	2606	74.638
Total	0607	20.089	1607	21.380	2607	75.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	12,91	1608	13,34	2608	26,73

Antigüedad	Situación actual 30/06/2021					
	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 04/07/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	16,46	1609	15,96	2609	1,63

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 04/07/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	93	0630	4.128	1620	82	1630	3.667	2620	37	2630	1.352
40% - 60%	0621	180	0631	15.421	1621	197	1631	17.056	2621	4	2631	718
60% - 80%	0622	5	0632	540	1622	6	1632	657	2622	2	2632	308
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	278	0638	20.089	1628	285	1638	21.380	2628	544	2638	75.000
Media ponderada (%)	0639	45,15	0649		1639	46,64	1649		2639	85,96	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 04/07/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,56	1650	0,61	2650	3,51
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,00	1651	4,00	2651	4,82
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,00	2652	2,55

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2021			Situación cierre anual anterior 31/12/2020			Situación inicial 04/07/2006					
	Nº de activos vivos	Principal pendiente		Nº de activos vivos	Principal pendiente		Nº de activos vivos	Principal pendiente				
Andalucía	0660	19	0683	1.467	1660	19	1683	1.547	2660	34	2683	4.963
Aragón	0661	0	0684	0	1661	0	1684	0	2661	0	2684	0
Asturias	0662	1	0685	28	1662	1	1685	31	2662	1	2685	135
Baleares	0663	125	0686	10.044	1663	128	1686	10.672	2663	197	2686	32.026
Canarias	0664	89	0687	5.546	1664	91	1687	5.926	2664	176	2687	21.703
Cantabria	0665	1	0688	57	1665	1	1688	59	2665	1	2688	182
Castilla-León	0666	1	0689	63	1666	1	1689	66	2666	3	2689	541
Castilla La Mancha	0667	1	0690	34	1667	1	1690	38	2667	5	2690	529
Cataluña	0668	4	0691	430	1668	4	1691	444	2668	12	2691	1.927
Ceuta	0669	0	0692	0	1669	0	1692	0	2669	0	2692	0
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	0	1693	0	2670	0	2693	0
Galicia	0671	0	0694	0	1671	0	1694	0	2671	0	2694	0
Madrid	0672	9	0695	745	1672	9	1695	771	2672	34	2695	3.563
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	3	0697	75	1674	3	1697	80	2674	4	2697	259
Navarra	0675	1	0698	106	1675	1	1698	109	2675	4	2698	534
La Rioja	0676	0	0699	0	1676	0	1699	0	2676	1	2699	83
Comunidad Valenciana	0677	5	0700	260	1677	6	1700	328	2677	24	2700	2.049
País Vasco	0678	19	0701	1.234	1678	20	1701	1.308	2678	48	2701	6.503
Total España	0679	278	0702	20.089	1679	285	1702	21.380	2679	544	2702	75.000
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	278	0705	20.089	1682	285	1705	21.380	2682	544	2705	75.000

TDA 26 MIXTO, FTA

S.05.1
Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA
Denominación del compartimento: 200900034
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL, BANCA MARCH

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 04/07/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	5,88			1710	5,70			2710	6,67		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 200900034

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2021			Situación cierre anual anterior 31/12/2020			Situación inicial 04/07/2006					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0377953056	SERIE 2 A	701	25.431	17.827	701	27.083	18.985	701	100.000	70.100			
ES0377953064	SERIE 2 B	49	55.478	2.718	49	59.084	2.895	49	100.000	4.900			
ES0377953072	SERIE 2 C	19	59.211	1.125	19	59.211	1.125	19	100.000	1.900			
Total		0723	769	0724	21.670	1723	769	1724	23.006	2723	769	2724	76.900

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 200900034

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		0738	0739			
									0730	0731	0732	0733			0734	0735	0742
ES0377953056	SERIE 2 A	NS	EURIBOR 3 m	0,16	0,00	0	0	SI	17.827	0	0	0	17.827	0			
ES0377953064	SERIE 2 B	S	EURIBOR 3 m	0,37	0,00	0	0	SI	2.718	0	0	0	2.718	0			
ES0377953072	SERIE 2 C	S	EURIBOR 3 m	2,50	1,96	4	2	SI	1.125	0	0	0	1.131	0			
Total						0740	4	0741	2	0743	21.670	0744	0	0745	21.676	0746	0

	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 04/07/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,16	0748	0,17	0749	3,26

TDA 26 MIXTO, FTA

S.05.2
Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA
Denominación del compartimento: 200900034
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2021
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2021								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2020							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0377953056	SERIE 2 A	577	52.273	0	9.469	458	50.068	0	9.469								
ES0377953064	SERIE 2 B	88	2.182	0	948	70	1.845	0	946								
ES0377953072	SERIE 2 C	0	775	4	750	0	775	6	728								
Total		0754	665	0755	55.230	0756	4	0757	11.167	1754	528	1755	52.688	1756	6	1757	11.144

S.05.2
Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA
Denominación del compartimento: 200900034
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2021
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 04/07/2006
				0762	0763	0764
ES0377953056	SERIE 2 A	29/03/2017	FCH	A+	A+	AAA
ES0377953064	SERIE 2 B	23/01/2019	FCH	A-	A-	A-
ES0377953072	SERIE 2 C	05/07/2006	FCH	CCC	CCC	CCC

S.05.2
Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA
Denominación del compartimento: 200900034
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2021
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 04/07/2006	
Inferior a 1 año	0765	1.215	1765	1.397	2765	2.322
Entre 1 y 2 años	0766	1.021	1766	1.087	2766	2.065
Entre 2 y 3 años	0767	1.021	1767	1.087	2767	2.290
Entre 3 y 4 años	0768	1.021	1768	1.087	2768	2.237
Entre 4 y 5 años	0769	17.392	1769	18.347	2769	2.299
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770	0	2770	12.440
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	53.247
Total	0772	21.670	1772	23.006	2772	76.900
Vida residual media ponderada (años)	0773	4,33	1773	4,33	2773	23,83

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 04/07/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	1.125	1775	1.125	2775	1.900
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	1.125	1776	1.125	2776	1.900
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	5,19	1777	4,89	2777	2,47
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Ver Nota S.06	1778	Ver Nota S.06	2778	Ver Nota S.06
1.4 Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781		1781		2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782		1782		2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784		1784		2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786		1786		2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787		1787		2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788		1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	82,24	1792	82,51	2792	91,16
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	

TDA 26 MIXTO, FTA

S.05.3

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características			
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 04/07/2006			
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806		
Pago interés recibido cartera/Recibo interes sobre importe bonos	HSBC	TRIMESTRAL	Tipos Interés de la cartera	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los préstamos al inicio del periodo correspondiente a Banca March	Tipo Rerefencia de los Bonos+ MMP + 0,55%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Bonos atribuible a Banca March	-545	-545				
Pago interés recibido cartera/Recibo interes sobre importe bonos	CREDIT AGRICOLE	TRIMESTRAL	Tipos Interés de la cartera	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los préstamos al inicio del periodo correspondiente a Guipuzcoano	Tipo Rerefencia de los Bonos+ MMP + 0,55%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Bonos atribuible a Guipuzcoano						
Total							0808	-545	0809	-545	0810	

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 04/07/2006		Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 04/07/2006			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	60	7006	0	7009	0,30	7012	0,00	7015	0,00		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	60	7008	0	7011	0,30	7014	0,00	7017	0,00	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	168	7024	170	7027	0,84	7030	0,79	7033	0,82		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	168	7026	170	7029	0,84	7032	0,79	7035	0,82	7036	4.9.2.2.2 Nota de Valores

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020			
	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: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
SERIE 2 B - ES0377953064	10,00	26,79	27,62	4.9.2.2.1.
SERIE 2 B - ES0377953064	1,25	0,30	0,00	4.9.2.2.1.
SERIE 2 B - ES0377953064	13,07	13,23	13,23	4.9.2.2.1.
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE 2 B - ES0377953064	12,40	0,22	0,23	3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		5,19	5,04	3.4.2.1 Módulo Adicional
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: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

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

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo											Total		
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872														
Margen de intereses	0873														
Deterioro de activos financieros (neto)	0874														
Dotaciones a provisiones (neto)	0875														
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876														
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877														
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878														
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879														
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880														
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881														
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882														
Comisión variable pagada	0883														
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884														

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total		
		28/01/2021	28/04/2021											
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885													
Saldo inicial	0886	1.125	1.125											
Cobros del periodo	0887	706	691											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-4	-6											
Pagos por derivados	0889	-21	-17											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-1.125	-1.125											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-676	-668											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0											
Resto pagos/retenciones	0893	0	0											
Saldo disponible	0894	5	0											
Liquidación de comisión variable	0895	5	0											5

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 200900034

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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