

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: 8474
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: 30/06/2020

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: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2020		Periodo anterior 31/12/2019
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	100.374	1001	108.188
I. Activos financieros a largo plazo	0002	100.374	1002	108.188
1. Activos titulizados	0003	100.188	1003	108.002
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	95.178	1004	102.606
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	0	1005	0
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	5.014	1025	5.400
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-5	1027	-5
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	186	1029	186
2.1 Derivados de cobertura	0030	186	1030	186
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

S.01
Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA
Denominación del compartimento: 8474
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	23.317	1041	23.141
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	11.839	1043	12.014
1. Activos titulizados	0044	11.741	1044	11.916
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	10.252	1045	10.738
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	0	1046	0
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	58	1065	63
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	20	1066	5
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	1.344	1067	1.042
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	77	1068	77
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-9	1069	-9
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	98	1071	98
2.1 Derivados de cobertura	0072	98	1072	98
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075	0	1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076	0	1076	0
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
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	11.478	1085	11.127
1. Tesorería	0086	11.478	1086	11.127
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	123.691	1088	131.329

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2020		Periodo anterior 31/12/2019
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	105.196	1089	113.238
I. Provisiones a largo plazo	0090	3.684	1090	3.756
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	3.684	1092	3.756
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	101.512	1094	109.482
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	101.483	1095	109.453
1.1 Series no subordinadas	0096	82.549	1096	89.559
1.2 Series subordinadas	0097	18.933	1097	19.894
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	29	1101	29
2.1 Préstamo subordinado	0102	29	1102	29
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	0	1105	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108	0	1108	0
3.1 Derivados de cobertura	0109	0	1109	0
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) PASIVO CORRIENTE	0117	18.051	1117	17.570
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	13.284	1123	13.497
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	13.272	1124	13.485
1.1 Series no subordinadas	0125	13.232	1125	13.451
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	40	1128	35
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	0	1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	10	1131	10
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133	0	1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134	0	1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	0	1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	8	1136	8
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	2	1137	2
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	0	1139	0
3.1 Derivados de cobertura	0140	0	1140	0
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	1	1143	2
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	1	1146	2
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	4.768	1148	4.074
1. Comisiones	0149	11	1149	11
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	7	1150	7
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	4	1152	4
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	4.757	1157	4.062
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	443	1158	520
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	443	1160	520
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	123.691	1162	131.329

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2020		Acumulado anterior 30/06/2019
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	272	1201	340	2201	544	3201	687
1.1 Activos titulizados	0202	272	1202	340	2202	544	3202	687
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-69	1204	-65	2204	-132	3204	-129
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-56	1205	-53	2205	-105	3205	-105
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	0	1206	0	2206	0	3206	0
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-13	1207	-12	2207	-26	3207	-24
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-129	1208	-212	2208	-311	3208	-427
A) MARGEN DE INTERESES	0209	74	1209	63	2209	101	3209	131
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	-37	1217	-266	2217	-173	3217	-473
7.1 Servicios exteriores	0218	-8	1218	-8	2218	-9	3218	-9
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-8	1219	-8	2219	-9	3219	-9
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	-29	1224	-258	2224	-164	3224	-464
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-12	1225	-12	2225	-23	3225	-23
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-6	1227	-6	2227	-12	3227	-12
7.3.4 Comisión variable	0228	-11	1228	-240	2228	-129	3228	-428
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	0	1231	0	2231	0	3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	0	2232	0	3232	0
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	-37	1234	204	2234	72	3234	342
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	-37	1236	204	2236	72	3236	342
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: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2020		Acumulado anterior 30/06/2019
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-14	1300	-193	2300	-144	3300	-343
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	14	1301	66	2301	19	3301	121
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	258	1302	344	2302	534	3302	696
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-50	1303	-53	2303	-100	3303	-106
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	-181	1305	-213	2305	-388	3305	-446
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	-13	1308	-12	2308	-27	3308	-23
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-29	1309	-258	2309	-164	3309	-464
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-12	1310	-12	2310	-23	3310	-23
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-6	1312	-6	2312	-12	3312	-12
2.4 Comisión variable	0313	-11	1313	-240	2313	-129	3313	-428
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	332	1322	-729	2322	495	3322	789
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	340	1325	-721	2325	504	3325	798
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	3.252	1326	3.117	2326	5.944	3326	6.203
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.013	1327	1.750	2327	2.416	3327	4.476
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	247	1328	385	2328	332	3328	762
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-4.172	1331	-5.973	2331	-8.189	3331	-10.643
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-8	1332	-8	2332	-9	3332	-9
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	-8	1336	-8	2336	-9	3336	-9
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	318	1337	-922	2337	350	3337	445
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	11.160	1338	12.982	2338	11.127	3338	11.615
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	11.478	1339	12.060	2339	11.478	3339	12.060

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2020		Acumulado anterior 30/06/2019
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	-181	1357	-213	2357	-388	3357	-446
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-181	1358	-213	2358	-388	3358	-446
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	129	1360	212	2360	311	3360	427
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	52	1362	1	2362	77	3362	19
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: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2020								Situación cierre anual anterior 31/12/2019								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380	5,69	0400	0,04	0420	0,00	0440	4,40	1380	5,38	1400	0,04	1420	0,00	1440	5,64	2380	0,00	2400	0,00	2420	0,00	2440	13,00
Certificados de transmisión de hipoteca	0381		0401		0421		0441		1381		1401		1421		1441		2381		2401		2421		2441	
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: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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	39	0467	13	0474	1	0481	0	0488	15	0495	2.428	0502	0	0509	2.443
De 1 a 3 meses	0461	15	0468	42	0475	18	0482	0	0489	60	0496	871	0503	0	0510	931
De 3 a 6 meses	0462	4	0469	7	0476	1	0483	1	0490	9	0497	250	0504	0	0511	259
De 6 a 9 meses	0463	3	0470	11	0477	1	0484	2	0491	14	0498	186	0505	0	0512	200
De 9 a 12 meses	0464	4	0471	26	0478	3	0485	3	0492	33	0499	233	0506	0	0513	266
Más de 12 meses	0465	57	0472	712	0479	71	0486	281	0493	1.063	0500	4.934	0507	0	0514	5.997
Total	0466	122	0473	811	0480	96	0487	287	0494	1.194	0501	8.901	0508	0	1515	10.095

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	39	0522	13	0529	1	0536	0	0543	15	0550	2.428	0557	0	0564	2.443	0571	8.501	0578	8.501	0584	28,73
De 1 a 3 meses	0516	15	0523	42	0530	18	0537	0	0544	60	0551	871	0558	0	0565	931	0572	3.782	0579	3.782	0585	24,61
De 3 a 6 meses	0517	4	0524	7	0531	1	0538	1	0545	9	0552	250	0559	0	0566	259	0573	861	0580	861	0586	30,11
De 6 a 9 meses	0518	3	0525	11	0532	1	0539	2	0546	14	0553	186	0560	0	0567	200	0574	503	0581	503	0587	39,70
De 9 a 12 meses	0519	4	0526	26	0533	3	0540	3	0547	33	0554	233	0561	0	0568	266	0575	847	0582	847	0588	31,36
Más de 12 meses	0520	57	0527	712	0534	71	0541	281	0548	1.063	0555	4.934	0562	0	0569	5.997	0576	14.284	0583	14.284	0589	41,99
Total	0521	122	0528	811	0535	96	0542	287	0549	1.194	0556	8.901	0563	0	0570	10.095	0577	28.777			0590	35,08

S.05.1

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 04/07/2006	
Inferior a 1 año	0600	360	1600	550	2600	65
Entre 1 y 2 años	0601	597	1601	407	2601	61
Entre 2 y 3 años	0602	1.048	1602	1.015	2602	170
Entre 3 y 4 años	0603	1.957	1603	1.599	2603	1.108
Entre 4 y 5 años	0604	4.822	1604	4.402	2604	1.912
Entre 5 y 10 años	0605	32.835	1605	29.376	2605	32.185
Superior a 10 años	0606	70.170	1606	82.438	2606	789.499
Total	0607	111.788	1607	119.787	2607	825.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	11,75	1608	12,11	2608	22,62

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 04/07/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	15,53	1609	15,05	2609	1,77

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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 30/06/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 04/07/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.621	0630	78.463	1620	1.657	1630	79.491	2620	1.761	2630	132.069
40% - 60%	0621	318	0631	31.850	1621	389	1631	38.821	2621	2.132	2631	247.111
60% - 80%	0622	11	0632	1.475	1622	11	1632	1.475	2622	3.031	2632	445.821
80% - 100%	0623	0	0633	0	1623	0	1633	0	2623	0	2633	0
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	1.950	0638	111.788	1628	2.057	1638	119.787	2628	6.924	2638	825.000
Media ponderada (%)	0639	32,42	0649		1639	33,29	1649		2639	58,66	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 04/07/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	1,01	1650	1,06	2650	3,54
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,00	1651	4,00	2651	6,92
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,00	2652	2,47

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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 30/06/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				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	152	0683	9.625	1660	157	1683	10.264	2660	439	2683	65.289
Aragón	0661	9	0684	682	1661	9	1684	705	2661	39	2684	5.037
Asturias	0662	0	0685	0	1662	0	1685	0	2662	3	2685	381
Baleares	0663	513	0686	27.198	1663	538	1686	28.869	2663	1.424	2686	150.091
Canarias	0664	295	0687	12.140	1664	320	1687	13.386	2664	1.104	2687	98.407
Cantabria	0665	11	0688	410	1665	11	1688	426	2665	33	2688	3.660
Castilla-León	0666	50	0689	2.834	1666	50	1689	2.947	2666	130	2689	15.452
Castilla La Mancha	0667	24	0690	2.032	1667	25	1690	2.105	2667	122	2690	17.163
Cataluña	0668	130	0691	10.576	1668	133	1691	11.004	2668	527	2691	82.880
Ceuta	0669	0	0692	0	1669	0	1692	0	2669	0	2692	0
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	0	1693	0	2670	3	2693	151
Galicia	0671	2	0694	68	1671	2	1694	72	2671	6	2694	412
Madrid	0672	273	0695	20.449	1672	285	1695	21.851	2672	1.006	2695	145.137
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	9	0697	433	1674	9	1697	460	2674	44	2697	4.882
Navarra	0675	24	0698	1.595	1675	25	1698	1.773	2675	130	2698	17.154
La Rioja	0676	13	0699	410	1676	14	1699	443	2676	41	2699	4.199
Comunidad Valenciana	0677	233	0700	11.533	1677	257	1700	12.644	2677	1.036	2700	110.625
País Vasco	0678	212	0701	11.803	1678	222	1701	12.838	2678	837	2701	104.082
Total España	0679	1.950	0702	111.788	1679	2.057	1702	119.787	2679	6.924	2702	825.000
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	1.950	0705	111.788	1682	2.057	1705	119.787	2682	6.924	2705	825.000

TDA 26 MIXTO, FTA

S.05.1
Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA
Denominación del compartimento: 8474
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO SABADELL, BANCA MARCH

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 04/07/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	3,20			1710	3,05			2710	32,98		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 8474

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2020			Situación cierre anual anterior 31/12/2019			Situación inicial 04/07/2006					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0377953007	SERIE 1 A1	1.650	0	0	1.650	0	0	1.650	100.000	165.000			
ES0377953015	SERIE 1 A2	6.364	15.051	95.782	6.364	16.186	103.009	6.364	100.000	636.400			
ES0377953023	SERIE 1 B	182	53.057	9.656	182	57.061	10.385	182	100.000	18.200			
ES0377953031	SERIE 1 C	54	56.982	3.077	54	61.282	3.309	54	100.000	5.400			
ES0377953049	SERIE 1 D	62	100.000	6.200	62	100.000	6.200	62	100.000	6.200			
Total		0723	8.312	0724	114.715	1723	8.312	1724	122.904	2723	8.312	2724	831.200

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 8474

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado						
									0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737
ES0377953007	SERIE 1 A1	NS	EURIBOR 3 m	0,04	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
ES0377953015	SERIE 1 A2	NS	EURIBOR 3 m	0,14	0,00	0	0	NO	95.782	0	0	95.782	0	0			
ES0377953023	SERIE 1 B	S	EURIBOR 3 m	0,35	0,16	3	0	NO	9.656	0	0	9.659	0	0			
ES0377953031	SERIE 1 C	S	EURIBOR 3 m	0,50	0,31	2	0	NO	3.077	0	0	3.079	0	0			
ES0377953049	SERIE 1 D	S	EURIBOR 3 m	3,50	3,31	36	0	NO	6.200	0	0	6.236	0	0			
Total						0740	40	0741	0	0743	114.715	0744	0	0745	114.755	0746	0

	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 04/07/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,16	0748	0,15	0749	3,26

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 8474

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2020								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2019							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0377953007	SERIE 1 A1	0	165.000	0	5.450	0	165.000	0	5.450	0	165.000	0	5.450	0	165.000	0	5.450
ES0377953015	SERIE 1 A2	3.683	540.618	0	91.137	5.272	525.121	0	91.137	5.272	525.121	0	91.137	0	91.137	0	91.137
ES0377953023	SERIE 1 B	371	8.544	0	3.421	532	6.981	1	3.420	532	6.981	1	3.420	1	3.420	1	3.420
ES0377953031	SERIE 1 C	118	2.323	1	1.136	169	1.825	2	1.132	169	1.825	2	1.132	2	1.132	2	1.132
ES0377953049	SERIE 1 D	0	0	49	3.916	0	0	50	3.719	0	0	50	3.719	50	3.719	50	3.719
Total		0754	4.172	0755	716.485	0756	50	0757	105.060	1754	5.973	1755	698.928	1756	53	1757	104.858

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 8474

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2020

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 30/06/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 04/07/2006
				0762	0763	0764
ES0377953007	SERIE 1 A1	05/07/2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0377953007	SERIE 1 A1	05/07/2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0377953015	SERIE 1 A2	29/03/2017	FCH	A+	A+	AAA
ES0377953015	SERIE 1 A2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0377953023	SERIE 1 B	13/02/2018	FCH	A+	A+	A
ES0377953023	SERIE 1 B	10/10/2019	MDY	Aa1	Aa1	Aa3
ES0377953031	SERIE 1 C	08/06/2020	FCH	A	A+	BBB
ES0377953031	SERIE 1 C	10/10/2019	MDY	A3	A3	Baa1
ES0377953049	SERIE 1 D	05/07/2006	FCH	CCC	CCC	CCC
ES0377953049	SERIE 1 D	23/03/2011	MDY	C	C	Ca

S.05.2
Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA
Denominación del compartimento: 8474
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2020
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 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 04/07/2006	
Inferior a 1 año	0765	7.560	1765	8.070	2765	37.517
Entre 1 y 2 años	0766	6.258	1766	6.747	2766	32.106
Entre 2 y 3 años	0767	6.258	1767	6.747	2767	32.955
Entre 3 y 4 años	0768	6.258	1768	6.747	2768	33.714
Entre 4 y 5 años	0769	6.258	1769	6.747	2769	34.239
Entre 5 y 10 años	0770	82.124	1770	87.845	2770	175.167
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	485.501
Total	0772	114.715	1772	122.904	2772	831.200
Vida residual media ponderada (años)	0773	5,33	1773	6,08	2773	20,11

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 04/07/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	6.200	1775	6.200	2775	6.200
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	6.200	1776	6.200	2776	6.200
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	5,40	1777	5,04	2777	0,75
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	83,47	1792	83,79	2792	96,41
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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 30/06/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	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	343	343				
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	343	0809	343	0810	

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 04/07/2006		Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		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: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	643	7006	634	7009	0,61	7012	0,56	7015	0,43		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	643	7008	634	7011	0,61	7014	0,56	7017	0,43	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	6.929	7024	7.041	7027	6,20	7030	5,88	7033	6,08		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	6.929	7026	7.041	7029	6,20	7032	5,88	7035	6,08	7036	4.9.2.1.3 Nota de Valores

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

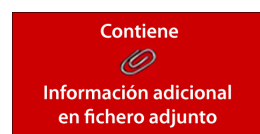
CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
SERIE 1 A2 - ES0377953015	3,20	0,61	0,43	4.9.2.1.2.
SERIE 1 B - ES0377953023	1,50	0,61	0,43	4.9.2.1.1.
SERIE 1 B - ES0377953023	5,72	11,73	11,73	4.9.2.1.1.
SERIE 1 C - ES0377953031	10,00	13,56	14,02	4.9.2.1.1.
SERIE 1 C - ES0377953031	1,00	0,61	0,43	4.9.2.1.1.
SERIE 1 A1 - ES0377953007	3,20	0,61	0,43	4.9.2.1.2.
SERIE 1 B - ES0377953023	10,00	13,56	14,02	4.9.2.1.1.
SERIE 1 C - ES0377953031	5,72	11,73	11,73	4.9.2.1.1.
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE 1 B - ES0377953023	10,00	0,85	0,86	3.4.6.2
SERIE 1 C - ES0377953031	7,00	0,85	0,86	3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		5,40	5,22	3.4.2.1 Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total		
		28/01/2020	28/04/2020											
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885													
Saldo inicial	0886	6.200	6.200											
Cobros del periodo	0887	4.410	4.440											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-19	-26											
Pagos por derivados	0889	-207	-181											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-6.200	-6.200											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-4.066	-4.222											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0											
Resto pagos/retenciones	0893	0	0											
Saldo disponible	0894	117	11											
Liquidación de comisión variable	0895	117	11											129

Denominación Fondo: TDA 26 MIXTO, FTA

Denominación del compartimento: 8474

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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