

TDA 26-MIXTO - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 28/07/20 - 28/10/20

| EUROS | TOTAL GRUPO1 | TOTAL GRUPO 2 | TOTAL FONDO |
|---|----------------------|---------------------|----------------------|
| I. Situación al 28/07/20: | 6.200.000,00 | 1.125.000,00 | 7.325.000,00 |
| Fondo de Reserva | 6.200.000,00 | 1.125.000,00 | 7.325.000,00 |
| Otros recursos | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 4.942.387,20 | 733.578,45 | 5.675.965,65 |
| Principal: | | | |
| Según calendario hasta 30/09/20: | 3.251.358,62 | 527.170,12 | 3.778.528,74 |
| Amort. Anticipada hasta 30/09/20: | 1.435.445,27 | 172.590,27 | 1.608.035,54 |
| Intereses: | 255.583,31 | 33.818,06 | 289.401,37 |
| III. Subtotal a Cuenta de reinversión (I + II): | 11.142.387,20 | 1.858.578,45 | 13.000.965,65 |
| IV. Total intereses de la reinversión: | -14.849,56 | -2.541,92 | -17.391,48 |
| Intereses de la Cta. De Tesorería | -55,45 | -10,60 | -66,05 |
| Intereses de la Cta. De Reinversión | -14.794,11 | -2.531,32 | -17.325,43 |
| V. Recursos disponibles (III + IV): | 11.127.537,64 | 1.856.036,53 | 12.983.574,17 |
| VI. Gastos: | 26.416,56 | 5.796,94 | 32.213,50 |
| VII. Liquidación del Swap | -183.003,47 | -17.174,34 | -200.177,81 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo): | 255.583,31 | 33.818,06 | 289.401,37 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (HSBC / Crédit Agricole CIB): | 72.579,84 | 16.643,72 | 89.223,56 |
| VIII. Pago a los Bonos: | 4.195.537,94 | 583.108,34 | 4.778.646,28 |
| Bonos 1-A2: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/10/20: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 28/10/20: | 3.660.190,96 | 0,00 | 3.660.190,96 |
| Bonos 1-B: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/10/20: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 28/10/20: | 369.008,64 | 0,00 | 369.008,64 |
| Bonos 1-C: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/10/20: | 394,74 | 0,00 | 394,74 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 75,00 | 0,00 | 75,00 |
| Amortización correspondiente al 28/10/20: | 117.586,08 | 0,00 | 117.586,08 |
| Bonos 1-D: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/10/20: | 48.357,52 | 0,00 | 48.357,52 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 9.187,93 | 0,00 | 9.187,93 |
| Amortización correspondiente al 28/10/20: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Bonos 2-A: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/10/20: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 28/10/20: | 0,00 | 500.836,46 | 500.836,46 |
| Bonos 2-B: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/10/20: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 28/10/20: | 0,00 | 76.372,38 | 76.372,38 |
| Bonos 2-C: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/10/20: | 0,00 | 5.899,50 | 5.899,50 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 | 1.120,91 | 1.120,91 |
| Amortización correspondiente al 28/10/20: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Reinversión de las retenciones: | -9.262,93 | -1.120,91 | -10.383,84 |
| IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII): | 6.722.579,67 | 1.249.956,91 | 7.972.536,58 |
| Distribución del saldo disponible: | | | |
| Fondo de Reserva previo(28/07/20): | 6.200.000,00 | 1.125.000,00 | 7.325.000,00 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Intereses pagados Préstamo Gastos Iniciales | 2.317,33 | 0,00 | 2.317,33 |
| Amortización Préstamo Gastos Iniciales | 29.181,79 | 0,00 | 29.181,79 |
| Otros recursos para el siguiente pago | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Margen de Intermediación Financiera | 491.080,55 | 124.956,91 | 616.037,46 |
| Fondo de Reserva (28/10/20): | 6.200.000,00 | 1.125.000,00 | 7.325.000,00 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.



Nº: 3920/20

Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.:917020808
http://www.tda-sgft.com
TDA26liq.trim/Oct20

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 28 de Octubre de 2020

Importes en euros

| I. BONOS 1-A2 ES0377953015 | | Sobre 6364 bonos | Por Bono |
|--|--|-------------------|-----------------|
| 1. Saldo inicial (11/07/06): | | 636.400.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | | 92.502.521,92 € | 14.535,28 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | | 3.660.190,96 € | 575,14 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | | 88.842.330,96 € | 13.960,14 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | | 13,960140% | 13,960140% |
| II. BONOS 1-B ES0377953023 | | Sobre 182 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (11/07/06): | | 18.200.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | | 9.325.789,20 € | 51.240,60 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | | 369.008,64 € | 2.027,52 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | | 8.956.780,56 € | 49.213,08 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | | 49,213080% | 49,213080% |
| III. BONOS 1-C ES0377953031 | | Sobre 54 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (11/07/06): | | 5.400.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | | 2.971.709,64 € | 55.031,66 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | | 394,74 € | 7,31 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | | 117.586,08 € | 2.177,52 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | | 2.854.123,56 € | 52.854,14 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | | 52,854140% | 52,854140% |
| IV. BONOS 1-D ES0377953049 | | Sobre 62 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (11/07/06): | | 6.200.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | | 6.200.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | | 48.357,52 € | 779,96 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | | 6.200.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | | 100,000000% | 100,000000% |
| V. BONOS 2-A ES0377953056 | | Sobre 701 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (11/07/06): | | 70.100.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | | 19.486.313,88 € | 27.797,88 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | | 500.836,46 € | 714,46 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | | 18.985.477,42 € | 27.083,42 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | | 27,083420% | 27,083420% |
| VI. BONOS 2-B ES0377953064 | | Sobre 49 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (11/07/06): | | 4.900.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | | 2.971.481,52 € | 60.642,48 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | | 76.372,38 € | 1.558,62 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | | 2.895.109,14 € | 59.083,86 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | | 59,083860% | 59,083860% |
| VII. BONOS 2-C ES0377953072 | | Sobre 19 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (11/07/06): | | 1.900.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | | 1.125.000,07 € | 59.210,53 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | | 5.899,50 € | 310,50 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | | 1.125.000,07 € | 59.210,53 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | | 59,210530% | 59,210530% |
| VIII. EL FONDO | | Importes en euros | |
| | | GRUPO1 | GRUPO2 |
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 30/09/20: | | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias No Fallidas: | | 100.653.237,29 € | 21.880.589,07 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias Fallidas: | | 5.570.614,30 € | 147.291,84 € |
| c) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias No Fallidas: | | 100.699.830,64 € | 21.882.245,63 € |
| d) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias Fallidas: | | 6.450.040,11 € | 172.656,26 € |
| 2. Amortización del período 30/06/20 a 30/09/20: | | 4.686.803,89 € | 699.760,39 € |
| a) Según calendario: | | 3.251.358,62 € | 527.170,12 € |
| b) Amortización anticipada hasta 30/09/20: | | 1.435.445,27 € | 172.590,27 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | | |
| a) Ultimo año: | | 4,37% | 3,32% |
| b) Ultimo semestre: | | 4,46% | 3,28% |
| c) Ultimo trimestre: | | 5,37% | 3,04% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | | 0,37% | 0,46% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses: | | 0,35% | 0,00% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | | 6,02% | 0,78% |
| 7. Nivel de Impago (2): | | 0,42% | 0,46% |

(1) Saldo pendiente de las participaciones hipotecarias fallidas según definición del Folleto de Emisión (retraso de 12 meses y otras causas), sobre el saldo pendiente total.

(2) Importe de principal de las Participaciones Hipotecarias con morosidad superior a 90 días en la Fecha de Cobro inmediata anterior a la Fecha de Pago en curso, sobre el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias.

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



Nº: 3921/20

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.
 Orense, 58
 28020 Madrid
 Tel.: 917020808
 http://www.tda-sgft.com
 TDA26\In\inver.trim\Oct20

TDA 26-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 28/07/20 - 28/10/20
I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|---|--|
| Fecha de Constitución del Fondo | 5 de julio de 2006 |
| Fecha Emisión BTH | 5 de julio de 2006 |
| Fecha Final Amortización BTH (4,37% TAA Grupo 1 / 3,32% TAA Grupo 2) | 30 de octubre de 2023 |
| Sociedad Gestora | Titulización de Activos, SGFT,S.A. |
| Emisor Participaciones Hipotecarias | Banco Sabadell (Banco Guipuzcoano) Banca March |
| Agente de Pagos | Societe Generale |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencia de Calificación | Moody's Investors Service / Fitch Ratings |
| Calificación | Bonos 1 A2: (M) Aa1 (sf) / (F) A+ (sf) Bonos 1 B: (M) Aa2 (sf) / (F) A+ (sf) Bonos 1 C: (M) Baa1 (sf) / (F) A (sf) Bonos 1 D: (M) C (sf) / (F) CCC (sf) Bonos 2 A: (M) - (sf) / (F) A+ (sf) Bonos 2 B: (M) - (sf) / (F) A- (sf) Bonos 2 C: (M) - (sf) / (F) CCC (sf) |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Nombre | Bonos de Titulización TDA 26-MIXTO |
|---|------------------------------------|
| Serie 1 A2: | |
| Código ISIN | ES0377953015 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 636.400.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 88.842.330,96 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 13.960,14 Euros |

TDA26-MIXTO\INFO.trim\Oct20

| II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.) | |
|--|---|
| Nombre | Bonos de Titulización TDA 26-MIXTO |
| Serie 1 B: | |
| Código ISIN | ES0377953023 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 18.200.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 8.956.780,56 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 49.213,08 Euros |
| Serie 1 C: | |
| Código ISIN | ES0377953031 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 5.400.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 2.854.123,56 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 52.854,14 Euros |
| Serie 1 D: | |
| Código ISIN | ES0377953049 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 6.200.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 6.200.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |
| Serie 2 A: | |
| Código ISIN | ES0377953056 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 70.100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 18.985.477,42 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 27.083,42 Euros |
| Serie 2 B: | |
| Código ISIN | ES0377953064 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 4.900.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 2.895.109,14 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 59.083,86 Euros |

TDA26-MIXTO\INFO.trim\Oct20

| II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.) | |
|--|---|
| Nombre | Bonos de Titulización TDA 26-MIXTO |
| Serie 2 C: | |
| Código ISIN | ES0377953072 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 1.900.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 1.125.000,07 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 59.210,53 Euros |

| III. INFORMACION INCLUIDA |
|--|
| * Liquidación del Período: 28/07/20 - 28/10/20 |
| * Flujos de Caja del Período: 28/07/20 - 28/10/20 |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 28 de Octubre de 2020 |

TDA 26-MIXTO, FTA**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 28/07/20 - 28/10/20**

| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | Euros | |
|--------------------------------------|----------------------|----------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| Amortización Bonos Titulización Hip. | | 4.723.994,52 |
| Amortización Participaciones Hip. | 5.386.564,28 | |
| Amortización Préstamo Subordinado | | 29.181,79 |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados a los BTH | | 54.651,76 |
| Intereses recibidos de las PHs | 289.401,37 | |
| Intereses Ptmo. Subordinado | | 2.317,33 |
| Intereses Inversiones Temporales | -17.391,48 | |
| Neto swap a favor de la contraparte | | 200.177,81 |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones Periódicas: | | 32.213,50 |
| Margen de Intermediación Financiera | | 616.037,46 |
| Total Ingresos/Pagos | <u>5.658.574,17</u> | <u>5.658.574,17</u> |
| Saldo inicial 28/07/20 | 7.325.000,00 | |
| A Inversiones Temporales | | 7.325.000,00 |
| Total | <u>12.983.574,17</u> | <u>12.983.574,17</u> |
| Retenciones practicadas el 28/10/20 | 10.383,84 | |
| A Inv.Temporales | | 10.383,84 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 3930/20**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA26flujo.trim\Oct20