

TDA 26-MIXTO - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 30/10/23 - 29/01/24

EUROS	TOTAL GRUPO1	TOTAL GRUPO 2	TOTAL FONDO
I. Situación al 30/10/23:	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	3.202.360,12	1.011.994,43	4.214.354,55
Principal:			
Según calendario hasta 31/12/23:	1.700.906,69	297.716,43	1.998.623,12
Amort. Anticipada hasta 31/12/23:	876.680,39	559.366,83	1.436.047,22
Intereses:	624.773,04	154.911,17	779.684,21
III. Subtotal a Cuenta de reinversión (I + II):	9.402.360,12	2.136.994,43	11.539.354,55
IV. Total intereses de la reinversión:	83.724,54	20.284,05	104.008,59
Intereses de la Cta. De Tesorería	967,23	398,35	1.365,58
Intereses de la Cta. De Reinversión	82.757,31	19.885,70	102.643,01
V. Recursos disponibles (III + IV):	9.486.084,66	2.157.278,48	11.643.363,14
VI. Gastos:	19.600,14	4.842,09	24.442,23
VII. Liquidación del Swap	54.841,16	15.772,27	70.613,43
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	624.773,04	154.911,17	779.684,21
Cantidad a Pagar por la Parte A (HSBC / Crédit Agricole CIB):	679.614,20	170.683,44	850.297,64
VIII. Pago a los Bonos:	3.321.325,64	1.026.164,58	4.347.490,22
Bonos 1-A2:			
Intereses correspondientes al 29/01/24:	494.737,36	0,00	494.737,36
Retenciones practicadas a los bonos:	94.000,10	0,00	94.000,10
Amortización correspondiente al 29/01/24:	2.608.094,48	0,00	2.608.094,48
Bonos 1-B:			
Intereses correspondientes al 29/01/24:	79.028,04	0,00	79.028,04
Retenciones practicadas a los bonos:	15.015,33	0,00	15.015,33
Amortización correspondiente al 29/01/24:	0,00	0,00	0,00
Bonos 1-C:			
Intereses correspondientes al 29/01/24:	26.060,94	0,00	26.060,94
Retenciones practicadas a los bonos:	4.951,58	0,00	4.951,58
Amortización correspondiente al 29/01/24:	0,00	0,00	0,00
Bonos 1-D:			
Intereses devengados desde 30/10/23 hasta 29/01/24:	116.789,40	0,00	116.789,40
Intereses pagados al 29/01/24	113.404,82	0,00	113.404,82
Intereses debidos tras actual fecha de pago:	3.384,58	0,00	3.384,58
Retenciones practicadas a los bonos:	21.546,92	0,00	21.546,92
Amortización correspondiente al 29/01/24:	0,00	0,00	0,00
Bonos 2-A:			
Intereses correspondientes al 29/01/24:	0,00	126.264,12	126.264,12
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00	23.990,18	23.990,18
Amortización correspondiente al 29/01/24:	0,00	857.140,74	857.140,74
Bonos 2-B:			
Intereses correspondientes al 29/01/24:	0,00	24.411,80	24.411,80
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00	4.638,24	4.638,24
Amortización correspondiente al 29/01/24:	0,00	0,00	0,00
Bonos 2-C:			
Intereses correspondientes al 29/01/24:	0,00	18.347,92	18.347,92
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00	3.486,10	3.486,10
Amortización correspondiente al 29/01/24:	0,00	0,00	0,00
Reinversión de las retenciones:	-135.513,93	-32.114,52	-167.628,45
IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII):	6.200.000,04	1.142.044,08	7.342.044,12
Distribución del saldo disponible:			
Fondo de Reserva previo(30/10/23):	6.200.000,00	1.125.000,00	7.325.000,00
Aportación al Fondo de Reserva	0,00	0,00	0,00
Otros recursos para el siguiente pago	0,04	0,00	0,04
Margen de Intermediación Financiera	0,00	17.044,08	17.044,08
Fondo de Reserva (29/01/24):	6.200.000,00	1.125.000,00	7.325.000,00

Destinatarios: CNMV; AIAF.



Nº: 196/24

Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.:917020808
http://www.tda-sgft.com
TDA26liq.trimEne24

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 29 de Enero de 2024

		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:		47.828.514,72 €	7.515,48 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:		494.737,36 €	77,74 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:		2.608.094,48 €	409,82 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:		45.220.420,24 €	7.105,66 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:		7,105660%	7,105660%
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:		7.267.292,76 €	39.930,18 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:		79.028,04 €	434,22 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:		0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:		7.267.292,76 €	39.930,18 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:		39,930180%	39,930180%
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:		2.315.759,22 €	42.884,43 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:		26.060,94 €	482,61 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:		0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:		2.315.759,22 €	42.884,43 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:		42,884430%	42,884430%
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 en esta Fecha de Pago:		116.789,40 €	1.883,70 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:		113.404,82 €	1.829,11 €
5. Intereses debidos en esta Fecha de Pago:		3.384,58 €	54,59 €
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:		0,00 €	0,00 €
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:		6.200.000,00 €	100.000,00 €
8. 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:		12.147.439,73 €	17.328,73 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:		126.264,12 €	180,12 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:		857.140,74 €	1.222,74 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:		11.290.298,99 €	16.105,99 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:		16,105990%	16,105990%
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:		2.234.480,85 €	45.601,65 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:		24.411,80 €	498,20 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:		0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:		2.234.480,85 €	45.601,65 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:		45,601650%	45,601650%
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 en esta Fecha de Pago:		18.347,92 €	965,68 €
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 31/12/23:			
a) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias No Fallidas:		54.803.485,44 €	13.524.777,57 €
b) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias Fallidas:		3.793.193,47 €	47.154,58 €
c) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias No Fallidas:		54.834.163,03 €	13.527.162,23 €
d) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias Fallidas:		4.780.583,28 €	88.058,85 €
2. Amortización del período 30/09/23 a 31/12/23:			
a) Según calendario:		2.577.587,08 €	857.083,26 €
b) Amortización anticipada hasta 31/12/23:		1.700.906,69 €	297.716,43 €
		876.680,39 €	559.366,83 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):			
a) Último año:		8,08%	9,56%
b) Último semestre:		6,15%	10,91%
c) Último trimestre:		5,97%	14,67%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:		0,23%	0,34%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:		0,07%	0,00%
6. Porcentaje de fallidos (1):		8,02%	0,65%
7. Nivel de Impago (2):		0,30%	0,34%

(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: 197/24

Titulización de Activos, (SGFT),S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

http://www.tda-sgft.com

TDA26\Infoinver.trim\Ene24

TDA 26-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 30/10/23 - 29/01/24
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 (8,08% TAA Grupo 1 / 9,56% TAA Grupo 2)	29/04/2024
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) AAA (sf) Bonos 1 B: (M) Aa1 (sf) / (F) AAA (sf) Bonos 1 C: (M) A1 (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)	45.220.420,24 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	7.105,66 Euros

TDA26-MIXTO\INFO.trim\Ene24

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)	7.267.292,76 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	39.930,18 Euros
Serie 1 C:	
Código ISIN	ES0377953031
Nominal en circulación total (inicial)	5.400.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	2.315.759,22 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	42.884,43 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)	11.290.298,99 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	16.105,99 Euros
Serie 2 B:	
Código ISIN	ES0377953064
Nominal en circulación total (inicial)	4.900.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	2.234.480,85 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	45.601,65 Euros

TDA26-MIXTO\INFO.trim\Ene24

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: 30/10/23 - 29/01/24
* Flujos de Caja del Período: 30/10/23 - 29/01/24
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 29 de Enero de 2024

TDA 26-MIXTO, FTA**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 30/10/23 - 29/01/24**

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip. Amortización Participaciones Hip.	3.434.670,34	3.465.235,22
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH		882.255,00
Intereses recibidos de las PHs	779.684,21	
Intereses Inversiones Temporales	104.008,59	
Neto swap a favor del fondo	70.613,43	0,00
III. GASTOS		
Comisiones Periódicas:		24.442,23
Margen de Intermediación Financiera		17.044,08
Total Ingresos/Pagos	<u>4.388.976,57</u>	<u>4.388.976,53</u>
Saldo inicial 30/10/23 A Inversiones Temporales	7.325.000,00	7.325.000,04
Total	<u>11.713.976,57</u>	<u>11.713.976,57</u>
Retenciones practicadas el 29/01/24 A Inv.Temporales	167.628,45	167.628,45

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 206/24**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA26\fluj.trim\Ene24