

TDA 26-MIXTO - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 30/01/23 - 28/04/23

| EUROS | EUROS | | |
|---|----------------------|---------------------|----------------------|
| | TOTAL GRUPO1 | TOTAL GRUPO 2 | TOTAL FONDO |
| I. Situación al 30/01/23: | 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 | 4.126.241,87 | 799.398,60 | 4.925.640,47 |
| Principal: | | | |
| Según calendario hasta 31/03/23: | 2.318.509,89 | 353.985,85 | 2.672.495,74 |
| Amort. Anticipada hasta 31/03/23: | 1.448.942,31 | 368.128,09 | 1.817.070,40 |
| Intereses: | 358.789,67 | 77.284,66 | 436.074,33 |
| III. Subtotal a Cuenta de reinversión (I + II): | 10.326.241,87 | 1.924.398,60 | 12.250.640,47 |
| IV. Total intereses de la reinversión: | 54.764,01 | 9.696,73 | 64.460,74 |
| Intereses de la Cta. De Tesorería | 652,13 | 139,97 | 792,10 |
| Intereses de la Cta. De Reinversión | 54.111,88 | 9.556,76 | 63.668,64 |
| V. Recursos disponibles (III + IV): | 10.381.005,88 | 1.934.095,33 | 12.315.101,21 |
| VI. Gastos: | 27.925,12 | 6.736,52 | 34.661,64 |
| VII. Liquidación del Swap | 167.734,22 | 51.249,48 | 218.983,70 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo): | 358.789,67 | 77.284,66 | 436.074,33 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (HSBC / Crédit Agricole CIB): | 526.523,89 | 128.534,14 | 655.058,03 |
| VIII. Pago a los Bonos: | 3.915.633,86 | 842.526,39 | 4.758.160,25 |
| Bonos 1-A2: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/04/23: | 368.984,72 | 0,00 | 368.984,72 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 70.107,10 | 0,00 | 70.107,10 |
| Amortización correspondiente al 28/04/23: | 3.389.339,12 | 0,00 | 3.389.339,12 |
| Bonos 1-B: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/04/23: | 50.060,92 | 0,00 | 50.060,92 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 9.511,57 | 0,00 | 9.511,57 |
| Amortización correspondiente al 28/04/23: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Bonos 1-C: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/04/23: | 16.801,02 | 0,00 | 16.801,02 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 3.192,19 | 0,00 | 3.192,19 |
| Amortización correspondiente al 28/04/23: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Bonos 1-D: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/04/23: | 90.448,08 | 0,00 | 90.448,08 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 17.185,14 | 0,00 | 17.185,14 |
| Amortización correspondiente al 28/04/23: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Bonos 2-A: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/04/23: | 0,00 | 90.975,78 | 90.975,78 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 | 17.285,40 | 17.285,40 |
| Amortización correspondiente al 28/04/23: | 0,00 | 722.387,51 | 722.387,51 |
| Bonos 2-B: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/04/23: | 0,00 | 15.501,15 | 15.501,15 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 | 2.945,22 | 2.945,22 |
| Amortización correspondiente al 28/04/23: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Bonos 2-C: | | | |
| Intereses correspondientes al 28/04/23: | 0,00 | 13.661,95 | 13.661,95 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 | 2.595,77 | 2.595,77 |
| Amortización correspondiente al 28/04/23: | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Reinversión de las retenciones: | -99.996,00 | -22.826,39 | -122.822,39 |
| IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII): | 6.605.181,12 | 1.136.081,90 | 7.741.263,02 |
| Distribución del saldo disponible: | | | |
| Fondo de Reserva previo(30/01/23): | 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 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Margen de Intermediación Financiera | 405.181,12 | 11.081,90 | 416.263,02 |
| Fondo de Reserva (28/04/23): | 6.200.000,00 | 1.125.000,00 | 7.325.000,00 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.



Nº: 1434/23

Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.:917020808
<http://www.tda-sgft.com>
TDA26liq.trimAbr23

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 28 de Abril de 2023

| 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: | 57.875.807,00 € | 9.094,25 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 368.984,72 € | 57,98 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 3.389.339,12 € | 532,58 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 54.486.467,88 € | 8.561,67 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 8,561670% | 8,561670% |
| 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: | 50.060,92 € | 275,06 € |
| 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: | 16.801,02 € | 311,13 € |
| 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 y pagados en esta Fecha de Pago: | 90.448,08 € | 1.458,84 € |
| 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: | 14.161.573,96 € | 20.201,96 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 90.975,78 € | 129,78 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 722.387,51 € | 1.030,51 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 13.439.186,45 € | 19.171,45 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 19,171450% | 19,171450% |
| 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: | 15.501,15 € | 316,35 € |
| 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: | 13.661,95 € | 719,05 € |
| 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 31/03/23: | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias No Fallidas: | 64.069.526,45 € | 15.673.669,29 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias Fallidas: | 4.020.790,40 € | 50.809,30 € |
| c) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias No Fallidas: | 64.106.998,44 € | 15.677.324,91 € |
| d) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias Fallidas: | 5.005.864,64 € | 88.058,85 € |
| 2. Amortización del período 31/12/22 a 31/03/23: | 3.767.452,20 € | 722.113,94 € |
| a) Según calendario: | 2.318.509,89 € | 353.985,85 € |
| b) Amortización anticipada hasta 31/03/23: | 1.448.942,31 € | 368.128,09 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | |
| a) Último año: | 6,93% | 6,17% |
| b) Último semestre: | 9,10% | 5,69% |
| c) Último trimestre: | 8,32% | 8,68% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | 0,44% | 0,00% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses: | 0,16% | 0,35% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | 7,24% | 0,56% |
| 7. Nivel de Impago (2): | 0,40% | 0,35% |

(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: 1435/23

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.: 917020808
<http://www.tda-sgft.com>
TDA26\Infoinver.trim\Abr23

TDA 26-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 30/01/23 - 28/04/23
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 (6,93% TAA Grupo 1 / 6,17% TAA Grupo 2) | 28 de julio 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) 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) | 54.486.467,88 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 8.561,67 Euros |

TDA26-MIXTO\INFO.trim\Abr23

| 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) | 13.439.186,45 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 19.171,45 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\Abr23

| 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: 30/01/23 - 28/04/23 |
| * Flujos de Caja del Período: 30/01/23 - 28/04/23 |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 28 de Abril de 2023 |

TDA 26-MIXTO, FTA**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 30/01/23 - 28/04/23**

| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | Euros | |
|---|----------------------|----------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| Amortización Bonos Titulización Hip. Amortización Participaciones Hip. | 4.489.566,14 | 4.111.726,63 |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados a los BTH | | 646.433,62 |
| Intereses recibidos de las PHs | 436.074,33 | |
| Intereses Inversiones Temporales | 64.460,74 | |
| Neto swap a favor del fondo | 218.983,70 | 0,00 |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones Periódicas: | | 34.661,64 |
| Margen de Intermediación Financiera | | 416.263,02 |
| Total Ingresos/Pagos | 5.209.084,91 | 5.209.084,91 |
| Saldo inicial 30/01/23 | 7.325.000,00 | |
| A Inversiones Temporales | | 7.325.000,00 |
| Total | 12.534.084,91 | 12.534.084,91 |
| Retenciones practicadas el 28/04/23 | 122.822,39 | |
| A Inv.Temporales | | 122.822,39 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 1444/23**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

TDA26fluj.trim\Abr23