

**I. DATOS IDENTIFICATIVOS**

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA  
Número de registro del Fondo: 9132  
NIF Fondo: V85489946  
Denominación del compartimento:  
Número de registro del compartimento:  
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.  
NIF Gestora: A80732142  
Fondo Abierto: NO  
Fondo Privado: NO  
Estados agregados: NO  
Fecha: 30/09/2020

**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)

S.01

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	221.083	1001	232.593
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	221.083	1002	232.593
1. Activos titulizados	0003	221.083	1003	232.593
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	220.636	1004	231.897
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005		1005	
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	2.875	1025	3.056
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-2.428	1027	-2.360
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0039		1039	
<b>III. Otros activos no corrientes</b>	0040		1040	

S.01

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	55.787	1041	67.450
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042	921	1042	1.495
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	27.569	1043	37.160
1. Activos titulizados	0044	27.569	1044	37.160
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	27.412	1045	36.962
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046		1046	
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	20	1065	24
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	0	1066	0
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	869	1067	753
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	9	1068	9
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-741	1069	-589
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0082	6	1082	1
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	6	1084	1
<b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b>	0085	27.291	1085	28.794
1. Tesorería	0086	27.291	1086	28.794
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	276.870	1088	300.042

S.01

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	252.936	1089	265.733
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0090		1090	
1. Provisión garantías financieras	0091		1091	
2. Provisión por margen de intermediación	0092		1092	
3. Otras provisiones	0093		1093	
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0094	252.936	1094	265.733
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	221.260	1095	232.814
1.1 Series no subordinadas	0096	199.260	1096	210.814
1.2 Series subordinadas	0097	22.000	1097	22.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101	23.760	1101	24.271
2.1 Préstamo subordinado	0102	28.000	1102	28.000
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-4.240	1105	-3.729
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	7.916	1108	8.647
3.1 Derivados de cobertura	0109	7.916	1109	8.647
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	
4.1 Garantías financieras	0113		1113	
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	0116		1116	

S.01

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	31.850	1117	42.956
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0118		1118	
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	0119		1119	
1. Provisión garantías financieras	0120		1120	
2. Provisión por margen de intermediación	0121		1121	
3. Otras provisiones	0122		1122	
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	0123	31.843	1123	42.927
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	29.367	1124	40.435
1.1 Series no subordinadas	0125	29.366	1125	40.433
1.2 Series subordinadas	0126		1126	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	1	1128	2
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	2.427	1131	2.386
2.1 Préstamo subordinado	0132	2.106	1132	2.106
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	-2.289	1135	-2.286
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	2	1136	3
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	2.608	1137	2.562
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	39	1139	37
3.1 Derivados de cobertura	0140	39	1140	37
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	9	1143	70
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	9	1144	70
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	0148	8	1148	29
1. Comisiones	0149	4	1149	5
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	2	1150	2
1.2 Comisión administrador	0151	1	1151	1
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	1	1152	1
1.4 Comisión variable	0153		1153	
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	3	1157	25
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158	-7.916	1158	-8.647
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159		1159	
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	-7.916	1160	-8.647
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161		1161	
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	276.870	1162	300.042

S.02

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2020		Acumulado anterior 30/09/2019
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	117	1201	205	2201	363	3201	610
1.1 Activos titulizados	0202	117	1202	205	2202	363	3202	610
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-31	1204	-37	2204	-75	3204	-116
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-12	1205	-15	2205	-30	3205	-47
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-18	1206	-22	2206	-45	3206	-69
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0208	-92	1208	-142	2208	-346	3208	-364
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	-5	1209	27	2209	-58	3209	131
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	0210	0	1210	0	2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0215	0	1215	0	2215		3215	
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0217	-39	1217	-44	2217	-127	3217	-127
7.1 Servicios exteriores	0218	-11	1218	-10	2218	-40	3218	-31
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219	0	2219	-6	3219	-3
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	-11	1222	-10	2222	-34	3222	-28
7.2 Tributos	0223	-1	1223	-5	2223	-9	3223	-11
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-27	1224	-28	2224	-77	3224	-85
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-13	1225	-15	2225	-40	3225	-47
7.3.2 Comisión administrador	0226	-7	1226	-7	2226	-20	3226	-23
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-5	1227	-5	2227	-15	3227	-15
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228		3228	
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	-2	1230	0	2230	-2	3230	0
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0231	-117	1231	304	2231	-220	3231	447
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-117	1232	304	2232	-220	3232	447
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233		3233	
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	0234	0	1234	0	2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237		3237	
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0238	-1	1238	15	2238	-110	3238	20
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0239	162	1239	-303	2239	515	3239	-471
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0241	0	1241	0	2241		3241	
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

S.03

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2020		Acumulado anterior 30/09/2019
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	-21	1300	16	2300	-430	3300	41
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	34	1301	70	2301	-64	3301	179
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	117	1302	209	2302	311	3302	568
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-14	1303	-16	2303	-31	3303	-48
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	-228	1304	-231	2304	-814	3304	-695
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	158	1305	107	2305	470	3305	354
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	0	1308	0	2308	0	3308	0
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	0309	-25	1309	-27	2309	-76	3309	-83
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-13	1310	-15	2310	-41	3310	-45
2.2 Comisión administrador	0311	-7	1311	-7	2311	-20	3311	-23
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	-5	2312	-15	3312	-15
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>	0315	-30	1315	-27	2315	-290	3315	-55
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	-30	1320	-27	2320	-290	3320	-55
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>	0322	83	1322	105	2322	-1.073	3322	-115
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b>	0325	83	1325	105	2325	-1.073	3325	-115
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	4.706	1326	5.124	2326	14.467	3326	15.625
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.825	1327	2.731	2327	6.038	3327	8.610
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	111	1328	257	2328	371	3328	625
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	160	1330	103	2330	673	3330	392
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-6.718	1331	-8.109	2331	-22.621	3331	-25.366
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	0332	0	1332	0	2332	0	3332	0
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	0	1336	0	2336	0	3336	0
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	0337	62	1337	121	2337	-1.503	3337	-74
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	27.229	1338	26.689	2338	28.794	3338	26.884
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	27.291	1339	26.811	2339	27.291	3339	26.811

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2020		Acumulado anterior 30/09/2019
<b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>0356</b>	<b>0</b>	<b>1356</b>	<b>0</b>	<b>2356</b>		<b>3356</b>	
<b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	400	1357	705	2357	385	3357	931
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	400	1358	705	2358	385	3358	931
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	92	1360	142	2360	346	3360	364
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-492	1362	-846	2362	-731	3362	-1.295
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>0363</b>	<b>0</b>	<b>1363</b>	<b>0</b>	<b>2363</b>	<b>0</b>	<b>3363</b>	<b>0</b>
<b>3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368		3368	
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>0369</b>	<b>0</b>	<b>1369</b>	<b>0</b>	<b>2369</b>		<b>3369</b>	
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>0370</b>	<b>0</b>	<b>1370</b>	<b>0</b>	<b>2370</b>	<b>0</b>	<b>3370</b>	<b>0</b>

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2020								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	1,49	0400	1,80	0420	0	0440	3,99	1380	1,40	1400	1,67	1420	0	1440	4,56	2380	0,23	2400	0,01	2420	0	2440	0
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	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

**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	4	0467	2	0474	0	0481		0488	3	0495	449	0502	0	0509	452
De 1 a 3 meses	0461	2	0468	4	0475	0	0482		0489	4	0496	375	0503	0	0510	379
De 3 a 6 meses	0462		0469		0476		0483		0490		0497		0504		0511	
De 6 a 9 meses	0463	3	0470	14	0477	0	0484	0	0491	15	0498	317	0505		0512	331
De 9 a 12 meses	0464	1	0471	3	0478	0	0485	0	0492	3	0499	26	0506		0513	29
Más de 12 meses	0465	20	0472	851	0479	9	0486	82	0493	942	0500	2.533	0507		0514	3.475
<b>Total</b>	0466	<b>30</b>	0473	<b>876</b>	0480	<b>9</b>	0487	<b>82</b>	0494	<b>967</b>	0501	<b>3.700</b>	0508	<b>0</b>	1515	<b>4.666</b>

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	4	0522	2	0529	0	0536		0543	3	0550	449	0557	0	0564	452	0571	1.203	0578	1.203	0584	37,57
De 1 a 3 meses	0516	2	0523	4	0530	0	0537		0544	4	0551	375	0558	0	0565	379	0572	995	0579	995	0585	38,12
De 3 a 6 meses	0517		0524		0531		0538		0545		0552		0559		0566		0573		0580		0586	
De 6 a 9 meses	0518	3	0525	14	0532	0	0539	0	0546	15	0553	317	0560		0567	331	0574	1.084	0581	1.084	0587	30,56
De 9 a 12 meses	0519	1	0526	3	0533	0	0540	0	0547	3	0554	26	0561		0568	29	0575	209	0582	209	0588	13,82
Más de 12 meses	0520	20	0527	851	0534	9	0541	82	0548	942	0555	2.533	0562		0569	3.475	0576	6.851	0583	6.851	0589	50,72
<b>Total</b>	0521	<b>30</b>	0528	<b>876</b>	0535	<b>9</b>	0542	<b>82</b>	0549	<b>967</b>	0556	<b>3.700</b>	0563	<b>0</b>	0570	<b>4.666</b>	0577	<b>10.342</b>			0590	<b>45,12</b>

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO C**

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 15/07/2008	
Inferior a 1 año	0600	279	1600	156	2600	77
Entre 1 y 2 años	0601	589	1601	775	2601	322
Entre 2 y 3 años	0602	960	1602	1.184	2602	1.327
Entre 3 y 4 años	0603	1.905	1603	1.292	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	1.716	1604	2.207	2604	1.665
Entre 5 y 10 años	0605	23.840	1605	23.409	2605	14.418
Superior a 10 años	0606	222.502	1606	243.644	2606	782.191
<b>Total</b>	0607	<b>251.792</b>	1607	<b>272.668</b>	2607	<b>800.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	0608	<b>14,47</b>	1608	<b>15,10</b>	2608	<b>25,41</b>

Antigüedad	Situación actual 30/09/2020					
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 15/07/2008	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	13,77	1609	13,03	2609	1,67

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO D**

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 15/07/2008			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	2.312	0630	170.319	1620	2.298	1630	171.659	2620	1.547	2630	154.528
40% - 60%	0621	633	0631	79.754	1621	753	1631	99.284	2621	1.515	2631	265.676
60% - 80%	0622	8	0632	1.627	1622	7	1632	1.533	2622	1.848	2632	379.796
80% - 100%	0623		0633		1623	1	1633	99	2623	0	2633	0
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624	0	2634	0
120% - 140%	0625	1	0635	93	1625	1	1635	94	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627	0	2637	0
<b>Total</b>	0628	<b>2.954</b>	0638	<b>251.793</b>	1628	<b>3.060</b>	1638	<b>272.668</b>	2628	<b>4.910</b>	2638	<b>800.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>	0639	<b>32,64</b>	0649		1639	<b>34,02</b>	1649		2639	<b>56,24</b>	2649	

S.05.1

**Denominación Fondo:** AyT Génova Hipotecario XII, FTH

**Denominación del compartimento:**

**Denominación de la gestora:** HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

**Estados agregados:** NO

**Fecha:** 30/09/2020

**Entidades cedentes de los activos titulizados:** A08663619 CAIXABANK, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 15/07/2008	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,20	1650	0,26	2650	5,08
Tipo de interés nominal máximo	0651	2,30	1651	2,30	2651	5,72
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,03	1652	0,03	2652	4,50

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO F**

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 15/07/2008			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	701	0683	55.709	1660	727	1683	60.211	2660	1.035	2683	155.972
Aragón	0661	111	0684	7.651	1661	116	1684	8.575	2661	185	2684	25.520
Asturias	0662	34	0685	2.070	1662	36	1685	2.219	2662	53	2685	6.385
Baleares	0663	115	0686	10.281	1663	116	1686	10.853	2663	188	2686	32.380
Canarias	0664	247	0687	19.201	1664	256	1687	20.718	2664	367	2687	54.102
Cantabria	0665	45	0688	3.242	1665	45	1688	3.427	2665	70	2688	9.978
Castilla-León	0666	97	0689	7.162	1666	100	1689	7.683	2666	175	2689	22.929
Castilla La Mancha	0667	47	0690	3.850	1667	49	1690	4.049	2667	185	2690	25.047
Cataluña	0668	437	0691	43.504	1668	456	1691	47.234	2668	693	2691	132.215
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	1	2692	23
Extremadura	0670	20	0693	1.180	1670	20	1693	1.263	2670	30	2693	3.684
Galicia	0671	139	0694	8.006	1671	145	1694	8.732	2671	236	2694	27.828
Madrid	0672	538	0695	55.309	1672	557	1695	60.100	2672	1.006	2695	199.206
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	54	0697	3.963	1674	58	1697	4.457	2674	94	2697	12.799
Navarra	0675	23	0698	1.920	1675	23	1698	2.031	2675	42	2698	6.114
La Rioja	0676	13	0699	897	1676	13	1699	968	2676	17	2699	2.672
Comunidad Valenciana	0677	272	0700	22.253	1677	279	1700	24.079	2677	416	2700	62.531
País Vasco	0678	61	0701	5.593	1678	64	1701	6.068	2678	117	2701	20.615
<b>Total España</b>	0679	<b>2.954</b>	0702	<b>251.792</b>	1679	<b>3.060</b>	1702	<b>272.668</b>	2679	<b>4.910</b>	2702	<b>800.000</b>
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
<b>Total general</b>	0682	<b>2.954</b>	0705	<b>251.792</b>	1682	<b>3.060</b>	1705	<b>272.668</b>	2682	<b>4.910</b>	2705	<b>800.000</b>

<b>S.05.1</b>
<b>Denominación Fondo:</b> AyT Génova Hipotecario XII, FTH
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b> HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
<b>Estados agregados:</b> NO
<b>Fecha:</b> 30/09/2020
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados:</b> A08663619 CAIXABANK, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 15/07/2008			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,91			1710	1,84			2710	1,31		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO A**

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2020			Situación cierre anual anterior 31/12/2019			Situación inicial 15/07/2008					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0312285002	A	15.560	14.693	228.626	15.560	16.147	251.247	15.560	50.000	778.000			
ES0312285010	B	440	50.000	22.000	440	50.000	22.000	440	50.000	22.000			
<b>Total</b>		0723	16.000	0724	250.626	1723	16.000	1724	273.247	2723	16.000	2724	800.000

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2020

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	0738	0739					
ES0312285002	A	NS	EURIBOR 3 MESES	0,30	0	0	0	SI	228.626	0	228.626						
ES0312285010	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,60	0,12	1	0	SI	22.000	0	22.001						
<b>Total</b>						0740	1	0741	0	0743	250.626	0744	0	0745	250.627	0746	

	Situación actual 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 15/07/2008			
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,02	0748	0,01	0749	5,36

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2020								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2019							
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	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0312285002	A	6.718	549.374	0	62.702	8.109	519.007	0	62.702	0	0	16	2.825				
ES0312285010	B	0	0	14	2.866	0	0	16	2.825								
<b>Total</b>		0754	6.718	0755	549.374	0756	14	0757	65.568	1754	8.109	1755	519.007	1756	16	1757	65.527

<b>S.05.2</b>
<b>Denominación Fondo:</b> AyT Génova Hipotecario XII, FTH
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b> HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
<b>Estados agregados:</b> NO
<b>Periodo de la declaración:</b> 30/09/2020
<b>Mercados de cotización de los valores emitidos:</b> 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 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 15/07/2008
				0762	0763	0764
ES0312285002	A	29/09/2016	FCH	A+	A+	AAA
ES0312285002	A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0312285010	B	28/02/2019	FCH	BBB+	BBB+	A
ES0312285010	B	29/06/2018	MDY	A3	A3	Aa2

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2020

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 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 15/07/2008	
Inferior a 1 año	0765		1765	0	2765	
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769	228.626	1769	251.247	2769	
Entre 5 y 10 años	0770	22.000	1770	22.000	2770	778.000
Superior a 10 años	0771	0	1771		2771	22.000
<b>Total</b>	<b>0772</b>	<b>250.626</b>	<b>1772</b>	<b>273.247</b>	<b>2772</b>	<b>800.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>0773</b>	<b>5,08</b>	<b>1773</b>	<b>4,80</b>	<b>2773</b>	<b>9,71</b>

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 15/07/2008	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	25.200	1775	25.210	2775	28.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	28.000	1776	28.000	2776	28.000
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	10,05	1777	9,23	2777	3
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783	Notas Explicativas	2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	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	91,22	1792	91,95	2792	97,25
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	

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 15/07/2008	
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806

AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Permuta 1	BANCO SANTANDER S.A	TRIMESTRAL	Suma de (i) intereses ordinarios de las Participaciones Hipotecarias, correspondientes al tipo de interés de referencia (calculado mediante la deducción del margen aplicable a cada liquidación del Préstamo Hipotecario) y en (ii) concepto de la parte variable de los intereses de demora de las Participaciones Hipotecarias, esto es, el tipo de interés de referencia sobre el que se pagan dichos intereses de demora durante el Periodo de Liquidación en curso, entre el Importe Nominal, multiplicado por 360 y dividido por los días efectivos existentes en dicho Periodo de Liquidación	Suma de los Importes Nacionales Individuales. Importe Nocial Individual de cada Préstamo Hipotecario : se dividirán (i) las cantidades efectivamente ingresadas por el Fondo en concepto de intereses ordinarios de las Participaciones Hipotecarias, correspondientes al tipo de interés de referencia (calculado mediante la deducción del margen aplicable a cada liquidación del Préstamo Hipotecario) y en concepto de la parte variable de los intereses de demora de las Participaciones Hipotecarias, esto es, el tipo de interés de referencia sobre el que se pagan dichos intereses de demora entre (ii) el tipo de interés de referencia aplicado en cada liquidación en el correspondiente Préstamo Hipotecario que será siempre Euribor a un año.	Importe Nocial del Periodo de Liquidación por el tipo de interés EURIBOR a 3 meses	Suma de los Importes Nacionales Individuales. Importe Nocial Individual de cada Préstamo Hipotecario : se dividirán (i) las cantidades efectivamente ingresadas por el Fondo en concepto de intereses ordinarios de las Participaciones Hipotecarias, correspondientes al tipo de interés de referencia (calculado mediante la deducción del margen aplicable a cada liquidación del Préstamo Hipotecario) y en concepto de la parte variable de los intereses de demora de las Participaciones Hipotecarias, esto es, el tipo de interés de referencia sobre el que se pagan dichos intereses de demora entre (ii) el tipo de interés de referencia aplicado en cada liquidación en el correspondiente Préstamo Hipotecario que será siempre Euribor a un año	-7.955	-8.684	-35.075			
<b>Total</b>							0808	-7.955	0809	-8.684	0810	-35.075

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

**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 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 15/07/2008		Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 15/07/2008			
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			
<b>Total</b>	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

**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 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación actual 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación actual 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Última Fecha Pago									
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	960	7006	841	7009	1,49	7012	1,40	7015	1,58		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	960	7008	841	7011	1,49	7014	1,40	7017	959.818	7018	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	921	7024	793	7027	1,25	7030	1,07	7033	1,24		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	921	7026	793	7029	1,25	7032	1,07	7035	1,24	7036	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

**INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO**

**CUADRO B**

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
<b>Amortización secuencial: series</b>	0854	0858	1858	2858
b) El importe a que asciende el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias en morosidad que presenten más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, sea superior al % establecido para cada ISIN del Saldo Vivo de los Activos en es	1,25	0,25	0,35	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.3.4
c) Cuando el SALDO VIVO DE LOS ACTIVOS en la fecha de Determinación correspondiente a la Fecha de Pago en curso sea inferior al porcentaje establecido del SALDO INICIAL que se haya ejercitado la opción de amortización anticipada	10	31,08	31,33	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.3.4
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series</b>	0855	0859	1859	2859
Saldo acumulado de Activos Fallidos (sin deducción de las posibles recuperaciones obtenidas de esos Activos Fallidos) fuese superior al porcentaje recogido para cada ISIN del Saldo Inicial de la cartera de Participaciones Hipotecarias siempre que no se hu	7	2,03	2,03	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL LA NOTA DE VALORES. APARTADO 3.4.6.3
<b>No Reducción del Fondo de Reserva</b>	0856	0860	1860	2860
(iii) Cuando en la Fecha de Determinación correspondiente a la Fecha de Pago en curso el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera superior al porcentaje recogido del Sal	1	0,25	0,35	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL A LA NOTA DE VALORES. APARTADO 3.4.2.2
<b>OTROS TRIGGERS</b>	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

**CUADRO C**

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



S.05.5

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

**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	HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.U.	1862	0	2862	Días del mes /Base 365	3862	0,020	4862	150	5862	30	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	CAIXABANK	1863	0	2863	Días del mes /Días año	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Trimestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	CAIXABANK, S.A.	1864	5	2864		3864	0	4864	0	5864	0	6864	Trimestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

<b>S.05.5</b>
<b>Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/09/2020</b>

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	S
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	N
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Caixabank
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo adicional 3.7.2.3

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo											Total	
		31/03/2020	30/06/2020	30/09/2020										
<b>Ingresos y gastos del periodo de cálculo</b>	0872													
Margen de intereses	0873	-18	-35	-5										-58
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	-96	-7	-117										-220
Dotaciones a provisiones (neto)	0875	0	0											0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876	-117	9	-1										-110
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-46	-42	-39										-127
<b>Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)</b>	0878	-277	-75	-162	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-515
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879													0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880													0
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881													0
<b>Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]</b>	0882	277	75	162	0	0	0	0	0	0	0	0	0	515
Comisión variable pagada	0883													0
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884													0

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885												
Saldo inicial	0886												
Cobros del periodo	0887												
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888												
Pagos por derivados	0889												
Retención importe Fondo de Reserva	0890												
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891												
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892												
Resto pagos/retenciones	0893												
Saldo disponible	0894												
Liquidación de comisión variable	0895												

S.06

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XII, FTH

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

**NOTAS EXPLICATIVAS**

Contiene



Información adicional  
en fichero adjunto

**INFORME DE AUDITOR**

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