

5.00

### I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Número de registro del Fondo: 8276

NIF Fondo: **V84906353** 

Denominación del compartimento: Número de registro del compartimento:

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

NIF gestora: A80732142 Estados agregados: No Periodo: 1er Trimestre Ejercicio: 2016

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:



Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No** Periodo: **1er Trimestre** Ejercicio: **2016** 

| BALANCE (miles de euros)                                |      | Periodo Actual<br>31/03/2016 |      | Periodo Anterior<br>31/12/2015 |
|---|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| ACTIVO  |      |                              |      |                                |
| A) ACTIVO NO CORRIENTE                                  | 0008 | 396.067                      | 1008 | 395.820                        |
| I. Activos financieros a largo plazo                    | 0010 | 396.067                      | 1010 | 395.820                        |
| Valores representativos de deuda                        | 0100 | 0                            | 1100 | 0                              |
| 1.1 Bancos centrales                                    | 0101 | 0                            | 1101 | 0                              |
| 1.2 Administraciones Públicas españolas                 | 0102 | 0                            | 1102 | 0                              |
| 1.3 Entidades de crédito                                | 0103 | 0                            | 1103 | 0                              |
| 1.4 Otros sectores residentes                           | 0104 | 0                            | 1104 | C                              |
| 1.5 Administraciones Públicas no residentes             | 0105 | 0                            | 1105 | C                              |
| 1.6 Otros sectores no residentes                        | 0106 | 0                            | 1106 | C                              |
| 1.7 Activos dudosos                                     | 0107 | 0                            | 1107 | C                              |
| 1.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)  | 0108 |                              | 1108 |                                |
| 1.9 Intereses y gastos devengados no vencidos           | 0109 | 0                            | 1109 | [ c                            |
| 1.10 Ajustes por operaciones de cobertura               | 0110 | 0                            | 1110 | 0                              |
| 2. Derechos de crédito                                  | 0200 | 396.067                      | 1200 | 395.820                        |
| 2.1 Participaciones hipotecarias                        | 0201 | 395.422                      | 1201 | 394.937                        |
| 2.2 Certificados de transmisión hipotecaria             | 0202 | 0                            | 1202 | C                              |
| 2.3 Préstamos hipotecarios                              | 0203 | 0                            | 1203 | C                              |
| 2.4 Cédulas Hipotecarias                                | 0204 | 0                            | 1204 | ĺ                              |
| 2.5 Préstamos a promotores                              | 0205 | 0                            | 1205 | ĺ                              |
| 2.6 Préstamos a PYMES                                   | 0206 | 0                            | 1206 | l c                            |
| 2.7 Préstamos a empresas                                | 0207 | 0                            | 1207 | l                              |
| 2.8 Préstamos Corporativos                              | 0208 | 0                            | 1208 | l c                            |
| 2.9 Cédulas territoriales                               | 0209 | 0                            | 1209 |                                |
| 2.10 Bonos de Tesosería                                 | 0210 | 0                            | 1210 |                                |
| 2.11 Deuda Subordinada                                  | 0211 | 0                            | 1211 |                                |
| 2.12 Créditos AAPP                                      | 0212 | 0                            | 1212 |                                |
| 2.13 Préstamos Consumo                                  | 0213 | 0                            | 1213 |                                |
| 2.14 Préstamos automoción                               | 0214 | 0                            | 1214 |                                |
| 2.15 Cuotas de Arrendamiento financiero (leasing)       | 0215 | 0                            | 1215 |                                |
| 2.16 Cuentas a cobrar                                   | 0216 | 0                            | 1216 |                                |
| 2.17 Derechos de crédito futuros                        | 0217 | 0                            | 1217 |                                |
| 2.18 Bonos de titulización                              | 0218 | 0                            | 1218 |                                |
| 2.19 Otros  | 0219 | 0                            | 1219 |                                |
| 2.20 Activos dudosos                                    | 0210 | 2.926                        | 1210 | 3.411                          |
| 2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-) | 0220 | -2.281                       | 1221 | -2.528                         |
| 2.22 Intereses y gastos devengados no vencidos          | 0221 | -2.261                       | 1221 | -2.526                         |
| 2.23 Ajustes por operaciones de cobertura               | 0222 | 0                            | 1223 |                                |
| 3. Derivados  | 0230 | 0                            | 1230 | 0                              |
| 3.1 Derivados de cobertura                              | 0230 | 0                            | 1230 | 0                              |
| 3.2 Derivados de regociación                            | 0231 | 0                            | 1231 |                                |
| Otros activos financieros                               | 0232 | 0                            | 1232 | 0                              |
|   |      | 0                            |      |                                |
| 4.1 Garantías financieras                               | 0241 |                              | 1241 | i                              |
| 4.2 Otros   | 0242 | 0                            | 1242 | 0                              |
| II. Activos por impuesto diferido                       | 0250 | 0                            | 1250 | 0                              |
| III. Otros activos no corrientes                        | 0260 | 0                            | 1260 | 0                              |



Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No** Periodo: **1er Trimestre** Ejercicio: **2016** 

| Description      | BALANCE (miles de euros)                               |       | Periodo Actual<br>31/03/2016 |      | Periodo Anterior<br>31/12/2015 |
|--|--|-------|------------------------------|------|--------------------------------|
| V. Activos financieros a corto piazo   0290   33.423   1290   1. Deuturos y otras cuentas a cobrar   0300   0   1300   0   1310   0   1310   0   1310   0   1310   0   1310   0   1310   0   1310   0   1310   0   1310   0   1310   0   1310   0   1310   0   1310   0   1310   0   1310   0   1310   0   1310   0   1310   0   1311      | B) ACTIVO CORRIENTE                                    | 0270  | 54.136                       | 1270 | 69.819                         |
| 1. Deutsdress y circas cuantrias a cubrar   3000   0   3000   0   3000   0   3000   0  | IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta     | 0280  | 834                          | 1280 | 834                            |
| 2. Valores representativos de deuda 2.1 Bancos centrales 2.2 Administraciones Públicas españolas 2.2 Administraciones Públicas españolas 3.3 0313 2.3 Entidades de ordetio 3.313 3.133 3.1313 3.1313 3.1313 3.1313 3.1313 3.1313 3.1313 3.1313 3.1313 3.1313 3.1313 3.1313 3.1313 3.1313 3.1313 3.1313 3.1313 3.1313 3.1315 3.1315 3.2 Administraciones Públicas no residentes 3.316 0.1316 0.1316 0.1316 0.1316 0.1316 0.1316 0.1316 0.1317  | V. Activos financieros a corto plazo                   | 0290  | 33.423                       | 1290 | 43.996                         |
| 2.1 Bancos centrales 2.2 Administraciones Públicas españolas 2.3 Entidades de crédio 3.313 0 1312 2.4 Entidades de crédio 2.5 Administraciones Públicas pañolas 2.4 Cotros sectores residentes 3.314 0 1314 2.5 Administraciones Públicas no residentes 3.315 0 1315 2.6 Cotros sectores residentes 3.316 0 1316 2.7 Ancivos dudosos 2.7 Ancivos dudosos 3.317 0 1317 2.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (·) 3.318 1318 2.3 Inistraces y gastos devengados no vencidos 3.319 0 1319 2.10 Aquetes por operaciones de cobertura 3.20 0 1320 3.1 Participaciones hipotecarias 3.1 Participaciones hipotecarias 3.2 Certificados de transmisión hipotecaria 3.2 Certificados de transmisión hipotecaria 3.3 Préstamos hipotecarias 40404 0 1401 3.3 Préstamos a promotores 40405 0 1405 3.0 Préstamos a promotores 40406 0 1406 3.1 Participaciones Públicas en en el despensarios 40407 0 1407 3.3 Préstamos a promotores 40405 0 1406 3.0 Préstamos a Porticipaciones 40407 0 1407 3.1 Participaciones de Cobertura 40408 0 1409 405 0 1406 406 0 1406 407 0 1407 408 409 0 1408 409 0 1409 409 0 1409 409 0 1409 409 0 1409 409 0 1409 409 0 1409 409 0 1409 410 0 1401 411 0 1411 411 0 1411 411 0 1411 411 0 1411 411 0 1411 411 0 1411 411 0 1411 411 0 1411 411 0 1411 411 0 1411 411 0 1411 411 0 1411 411 411 0 1411 411 411 411 411 411 411 411 411 41   | Deudores y otras cuentas a cobrar                      | 0300  | 0                            | 1300 | 0                              |
| 2.2 Administrationes Públicas españolas 2.3 Entidades de créditio 2.3 Entidades de créditio 3313 0 1313 2.4 Otros sectores residentes 3314 0 1314 2.5 Administrationes Públicas no residentes 3316 0 1315 2.6 Otros sectores ne residentes 3316 0 1316 2.7 Activos dudosos 3317 0 1317 2.8 1318 2.9 Entros sectores no residentes 3317 0 1317 3.1 1318 2.1 Otros dudosos 3.1 0 1318 3.1 1318 3.2 Entroscolores de valer por deterioro de activos (·) 3.3 18 1318 3.1 1318 3.1 1318 3.1 1318 3.1 1318 3.2 Intereses y gastos devengados no vencidos 3.3 19 0 1330 3.3 Derechos de créditio 3.3 Derechos de créditio 3.4 Participaciones hipotecarias 3.5 Petatamos inpotecarias 40401 33.170 3.6 Préstamos a promotores 3.6 Préstamos a promotores 3.6 Préstamos a promotores 3.7 Préstamos a promotores 3.8 Préstamos a promotores 3.9 Préstamos a promotores 3.9 Préstamos a promotores 40406 0 1406 3.1 Participaciones hipotecarias 40407 0 1407 3.1 Participaciones a PMES 40406 0 1406 3.1 Préstamos a promotores 40407 0 1407 40.1 4 | Valores representativos de deuda                       | 0310  | 0                            | 1310 | 0                              |
| 2.4 Entidades de crédifio 2.4 Otros soctores residentes 2.5 Administraciones Públicas no residentes 3.15 0.1314 2.5 Cotros sectores no residentes 3.315 0.316 2.6 Otros sectores no residentes 3.316 0.316 3.7 Activos dudosos 3.317 0.317 2.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (·) 2.8 Intereses y apticas devengados no vencidos 3.10 0.319 3.11 0.320 0.330 3.10 0.33 | 2.1 Bancos centrales                                   | 0311  | 0                            | 1311 | 0                              |
| 2.4 Otros sectores residentes 2.5 Administraciones Públicas no residentes 3.16 0.315 | 2.2 Administraciones Públicas españolas                | 0312  | 0                            | 1312 | 0                              |
| 2.5 Administraciones Públicas no residentes 2.6 Otros sectores no residentes 2.7 Activos ductions 2.8 Corrocciones de vialor por deterioro de activos (·) 2.9 Intereses y astros devengados no vencidos 2.10 Ajustes por operaciones de cobertura 3.10 Ajustes de rédito 3.10 Ajustes por operaciones de cobertura 3.10 Ajustes de rédito 3.10 Ajustes por operaciones de cobertura 3.10 Ajustes de rédito 3.10 Ajustes de rédito 3.10 Ajustes de rédito 3.10 Ajustes de rédito 3.10 Ajustes ajuste de rédito futuro de rédito futuro de rédito de rédito futuro de r | 2.3 Entidades de crédito                               | 0313  | 0                            | 1313 | 0                              |
| 2.6 Otros sectores no residentes 2.7 Activos dudosos 2.8 Correctiones de valor por deterioro de activos (·) 3.18 2.9 Interesses y gastos devengados no vencidos 3.10 Autises por operaciones de cobertura 3.20 (a) 1319 3.10 Autises por operaciones de cobertura 3.20 (b) 1330 3. Derectiones de residito 3.10 Autises por operaciones de cobertura 3.2 (c) 11 Interesses vencidos e impagados 3. Derectiones de residito de residito de residito de residio de residito de residio | 2.4 Otros sectores residentes                          | 0314  | 0                            | 1314 | 0                              |
| 2.7 Activos dudosos 2.8 Correctiones de valor por deterior de activos (·) 2.9 Interesses y gastos devengados no vencidos 0.19 0 1319 2.10 Alustas por operaciones de acterium 0.300 0 1320 2.11 Interesses vencidos e impagados 3. Derechos de refetto 0.000 33.423 1400 3. Peratricipaciones hipotecarias 0.000 33.423 1400 3.1 Participaciones hipotecarias 0.000 33.423 1400 3.1 Participaciones hipotecarias 0.001 33.170 1401 3.2 Certificados de transmisión hipotecaria 0.002 0 1402 3.3 Préstamos hipotecarias 0.003 0 1403 3.4 Cédulas Hipotecarios 0.005 0 1404 3.5 Préstamos a promotores 0.005 0 1405 3.6 Préstamos a promotores 0.005 0 1405 3.8 Préstamos a promotores 0.006 0 1406 3.7 Préstamos a promotores 0.007 0 1407 3.8 Préstamos a promotores 0.007 0 1407 3.8 Préstamos a promotores 0.009 0 1409 3.10 Bonos de Tesoseria 0.010 0 1406 3.10 Bonos de Tesoseria 0.010 0 1401 3.11 Deuda Subordinada 0.011 0 1411 3.12 Créditos AAPP 0.012 0 1412 3.13 Préstamos Corporativos 0.014 0 0 1410 3.14 Préstamos a cobrar 0.015 0 1415 3.16 Cuentas a cobrar 0.016 0 1416 0.1422 0.32 Alustes dudosos 0.0420 0 1430 0.1431 0.1431 0.1431 0.1431 0.1431 0.1431 0.1431 0.1431 0.1431 0.1431 0.1431 0.1442 0.1442 0.1442 0.1442 0.1442 0.1442 0.1442 0.1442 0.1443 0.1444  | 2.5 Administraciones Públicas no residentes            | 0315  | 0                            | 1315 | 0                              |
| 2.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (·) 2.9 Intereses y gastos devengados no vencidos 3.10 Ajustes por operaciones de cobertura 3.30 2.11 Intereses vencidos e impagados 3. Derechos de crédito 3.3.0 — 3.3.0 3. Derechos de crédito 3.4 — 3. | 2.6 Otros sectores no residentes                       | 0316  | 0                            | 1316 | 0                              |
| 2.9 Intereses y gastos devengados no vencidos       0319       0       1319         2.10 Ajustes por operaciones de cobertura       0320       0       1320         2.11 Intereses vencidos e impagados       0330       0       1330         3. Derechos de crédito       0400       33.423       1400         3.1 Participaciones hipotecarias       0401       33.170       1401         3.2 Certificados de transmisión hipotecaria       0402       0       1402         3.4 Cédulas Hipotecarias       0404       0       1404         3.5 Préstamos a promotores       0405       0       1406         3.6 Préstamos a promotores       0406       0       1406         3.7 Préstamos a promotores       0406       0       1407         3.8 Préstamos a promotores       0408       0       1409         3.10 Bustina de l'échtoris d'échtor   | 2.7 Activos dudosos                                    | 0317  | 0                            | 1317 | 0                              |
| 2.10 Ajustes por operaciones de cobertura 2.11 Intereses vencidos e impagados 3. Derechos de crédito 0.0400 33.423 1400 3.1 Participaciones hipotecarias 3.1 Participaciones hipotecarias 3.2 Certificados de transmisión hipotecaria 0.0401 3.3 Préstamos hipotecarios 0.0402 0.1 402 0.3 1403 0.3 1404 0.3 1404 0.3 1405 0.3 17 Préstamos a promotores 0.0405 0.3 16 Préstamos a promotores 0.0406 0.3 1406 0.3 1406 0.3 1406 0.3 1406 0.3 1407 0.3 1407 0.3 1407 0.3 1407 0.3 1408 0.3 1408 0.3 1408 0.3 1408 0.3 1408 0.3 1408 0.3 1408 0.3 1409 0.3 1409 0.3 1409 0.3 1409 0.3 1409 0.3 1409 0.3 1409 0.3 1409 0.3 1409 0.3 1409 0.3 1409 0.3 1409 0.3 1409 0.3 1411 0 | 2.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-) | 0318  |                              | 1318 |                                |
| 2.11 Intereses vencidos e impagados         0330         0 1330           3. Derechos de crédito         0400         33.423         1400           3.1 Participaciones hipotecarias         0401         33.170         1401           3.2 Certificados de transmisión hipotecaria         0402         0 1402           3.3 Préstamos hipotecarias         0403         0 1403           3.4 Cédulas Hipotecarias         0404         0 1404           3.5 Préstamos a promotores         0405         0 1405           3.6 Préstamos a promotores         0406         0 1406           3.7 Préstamos a prymesas         0407         0 1407           3.8 Préstamos Corporativos         0408         0 1408           3.9 Cédulas territoriales         0409         1409           3.10 Bonos de Tesosería         0410         0 1410           3.11 Deuda Subordinada         0411         0 1411           3.12 Créditos AAPP         0412         0 1412           3.13 Préstamos cutomoción         0413         0 1413           3.14 Préstamos automoción         0414         0 1414           3.15 Crientas a cobrar         0416         0 1416           3.17 Derechos de crédito futuros         0417         0 1415           3.18 Bonos   | 2.9 Intereses y gastos devengados no vencidos          | 0319  | 0                            | 1319 | 0                              |
| 3. Derechos de crédito   33.423   1400   | 2.10 Ajustes por operaciones de cobertura              | 0320  | 0                            | 1320 | 0                              |
| 3.1 Participaciones hipotecarias   0401   33.170   1401   3.2 Certificados de transmisión hipotecaria   0402   0   1402   3.3 Préstamos hipotecarios   0403   0   1403   3.4 Cédulas Hipotecarias   0404   0   1404   3.5 Préstamos a promotores   0405   0   1406   0.5   1406   3.6 Préstamos a promotores   0405   0   1406   0.5   1406   0.5   1406   0.5   1407   0   1407   0.5   1407   0.5   1407   0.5   1407   0.5   1408   0.5   0.5   1408   0.5      | 2.11 Intereses vencidos e impagados                    | 0330  | 0                            | 1330 | 0                              |
| 3.2 Certificados de transmisión hipotecaria 3.3 Préstamos hipotecarias 4.4 Cédulas Hipotecarias 4.5 Préstamos a promotores 4.6 Vidus Hipotecarias 4.7 Préstamos a promotores 4.6 Vidus Hipotecarias 4.7 Préstamos a PVMES 4.6 Vidus Hipotecarias 4.6 Vidus Hipotecarias 4.7 Vidus Hibotecarias 4.8 Vidus Hipotecarias 4.9 Vidus Hipotecarias 4.0 Vidus Hipotecarias 4.0 Vidus Hipotecarias 4.0 Vidus Hipotecarias 4.1 Derivados 4.2 Vidus Hipotecarias 4.2 Vidus Hipotecarias 4.4 Vidus Hipotecari | 3. Derechos de crédito                                 | 0400  | 33.423                       | 1400 | 43.996                         |
| 3.3 Préstamos hipotecarios 3.4 Cédulas Hipotecarias 0.404 3.5 Préstamos a promoters 0.405 3.6 Préstamos a PYMES 0.406 0.1406 3.7 Préstamos a PYMES 0.407 0.1408 3.9 Cédulas territoriales 0.409 0.1408 3.9 Cédulas territoriales 0.409 0.1409 3.10 Bonos de Tesosería 0.410 0.1411 0.1411 0.1411 0.1412 0.1412 0.1412 0.1412 0.1412 0.1414 0.1414 0.1415 0.15 Arrendamiento financiero 0.415 0.16 Cuentas a cobrar 0.416 0.1416 | 3.1 Participaciones hipotecarias                       | 0401  | 33.170                       | 1401 | 43.699                         |
| 3.4 Cédulas Hipotecarias 3.5 Préstamos a promotores 0.405 0.1405 3.6 Préstamos a promotores 0.406 0.1406 3.7 Préstamos a empresas 0.407 0.1407 3.8 Préstamos a empresas 0.407 0.1408 3.9 Cédulas territoriales 0.409 0.1409 3.10 Bonos de Tesoseria 0.410 0.1410 3.11 Deuda Subordinada 0.411 0.1411 3.12 Créditos AAPP 0.412 0.1413 0.1414 0.1414 0.1414 0.1414 0.1414 0.1414 0.1414 0.15 Arrendamiento financiero 0.415 0.16 Ceurtas a cobrar 0.416 0.1416 0.1416 0.1416 0.1417 0.1417 0.1417 0.1417 0.1417 0.1418 0.19 Dortos 0.419 0.419 0.20 Activos dudosos 0.420 0.420 0.43 Ustes por operaciones de cobertura 0.410 Derivados de cobertura 0.410 Derivados de negociación 0.421 0.1420 0.1421 0.1419 0.1 | 3.2 Certificados de transmisión hipotecaria            | 0402  | 0                            | 1402 | 0                              |
| 3.5 Préstamos a promotores 3.6 Préstamos a PYMES 0.406 3.7 Préstamos a PYMES 0.406 0.1406 3.7 Préstamos a PYMES 0.407 0.1407 3.8 Préstamos compretativos 0.408 0.1408 3.9 Cédulas territoriales 0.409 0.1409 3.10 Bonos de Tesoseria 0.410 0.1411 0.1411 3.12 Créditos AAPP 0.412 0.1412 3.13 Préstamos Consumo 0.413 0.1414 0.1414 0.1414 0.15 Arrendamiento financiero 0.415 0.16 Cuentas a cobrar 0.415 0.17 Derechos de crédito futuros 0.417 0.1416 0.1416 0.1416 0.1417 0.1417 0.1818 Bonos de titulización 0.419 0.20 Cetalita de Valor por deterioro de activos (·) 0.420 0.21 Derechos de valor por deterioro de activos (·) 0.421 0.22 100 0.422 0.23 Ajustes por operaciones de cobertura 0.423 0.24 Intereses y gastos devengados no vencidos 0.422 0.420 0.431 0.4120 0.421 0.423 0.421 0.422 0.424 0.424 0.442 0.444 0.51 Garantias financieros 0.445 0.4410 0.1441 0.4411 0.4441 | 3.3 Préstamos hipotecarios                             | 0403  | 0                            | 1403 | 0                              |
| 3.6 Préstamos a PYMES       0406       0 1406         3.7 Préstamos a empresas       0407       0 1407         3.8 Préstamos Corporativos       0408       0 1408         3.9 Cédulas territoriales       0409       0 1409         3.10 Bonos de Tesosería       0410       0 1410         3.11 Deuda Subordinada       0411       0 1411         3.12 Créditos AAPP       0412       0 1412         3.13 Préstamos Consumo       0413       0 1413         3.14 Préstamos automoción       0414       0 1414         3.15 Arrendamiento financiero       0415       0 1415         3.16 Cuentas a cobrar       0416       0 1416         3.17 Derechos de crédito futuros       0417       0 1417         3.19 Otros       0418       0 1418         3.19 Otros       0419       0 1419         3.20 Activos dudosos       0420       684       1420         3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (·)       0421       -533       1421         3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos       0422       100       1422         3.23 Ajustes por operaciones de cobertura       0423       0 1423       0 1423         4.1 Derivados de negociación       0432       0 1430 <td< td=""><td>3.4 Cédulas Hipotecarias</td><td>0404</td><td>0</td><td>1404</td><td>0</td></td<>  | 3.4 Cédulas Hipotecarias                               | 0404  | 0                            | 1404 | 0                              |
| 3.7 Préstamos a empresas 3.8 Préstamos Corporativos 40408 3.9 Cédulas territoriales 40409 40410 40411 40414 40411 40414  | 3.5 Préstamos a promotores                             | 0405  | 0                            | 1405 | 0                              |
| 3.8 Préstamos Corporativos       0408       0 1408         3.9 Cédulas territoriales       0409       0 1409         3.10 Bonos de Tesosería       0410       0 1410         3.11 Deuda Subordinada       0411       0 1411         3.12 Créditos AAPP       0412       0 1412         3.13 Préstamos Consumo       0413       0 1413         3.14 Préstamos automoción       0414       0 1414         3.15 Arrendamiento financiero       0415       0 1415         3.16 Cuentas a cobrar       0416       0 1416         3.17 Derechos de crédito futuros       0417       0 1417         3.18 Bonos de titulización       0418       0 1418         3.19 Otros       0419       0 1419         3.20 Activos dudosos       0420       684       1420         3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)       0421       -533       1421         3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos       0422       100       1422         3.23 Ajustes por operaciones de cobertura       0423       0 1423         3.24 Intereses vencidos e impagados       0424       2 1424         4. Derivados de cobertura       0430       0 1430         4.1 Derivados de cobertura       0430       0 1430   | 3.6 Préstamos a PYMES                                  | 0406  | 0                            | 1406 | 0                              |
| 3.9 Cédulas territoriales 3.10 Bonos de Tesosería 3.11 Deuda Subordinada 3.12 Créditos AAPP 4.13 Préstamos Consumo 4.14 O 1411 3.14 Préstamos Consumo 4.15 Arrendamiento financiero 4.16 Cuentas a cobrar 4.17 Derivados de titulización 4.18 Derivados de cobertura 4.2 Derivados de negociación 4.10 Evisiones 4.10 Derivados de negociación 4.10 Evisiones 4.10 Derivados de negociación 4.10 I 1409 4.11 O 1410 4.11 O 1411 4.12 O 1414 4.13 O 1414 4.14 O 1414 4.15 O 1415 4.16 Cuentas a cobrar 4.16 O 1416 6.0 O 1416 6.0 O 1416 6.0 O 1416 6.0 O 1417 6.0 O 1417 6.0 O 1418 6.0 O 1419 6.0 O 1420 6.0 O 1430 6.0 O 1430 6.0 O 1430 6.0 O 1430 6.0 O 1440 6.0 O 1440 6.0 O 1441 6.0 O 1442 6.0 | 3.7 Préstamos a empresas                               | 0407  | 0                            | 1407 | 0                              |
| 3.9 Cédulas territoriales 3.10 Bonos de Tesosería 3.11 Deuda Subordinada 3.12 Créditos AAPP 0412 3.13 Préstamos Consumo 0413 3.14 Préstamos automoción 0414 3.15 Arrendamiento financiero 0415 3.16 Cuentas a cobrar 3.16 Cuentas a cobrar 3.17 Derechos de crédito futuros 0417 3.18 Bonos de titulización 0418 3.19 Otros 0419 0.1418 3.20 Activos dudosos 0420 052 Intereses y gastos devengados no vencidos 0421 3.21 Intereses y gastos devengados no vencidos 0422 053.23 Ajustes por operaciones de cobertura 0423 0423 0424 0424 0426 0430 0440 0440 0440 051 Garantías financieras 0441 051 Qarantías financieras 0440 051 Garantías financieras 0441 0645 071 Qarantías financieras 0440 071 Qarantías financieras 0440 071 Qarantías financieras 0441 071 Qarantías financieras 0442 071 Qarantías financieras 0440 071 Qarantías financieras 0440 071 Qarantías financieras 0441 0442 0443 0444 0444 0444 0444 0444 0444   | 3.8 Préstamos Corporativos                             | 0408  | 0                            | 1408 | 0                              |
| 3.11 Deuda Subordinada       0411       0 1411         3.12 Créditos AAPP       0412       0 1412         3.13 Préstamos Consumo       0413       0 1413         3.14 Préstamos automoción       0414       0 1414         3.15 Arrendamiento financiero       0415       0 1415         3.16 Cuentas a cobrar       0416       0 1416         3.17 Derechos de crédito futuros       0417       0 1417         3.18 Bonos de titulización       0418       0 1418         3.19 Otros       0419       0 1419         3.20 Activos dudosos       0420       684       1420         3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)       0421       -533       1421         3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos       0422       100       1422         3.23 Ajustes por operaciones de cobertura       0423       0 1423       0 1423         3.24 Intereses vencidos e impagados       0424       2 1424         4. Derivados       0430       0 1430         4.1 Derivados de negociación       0431       0 1431         4.2 Derivados de negociación       0431       0 1431         5. Otros activos financieras       0440       0 1440         5. Otros activos financieras       0441  | · ·  |       | 0                            |      | 0                              |
| 3.11 Deuda Subordinada       0411       0 1411         3.12 Créditos AAPP       0412       0 1412         3.13 Préstamos Consumo       0413       0 1413         3.14 Préstamos automoción       0414       0 1414         3.15 Arrendamiento financiero       0415       0 1415         3.16 Cuentas a cobrar       0416       0 1416         3.17 Derechos de crédito futuros       0417       0 1417         3.18 Bonos de titulización       0418       0 1418         3.19 Otros       0419       0 1419         3.20 Activos dudosos       0420       684       1420         3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)       0421       -533       1421         3.22 Interesses y gastos devengados no vencidos       0422       100       1422         3.23 Ajustes por operaciones de cobertura       0423       0 1423       0 1423         3.24 Interesses vencidos e impagados       0424       2 1424         4. Derivados       0430       0 1430       0 1430         4.1 Derivados de cobertura       0431       0 1431       0 1431         4.2 Derivados de negociación       0432       0 1432       0 1432         5. Otros activos financieros       0440       0 1440       0 1441 <td>3.10 Bonos de Tesosería</td> <td>0410</td> <td>0</td> <td>1410</td> <td>0</td>   | 3.10 Bonos de Tesosería                                | 0410  | 0                            | 1410 | 0                              |
| 3.12 Créditos AAPP 3.13 Préstamos Consumo 3.14 Préstamos automoción 3.14 Préstamos automoción 3.14 Préstamos automoción 3.15 Arrendamiento financiero 3.16 Cuentas a cobrar 3.17 Derechos de crédito futuros 3.17 Derechos de crédito futuros 3.18 Bonos de titulización 3.19 Otros 3.20 Activos dudosos 3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-) 3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos 3.23 Ajustes por operaciones de cobertura 3.24 Intereses vencidos e impagados 4. Derivados 4. Derivados de cobertura 4. Derivados de cobertura 4. Derivados de negociación 5.1 Garantías financieras 5.1 Garantías financieras 5.2 Otros 5.1 Comisiones 5.1 Comisiones 5.1 Comisiones 5.1 Comisiones 5.1 Comisiones 5.1 Carantías financieras 5.2 Otros 5.1 Carantías financieras 5.2 Otros 5.1 Comisiones 5.1 Caria duda 5.1 data 5.2 |  | 0411  | 0                            | 1411 | 0                              |
| 3.13 Préstamos Consumo       0413       0 1413         3.14 Préstamos automoción       0414       0 1414         3.15 Arrendamiento financiero       0415       0 1415         3.16 Cuentas a cobrar       0416       0 1416         3.17 Derechos de crédito futuros       0417       0 1417         3.18 Bonos de titulización       0418       0 1418         3.19 Otros       0419       0 1419         3.20 Activos dudosos       0420       684       1420         3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (·)       0421       -533       1421         3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos       0422       100       1422         3.23 Ajustes por operaciones de cobertura       0423       0 1423         3.24 Intereses vencidos e impagados       0424       2 1424         4. Derivados       0430       0 1430         4.1 Derivados de cobertura       0431       0 1431         4.2 Derivados de negociación       0432       0 1432         5. Otros activos financieros       0440       0 1440         5.1 Garantías financieras       0441       0 1442         5.2 Otros       0442       0 1442              VI. Ajustes por periodificaciones       0  |  |       |                              |      | 0                              |
| 3.14 Préstamos automoción       0414       0       1414         3.15 Arrendamiento financiero       0415       0       1415         3.16 Cuentas a cobrar       0416       0       1416         3.17 Derechos de crédito futuros       0417       0       1417         3.18 Bonos de titulización       0418       0       1418         3.19 Otros       0419       0       1419         3.20 Activos dudosos       0420       684       1420         3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (·)       0421       -533       1421         3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos       0422       100       1422         3.23 Ajustes por operaciones de cobertura       0423       0       1423         3.24 Intereses vencidos e impagados       0424       2       1424         4. Derivados       0430       0       1430         4.1 Derivados de cobertura       0431       0       1431         4.2 Derivados de negociación       0432       0       1432         5. Otros activos financieros       0440       0       1440         5.1 Garantías financieras       0441       0       1441         5.2 Otros       0442       0       1442     <  |  |       | 0                            |      | 0                              |
| 3.15 Arrendamiento financiero       0415       0 1415         3.16 Cuentas a cobrar       0416       0 1416         3.17 Derechos de crédito futuros       0417       0 1417         3.18 Bonos de titulización       0418       0 1418         3.19 Otros       0419       0 1419         3.20 Activos dudosos       0420       684       1420         3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)       0421       -533       1421         3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos       0422       100       1422         3.23 Ajustes por operaciones de cobertura       0423       0 1423       0 1423         3.24 Intereses vencidos e impagados       0424       2 1424         4. Derivados       0430       0 1430         4.1 Derivados de cobertura       0431       0 1431         4.2 Derivados de negociación       0432       0 1432         5. Otros activos financieros       0440       0 1440         5. Carantías financieras       0441       0 1441         5.2 Otros       0442       0 1442          VI. Ajustes por periodificaciones       0450       0 1450         1. Comisiones       0451       0 1451   |  |       |                              |      | 0                              |
| 3.16 Cuentas a cobrar       0416       0 1416         3.17 Derechos de crédito futuros       0417       0 1417         3.18 Bonos de titulización       0418       0 1418         3.19 Otros       0419       0 1419         3.20 Activos dudosos       0420       684       1420         3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)       0421       -533       1421         3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos       0422       100       1422         3.23 Ajustes por operaciones de cobertura       0423       0 1423       0 1423         3.24 Intereses vencidos e impagados       0424       2 1424       1424         4. Derivados       0430       0 1430       0 1430         4.1 Derivados de cobertura       0431       0 1431       0 1431         4.2 Derivados de negociación       0432       0 1432       0 1432         5. Otros activos financieros       0440       0 1440       0 1441         5.1 Garantías financieras       0441       0 1441       0 1441         5.2 Otros       0442       0 1442       0 1442          VI. Ajustes por periodificaciones       0450       0 1450       0 1451  |  |       |                              |      | 0                              |
| 3.17 Derechos de crédito futuros       0417       0 1417         3.18 Bonos de titulización       0418       0 1418         3.19 Otros       0419       0 1419         3.20 Activos dudosos       0420       684 1420         3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)       0421       -533 1421         3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos       0422       100 1422         3.23 Ajustes por operaciones de cobertura       0423       0 1423         3.24 Intereses vencidos e impagados       0424       2 1424         4. Derivados       0430       0 1430         4.1 Derivados de cobertura       0431       0 1431         4.2 Derivados de negociación       0432       0 1432         5. Otros activos financieros       0440       0 1440         5.1 Garantías financieras       0441       0 1441         5.2 Otros       0442       0 1442         VI. Ajustes por periodificaciones       0450       0 1450         1. Comisiones       0451       0 1451  |  |       |                              |      | 0                              |
| 3.18 Bonos de titulización   0418   0   1418       3.19 Otros   0419   0   1419       3.20 Activos dudosos   0420   684   1420       3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)   0421   -533   1421       3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos   0422   100   1422       3.23 Ajustes por operaciones de cobertura   0423   0   1423       3.24 Intereses vencidos e impagados   0424   2   1424       4. Derivados   0430   0   1430       4.1 Derivados de cobertura   0431   0   1431       4.2 Derivados de negociación   0432   0   1432       5. Otros activos financieros   0440   0   1440       5.1 Garantías financieras   0441   0   1441       5.2 Otros   0442   0   1442      VI. Ajustes por periodificaciones   0450   0   1450       1. Comisiones   0451   0   1451  |  |       |                              |      | 0                              |
| 3.19 Otros   |  |       |                              |      | 0                              |
| 3.20 Activos dudosos       0420       684       1420         3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)       0421       -533       1421         3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos       0422       100       1422         3.23 Ajustes por operaciones de cobertura       0423       0       1423         3.24 Intereses vencidos e impagados       0424       2       1424         4. Derivados       0430       0       1430         4.1 Derivados de cobertura       0431       0       1431         4.2 Derivados de negociación       0432       0       1432         5. Otros activos financieros       0440       0       1440         5.1 Garantías financieras       0441       0       1441         5.2 Otros       0442       0       1442          VI. Ajustes por periodificaciones       0450       0       1450         1. Comisiones       0451       0       1451  |  |       |                              |      | 0                              |
| 3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)       0421       -533       1421         3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos       0422       100       1422         3.23 Ajustes por operaciones de cobertura       0423       0       1423         3.24 Intereses vencidos e impagados       0424       2       1424         4. Derivados       0430       0       1430         4.1 Derivados de cobertura       0431       0       1431         4.2 Derivados de negociación       0432       0       1432         5. Otros activos financieros       0440       0       1440         5.1 Garantías financieras       0441       0       1441         5.2 Otros       0442       0       1442          VI. Ajustes por periodificaciones       0450       0       1450         1. Comisiones       0451       0       1451   |  |       |                              |      | 682                            |
| 3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos       0422       100       1422         3.23 Ajustes por operaciones de cobertura       0423       0 1423         3.24 Intereses vencidos e impagados       0424       2 1424         4. Derivados       0430       0 1430         4.1 Derivados de cobertura       0431       0 1431         4.2 Derivados de negociación       0432       0 1432         5. Otros activos financieros       0440       0 1440         5.1 Garantías financieras       0441       0 1441         5.2 Otros       0442       0 1442          VI. Ajustes por periodificaciones       0450       0 1450         1. Comisiones       0451       0 1451  |  |       |                              |      | -505                           |
| 3.23 Ajustes por operaciones de cobertura       0423       0 1423         3.24 Intereses vencidos e impagados       0424       2 1424         4. Derivados       0430       0 1430         4.1 Derivados de cobertura       0431       0 1431         4.2 Derivados de negociación       0432       0 1432         5. Otros activos financieros       0440       0 1440         5.1 Garantías financieras       0441       0 1441         5.2 Otros       0442       0 1442            VI. Ajustes por periodificaciones       0450       0 1450         1. Comisiones       0451       0 1451   |  |       |                              |      | 119                            |
| 3.24 Intereses vencidos e impagados       0424       2 1424         4. Derivados       0430       0 1430         4.1 Derivados de cobertura       0431       0 1431         4.2 Derivados de negociación       0432       0 1432         5. Otros activos financieros       0440       0 1440         5.1 Garantías financieras       0441       0 1441         5.2 Otros       0442       0 1442         VI. Ajustes por periodificaciones       0450       0 1450         1. Comisiones       0451       0 1451  |  |       |                              |      | 0                              |
| 4. Derivados       0430       0 1430         4.1 Derivados de cobertura       0431       0 1431         4.2 Derivados de negociación       0432       0 1432         5. Otros activos financieros       0440       0 1440         5.1 Garantías financieras       0441       0 1441         5.2 Otros       0442       0 1442         VI. Ajustes por periodificaciones       0450       0 1450         1. Comisiones       0451       0 1451  |  |       |                              |      | 1                              |
| 4.1 Derivados de cobertura       0431       0 1431         4.2 Derivados de negociación       0432       0 1432         5. Otros activos financieros       0440       0 1440         5.1 Garantías financieras       0441       0 1441         5.2 Otros       0442       0 1442         VI. Ajustes por periodificaciones       0450       0 1450         1. Comisiones       0451       0 1451   | · -  |       |                              |      | ·                              |
| 4.2 Derivados de negociación       0432       0 1432         5. Otros activos financieros       0440       0 1440         5.1 Garantías financieras       0441       0 1441         5.2 Otros       0442       0 1442         VI. Ajustes por periodificaciones       0450       0 1450         1. Comisiones       0451       0 1451  |  |       |                              |      | 0                              |
| 5. Otros activos financieros       0440       0 1440         5.1 Garantías financieras       0441       0 1441         5.2 Otros       0442       0 1442         VI. Ajustes por periodificaciones       0450       0 1450         1. Comisiones       0451       0 1451   |  |       |                              |      | 0                              |
| 5.1 Garantías financieras       0441       0 1441         5.2 Otros       0442       0 1442             VI. Ajustes por periodificaciones       0450       0 1450         1. Comisiones       0451       0 1451  | Ü  |       |                              |      |                                |
| 5.2 Otros     0442     0 1442       VI. Ajustes por periodificaciones     0450     0 1450       1. Comisiones     0451     0 1451  |  |       |                              |      | 0                              |
| VI. Ajustes por periodificaciones         0450         0         1450           1. Comisiones         0451         0         1451  |  |       |                              |      |                                |
| 1. Comisiones 0451 0 1451  | 5.2 UTOS   | 0442  | 0                            | 1442 | 0                              |
| 1. Comisiones 0451 0 1451  | VI. Ajustes por periodificaciones                      | 0450  | 0                            | 1450 | 0                              |
|  |  | 0451  | 0                            | 1451 | 0                              |
|  | 2. Otros   | 0452  | 0                            | 1452 | 0                              |
| VIII Efectives y etres actives l'eurides equivelentes  | VII Etactivas vietras activas líquidos amitiralantes   | 0.460 | 40.070                       | 1400 | 04.000                         |
| VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes 0460 19.879 1460  |  |       |                              |      | 24.989                         |
| 1. Tesorería       0461       19.879       1461         2. Otros activos líquidos equivalentes       0462       0       1462   |  |       |                              |      | 24.989                         |

 TOTAL ACTIVO
 0500
 450.203
 1500
 465.639



Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No** Periodo: **1er Trimestre** Ejercicio: **2016** 

| BALANCE (miles de euros)   |  | Periodo Actual<br>31/03/2016  |  | Periodo Anterior<br>31/12/2015                         |
|--|--|---|--|--|
| PASIVO   |  |   |  |  |
| A) PASIVO NO CORRIENTE   | 0650   | 413.030   | 1650   | 412.89   |
| I. Provisiones a largo plazo   | 0660   | 0   | 1660   |  |
| II. Pasivos financieros a largo plazo  | 0700   | 413.030   | 1700   | 412.89   |
| Obligaciones y otros valores negociables   | 0710   | 396.012   | 1710   | 396.01   |
| 1.1 Series no subordinadas   | 0711   | 370.271   | 1711   | 370.27   |
| 1.2 Series subordinadas  | 0712   | 25.741  | 1712   | 25.74  |
| 1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  | 0713   |   | 1713   |  |
| 1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos  | 0714   | 0   | 1714   |  |
| 1.5 Ajustes por operaciones de cobertura   | 0715   | 0   | 1715   |  |
| 2. Deudas con entidades de crédito   | 0720   | 9.337   | 1720   | 10.30  |
| 2.1 Préstamo subordinado   | 0721   | 9.337   | 1721   | 10.30  |
| 2.2 Crédito línea de liquidez  | 0722   | 0   | 1722   |  |
| 2.3 Otras deudas con entidades de crédito  | 0723   | 0   | 1723   |  |
| 2.4 Correciones de valor por repercusión de pérdidas (-)   | 0724   |   | 1724   |  |
| 2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos  | 0725   | 0   | 1725   |  |
| 2.6 Ajustes por operaciones de cobertura   | 0726   | 0   | 1726   |  |
| 3. Derivados   | 0730   | 7.681   | 1730   | 6.58   |
| 3.1 Derivados de cobertura   | 0731   | 7.681   | 1731   | 6.58   |
| 3.2 Derivados de negociación   | 0732   | 0   | 1732   |  |
| 3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  | 0733   |   | 1733   |  |
| 4. Otros pasivos financieros   | 0740   | 0   | 1740   |  |
| 4.1 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  | 0741   |   | 1741   |  |
| 4.2 Otros  | 0742   | 0   | 1742   |  |
|  | 0142   | 0   | 1742   | l '  |
| III. Pasivos por impuesto diferido   | 0750   | 0   | 1750   |  |
|  |  |   |  |  |
| III. Pasivos por impuesto diferido   | 0750   | 0   | 1750   |  |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  | 0750<br>0760   | 0<br>44.854   | 1750<br>1760   | 59.32  |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta   | 0750<br>0760<br>0770   | 0<br>44.854<br>0  | 1750<br>1760<br>1770   | 59.32  |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo   | 0750<br>0760<br>0770<br>0780   | 0<br>44.854<br>0  | 1750<br>1760<br>1770<br>1780   | 59.32  |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  | 0750<br>0760<br>0770<br>0780<br>0800   | 0<br>44.854<br>0<br>0<br>44.129   | 1750<br>1760<br>1770<br>1780<br>1800   | 59.32<br>59.05   |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar   | 0750<br>0760<br>0770<br>0780<br>0800<br>0810   | 0<br>44.854<br>0<br>0<br>44.129<br>3  | 1750<br>1760<br>1770<br>1780<br>1800<br>1810   | 59.32<br>59.05<br>41                                   |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar  2. Obligaciones y otros valores negociables  | 0750<br>0760<br>0770<br>0780<br>0800<br>0810<br>0820   | 0<br>44.854<br>0<br>0<br>44.129<br>3<br>43.087  | 1750<br>1760<br>1770<br>1780<br>1800<br>1810<br>1820   | 59.32<br>59.05<br>41<br>57.40                          |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar  2. Obligaciones y otros valores negociables  2.1 Series no subordinadas  | 0750<br>0760<br>0770<br>0780<br>0800<br>0810<br>0820<br>0821   | 44.854<br>0<br>0<br>44.129<br>3<br>43.087<br>40.234   | 1750<br>1760<br>1770<br>1780<br>1800<br>1810<br>1820<br>1821   | 59.32<br>59.05<br>41<br>57.40<br>53.53                 |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar  2. Obligaciones y otros valores negociables  2.1 Series no subordinadas  2.2 Series subordinadas   | 0750 0760 0770 0780 0800 0810 0820 0821 0822   | 44.854<br>0<br>0<br>44.129<br>3<br>43.087<br>40.234   | 1750<br>1760<br>1770<br>1780<br>1800<br>1810<br>1820<br>1821<br>1822   | 59.32<br>59.05<br>41<br>57.40<br>53.53<br>3.72         |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar  2. Obligaciones y otros valores negociables  2.1 Series no subordinadas  2.2 Series subordinadas  2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  | 0750 0760 0770 0780 0800 0810 0820 0821 0822 0823  | 44.854<br>0<br>0<br>44.129<br>3<br>43.087<br>40.234<br>2.797  | 1750<br>1760<br>1770<br>1780<br>1800<br>1810<br>1820<br>1821<br>1822<br>1823   | 59.32<br>59.05<br>41<br>57.40<br>53.53<br>3.72         |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar  2. Obligaciones y otros valores negociables  2.1 Series no subordinadas  2.2 Series subordinadas  2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos   | 0750 0760 0770 0780 0800 0810 0820 0821 0822 0823 0824   | 44.854 0 0 44.129 3 43.087 40.234 2.797 56  | 1750<br>1760<br>1770<br>1780<br>1800<br>1810<br>1820<br>1821<br>1822<br>1823<br>1824   | 59.32<br>59.05<br>41<br>57.40<br>53.53                 |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar  2. Obligaciones y otros valores negociables  2.1 Series no subordinadas  2.2 Series subordinadas  2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos  2.5 Ajustes por operaciones de cobertura   | 0750 0760 0770 0780 0800 0810 0820 0821 0822 0823 0824 0825  | 44.854 0 0 44.129 3 43.087 40.234 2.797 56 0  | 1750<br>1760<br>1770<br>1780<br>1800<br>1810<br>1820<br>1821<br>1822<br>1823<br>1824<br>1825   | 59.32<br>59.05<br>41<br>57.40<br>53.53<br>3.72         |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar  2. Obligaciones y otros valores negociables  2.1 Series no subordinadas  2.2 Series subordinadas  2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos  2.5 Ajustes por operaciones de cobertura  2.6 Intereses vencidos e impagados   | 0750  0760  0770  0780  0800  0810  0820  0821  0822  0823  0824  0825  0826   | 44.854  0  0  44.129  3  43.087  40.234  2.797  56  0  0  | 1750<br>1760<br>1770<br>1780<br>1800<br>1810<br>1820<br>1821<br>1822<br>1823<br>1824<br>1825<br>1826   | 59.32<br>59.05<br>41<br>57.40<br>53.53<br>3.72         |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar  2. Obligaciones y otros valores negociables  2.1 Series no subordinadas  2.2 Series subordinadas  2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos  2.5 Ajustes por operaciones de cobertura  2.6 Intereses vencidos e impagados  3. Deudas con entidades de crédito   | 0750  0760  0770  0780  0800  0810  0820  0821  0822  0823  0824  0825  0826  0830   | 0 44.854 0 0 0 44.129 3 43.087 40.234 2.797 56 0 0 0 634  | 1750<br>1760<br>1770<br>1780<br>1800<br>1810<br>1820<br>1821<br>1822<br>1823<br>1824<br>1825<br>1826<br>1830                                 | 59.32<br>59.05<br>41<br>57.40<br>53.53<br>3.72         |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar  2. Obligaciones y otros valores negociables  2.1 Series no subordinadas  2.2 Series subordinadas  2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos  2.5 Ajustes por operaciones de cobertura  2.6 Intereses vencidos e impagados  3. Deudas con entidades de crédito  3.1 Préstamo subordinado   | 0750  0760  0770  0780  0800  0810  0820  0821  0822  0823  0824  0825  0826  0830  0831   | 0 44.854 0 0 0 44.129 3 43.087 40.234 2.797 56 0 0 634 589  | 1750<br>1760<br>1770<br>1780<br>1800<br>1810<br>1820<br>1821<br>1822<br>1823<br>1824<br>1825<br>1826<br>1830<br>1831                         | 59.32<br>59.05<br>41<br>57.40<br>53.53<br>3.72         |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar  2. Obligaciones y otros valores negociables  2.1 Series no subordinadas  2.2 Series subordinadas  2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos  2.5 Ajustes por operaciones de cobertura  2.6 Intereses vencidos e impagados  3. Deudas con entidades de crédito  3.1 Préstamo subordinado  3.2 Crédito línea de liquidez  | 0750  0760  0770  0780  0800  0810  0820  0821  0822  0823  0824  0825  0826  0830  0831  0832   | 0 44.854 0 0 0 44.129 3 43.087 40.234 2.797 56 0 0 634 589 0  | 1750<br>1760<br>1770<br>1780<br>1800<br>1810<br>1820<br>1821<br>1822<br>1823<br>1824<br>1825<br>1826<br>1830<br>1831<br>1832                 | 59.32<br>59.05<br>41<br>57.40<br>53.53<br>3.72<br>15   |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar  2. Obligaciones y otros valores negociables  2.1 Series no subordinadas  2.2 Series subordinadas  2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos  2.5 Ajustes por operaciones de cobertura  2.6 Intereses vencidos e impagados  3. Deudas con entidades de crédito  3.1 Préstamo subordinado  3.2 Crédito línea de liquidez  3.3 Otras deudas con entidades de crédito   | 0750  0760  0770  0780  0800  0810  0820  0821  0822  0823  0824  0825  0826  0830  0831  0832  0833   | 0 44.854 0 0 0 44.129 3 43.087 40.234 2.797 56 0 0 634 589 0  | 1750<br>1760<br>1770<br>1780<br>1800<br>1810<br>1820<br>1821<br>1822<br>1823<br>1824<br>1825<br>1826<br>1830<br>1831<br>1832<br>1833         | 59.32<br>59.05<br>41<br>57.40<br>53.53<br>3.72<br>15   |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar  2. Obligaciones y otros valores negociables  2.1 Series no subordinadas  2.2 Series subordinadas  2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos  2.5 Ajustes por operaciones de cobertura  2.6 Intereses vencidos e impagados  3. Deudas con entidades de crédito  3.1 Préstamo subordinado  3.2 Crédito línea de liquidez  3.3 Otras deudas con entidades de crédito  3.4 Correciones de valor por repercusión de pérdidas (-)   | 0750  0760  0770  0780  0800  0810  0820  0821  0822  0823  0824  0825  0826  0830  0831  0832  0833  0834   | 0<br>44.854<br>0<br>0<br>44.129<br>3<br>43.087<br>40.234<br>2.797<br>56<br>0<br>0<br>634<br>589<br>0                                      | 1750<br>1760<br>1770<br>1780<br>1800<br>1810<br>1820<br>1821<br>1822<br>1823<br>1824<br>1825<br>1826<br>1830<br>1831<br>1832<br>1833<br>1834 | 59.32<br>59.05<br>44<br>57.4(<br>53.53<br>3.72<br>15   |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar  2. Obligaciones y otros valores negociables  2.1 Series no subordinadas  2.2 Series subordinadas  2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos  2.5 Ajustes por operaciones de cobertura  2.6 Intereses vencidos e impagados  3. Deudas con entidades de crédito  3.1 Préstamo subordinado  3.2 Crédito línea de liquidez  3.3 Otras deudas con entidades de crédito  3.4 Correciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  3.5 Intereses y gastos devengados no vencidos  | 0750  0760  0770  0780  0800  0810  0820  0821  0822  0823  0824  0825  0826  0830  0831  0832  0833  0834  0835   | 0<br>44.854<br>0<br>0<br>44.129<br>3<br>43.087<br>40.234<br>2.797<br>56<br>0<br>0<br>634<br>589<br>0<br>0                                 | 1750 1760 1770 1780 1800 1810 1820 1821 1822 1823 1824 1825 1826 1830 1831 1832 1833 1834 1835   | 59.08<br>4'<br>57.4(<br>53.53<br>3.72<br>18            |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar  2. Obligaciones y otros valores negociables  2.1 Series no subordinadas  2.2 Series subordinadas  2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos  2.5 Ajustes por operaciones de cobertura  2.6 Intereses vencidos e impagados  3. Deudas con entidades de crédito  3.1 Préstamo subordinado  3.2 Crédito línea de liquidez  3.3 Otras deudas con entidades de crédito  3.4 Correciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  3.5 Intereses y gastos devengados no vencidos  3.6 Ajustes por operaciones de cobertura  | 0750  0760  0770  0780  0800  0810  0820  0821  0822  0823  0824  0825  0826  0830  0831  0832  0831  0832  0833  0834  0835  0836                               | 0<br>44.854<br>0<br>0<br>44.129<br>3<br>43.087<br>40.234<br>2.797<br>56<br>0<br>0<br>0<br>634<br>589<br>0<br>0                            | 1750 1760 1770 1780 1800 1810 1820 1821 1822 1823 1824 1825 1826 1830 1831 1832 1833 1834 1835 1836  | 59.08<br>4'<br>57.4(<br>53.53<br>3.72<br>18            |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar  2. Obligaciones y otros valores negociables  2.1 Series no subordinadas  2.2 Series subordinadas  2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos  2.5 Ajustes por operaciones de cobertura  2.6 Intereses vencidos e impagados  3. Deudas con entidades de crédito  3.1 Préstamo subordinado  3.2 Crédito línea de liquidez  3.3 Otras deudas con entidades de crédito  3.4 Correciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  3.5 Intereses y gastos devengados no vencidos  3.6 Ajustes por operaciones de cobertura  3.7 Intereses vencidos e impagados  | 0750  0760  0770  0780  0800  0810  0820  0821  0822  0823  0824  0825  0826  0830  0831  0832  0831  0832  0833  0834  0835  0836  0837                         | 0<br>44.854<br>0<br>0<br>44.129<br>3<br>43.087<br>40.234<br>2.797<br>56<br>0<br>0<br>634<br>589<br>0<br>0                                 | 1750 1760 1770 1780 1800 1810 1820 1821 1822 1823 1824 1825 1826 1830 1831 1832 1833 1834 1835 1836 1837                                     | 59.08<br>4'<br>57.44<br>53.53<br>3.72<br>18            |
| III. Pasivos por impuesto diferido  3) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar  2. Obligaciones y otros valores negociables  2.1 Series no subordinadas  2.2 Series subordinadas  2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos  2.5 Ajustes por operaciones de cobertura  2.6 Intereses vencidos e impagados  3. Deudas con entidades de crédito  3.1 Préstamo subordinado  3.2 Crédito línea de liquidez  3.3 Otras deudas con entidades de crédito  3.4 Correciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  3.5 Intereses y gastos devengados no vencidos  3.6 Ajustes por operaciones de cobertura  3.7 Intereses vencidos e impagados  4. Derivados  | 0750  0760  0770  0780  0800  0810  0820  0821  0822  0823  0824  0825  0826  0830  0831  0832  0831  0832  0833  0834  0835  0836  0837                         | 0<br>44.854<br>0<br>0<br>44.129<br>3<br>43.087<br>40.234<br>2.797<br>56<br>0<br>0<br>634<br>589<br>0<br>0<br>45                           | 1750 1760 1770 1780 1800 1810 1820 1821 1822 1823 1824 1825 1826 1830 1831 1832 1833 1834 1835 1836 1837                                     | 59.03<br>4<br>57.44<br>53.53<br>3.73<br>11<br>93<br>86 |
| III. Pasivos por impuesto diferido  B) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar  2. Obligaciones y otros valores negociables  2.1 Series no subordinadas  2.2 Series subordinadas  2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos  2.5 Ajustes por operaciones de cobertura  2.6 Intereses vencidos e impagados  3. Deudas con entidades de crédito  3.1 Préstamo subordinado  3.2 Crédito línea de liquidez  3.3 Otras deudas con entidades de crédito  3.4 Correciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  3.5 Intereses y gastos devengados no vencidos  3.6 Ajustes por operaciones de cobertura  3.7 Intereses vencidos e impagados  4. Derivados  4.1 Derivados de cobertura  | 0750  0760  0770  0780  0800  0810  0820  0821  0822  0823  0824  0825  0826  0830  0831  0832  0831  0832  0833  0834  0835  0836  0837  0840                   | 0<br>44.854<br>0<br>0<br>44.129<br>3<br>3<br>43.087<br>40.234<br>2.797<br>56<br>0<br>0<br>0<br>634<br>589<br>0<br>0<br>0<br>45<br>0<br>45 | 1750 1760 1770 1780 1800 1810 1820 1821 1822 1823 1824 1825 1826 1830 1831 1832 1833 1834 1835 1836 1837 1840                                | 59.32<br>59.03<br>44<br>57.44<br>53.53<br>3.72<br>18   |
| III. Pasivos por impuesto diferido  3) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar  2. Obligaciones y otros valores negociables  2.1 Series no subordinadas  2.2 Series subordinadas  2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos  2.5 Ajustes por operaciones de cobertura  2.6 Intereses vencidos e impagados  3. Deudas con entidades de crédito  3.1 Préstamo subordinado  3.2 Crédito línea de liquidez  3.3 Otras deudas con entidades de crédito  3.4 Correciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  3.5 Intereses y gastos devengados no vencidos  3.6 Ajustes por operaciones de cobertura  3.7 Intereses vencidos e impagados  4. Derivados  4.1 Derivados de cobertura  4.2 Derivados de negociación  | 0750  0760  0770  0780  0800  0810  0820  0821  0822  0823  0824  0825  0826  0830  0831  0832  0831  0832  0833  0834  0835  0836  0837  0840  0841             | 0<br>44.854<br>0<br>0<br>44.129<br>3<br>3<br>43.087<br>40.234<br>2.797<br>56<br>0<br>0<br>0<br>634<br>589<br>0<br>0<br>0<br>45<br>0<br>45 | 1750 1760 1770 1780 1800 1810 1820 1821 1822 1823 1824 1825 1826 1830 1831 1832 1833 1834 1835 1836 1837 1840 1841 1842                      | 59.08<br>4'<br>57.44<br>53.53<br>3.72<br>18            |
| III. Pasivos por impuesto diferido  3) PASIVO CORRIENTE  IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta  V. Provisiones a corto plazo  VI. Pasivos financieros a corto plazo  1. Acreedores y otras cuentas a pagar  2. Obligaciones y otros valores negociables  2.1 Series no subordinadas  2.2 Series subordinadas  2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos  2.5 Ajustes por operaciones de cobertura  2.6 Intereses vencidos e impagados  3. Deudas con entidades de crédito  3.1 Préstamo subordinado  3.2 Crédito línea de liquidez  3.3 Otras deudas con entidades de crédito  3.4 Correciones de valor por repercusión de pérdidas (-)  3.5 Intereses y gastos devengados no vencidos  3.6 Ajustes por operaciones de cobertura  3.7 Intereses vencidos e impagados  4. Derivados  4.1 Derivados de cobertura  4.2 Derivados de negociación  4.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0750  0760  0770  0780  0800  0810  0820  0821  0822  0823  0824  0825  0826  0830  0831  0832  0831  0832  0833  0834  0835  0836  0837  0840  0841  0842  0843 | 0<br>44.854<br>0<br>0<br>44.129<br>3<br>3<br>43.087<br>40.234<br>2.797<br>56<br>0<br>0<br>634<br>589<br>0<br>0<br>45<br>0<br>45<br>0      | 1750 1760 1770 1780 1800 1810 1820 1821 1822 1823 1824 1825 1826 1830 1831 1832 1833 1834 1835 1836 1837 1840 1841 1842 1843                 | 59.32<br>59.05<br>441<br>57.40<br>53.53<br>3.72<br>15  |

| VII. Ajustes por periodificación                                    | 0900 | 725     | 1900 | 275     |
|---|------|---------|------|---------|
| 1. Comisiones   | 0910 | 719     | 1910 | 269     |
| 1.1 Comisión sociedad gestora                                       | 0911 | 19      | 1911 | 20      |
| 1.2 Comisión administrador  | 0912 | 639     | 1912 | 629     |
| 1.3 Comisión agente financiero/pagos                                | 0913 | 4       | 1913 | 4       |
| 1.4 Comisión variable - resultados realizados                       | 0914 | 1.602   | 1914 | 1.602   |
| 1.5 Comisión variable - resultados no realizados                    | 0915 | 0       | 1915 | 0       |
| 1.6 Otras comisiones del cedente                                    | 0916 | 0       | 1916 | 0       |
| 1.7 Correciones de valor por repercusión de pérdidas (-)            | 0917 | -1.545  | 1917 | -1.986  |
| 1.8 Otras comisiones  | 0918 | 0       | 1918 | 0       |
| 2. Otros  | 0920 | 6       | 1920 | 6       |
| C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS | 0930 | -7.681  | 1930 | -6.581  |
| VIII. Activos financieros disponibles para la venta                 | 0940 | 0       | 1940 | 0       |
| IX. Coberturas de flujos de efectivo                                | 0950 | -7.681  | 1950 | -6.581  |
| X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos           | 0960 | 0       | 1960 | 0       |
| XI. Gastos de constitución en transición                            | 0970 |         | 1970 |         |
| TOTAL PASIVO  | 1000 | 450.203 | 2000 | 465.639 |



Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No** Periodo: **1er Trimestre** Ejercicio: **2016** 

| 0<br>0<br>0<br>0<br>0 |
|-----------------------|
| 0 0 0 0 0 0 0         |
| 0 0 0 0 0 0 0         |
| 0 0 0 0 0 0           |
| 0 0 0 0 0             |
| 0 0 0 0 0             |
| 0 0 0 0 0             |
| 0 0 0 0 0             |
| 0 0 0 0 0             |
| 0 0 0 0 0             |
| 0<br>0<br>0<br>0      |
| 0<br>0<br>0           |
| 0                     |
| 0                     |
| 0                     |
|                       |
| 0                     |
|                       |
|                       |
|                       |
|                       |
|                       |
|                       |
|                       |
|                       |
|                       |
|                       |
|                       |
|                       |
|                       |
|                       |
|                       |
|                       |
| 0                     |
| 0                     |
| 0                     |
| 0                     |
| 0                     |
| 0                     |
| 0                     |
| 0                     |
| 0                     |
| 0                     |
| 0                     |
|                       |



Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No** Periodo: **1er Trimestre** Ejercicio: **2016** 

| 1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones   | ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)   |      | Periodo Actual<br>31/03/2016 |      | Mismo Periodo año<br>Anterior 31/03/2015 |
|--|---|------|------------------------------|------|--|
| 1.1 Intercesc acchardes de los activos truitades   8110  | A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN                              | 8000 | -227                         | 9000 | 0  |
| 1.2 Intereses pagades por valores de titulización 1.3 Chóres/pagis netidos por operaciones de derivados 1.4 Intereses cobradado de inveniones financieros 1.5 Intereses pagades por préstamos y civilidos en entidades de crédito 1.5 Intereses pagades por préstamos y criditos en entidades de crédito 1.6 Otros intereses cobradado de inveniones financieros 1.6 Otros intereses cobradado de inveniones financieros 1.6 Otros intereses cobradado de inveniones financieros 2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo 2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo 2.1 Comisiones pagadas a la societad gestora 2.2 Comisiones pagadas a la societad gestora 2.3 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados 2.3 Comisiones pagadas en administración de activos titulizados 2.4 Comisiones variables pagadas 2.5 Otras comisiones 2.5 Otras comisiones 2.6 Otras comisiones 2.7 Otras fulgos de caja provenientes de operaciones del Fondo 2.8 3.0 Unidado de caja provenientes de operaciones del Fondo 3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos 3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos 3.2 Pagos de provisiones 3.2 Degos de provisiones 3.3 Cobres procedentes de la enajeración de activos no corrientes mantenidos para la venta 3.3 Otros procedentes de la enajeración de activos no corrientes mantenidos para la venta 4.1 Cobres por permisión de valores de titulización 4.1 Cobres por emisión de valores de titulización 4.2 Pagos por emisión de valores de titulización (seguramiento colocación) 4.2 Pagos por emisión de valores de titulización (seguramiento colocación) 5.4 Pagos por emisión de valores de titulización (seguramiento colocación) 5.5 Pagos por aminidado evidos de caja de fondo 5.6 Cobres por anoritización de otros activos titulización (seguramiento colocación) 5.6 Otros por por andipitación de derechos de crédito 5.7 Depos por anoritización de otros activos titulización 6.8 Otros por anoritización de otros activos titulización 6.1 Cobres por anoritiza | 1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones  | 8100 | -170                         | 9100 | 0  |
| 1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados 1.4 Intereses cubrados de irreversiones financieras 8.140 0 9140 ( 1.5 Intereses pagados por prefatamos y crédicto en entidades de crédito 1.5 Intereses pagados por prefatamos y créditos en entidades de crédito 1.5 Cros intereses cobrados/pagados (neto)  2. Comisiones pagados a la sociedad gestora 2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora 2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados 2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados 2.2 Comisiones pagadas a la sociedad gestora 2.2 Comisiones pagadas a per administración de activos titulizados 2.2 Comisiones pagadas a per administración de activos titulizados 2.2 Comisiones variables pagadas 2.5 Otras comisiones 2.5 Otras comisiones 2.5 Otras comisiones variables pagadas 2.5 Otras pagadas por administración de activos notariables pagadas 2.5 Otras pagadas por administración de variables de titulización 2.5 Plujos de caja provisiones variables pagadas 2.5 Otras para para administración de variables pagadas 2.5 Otras para para administración de variables paga | 1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados   | 8110 | 467                          | 9110 | 0  |
| 1. A Interesses cobrados de inversiones financieras   1.5 Interesses pagados por préstamos y créditos en entidades de crédito   1.5 Interesses pagados por préstamos y créditos en entidades de crédito   1.6 Otros interoses cobrados-gapados (neto)   1.6 Otros interoses cobrados-gapados por del produce   1.5 Otros interoses cobrados-gapados por deministración de activos titulizados   1.5 Otros interoses pagados por deministración de activos titulizados   1.5 Otros interoses variables pagadas   1.5 Otros comisiones pagadas al agente financiero   1.5 Otros comisiones pagadas al agente financiero   1.5 Otros interoses variables pagadas   1.5 Otros interoses de interior variables   1.5 Otros interoses de interior variables   1.5 Otros interior variables   1.5    | 1.2 Intereses pagados por valores de titulización   | 8120 | -179                         | 9120 |  |
| 1.5 Interesses pagados por préstamos y créditos en entidades de crédito 1.0 Otros interesses cobrados/pagados (neto) 2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo 2. Comisiones pagados a la sociedad gestora 2.1 Comisiones pagados por servicios financieros pagados por el Fondo 2.2 Comisiones pagados a la sociedad gestora 2.2 Comisiones pagados a la sociedad gestora 2.2 Comisiones pagados a pagente financiero 2.230 9220 2.2 Comisiones pagados a gapente financiero 2.230 9230 2.4 Comisiones pagados al gapente financiero 2.5 Otras comisiones pagados al gapente financiero 2.5 Otras comisiones variables pagadas 2.5 Otras comisiones variables pagadas 2.5 Otras comisiones variables pagados 2.5 Otras comisiones variables pagados 3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos 3.2 Pagos de provisiones 3.2 Pagos de provisiones 3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 3.2 Otros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 3.2 Pagos de provisiones 3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 3.2 Pagos de provisiones 3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 3.2 Pagos de provisiones 3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 3.2 Pagos de recentro de valores de titulización 3.4 Palujos de caja netos por emisión de valores de titulización 4.1 Cobros por emisión de valores de titulización 4.1 Cobros por emisión de valores de titulización 4.2 Pagos por adquisición de decrebos de crédito 5.1 Pagos por adquisición de decrebos de crédito 5.1 Pagos por adquisición de decrebos de crédito 5.1 Pagos por adquisición de decrebos de crédito 6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito 6.2 Cobros por amortización de prétamos o organización de servicions 7.2 Cobros por amortización de prétamos o organización de prétamos o organización de prétamos o organización de prétamos organ | 1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados   | 8130 | -319                         | 9130 | 0  |
| 1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)   8160   0   9160  | 1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras   | 8140 | 0                            | 9140 | 0  |
| 2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo         8200         .28 9200           2.1 Comisiones pagados a la sociedad gestora         8210         .23 9210           2.2 Comisiones pagados a la sociedad gestora         8220         .9220           2.2 Comisiones pagados por administración de activos titulizados         8220         .9220           2.4 Comisiones variables pagadas         8240         .9240           2.5 Otras comisiones         9250         .9250           3. Otros filujos de caja provenientes de operaciones del Fondo         8300         .29 9300         .9250           3.1 Recuperaciones de falidos y otros activos adquiridos         8310         .0 9310         .9310         .9310         .9320           3.2 Otros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta         8320         .9325         .9325         .9325         .0 9325   | 1.5 Intereses pagados por préstamos y créditos en entidades de crédito                        | 8150 | -139                         | 9150 |  |
| 2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora 2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados 2.3 Comisiones pagadas a ganete financiero 2.3 Comisiones pagadas a ganete financiero 2.4 Comisiones variables pagadas 2.5 Otras comisiones variables pagadas 2.5 Otras comisiones 3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos 3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos 3.2 Pagos de provisiones 3.3 Cobras procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 3.3 Cobras procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 3.4 Otros 3.4 Otros 3.7 Pagos procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 3.8 S330 3.3 Cobras procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 3.4 Otros 4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización 4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización 4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización 4. Pagos por emisión de valores de titulización 4. Pagos por emisión de valores de titulización (aseguramiento colocación) 4. Pagos por adquisición de derechos de crédito 5. Pagos por adquisición de derechos de crédito 8. S600 5. Pagos por adquisición de derechos de crédito 8. S600 5. Pagos por adquisición de derechos de crédito 8. S600 6. 1 Cobros por amortización de derechos de crédito 8. S600 7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo 7. Cobros por amortización de valores de tirulización 8. S700 7. Cobros por amortización de valores de reditos 8. S700 7. Cobros por amortización de valores de reditos 8. S700 7. Cobros por amortización de valores de reditos 8. S700 7. Cobros por amortización de valores de reditos 8. S700 9. S700 9. Gobre por amortización de valores de reditos 9. S700 9. Gobre por amor | 1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)   | 8160 | 0                            | 9160 | 0  |
| 2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados 2.3 Comisiones pagadas al agente financiero 2.4 Comisiones variables pagadas 2.5 Otras comisiones variables pagadas 2.5 Otras comisiones 2.5 Otras comisiones 2.5 Otras comisiones 2.5 Otras comisiones 2.6 Otras comisiones de fallidos y otros activos adquiridos 3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos 3.2 Pagos de provisiones 3.2 Cebros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 3.2 Otros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 3.3 Cebros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 3.4 Otros  2.5 IFLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION 3.5 PLUJOS DE GERECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION 3.6 FILUJOS DE GERECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION 3.7 PAGO DE GERECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION 3.8 JUNIO DE GERECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION 3. JUNIO DE GERECTIVO DE GERECTIVO DE GERECTIVO DE GENUVALENTES 3. JUNIO DE GERECTIVO DE GUIVALENTES 3. JUNIO DE SUDO DE GERECTIVO DE GUIVALENTES 3. JUNIO DE GERECTIVO DE GUIVALENTES 3.  | 2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo                         | 8200 | -28                          | 9200 |  |
| 2.3 Comisiones pagadas al agente financiero 2.4 Comisiones variables pagadas 2.5 Otras comisiones 8250 9250  3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo 3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos 3.2 Pagos de provisiones 3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 8325 3.4 Otros  8310 0 9320 3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 8325 0 9320 3.4 Otros  8520 9320 3.5 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 8325 0 9320 3.4 Otros  8510 4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización 4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización 4. Plujos de caja netos por emisión de valores de titulización 4. Plujos de caja por adquisición de activos financieros 8500 9500 5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros 8500 9500 5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros 8500 9500 5. Flujos de caja netos por amortización de derechos de crédito 8510 8520 6. Flujos de caja netos por amortización de derechos de crédito 8510 8520 6. Flujos de caja netos por amortización de derechos de crédito 8600 -3.704 8600 -3.704 9600  7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo 8700 -7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo 8700 -7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo 8700 -7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo 8700 -7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo 8700 -7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo 8700 -7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo 8700 -7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo 8700 -7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo 8700 -7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo 8700 -7. Otros flujos provenientes de oper | 2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora  | 8210 | -23                          | 9210 |  |
| 2.4 Comisiones variables pagadas 2.5 Otras comisiones 8.250  3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo 8.300 2.9 9300 3.1 Recuperaciones del fallidos y otros activos adquiridos 8.310 0.9310 3.2 Pagos de provisiones 3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 8.320 3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 8.325 0.9 9325 3.4 Otros  B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION 8.350 4.882 9.350  4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización 8.400 0.9 440 0.9 4410 0.4 1. Cobros por emisión de valores de titulización 8.410 0.9 4410 0.9 4410 0.9 4410 0.9 4420  5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros 8.500 5. 1 Pagos por adquisición de derechos de crédito 8.510 9.510 5. Pagos por adquisición de derechos de crédito 8.510 9.520  6. Flujos de caja netos por amortizaciones financieras 8.520  6. Flujos de caja netos por amortización de otros inversiones financieras 8.520  6. Flujos de caja por adquisición de derechos de crédito 8.510 9.520  6. Flujos de caja por adquisición de derechos de crédito 8.510 9.520  6. Flujos de caja por adquisición de otros inversiones financieras 8.520  6. Flujos de caja por adquisición de otros activos titulización 8.600 3.704 9.600  6. 1. Cobros por amortización de otros activos titulización 8.600 3.704 9.600  7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo 7. 1. Cobros por concesiones de préstamos o créditos 8.700 7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo 7. 3. Cobros derechos de créditos 9.740 9.75 Otros deudores y acreadores 8.750 9.76 Cobros por amortización eventa de inversiones financieras 8.770 9.76 Cobros por amortización eventa de inversiones financieras 8.770 9.77 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso 8.76 Cobros por amortización eventa de inversiones financieras 8.770 9.77 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso 9.7800 9.7800 9.7900 9.7900 9.7900 9.7900 9.7900 9.7900 9.7900 9 | 2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados                              | 8220 |                              | 9220 |  |
| 2.5 Otras comisiones         8250         9250           3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo         8300         -29         9300         0           3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos         8310         0         9310         320         9320         9320         9320         9320         9320         9320         9320         9320         9325         0         9325         0         9325         0         9325         0         9325         0         9325         0         9325         0         9325         0         9325         0         9325         0         9325         0         9325         0         9325         0         9325         0         9325         0         9325         0         9325         0         0         9400         0         4         9300         0         0         9400         0         9400         0         9400         0         9400         0         9400         0         9400         0         9400         0         9400         0         9400         0         9400         0         9400         0         9400         0         9400         0         9400         0  | 2.3 Comisiones pagadas al agente financiero   | 8230 | -5                           | 9230 |  |
| 3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo 3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos 3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos 3.2 Pagos de provisiones 3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos financieros 4.1 Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización 4.1 Cobros por emisión de valores de titulización 8400 0 9400 0 4.1 Cobros por emisión de valores de titulización 8420 9420  5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros 8500 9500 5. 1 Pagos por adquisición de activos financieros 8500 9500 6. 1 Pagos por adquisición de derechos de crédito 8510 9510 5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras 8520 9520  6. Flujos de caja netos por amortizaciones 8600 3.704 9600 0 6. 1 Cobros por amortización de otros activos titulización 8610 10.523 9610 0 6. 2 Cobros por amortización de valores de titulización 8630 -14.227 9630  7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo 8700 -1.178 9700 0 7. 1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos 870 0 9710 0 7. 2 Pagos por amortización de préstamos o disposiciones de créditos 870 0 9770 0 7. 3 Cobros deudores y acreedores 8750 0 9750 0 7. 7. Cobros deudores y acreedores 8750 0 9770 0 7. 7. Cobros deudores y acreedores 8750 0 9770 0 7. 7. Cobros deudores y acreedores 8750 0 9770 0 7. 7. Cobros deudores y acreedores 8750 0 9770 0 7. 7. Cobros deudores y acreedores 8750 0 9770 0 7. 7. Cobros deudores y acreedores 8750 0 9770 0 7. 7. Cobros deudores y acreedores 8750 0 9770 0 7. 7. Cobros deudores y acreedores 8750 0 9770 0 7. 7. Cobros deudores y acreedores 8750 0 9770 0 7. 7. Cobros de Subvenciones  | 2.4 Comisiones variables pagadas  | 8240 |                              | 9240 |  |
| 3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos   3.2 Pagos de provisiones   33.0   93.20    | 2.5 Otras comisiones  | 8250 |                              | 9250 |  |
| 3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos   3.2 Pagos de provisiones   3.2 Pagos de provisiones   3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta   33.5   0.9325   0.9325   0.34 Otros   0.9326   0.9325   0.34 Otros   0.9326   0.9325   0.9325   0.34 Otros   0.9326   0.9325      | 3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo                                 | 8300 | -29                          | 9300 | 0  |
| 3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta 3.4 Otros  8330 -29 9330  (B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION  8350 -4.882 9350  (4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización  4.1 Cobros por emisión de valores de titulización  4.1 Cobros por emisión de valores de titulización  8400 0 9400  (4. Pagos por emisión de valores de titulización  8420 9420  5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros  8500 9500  5. 1 Pagos por adquisición de derechos de crédito  8510 9510  6. Flujos de caja netos por adquisición de otras inversiones financieras  8520 9620  6. Flujos de caja netos por adquisición de derechos de crédito  8510 9600  6. Flujos de caja netos por adquisición de derechos de crédito  8510 9600  6. Flujos de caja netos por adquisición de derechos de crédito  8610 10.523 9610  6. Cobros por amortización de derechos de crédito  8620 0 9620  6. 3 Pagos por amortización de valores de titulización  7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo  7. 1 Cobros por concesiones del préstamos o disposiciones de créditos  7. 2 Pagos por amortización de préstamos o créditos  8710 0 9710  7. 2 Pagos por amortización de préstamos o créditos  8720 -1.178 9700  7. 4 Administraciones públicas - Pasivo  7. 4 Administraciones públicas - Pasivo  7. 5 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso  7. 6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras  8770 0 9770  (C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES  8800 5-5.109 9800  Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo   |   | 8310 | 0                            | 9310 | 0  |
| B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION   8350   | l '   | 8320 |                              | 9320 |  |
| B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION   8350   | 3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta    | 8325 | 0                            | 9325 | 0  |
| 4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización         8400         0         9400         0           4.1 Cobros por emisión de valores de titulización         8410         0         9410         0           4.2 Pagos por emisión de valores de titulización (aseguramiento colocación)         8420         9420         9420           5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros         8500         9500         9500           5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito         8510         9510         9510           5.2 Pagos por adquisición de derechos de crédito         8520         9520           6. Flujos de caja netos por amortización de otras inversiones financieras         8600         -3.704         9600           6. Flujos de caja netos por amortización de derechos de crédito         8610         10.523         9610         0           6. Flujos de caja petos por amortización de valores de crédito         8610         10.523         9610         0           6. Flujos de caja por amortización de valores de titulización         8610         10.523         9610         0           6. Flujos de caja por amortización de valores de titulización         8610         10.523         9610         0           6. Flujos de caja por amortización de valores de titulización         8620         0         9620   | l · · · · · · · · · · · · · · · · · · ·   |      |                              |      | 0  |
| 4.1 Cobros por emisión de valores de titulización (aseguramiento colocación)  8410 0 9410 0 9410 0 9420  5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros 8500 9500 5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito 8510 9510 9520  6. Flujos de caja netos por adquisición de otras inversiones financieras 8520 9520  6. Flujos de caja netos por amortizaciones 8600 3.704 9600 0 9500 9520  6. Flujos de caja netos por amortizaciones 8600 3.704 9600 0 9520 9520  6. Flujos de caja netos por amortizaciones 8600 3.704 9600 0 9520 9520 9520  7. Otros por amortización de derechos de crédito 8610 10.523 9610 0 9620 0 9 | B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION                       | 8350 | -4.882                       | 9350 | 0  |
| 4.2 Pagos por emisión de valores de titulización (aseguramiento colocación)         8420         9420           5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros         8500         9500           5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito         8510         9510           5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras         8520         9520           6. Flujos de caja netos por amortización de otras inversiones financieras         8600         -3.704         9600         0           6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito         8610         10.523         9610         0           6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados         8620         0         9620         0           6.3 Pagos por amortización de valores de titulización         8630         -14.227         9630           7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo         8700         -1.178         9700         0           7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos         8710         0         9710         0           7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos         8720         -1.178         9720         0           7.3 Cobros de recebos de crédito pendientes ingreso         8730         0         9730         0           7.4 Administraciones públicas - Pasivo   | 4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización                                | 8400 | 0                            | 9400 | 0  |
| 5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros         8500         9500           5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito         8510         9510           5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras         8520         9520           6. Flujos de caja netos por amortizaciones         8600         -3.704         9600           6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito         8610         10.523         9610         0           6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados         8620         0         9620         0           6.3 Pagos por amortización de valores de titulización         8630         -14.227         9630           7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo         8700         -1.178         9700           7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos         8710         0         9710         0           7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos         8720         -1.178         9720         0           7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso         8730         0         9730         0           7.4 Administraciones públicas - Pasivo         8740         0         9740         0           7.5 Otros deudores y acreedores         8750         0         9750         0  | 4.1 Cobros por emisión de valores de titulización   | 8410 | 0                            | 9410 | 0  |
| 5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito       8510       9510         5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras       8520       9520         6. Flujos de caja netos por amortizaciones       8600       -3.704       9600       0         6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito       8610       10.523       9610       0         6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados       8620       0       9620       0         6.3 Pagos por amortización de valores de titulización       8630       -14.227       9630         7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo       8700       -1.178       9700       0         7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos       8710       0       9710       0         7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos       8720       -1.178       9720       0         7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso       8730       0       9730       0         7.4 Administraciones públicas - Pasivo       8740       0       9740       0         7.5 Otros deudores y acreedores       8750       0       9750       0         7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras       8770       0       9770       0  | 4.2 Pagos por emisión de valores de titulización (aseguramiento colocación)                   | 8420 |                              | 9420 |  |
| 5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito       8510       9510         5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras       8520       9520         6. Flujos de caja netos por amortizaciones       8600       -3.704       9600       0         6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito       8610       10.523       9610       0         6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados       8620       0       9620       0         6.3 Pagos por amortización de valores de titulización       8630       -14.227       9630         7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo       8700       -1.178       9700       0         7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos       8710       0       9710       0         7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos       8720       -1.178       9720       0         7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso       8730       0       9730       0         7.4 Administraciones públicas - Pasivo       8740       0       9740       0         7.5 Otros deudores y acreedores       8750       0       9750       0         7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras       8770       0       9770       0  | 5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros                                      | 8500 |                              | 9500 |  |
| 5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras       8520       9520         6. Flujos de caja netos por amortizaciones       8600       -3.704       9600       0         6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito       8610       10.523       9610       0         6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados       8620       0       9620       0         6.3 Pagos por amortización de valores de titulización       8630       -14.227       9630         7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo       8700       -1.178       9700       0         7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos       8710       0       9710       0         7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos       8720       -1.178       9720       0         7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso       8730       0       9730       0         7.4 Administraciones públicas - Pasivo       8740       0       9740       0         7.5 Otros deudores y acreedores       8750       0       9750       0         7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras       8770       0       9770       0         7.7 Cobros de Subvenciones       8780       0       9780       0 <tr< td=""><td></td><td>8510</td><td></td><td>9510</td><td></td></tr<>   |   | 8510 |                              | 9510 |  |
| 6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito 6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados 6.3 Pagos por amortización de valores de titulización  7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo 7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos 7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos 8720 7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso 8730 0 9730 0 9740 0 9740 0 9750 0 9750 0 9750 0 977 | 1   |      |                              |      |  |
| 6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados 6.3 Pagos por amortización de valores de titulización  7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo 7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos 7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos 8720 7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso 8730 0 9730 0 9740 7.5 Otros deudores y acreedores 8750 0 9750 0 9750 0 9760 0 9770 0 9770 0 9770 0 9770 0 9780  C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES 8800 0 9800 0 9820 0 9620 0 9620 0 9620 0 9620 0 9620 0 9620 0 9620 0 9620 0 9620 0 9760 0 9710 0 9710 0 9770 0 | 6. Flujos de caja netos por amortizaciones  | 8600 | -3.704                       | 9600 | 0  |
| 6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados       8620       0 9620       0         6.3 Pagos por amortización de valores de titulización       8630       -14.227       9630         7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo       8700       -1.178       9700       0         7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos       8710       0 9710       0         7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos       8720       -1.178       9720         7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso       8730       0 9730       0         7.4 Administraciones públicas - Pasivo       8740       0 9740       0         7.5 Otros deudores y acreedores       8750       0 9750       0         7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras       8770       0 9770       0         7.7 Cobros de Subvenciones       8780       0 9780       0         C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES       8800       -5.109       9800         Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo       8900       24.989       9900       0  | 6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito  | 8610 | 10.523                       | 9610 | 0  |
| 6.3 Pagos por amortización de valores de titulización         8630         -14.227         9630           7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo         8700         -1.178         9700         0           7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos         8710         0         9710         0           7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos         8720         -1.178         9720           7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso         8730         0         9730         0           7.4 Administraciones públicas - Pasivo         8740         0         9740         0           7.5 Otros deudores y acreedores         8750         0         9750         0           7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras         8770         0         9770         0           7.7 Cobros de Subvenciones         8780         0         9780         0           C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES         8800         -5.109         9800         0           Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo         8900         24.989         9900         0   | · ·   | 8620 | 0                            | 9620 | 0  |
| 7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos       8710       0       9710       0         7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos       8720       -1.178       9720         7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso       8730       0       9730       0         7.4 Administraciones públicas - Pasivo       8740       0       9740       0         7.5 Otros deudores y acreedores       8750       0       9750       0         7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras       8770       0       9770       0         7.7 Cobros de Subvenciones       8780       0       9780       0         C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES       8800       -5.109       9800       0         Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo       8900       24.989       9900       0  | · ·   | 8630 | -14.227                      | 9630 |  |
| 7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos       8710       0       9710       0         7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos       8720       -1.178       9720         7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso       8730       0       9730       0         7.4 Administraciones públicas - Pasivo       8740       0       9740       0         7.5 Otros deudores y acreedores       8750       0       9750       0         7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras       8770       0       9770       0         7.7 Cobros de Subvenciones       8780       0       9780       0         C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES       8800       -5.109       9800       0         Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo       8900       24.989       9900       0  | 7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo   | 8700 | -1.178                       | 9700 | 0  |
| 7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos       8720       -1.178       9720         7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso       8730       0       9730       0         7.4 Administraciones públicas - Pasivo       8740       0       9740       0         7.5 Otros deudores y acreedores       8750       0       9750       0         7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras       8770       0       9770       0         7.7 Cobros de Subvenciones       8780       0       9780       0         C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES       8800       -5.109       9800       0         Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo       8900       24.989       9900       0  | · · ·   |      |                              |      | 0  |
| 7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso       8730       0 9730       0         7.4 Administraciones públicas - Pasivo       8740       0 9740       0         7.5 Otros deudores y acreedores       8750       0 9750       0         7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras       8770       0 9770       0         7.7 Cobros de Subvenciones       8780       0 9780       0         C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES       8800       -5.109       9800       0         Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo       8900       24.989       9900       0  | l ' '   |      | -                            |      |  |
| 7.4 Administraciones públicas - Pasivo       8740       0       9740       0         7.5 Otros deudores y acreedores       8750       0       9750       0         7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras       8770       0       9770       0         7.7 Cobros de Subvenciones       8780       0       9780       0         C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES       8800       -5.109       9800       0         Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo       8900       24.989       9900       0  |   |      | l .                          |      | 0  |
| 7.5 Otros deudores y acreedores       8750       0 9750       0         7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras       8770       0 9770       0         7.7 Cobros de Subvenciones       8780       0 9780       0         C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES       8800       -5.109       9800       0         Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo       8900       24.989       9900       0   | l · · · · · · · · · · · · · · · · · · ·   |      |                              |      | 0  |
| 7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras       8770       0       9770       0         7.7 Cobros de Subvenciones       8780       0       9780       0         C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES       8800       -5.109       9800       0         Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo       8900       24.989       9900       0   | 1   |      | -                            |      | 0  |
| 7.7 Cobros de Subvenciones         8780         0         9780         0           C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES         8800         -5.109         9800         0           Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo         8900         24.989         9900         0  | 1   |      | l .                          |      | 0  |
| Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo 8900 24.989 9900 (   | · ·   |      |                              |      | 0  |
| Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo 8900 24.989 9900 (   | C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES                                  | 8800 | -5.109                       | 9800 | 0  |
|  |   | 8900 | 24 090                       | ggnn | 0  |
| I Efective a equivalentee of final del periodo   | Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo  Efectivo o equivalentes al final del periodo | 8990 | 19.880                       | 9990 | 0  |



Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No Periodo: 1er Trimestre Ejercicio: 2016

| INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)   |      | Periodo Actual<br>31/03/2016 |      | Mismo Periodo<br>año Anterior<br>31/03/2015 |
|--|------|------------------------------|------|---|
|  |      |                              |      |   |
| 1 Activos financieros disponibles para la venta  |      |                              |      |   |
| 1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración  | 6010 | 0                            | 7010 | 0   |
| 1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración   | 6020 | 0                            | 7020 | 0   |
| 1.1.2 Efecto fiscal  | 6021 | 0                            | 7021 | 0   |
| 1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias  | 6022 | 0                            | 7022 | 0   |
| 1.3 Otras reclasificaciones  | 6030 | 0                            | 7030 | 0   |
| 1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo  | 6040 | 0                            | 7040 | 0   |
| Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta                          | 6100 | 0                            | 7100 | 0   |
| 2 Cobertura de los flujos de efectivo  |      |                              |      |   |
| 2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración  | 6110 | -1.527                       | 7110 | 0   |
| 2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración   | 6120 | -1.527                       | 7120 | 0   |
| 2.1.2 Efecto fiscal  | 6121 | o                            | 7121 | 0   |
| 2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias  | 6122 | 427                          | 7122 | 0   |
| 2.3 Otras reclasificaciones  | 6130 | 0                            | 7130 | 0   |
| 2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo  | 6140 | 1.100                        | 7140 | 0   |
| Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables   | 6200 | 0                            | 7200 | 0   |
| 3 Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos   |      |                              |      |   |
| 3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directemente en el balance en el periodo | 6310 | 0                            | 7310 | 0   |
| 3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración   | 6320 | l ol                         | 7320 | i 0   |
| 3.1.2 Efecto fiscal  | 6321 | o                            | 7321 | 0   |
| 3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias  | 6322 | 0                            | 7322 | 0   |
| 3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo  | 6330 | 0                            | 7330 | 0   |
| Total Ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias   | 6400 | 0                            | 7400 | 0   |
| TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)   | 6500 | 0                            | 7500 | 0   |

S.04



S.05.1

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No Periodo: 1er Trimestre Ejercicio: 2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BARCLAYS BANK, S.A.

### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

| CUADRO A                                | :         | Situación actual 31/03/2016            |      |         |            | ón cierre anua | al anterior 31 | 12/2015      | Situación inicial 30/11/2006 |            |                         |           |  |
|---|-----------|--|------|---------|------------|----------------|----------------|--------------|------------------------------|------------|-------------------------|-----------|--|
| Tipología de activos titulizados        | Nº de act | Nº de activos vivos Principal pendient |      |         | Nº de acti | vos vivos      | Principal po   | endiente (1) | Nº de act                    | ivos vivos | Principal pendiente (1) |           |  |
| Participaciones hipotecarias            | 0001      |  | 0030 | 432.191 | 0060       | 4.530          | 0090           | 442.714      | 0120                         | 6.267      | 0150                    | 1.000.000 |  |
| Certificados de transmisión hipotecaria | 0002      |  | 0031 |         | 0061       |                | 0091           |              | 0121                         |            | 0151                    |           |  |
| Préstamos hipotecarios                  | 0003      |  | 0032 |         | 0062       |                | 0092           |              | 0122                         |            | 0152                    |           |  |
| Cédulas hipotecarias                    | 0004      |  | 0033 |         | 0063       |                | 0093           |              | 0123                         |            | 0153                    |           |  |
| Préstamos a promotores                  | 0005      |  | 0034 |         | 0064       |                | 0094           |              | 0124                         |            | 0154                    |           |  |
| Préstamos a PYMES                       | 0007      |  | 0036 |         | 0066       |                | 0096           |              | 0126                         |            | 0156                    |           |  |
| Préstamos a empresas                    | 8000      |  | 0037 |         | 0067       |                | 0097           |              | 0127                         |            | 0157                    |           |  |
| Préstamos Corporativos                  | 0009      |  | 0038 |         | 0068       |                | 0098           |              | 0128                         |            | 0158                    |           |  |
| Cédulas territoriales                   | 0010      |  | 0039 |         | 0069       |                | 0099           |              | 0129                         |            | 0159                    |           |  |
| Bonos de tesorería                      | 0011      |  | 0040 |         | 0070       |                | 0100           |              | 0130                         |            | 0160                    |           |  |
| Deuda subordinada                       | 0012      |  | 0041 |         | 0071       |                | 0101           |              | 0131                         |            | 0161                    |           |  |
| Créditos AAPP                           | 0013      |  | 0042 |         | 0072       |                | 0102           |              | 0132                         |            | 0162                    |           |  |
| Préstamos consumo                       | 0014      |  | 0043 |         | 0073       |                | 0103           |              | 0133                         |            | 0163                    |           |  |
| Préstamos automoción                    | 0015      |  | 0044 |         | 0074       |                | 0104           |              | 0134                         |            | 0164                    |           |  |
| Arrendamiento financiero                | 0016      |  | 0045 |         | 0075       |                | 0105           |              | 0135                         |            | 0165                    |           |  |
| Cuentas a cobrar                        | 0017      |  | 0046 |         | 0076       |                | 0106           |              | 0136                         |            | 0166                    |           |  |
| Derechos de crédito futuros             | 0018      |  | 0047 |         | 0077       |                | 0107           |              | 0137                         |            | 0167                    |           |  |
| Bonos de titulización                   | 0019      |  | 0048 |         | 0078       |                | 0108           |              | 0138                         |            | 0168                    |           |  |
| Otros                                   | 0020      |  | 0049 |         | 0079       |                | 0109           |              | 0139                         |            | 0169                    |           |  |
| Total                                   | 0021      | 4.471                                  | 0050 | 432.191 | 0080       | 4.530          | 0110           | 442.714      | 0140                         | 6.267      | 0170                    | 1.000.000 |  |

<sup>(1)</sup> Entendido como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso



S.05.1

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No Periodo: 1er Trimestre

Ejercicio: 2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BARCLAYS BANK, S.A.

#### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

#### **CUADRO B**

|   |          |                     | Situa | ción cierre anual |
|---|----------|---------------------|-------|-------------------|
| Movimiento de la cartera de activos titulizados/Tasa de amortización anticipada                                   | Situació | n actual 31/03/2016 | ante  | erior 31/12/2015  |
| Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior   | 0196     | 0                   | 0206  | 0                 |
| Derechos de crédito dados de baja por dación/adjudicación de bienes desde el cierre anual anterior                | 0197     |                     | 0207  | -302              |
| Amortización ordinaria desde el cierre anual anterior   | 0200     | -7.100              | 0210  | -29.230           |
| Amortización anticipada desde el cierre anual anterior  | 0201     | -3.423              | 0211  | -17.854           |
| Total importe amortizado acumulado, incluyendo adjudicaciones y otros pagos en especie, desde el origen del Fondo | 0202     | -567.809            | 0212  | -557.286          |
| Importe de principal pendiente de amortización de los nuevos activos incorporados en el periodo (1)               | 0203     | 0                   | 0213  | 0                 |
| Principal pendiente cierre del periodo (2)  | 0204     | 432.191             | 0214  | 442.714           |
| Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)   | 0205     | 0,79                | 0215  | 3,87              |

<sup>(1)</sup> En fondos abiertos, importe de principal pendiente de reembolso en la fecha de presentación de la información de los nuevos activos incorporados en el periodo

<sup>(2)</sup> Importe del principal pendiente de reembolso de la totalidad de los activos (incluídas las nuevas incorporaciones del periodo) a fecha del informe



S.05.1

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No** Periodo: **1er Trimestre** 

Ejercicio: 2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BARCLAYS BANK, S.A.

#### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

| CUADRO C             |      |            |       |                           |         | Importe impagado   |      |       |        |                          |             |       |  |
|----------------------|------|------------|-------|---------------------------|---------|--------------------|------|-------|--------|--------------------------|-------------|-------|--|
| Total Impagados (1)  | N    | de activos | Princ | ipal pendiente<br>vencido | Interes | ses ordinarios (2) |      | Total | Princi | pal pendiente no vencido | Deuda Total |       |  |
| Hasta 1 mes          | 0700 | 5          | 0710  | 3                         | 0720    | 0                  | 0730 | 3     | 0740   | 691                      | 0750        | 694   |  |
| De 1 a 3 meses       | 0701 | 9          | 0711  | 13                        | 0721    | 1                  | 0731 | 14    | 0741   | 1.386                    | 0751        | 1.401 |  |
| De 3 a 6 meses       | 0703 | 2          | 0713  | 4                         | 0723    | 0                  | 0733 | 4     | 0743   | 267                      | 0753        | 272   |  |
| De 6 a 9 meses       | 0704 | 0          | 0714  | 0                         | 0724    | 0                  | 0734 | 0     | 0744   | 0                        | 0754        | 0     |  |
| De 9 a 12 meses      | 0705 | 1          | 0715  | 3                         | 0725    | 0                  | 0735 | 3     | 0745   | 48                       | 0755        | 51    |  |
| De 12 meses a 2 años | 0706 | 4          | 0716  | 46                        | 0726    | 4                  | 0736 | 50    | 0746   | 417                      | 0756        | 467   |  |
| Más de 2 años        | 0708 | 18         | 0718  | 618                       | 0728    | 86                 | 0738 | 704   | 0748   | 2.173                    | 0758        | 2.877 |  |
| Total                | 0709 | 39         | 0719  | 687                       | 0729    | 91                 | 0739 | 778   | 0749   | 4.982                    | 0759        | 5.762 |  |

<sup>(1)</sup> La distribución de los activos vencidos impagados entre los distintos tramos señalados se realizará en función de la antigüedad de la primera cuota vencida y no cobrada. Los intervalos se entenderán excluído el de inicio e incluído el final (p.e. De 1 a 3 meses, esto es: superior a 1 mes y menor o igual a 3 meses)

<sup>(2)</sup> Importe de intereses cuyo devengo, en su caso, se ha interrumpido conforme lo establecido en el apartado 12 de la norma 13ª de la Circular(p.e. De 1 a 3 meses, esto es: superior a 1 mes y menor o igual a 3 meses)

|                             |      |            |      |                           | Impo                   | rte impagado |                     |     |                         |       |      |                             |      |            |      |                |      |                                 |       |                |
|-----------------------------|------|------------|------|---------------------------|------------------------|--------------|---------------------|-----|-------------------------|-------|------|-----------------------------|------|------------|------|----------------|------|---------------------------------|-------|----------------|
| Impagados con garantía real | Nº   | de activos |      | ipal pendiente<br>vencido | ' Intereses ordinarios |              | ntereses ordinarios |     | Intereses ordinarios To |       |      | ipal pendiente<br>o vencido | D    | euda Total | Valo | r garantía (3) |      | Garantía con<br>ón > 2 años (4) | % Deu | da/v. Tasación |
| Hasta 1 mes                 | 0772 | 5          | 0782 | 3                         | 0792                   | 0            | 0802                | 3   | 0812                    | 691   | 0822 | 694                         | 0832 | 1.819      |      |                | 0842 | 38,14                           |       |                |
| De 1 a 3 meses              | 0773 | 9          | 0783 | 13                        | 0793                   | 1            | 0803                | 14  | 0813                    | 1.386 | 0823 | 1.401                       | 0833 | 3.170      |      |                | 0843 | 44,21                           |       |                |
| De 3 a 6 meses              | 0774 | 2          | 0784 | 4                         | 0794                   | 0            | 0804                | 4   | 0814                    | 267   | 0824 | 272                         | 0834 | 1.024      | 1854 | 1.024          | 0844 | 26,52                           |       |                |
| De 6 a 9 meses              | 0775 | 0          | 0785 | 0                         | 0795                   | 0            | 0805                | 0   | 0815                    | 0     | 0825 | 0                           | 0835 | 0          | 1855 | 0              | 0845 | 0,00                            |       |                |
| De 9 a 12 meses             | 0776 | 1          | 0786 | 3                         | 0796                   | 0            | 0806                | 3   | 0816                    | 48    | 0826 | 51                          | 0836 | 235        | 1856 | 235            | 0846 | 21,85                           |       |                |
| De 12 meses a 2 años        | 0777 | 4          | 0787 | 46                        | 0797                   | 4            | 0807                | 50  | 0817                    | 417   | 0827 | 467                         | 0837 | 2.390      | 1857 | 2.390          | 0847 | 19,55                           |       |                |
| Más de 2 años               | 0778 | 18         | 0788 | 618                       | 0798                   | 86           | 0808                | 704 | 0818                    | 2.173 | 0828 | 2.877                       | 0838 | 5.827      | 1858 | 5.827          | 0848 | 49,38                           |       |                |
| Total                       | 0779 | 39         | 0789 | 687                       | 0799                   | 91           | 0809                | 778 | 0819                    | 4.982 | 0829 | 5.762                       | 0839 | 14.465     |      |                | 0849 | 39,83                           |       |                |

<sup>(2)</sup> La distribución de los activos vencidos impagados entre los distintos tramos señalados se realizará en función de la antigüedad de la primera cuota vencida y no cobrada. Los intervalos se entenderán excluído el de inicio e incluído el final (p.e. De 1 a 2 meses, estos es: superior a 1 mes y menor o igual a 2 meses)

<sup>(3)</sup> Cumplimentar con la última valoración disponible de tasación del inmueble o valor razonable de la garantía real (acciones o deuda pignoradas, etc.) si el valor de las mismas se ha considerado en el momento incial del Fondo

<sup>(4)</sup> Se incluirá el valor de las garantías que tengan una tasación superior a dos años



S.05.1

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No Periodo: 1er Trimestre

Ejercicio: 2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BARCLAYS BANK, S.A.

#### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

| CUADRO D                                | Situación actual 31/03/2016 |      |      |             |                               |      |                         | Situación                            | cierre | anual anterior 3 | 1/12/201 | 5          | Escenario inicial |      |                |                                 |              |      |
|---|-----------------------------|------|------|-------------|-------------------------------|------|-------------------------|--------------------------------------|--------|------------------|----------|------------|-------------------|------|----------------|---------------------------------|--------------|------|
|   |                             |      |      |             |                               |      |                         |                                      |        |                  |          |            |                   |      |                |                                 |              |      |
|   |                             |      |      |             |                               | .,   | _                       |                                      | _      |                  |          |            |                   |      |                |                                 |              |      |
| Ratios de morosidad (1) (%)             |                             |      |      |             | e recuperación<br>Illidos (D) |      | de activos<br>dosos (A) | Tasa de fallido Tasa de recuperación |        |                  |          |            |                   |      |                | de fallido Tasa de recuperación |              |      |
|   |                             | . ,  |      | ntable) (B) |                               |      |                         |                                      |        | ontable) (B)     |          | Ilidos (D) |                   | . ,  | (contable) (B) |                                 | fallidos (D) |      |
| Participaciones hipotecarias            | 0850                        | 0,84 |      | 0,00        | 0886                          | 0,00 |                         | 0,92                                 | 0922   | 0,00             | 0940     | 0,00       | 0958              | 0,00 | 0976           | 0,00                            | 0994         | 0,00 |
| Certificados de transmisión de hipoteca | 0851                        |      | 0869 |             | 0887                          |      | 0905                    |                                      | 0923   |                  | 0941     |            | 0959              |      | 0977           |                                 | 0995         |      |
| Préstamos hipotecarios                  | 0852                        |      | 0870 |             | 0888                          |      | 0906                    |                                      | 0924   |                  | 0942     |            | 0960              |      | 0978           |                                 | 0996         |      |
| Cédulas Hipotecarias                    | 0853                        |      | 0871 |             | 0889                          |      | 0907                    |                                      | 0925   |                  | 0943     |            | 0961              |      | 0979           |                                 | 0997         |      |
| Préstamos a promotores                  | 0854                        |      | 0872 |             | 0890                          |      | 0908                    |                                      | 0926   |                  | 0944     |            | 0962              |      | 0980           |                                 | 0998         |      |
| Préstamos a PYMES                       | 0855                        |      | 0873 |             | 0891                          |      | 0909                    |                                      | 0927   |                  | 0945     |            | 0963              |      | 0981           |                                 | 0999         |      |
| Préstamos a empresas                    | 0856                        |      | 0874 |             | 0892                          |      | 0910                    |                                      | 0928   |                  | 0946     |            | 0964              |      | 0982           |                                 | 1000         |      |
| Préstamos Corporativos                  | 0857                        |      | 0875 |             | 0893                          |      | 0911                    |                                      | 0929   |                  | 0947     |            | 0965              |      | 0983           |                                 | 1001         |      |
| Cédulas Territoriales                   | 1066                        |      | 1084 |             | 1102                          |      | 1120                    |                                      | 1138   |                  | 1156     |            | 1174              |      | 1192           |                                 | 1210         |      |
| Bonos de Tesorería                      | 0858                        |      | 0876 |             | 0894                          |      | 0912                    |                                      | 0930   |                  | 0948     |            | 0966              |      | 0984           |                                 | 1002         |      |
| Deuda subordinada                       | 0859                        |      | 0877 |             | 0895                          |      | 0913                    |                                      | 0931   |                  | 0949     |            | 0967              |      | 0985           |                                 | 1003         |      |
| Créditos AAPP                           | 0860                        |      | 0878 |             | 0896                          |      | 0914                    |                                      | 0932   |                  | 0950     |            | 0968              |      | 0986           |                                 | 1004         |      |
| Préstamos Consumo                       | 0861                        |      | 0879 |             | 0897                          |      | 0915                    |                                      | 0933   |                  | 0951     |            | 0969              |      | 0987           |                                 | 1005         |      |
| Préstamos automoción                    | 0862                        |      | 0880 |             | 0898                          |      | 0916                    |                                      | 0934   |                  | 0952     |            | 0970              |      | 0988           |                                 | 1006         |      |
| Cuotas arrendamiento financiero         | 0863                        |      | 0881 |             | 0899                          |      | 0917                    |                                      | 0935   |                  | 0953     |            | 0971              |      | 0989           |                                 | 1007         |      |
| Cuentas a cobrar                        | 0864                        |      | 0882 |             | 0900                          |      | 0918                    |                                      | 0936   |                  | 0954     |            | 0972              |      | 0990           |                                 | 1008         |      |
| Derechos de crédito futuros             | 0865                        |      | 0883 |             | 0901                          |      | 0919                    |                                      | 0937   | [                | 0955     |            | 0973              |      | 0991           |                                 | 1009         |      |
| Bonos de titulización                   | 0866                        |      | 0884 |             | 0902                          |      | 0920                    |                                      | 0938   | [                | 0956     |            | 0974              |      | 0992           |                                 | 1010         |      |
| Otros                                   | 0867                        |      | 0885 |             | 0903                          |      | 0921                    |                                      | 0939   |                  | 0957     |            | 0975              |      | 0993           |                                 | 1011         |      |

<sup>(1)</sup> Estos ratios se referirán exclusivamente a la cartera de activos cedidos al Fondo(presentados en el balance en la partida de "derechos de crédito") y se expresaran en términos porcentuales

<sup>(</sup>A) Determinada por el cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos a la fecha de presentación de la información, y el principal pendiente (sin incluir intereses, e incluyendo principales impagados) del total activos dados de alta en el balance a la fecha de presentación de la información. La clasificación como dudosos se realizará con arreglo a lo previsto en las Normas 13ª y 23ª

<sup>(</sup>B) Determinada por el cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos a la fecha de presentación de la información, y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en el balance a la fecha de presentación de la información más el principal de los activos clasificados como fallidos. Se considerará la definición de fallidos recogida en la Circular (no necesariamente coincidentes con la definición de la escritura o folleto, recogidas en el estado 5.4)

<sup>(</sup>D) Determinada por el cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo período del año anterior y el importe de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo período del año anterior y el importe de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo período del año anterior



S.05.1

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No Periodo: 1er Trimestre Ejercicio: 2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BARCLAYS BANK, S.A.

#### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

| CUADRO E  |   | Situación actu | ual 31/03/2 | 2016    | Situación cierre anual anterior 31/12/2015 |            |       |             |         |       | Situación inicial 30/11/2006 |                     |      |           |  |
|---|---|----------------|-------------|---------|--|------------|-------|-------------|---------|-------|------------------------------|---------------------|------|-----------|--|
| Vida residual de los activos cedidos al Fondo (1) | Nº de activos vivos Principal pendiente |                |             | _       | Nº de activos vivos Principal pendiente    |            |       |             |         | Nº de | e activos vivos              | Principal pendiente |      |           |  |
| Inferior a 1 año                                  | 1300                                    | 51             | 1310        | 205     |  | 1320 61    |       | 1330        | 216     |       | 1340                         | 0                   | 1350 | 0         |  |
| Entre 1 y 2 años                                  | 1301                                    | 80             | 1311        | 935     |  | 1321       | 70    | 1331        | 885     |       | 1341                         | 1                   | 1351 | 39        |  |
| Entre 2 y 3 años                                  | 1302                                    | 58             | 1312        | 954     |  | 1322       | 65    | 1332        | 1.026   |       | 1342                         | 4                   | 1352 | 217       |  |
| Entre 3 y 5 años                                  | 1303                                    | 287            | 1313        | 7.926   |  | 1323       | 255   | 1333        | 6.968   |       | 1343                         | 17                  | 1353 | 813       |  |
| Entre 5 y 10 años                                 | 1304                                    | 652            | 1314        | 35.854  |  | 1324 636   |       | 1334 33.630 |         |       | 1344                         | 224                 | 1354 | 15.013    |  |
| Superior a 10 años                                | 1305                                    | 3.343          | 1315        | 386.317 |  | 1325       | 3.443 | 1335        | 399.990 |       | 1345                         | 6.021               | 1355 | 983.918   |  |
| Total   | 1306                                    | 4.471          | 1316        | 432.191 |  | 1326 4.53  |       | 1336        | 442.715 |       | 1346 6                       |                     | 1356 | 1.000.000 |  |
| Vida residual media ponderada (años)              | 1307                                    | 16,91          |             |         |  | 1327 17,11 |       |             |         |       | 1347                         | 26,02               |      |           |  |

<sup>(1)</sup> Los intervalos se entenderán excluído el inicio del mismo e incluído el final (p.e. Entre 1 y 2 años: superior a 1 año y menor o igual a 2 años)

|                            | Situación actual 31/03/2016 | Situación cierre anual anterior 31/12/2015 | Situación inicial 30/11/2006 |
|----------------------------|-----------------------------|--|------------------------------|
| Antigüedad                 | Años                        | Años                                       | Años                         |
| Antigüedad media ponderada | 0630 10,39                  | 0632 10,14                                 | 0634 1,08                    |



S.05.2

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No** Periodo: **1er Trimestre** 

Ejercicio: 2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

#### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)

| CUADRO A     |              |       |         | Situación ac | tual 31/0 | 03/2016       |                 |         | Sit     | tuación cierre anu | ual anter | rior 31/12/2015 | 5               | Escenario inicial 30/11/2006 |         |          |      |                  |                 |  |
|--------------|--------------|-------|---------|--------------|-----------|---------------|-----------------|---------|---------|--------------------|-----------|-----------------|-----------------|------------------------------|---------|----------|------|------------------|-----------------|--|
|              | Denominación | Nº de | pasivos | Nominal      |           | Vida media de | Nº de p         | pasivos | Nominal | Vida media de      |           |                 |                 | pasivos                      | Nominal |          |      | Vida media de    |                 |  |
| Serie (2)    | serie        | em    | itidos  | unitario     | Princip   | al pendiente  | los pasivos (1) | emit    | tidos   | unitario           | Princip   | al pendiente    | los pasivos (1) | en                           | nitidos | unitario | Prin | ncipal pendiente | los pasivos (1) |  |
|              |              | C     | 0001    | 0002         |           | 0003          | 0004            | 00      | 005     | 0006               |           | 0007            | 8000            |                              | 0009    | 0070     |      | 0800             | 0090            |  |
| ES0312300041 | D            |       | 214     | 44           |           | 9.396         | 4,80            |         | 214     | 45                 |           | 9.700           | 4,80            |                              | 214     |          | 50   | 10.700           | 21,90           |  |
| ES0312300033 | С            |       | 216     | 44           |           | 9.483         | 4,80            |         | 216     | 45                 |           | 9.791           | 4,80            |                              | 216     |          | 50   | 10.800           | 21,90           |  |
| ES0312300025 | В            |       | 220     | 44           |           | 9.659         | 4,80            |         | 220     | 45                 |           | 9.972           | 4,80            |                              | 220     |          | 50   | 11.000           | 21,90           |  |
| ES0312300017 | A2           |       | 15.000  | 27           |           | 410.505       | 4,80            |         | 15.000  | 28                 |           | 423.807         | 4,80            |                              | 15.000  |          | 50   | 750.000          | 17,90           |  |
| ES0312300009 | A1           |       | 0       | 0            |           | 0             | 0,00            |         | 0       | 0                  |           | О               | 0,00            |                              | 4.350   |          | 50   | 217.500          | 3,90            |  |
| Total        |              | 8006  | 15.650  |              | 8025      | 439.043       |                 | 8045    | 15.650  |                    | 8065      | 453.270         |                 | 8085                         | 20.000  |          | 810  | 1.000.000        |                 |  |

<sup>(1)</sup> Importes en años. En caso de ser estimado se indicará en las notas explicativas las hipótesis de estimación

<sup>(2)</sup> La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación



S.05.2

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No Periodo: 1er Trimestre Ejercicio: 2016

\_jercicio. **2010** 

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

#### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)

| CUADRO B     |                       |                                  |                             |            |               | Intereses                       | .,                     | Principal                   | pendiente              |                         |                       |                 |  |
|--------------|-----------------------|----------------------------------|-----------------------------|------------|---------------|---------------------------------|------------------------|-----------------------------|------------------------|-------------------------|-----------------------|-----------------|--|
| Serie (1)    | Denominación<br>serie | Grado de<br>subordinación<br>(2) | Índice de<br>referencia (3) | Margen (4) | Tipo aplicado | Base de cálculo de<br>intereses | Días<br>Acumulados (5) | Intereses<br>Acumulados (6) | Intereses<br>impagados | Principal no<br>vencido | Principal<br>impagado | Total pendiente | Corrección de<br>valor por<br>repercusión de<br>pérdidas |
|              |                       | 9950                             | 9960                        | 9970       | 9980          | 9990                            | 9991                   | 9993                        | 9997                   | 9994                    | 9995                  | 9998            | 9955   |
| ES0312300041 | D                     | s                                | EURIBOR 3<br>MESES          | 2,25       | 2,10          | 360                             | 77                     | 42                          | 0                      | 9.396                   | 0                     | 9.438           |  |
| ES0312300033 | С                     | s                                | EURIBOR 3<br>MESES          | 0,47       | 0,32          | 360                             | 77                     | 7                           | 0                      | 9.483                   | 0                     | 9.490           |  |
| ES0312300025 | В                     | s                                | EURIBOR 3<br>MESES          | 0,22       | 0,07          | 360                             | 77                     | 2                           | 0                      | 9.659                   | 0                     | 9.661           |  |
| ES0312300017 | A2                    | NS                               | EURIBOR 3<br>MESES          | 0,15       | 0,00          | n/a                             | 77                     | 5                           | 0                      | 410.505                 | 0                     | 410.510         |  |
| ES0312300009 | A1                    | NS                               | EURIBOR 3<br>MESES          | 0,05       | 0,00          | n/a                             | 77                     | 0                           | 0                      | 0                       | 0                     | 0               |  |
| Total        |                       |                                  |                             |            |               |                                 |                        | 9228 56                     | 9105 0                 | 9085 439.043            | 9095 0                | 9115 439.099    | 9227   |

<sup>(1)</sup> La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

- (5) Días acumulados desde la última fecha de pago
- (6) Intereses acumulados desde la última fecha de pago

<sup>(2)</sup> La gestora deberá indicar si la serie es subordinada o no subordinada (S=Subordinada; NS=No subordinada)

<sup>(3)</sup> La gestora deberá cumplimentar el índice de referencia que corresponda en cada caso (EURIBOR un año, EURIBOR a tres meses...). En el caso de tipos fijos esta columna se cumplimentará con el término "fijo"

<sup>(4)</sup> En el caso de tipos fijos esta columna no se cumplimentará



S.05.2

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No Periodo: 1er Trimestre

Ejercicio: 2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

#### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)

| CUADRO C     |              |                 |                       | Situación act        | ual 31/03/2016        |                      | Situación cierre anual anterior 31/12/2015 |                      |                       |                      |  |  |  |  |  |
|--------------|--------------|-----------------|-----------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|--|----------------------|-----------------------|----------------------|--|--|--|--|--|
|              |              |                 | Amortizaci            | ón principal         | Inter                 | eses                 | Amortizaci                                 | ón principal         | Inter                 | eses                 |  |  |  |  |  |
|              | Denominación |                 |                       |                      |                       |                      |  |                      |                       |                      |  |  |  |  |  |
| Serie (1)    | serie        | Fecha final (2) | Pagos del periodo (3) | Pagos acumulados (4) | Pagos del periodo (3) | Pagos acumulados (4) | Pagos del periodo (3)                      | Pagos acumulados (4) | Pagos del periodo (3) | Pagos acumulados (4) |  |  |  |  |  |
|              |              | 7290            | 7300                  | 7310                 | 7320                  | 7330                 | 7340                                       | 7350                 | 7360                  | 7370                 |  |  |  |  |  |
| ES0312300041 | D            | 15-07-2041      | 304                   | 1.304                | 55                    | 3.763                | 1.000                                      | 1.000                | 248                   | 3.708                |  |  |  |  |  |
| ES0312300033 | С            | 15-07-2041      | 307                   | 1.316                | 11                    | 2.024                | 1.009                                      | 1.009                | 55                    | 2.013                |  |  |  |  |  |
| ES0312300025 | В            | 15-07-2041      | 313                   | 1.341                | 4                     | 1.809                | 1.028                                      | 1.028                | 29                    | 1.805                |  |  |  |  |  |
| ES0312300017 | A2           | 15-07-2041      | 13.302                | 339.495              | 109                   | 112.250              | 42.193                                     | 326.193              | 850                   | 112.141              |  |  |  |  |  |
| ES0312300009 | A1           | 15-07-2041      | 0                     | 217.500              | 0                     | 12.531               | 0  | 217.500              | 0                     | 12.531               |  |  |  |  |  |
| Total        |              |                 | 7305 14.226           | 7315 560.956         | 7325 179              | 7335 132.377         | 7345 45.230                                | 7355 546.730         | 7365 1.182            | 7375 132.198         |  |  |  |  |  |

<sup>(1)</sup> La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

<sup>(2)</sup> Entendiendo como fecha final aquella que de acuerdo con la documentación contractual determine la extinción del Fondo, siempre que no se haya producido previamente una causa de liquidación anticipada

<sup>(3)</sup> Total de pagos realizados desde el último cierre anual

<sup>(4)</sup> Total de pagos realizados desde la fecha de constitución del Fondo



S.05.2

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No Periodo: 1er Trimestre

Ejercicio: 2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

#### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

| CUADRO D     |                    |                         |                         | Calificación     |                                 |                   |
|--------------|--------------------|-------------------------|-------------------------|------------------|---------------------------------|-------------------|
|              |                    | Fecha último cambio de  | Agencia de calificación |                  |                                 |                   |
| Serie (1)    | Denominación serie | calificación crediticia | crediticia (2)          | Situación actual | Situación anual cierre anterior | Situación inicial |
|              |                    | 3310                    | 3330                    | 3350             | 3360                            | 3370              |
| ES0312300041 | D                  | 02-12-2014              | SYP                     | В                | В                               | BB-               |
| ES0312300041 | D                  | 10-07-2015              | MDY                     | B2               | B2                              | Ba3               |
| ES0312300041 | D                  | 17-11-2006              | FCH                     | ВВ               | ВВ                              | BB                |
| ES0312300033 | c                  | 02-12-2014              | SYP                     | BB+              | BB+                             | BBB+              |
| ES0312300033 | c                  | 10-07-2015              | MDY                     | Ba2              | Ba2                             | Baa1              |
| ES0312300033 | c                  | 17-11-2006              | FCH                     | BBB+             | BBB+                            | BBB+              |
| ES0312300025 | В                  | 25-01-2016              | SYP                     | BBB+             | BBB                             | A                 |
| ES0312300025 | В                  | 10-07-2015              | MDY                     | A3               | A3                              | Aa3               |
| ES0312300025 | В                  | 17-11-2006              | FCH                     | AA-              | AA-                             | AA-               |
| ES0312300017 | A2                 | 25-01-2016              | SYP                     | AA+              | AA                              | AAA               |
| ES0312300017 | A2                 | 10-07-2015              | MDY                     | Aa2              | Aa2                             | Aaa               |
| ES0312300017 | A2                 | 10-10-2014              | FCH                     | AA+              | AA+                             | AAA               |
| ES0312300009 | A1                 | 30-11-2006              | SYP                     | AAA              | AAA                             | AAA               |
| ES0312300009 | A1                 | 30-11-2006              | MDY                     | Aaa              | Aaa                             | Aaa               |
| ES0312300009 | A1                 | 30-11-2006              | FCH                     | AAA              | AAA                             | AAA               |

<sup>(1)</sup> La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

<sup>(2)</sup> La gestora deberá cumplimentar la calificación crediticia otorgada por cda agencia de rating, cuya denominación también deberá ser cumplimentada, para serie - MDY para Moody's; SYP para Standard & Poors; FCH para Fitch; DBRS para Dominion Bond Rating Service -



S.05.3

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No** Periodo: **1er Trimestre** Ejercicio: **2016** 

| INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS<br>(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)           |      | Situación actual<br>31/03/2016 |      | Situación cierre<br>anual anterior<br>31/12/2015 |
|---|------|--------------------------------|------|--|
| 1. Importe del Fondo de Reserva   | 0010 | 9.337                          | 1010 | 10.300   |
| 2. Porcentaje que representa el Fondo de Reserva, u otras mejoras equivalentes, sobre el total de activos titulizados | 0020 | 2,16                           | 1020 | 2,33   |
| 3. Exceso de spread (%) (1)   | 0040 | 0,55                           | 1040 | 0,58   |
| 4. Permuta financiera de intereses (S/N)  | 0050 | Si                             | 1050 | Si   |
| 5. Permuta financiera de tipos de cambio (S/N)  | 0070 | No                             | 1070 | No   |
| 6. Otras permutas financieras (S/N)   | 0080 | No                             | 1080 | No   |
| 7. Importe disponible de la línea/s de liquidez (2)   | 0090 | 0                              | 1090 | 0  |
| 8. Subordinación de series (S/N)  | 0110 | Si                             | 1110 | Si   |
| 9. Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total de bonos (3)   | 0120 | 93,49                          | 1120 | 93,49  |
| 10. Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales   | 0150 | 0                              | 1150 | 0  |
| 11. Porcentaje que representa el aval sobre el total de los pasivos emitidos  | 0160 | 0,00                           | 1160 | 0,00   |
| 12. Importe máximo de riesgo cubierto por derivados de crédito u otras garantías financieras adquiridas               | 0170 | 0                              | 1170 | 0  |
| 13. Otros (S/N) (4)   | 0180 | No                             | 1180 | No   |
|   |      |                                |      |  |

<sup>(1)</sup> Diferencial existente entre los tipos de interés medios ponderados percibidos de la cartera de activos titulizados conforme se establece en el Cuadro 5.5.E y el tipo de interés medio de los pasivos emitidos cuya finalidad ha sido la adquisición de los activos

- (2) Se incluirá el importe total disponible de las distintas líneas de liquidez en caso de que haya más de una
- (3) Entendiendo como no subordinadas aquellas series que en la fecha se encuentren, respecto a las demás, en una posición anterior para el cobro de capital conforme al orden de prelación de pagos
- (4) La gestora deberá incluir una descripción de dichas mejoras crediticias en las notas explicativas en caso de que las consideren relevantes

| Información sobre contrapartes de las mejoras crediticias         |      | NIF |      | Denominación   |
|---|------|-----|------|----------------|
| Contraparte del Fondo de Reserva u otras mejores equivalentes (5) | 0200 |     | 1210 | BARCLAYS BANK, |
| Contraparte del Fondo de Reserva d'otras mejores equivalentes (5) | 0200 |     | 1210 | S.A.           |
| Permutas financieras de tipos de interés                          | 0210 |     | 1220 | BARCLAYS BANK, |
| 1 cirridas inianoleras de lipos de inicires                       | 0210 |     | 1220 | S.A.           |
| Permutas financieras de tipos de cambio                           | 0220 |     | 1230 | 0              |
| Otras permutas financieras  | 0230 |     | 1240 | 0              |
| Contraparte de la Línea de Liquidez                               | 0240 |     | 1250 | 0              |
| Entidad Avalista  | 0250 |     | 1260 | 0              |
| Contraparte del derivado de crédito                               | 0260 |     | 1270 | 0              |

<sup>(5)</sup> Si el Fondo de Reserva se ha constituido a través de títulos emitidos y se desconoce el titular de esos títulos no se cumplimentará



S.05.4

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No Periodo: 1er Trimestre Ejercicio: 2016

#### CIRCUNSTANCIAS ESPECÍFICAS ESTABLECIDAS CONTRACTUALMENTE EN EL FONDO

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

|   |              |    |             |    | Importe impagado acumulado |            |        |            | Ratio (2) |            |        |             |        |            |      |   |
|---|--------------|----|-------------|----|----------------------------|------------|--------|------------|-----------|------------|--------|-------------|--------|------------|------|---|
| Concepto (1)  | Meses impago |    | Días impago |    | Situac                     | ión actual | Period | o anterior | Situac    | ión actual | Period | lo anterior | Última | Fecha Pago |      | Ref. Folleto                                  |
| Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a     | 0010         | 0  | 0030        | 90 | 0100                       | 762        | 0200   | 784        | 0300      | 0,83       | 0400   | 0,92        | 1120   | 1,08       |      |   |
| 2. Activos Morosos por otras razones                              |              |    |             |    | 0110                       | 0          | 0210   | 0          | 0310      | 0,00       | 0410   | 0,00        | 1130   | 0,00       |      |   |
| Total Morosos   |              |    |             |    | 0120                       | 762        | 0220   | 784        | 0320      | 0,83       | 0420   | 0,92        | 1140   | 1,08       | 1280 |   |
|   |              |    |             |    |                            |            |        |            |           |            |        |             |        |            |      |   |
| 3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a | 0050         | 18 | 0060        | 0  | 0130                       | 716        | 0230   | 741        | 0330      | 0,65       | 0430   | 0,68        | 1050   | 0,71       |      |   |
| 4. Activos Fallidos por otras razones                             |              |    |             |    | 0140                       | 0          | 0240   | 0          | 0340      | 0,00       | 0440   | 0,00        | 1160   | 0,00       |      |   |
| Total Fallidos  |              |    |             |    | 0150                       | 716        | 0250   | 741        | 0350      | 0,65       | 0450   | 0,68        | 1200   | 0,71       | 1290 | FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES |

(1) En caso de existir definiciones adicionales a las recogidas en la presente tabla (moras cualificadas, fallidos subjetivos, etc) respecto a las que se establezca algún trigger se indicarán en la tabla de Otros ratios relevantes, indicando el nombre del ratio

(2) Los ratios se corresponden al importe total de activos fallidos o morosos entre el saldo vivo de los activos cedidos al fondo según se defina en la documentación contractual. En la columna Ref. Folleto se indicará el epígrafe o capítulo del folleto en el que el concepto esté definido

Otros ratios relevantes Situación actual periodo anterior Última Fecha Pago Ref. Folleto

#### Última Fecha

|   |              |              | •a . • •a    |                              |
|---|--------------|--------------|--------------|------------------------------|
| TRIGGERS (3)  | Límite       | % Actual     | Pago         | Ref. Folleto                 |
| Amortización secuencial: series (4)                                 | 0500         | 0520         | 0540         | 0560                         |
| Amortización Secuencial Fondo Reserva (302) Amortización Secuencial | 10.300.000,0 | 10.300.000,0 | 10.300.000,0 | FOLLETO INFORMATIVO. NOTA    |
| Fondo Reserva (302)   | 0            | 0            | 0            | DE VALORES. APARTADO 4.9.3.4 |
| Amortización Secuencial D (305) Amortización Secuencial D (305)     | 0.75         | 1.52         | 1,71         | FOLLETO INFORMATIVO. NOTA    |
| Amortización Secuenciai D (305) Amortización Secuenciai D (305)     | 0,75         | 1,52         | 1,71         | DE VALORES. APARTADO 4.9.3.4 |
| Amortización Secuencial C (304) Amortización Secuencial C (304)     | 1.00         | 1.52         | 1.71         | FOLLETO INFORMATIVO. NOTA    |
| Amortización Secuencial C (304) Amortización Secuencial C (304)     | 1,00         | 1,52         | 1,71         | DE VALORES. APARTADO 4.9.3.4 |
| Amortización Secuencial B (303) Amortización Secuencial B (303)     | 1.25         | 1.52         | 1.71         | FOLLETO INFORMATIVO. NOTA    |
| Amortización Secuenciai B (303) Amortización Secuenciai B (303)     | 1,25         | 1,52         | 1,71         | DE VALORES. APARTADO 4.9.3.4 |
| Amortización Secuencial (306) Amortización Secuencial (306)         | 10,00        | 43.81        | 44,40        | FOLLETO INFORMATIVO. NOTA    |
| Amortización Secuenciai (300) Amortización Secuenciai (300)         | 10,00        | 43,61        | 44,40        | DE VALORES. APARTADO 4.9.3.4 |

| Diferimiento/postergamiento intereses: series (5)   |      | 0506 |      | 0526 |      | 0546 |      | 0566   |
|---|------|------|------|------|------|------|------|--|
| Diferimiento o Postergamiento de Interes D (312) Diferimiento o Postergamiento de Interes D (312) |      | 0,00 |      | 0,00 |      | 0,00 |      | FOLLETO INFORMATIVO.<br>MÓDULO ADICIONAL LA NOTA DE<br>VALORES. APARTADO 3.4.6.3   |
| Diferimiento o Postergamiento de Interes D (309) Diferimiento o Postergamiento de Interes D (309) |      | 4,00 |      | 1,04 |      | 1,04 |      | FOLLETO INFORMATIVO.<br>MÓDULO ADICIONAL LA NOTA DE<br>VALORES. APARTADO 3.4.6.3   |
| Diferimiento o Postergamiento de Interes C (311) Diferimiento o Postergamiento de Interes C (311) |      | 0,00 |      | 0,00 |      | 0,00 |      | FOLLETO INFORMATIVO.<br>MÓDULO ADICIONAL LA NOTA DE<br>VALORES. APARTADO 3.4.6.3   |
| Diferimiento o Postergamiento de Interes C (308) Diferimiento o Postergamiento de Interes C (308) |      | 5,00 |      | 1,04 |      | 1,04 |      | FOLLETO INFORMATIVO.<br>MÓDULO ADICIONAL LA NOTA DE<br>VALORES. APARTADO 3.4.6.3   |
| Diferimiento o Postergamiento de Interes B (310) Diferimiento o Postergamiento de Interes B (310) |      | 0,00 |      | 0,00 |      | 0,00 |      | FOLLETO INFORMATIVO.<br>MÓDULO ADICIONAL LA NOTA DE<br>VALORES. APARTADO 3.4.6.3   |
| Diferimiento o Postergamiento de Interes B (307) Diferimiento o Postergamiento de Interes B (307) |      | 7,00 |      | 1,04 |      | 1,04 |      | FOLLETO INFORMATIVO.<br>MÓDULO ADICIONAL LA NOTA DE<br>VALORES. APARTADO 3.4.6.3   |
| No Reducción del Fondo de Reserva (6)   | 0512 | 1,00 | 0532 | 1,50 | 0552 | 1,70 | 0572 | FOLLETO INFORMATIVO.<br>MÓDULO ADICIONAL A LA NOTA<br>DE VALORES. APARTADO 3.4.2.2 |
| OTROS TRIGGERS (3)  |      | 0513 |      | 0523 |      | 0553 |      | 0573   |

<sup>(3)</sup> En caso de existir triggers adicionales a los recogidos en la presente tabla se indicarán su nombre o concepto debajo de OTROS TRIGGERS. Si los triggers recogidos expresamente en la tabla no están previstos en el Fondo, no se cumplimentarán

(5) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto al diferimiento o postergamiento de intereses de algunas de las series se indicarán las series afectadas indicando su ISIN o nombre, el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

(6) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto a la no reducción del fondo de reserva se indicará el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

<sup>(4)</sup> Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto al modo de amortización (prorrata/secuencial) de algunas de las series se indicarán las series afectadas indicando su ISIN, y en su defecto el nombre, el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido



S.05.5

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No Periodo: 1er Trimestre Ejercicio: 2016

#### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

| CUADRO A                                       |           | Situación acti | ctual 31/03/2016 |              |  | Situació   | n cierre anua | l anterior 31 | /12/2015     | Situación inic |           |             | 6            |
|--|-----------|----------------|------------------|--------------|--|------------|---------------|---------------|--------------|----------------|-----------|-------------|--------------|
| Distribución geográfica de activos titulizados | Nº de act | ivos vivos     | Principal p      | endiente (1) |  | Nº de acti | vos vivos     | Principal p   | endiente (1) | Nº de acti     | vos vivos | Principal p | endiente (1) |
| Andalucía                                      | 0400      |                |                  | 84.916       |  | 0452       | 961           | 0478          | 86.816       | 0504           | 1.286     | 0530        | 180.509      |
| Aragón   | 0401      | 104            | 0427             | 9.488        |  | 0453       | 104           | 0479          | 9.673        | 0505           | 156       | 0531        | 23.279       |
| Asturias                                       | 0402      | 55             | 0428             | 4.013        |  | 0454       | 55            | 0480          | 4.114        | 0506           | 67        | 0532        | 8.734        |
| Baleares                                       | 0403      | 223            | 0429             | 22.310       |  | 0455       | 227           | 0481          | 22.770       | 0507           | 290       | 0533        | 47.513       |
| Canarias                                       | 0404      | 302            | 0430             | 27.636       |  | 0456       | 302           | 0482          | 28.083       | 0508           | 398       | 0534        | 56.160       |
| Cantabria                                      | 0405      | 75             | 0431             | 5.739        |  | 0457       | 75            | 0483          | 5.851        | 0509           | 97        | 0535        | 13.114       |
| Castilla-León                                  | 0406      | 234            | 0432             | 16.505       |  | 0458       | 238           | 0484          | 16.996       | 0510           | 316       | 0536        | 40.416       |
| Castilla La Mancha                             | 0407      | 133            | 0433             | 10.540       |  | 0459       | 135           | 0485          | 10.767       | 0511           | 173       | 0537        | 24.194       |
| Cataluña                                       | 0408      | 673            | 0434             | 74.674       |  | 0460       | 684           | 0486          | 76.697       | 0512           | 943       | 0538        | 173.701      |
| Ceuta  | 0409      | 1              | 0435             | 86           |  | 0461       | 1             | 0487          | 88           | 0513           | 2         | 0539        | 161          |
| Extremadura                                    | 0410      | 13             | 0436             | 1.018        |  | 0462       | 13            | 0488          | 1.036        | 0514           | 21        | 0540        | 2.662        |
| Galicia  | 0411      | 105            | 0437             | 7.720        |  | 0463       | 106           | 0489          | 7.897        | 0515           | 155       | 0541        | 20.593       |
| Madrid   | 0412      | 926            | 0438             | 106.211      |  | 0464       | 940           | 0490          | 108.831      | 0516           | 1.435     | 0542        | 270.823      |
| Meilla   | 0413      | 0              | 0439             | 0            |  | 0465       | 0             | 0491          | 0            | 0517           | 0         | 0543        | 0            |
| Murcia   | 0414      | 123            | 0440             | 12.342       |  | 0466       | 123           | 0492          | 12.545       | 0518           | 144       | 0544        | 21.272       |
| Navarra  | 0415      | 36             | 0441             | 3.192        |  | 0467       | 36            | 0493          | 3.243        | 0519           | 49        | 0545        | 7.760        |
| La Rioja                                       | 0416      | 20             | 0442             | 1.616        |  | 0468       | 21            | 0494          | 1.662        | 0520           | 24        | 0546        | 3.243        |
| Comunidad Valenciana                           | 0417      | 377            | 0443             | 32.714       |  | 0469       | 385           | 0495          | 33.802       | 0521           | 519       | 0547        | 75.901       |
| País Vasco                                     | 0418      | 122            | 0444             | 11.469       |  | 0470       | 124           | 0496          | 11.845       | 0522           | 192       | 0548        | 29.965       |
| Total España                                   | 0419      | 4.471          | 0445             | 432.189      |  | 0471       | 4.530         | 0497          | 442.716      | 0523           | 6.267     | 0549        | 1.000.000    |
| Otros países Unión europea                     | 0420      | 0              | 0446             | 0            |  | 0472       | 0             | 0498          | 0            | 0524           | 0         | 0550        | 0            |
| Resto  | 0422 0    |                | 0448             | 0            |  | 0474       | 0             | 0500          | 0            | 0526           | 0         | 0552        | 0            |
| Total general                                  | 0425      | 4.471          | 0450             | 432.189      |  | 0475       | 4.530         | 0501          | 442.716      | 0527           | 6.267     | 0553        | 1.000.000    |

<sup>(1)</sup> Entendiendo como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso



S.05.5

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No Periodo: 1er Trimestre Ejercicio: 2016

#### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

| CUADRO B                   | Situación actual 31/03/2016 |               |        |               |        |               | Situación cierre anual anterior 31/12/2015 |               |          |                |         |              | Situación inicial 30/11/2006 |              |        |               |         |              |  |
|----------------------------|-----------------------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|--|---------------|----------|----------------|---------|--------------|------------------------------|--------------|--------|---------------|---------|--------------|--|
|                            |                             |               | Princi | oal pendiente | Princi | pal pendiente |  |               | Principa | l pendiente en | Princip | al pendiente |                              |              | Princi | pal pendiente | Princip | al pendiente |  |
| Divisa/Activos titulizados | Nº de a                     | activos vivos | en     | Divisa (1)    | en     | euros (1)     | Nº d                                       | activos vivos | D        | ivisa (1)      | en      | euros (1)    | Nº de a                      | ctivos vivos | en     | Divisa (1)    | en      | euros (1)    |  |
| Euro - EUR                 | 0571                        | 4.471         | 0577   | 432.191       | 0583   | 432.191       | 0600                                       | 4.530         | 0606     | 442.714        | 0611    | 442.714      | 0620                         | 6.267        | 0626   | 1.000.000     | 0631    | 1.000.000    |  |
| EEUU Dólar - USD           | 0572                        | 0             | 0578   | 0             | 0584   | 0             | 0601                                       | 0             | 0607     | 0              | 0612    | 0            | 0621                         | 0            | 0627   | 0             | 0632    | 0            |  |
| Japón Yen - JPY            | 0573                        | 0             | 0579   | 0             | 0585   | 0             | 0602                                       | 0             | 0608     | 0              | 0613    | 0            | 0622                         | 0            | 0628   | 0             | 0633    | 0            |  |
| Reino Unido Libra - GBP    | 0574                        | 0             | 0580   | 0             | 0586   | 0             | 0603                                       | 0             | 0609     | 0              | 0614    | 0            | 0623                         | 0            | 0629   | 0             | 0634    | 0            |  |
| Otras                      | 0575                        | 0             |        |               | 0587   | 0             | 0604                                       | 0             |          |                | 0615    | 0            | 0624                         | 0            |        |               | 0635    | 0            |  |
| Total                      | 0576                        | 4.471         |        |               | 0588   | 432.191       | 0605                                       | 4.530         |          |                | 0616    | 442.714      | 0625                         | 6.267        |        |               | 0636    | 1.000.000    |  |

<sup>(1)</sup> Entendiendo como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso



S.05.5

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No Periodo: 1er Trimestre Ejercicio: 2016

#### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

| CUADRO C   | Situación actual 31 |            |           | ıl 31/03/2016 |  |            | Situación cierre anual anterior 31/12/2015 |           |           |  |            | Situación inicial 30/11/2006 |           |           |  |  |
|--|---------------------|------------|-----------|---------------|--|------------|--|-----------|-----------|--|------------|------------------------------|-----------|-----------|--|--|
| Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (1) | Nº de acti          | ivos vivos | Principal | pendiente     |  | Nº de acti | vos vivos                                  | Principal | pendiente |  | Nº de acti | vos vivos                    | Principal | pendiente |  |  |
| 0% - 40%   | 1100                | 2.594      | 1110      | 177.402       |  | 1120       | 2.597                                      | 1130      | 176.973   |  | 1140       | 1.825                        | 1150      | 185.326   |  |  |
| 40% - 60%  | 1101                | 1.861      | 1111      | 251.880       |  | 1121       | 1.878                                      | 1131      | 256.423   |  | 1141       | 1.441                        | 1151      | 232.464   |  |  |
| 60% - 80%  | 1102                | 15         | 1112      | 2.717         |  | 1122       | 54   | 1132      | 9.123     |  | 1142       | 3.001                        | 1152      | 582.209   |  |  |
| 80% - 100%   | 1103                | 1          | 1113      | 191           |  | 1123       | 1  | 1133      | 194       |  | 1143       | 0                            | 1153      | 0         |  |  |
| 100% - 120%  | 1104                | 0          | 1114      | 0             |  | 1124       | 0  | 1134      | 0         |  | 1144       | 0                            | 1154      | 0         |  |  |
| 120% - 140%  | 1105                | 0          | 1115      | 0             |  | 1125       | 0  | 1135      | 0         |  | 1145       | 0                            | 1155      | 0         |  |  |
| 140% - 160%  | 1106                | 0          | 1116      | 0             |  | 1126       | 0  | 1136      | 0         |  | 1146       | 0                            | 1156      | 0         |  |  |
| superior al 160%   | 1107                | 0          | 1117      | 0             |  | 1127       | 0  | 1137      | 0         |  | 1147       | 0                            | 1157      | 0         |  |  |
| Total  | 1108                | 4.471      | 1118      | 432.190       |  | 1128       | 4.530                                      | 1138      | 442.713   |  | 1148       | 6.267                        | 1158      | 999.999   |  |  |
| Media ponderada (%)  |                     |            | 1119      | 41,31         |  |            |  | 1139      | 41,79     |  |            |                              | 1159      | 59,63     |  |  |

<sup>(1)</sup> Distribución según el valor de la razón entre el importe pendiente de amortizar de los préstamos con garantía real y la última valoración disponible de tasación de los inmuebles hipotecados, o valor razonable de otras garantías reales, siempre que el valor de las mismas se haya considerado en el momento inicial del Fondo, expresada en porcentaje



S.05.5

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No Periodo: 1er Trimestre Ejercicio: 2016

#### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

#### CUADRO D

|                                |            | Margen ponderado s/ |                     |         |  | Tipo de interés medio |      |     |      |               |  |  |
|--------------------------------|------------|---------------------|---------------------|---------|--|-----------------------|------|-----|------|---------------|--|--|
| Rendimiento índice del periodo | vivos      | F                   | Principal Pendiente |         |  | índice de referencia  |      |     |      | ponderado (2) |  |  |
| Índice de referencia (1)       | 1400       |                     | 1410                |         |  | 1420                  |      |     | 1430 |               |  |  |
| TIPO FIJO                      | 17         |                     | 2.838               |         |  | 0,29                  |      | 0,! |      | 0,56          |  |  |
| EURIBOR AÑO                    | 4.454      |                     | 429.353             |         |  | 0,45                  |      |     | 0,56 |               |  |  |
| Total                          | 1405 4.471 |                     | 1415                | 432.191 |  | 1425                  | 0,44 |     | 1435 | 0,56          |  |  |

<sup>(1)</sup> La gestora deberá cumplimentar el índice de referencia que corresponda en cada caso (EURIBOR un año, LIBRO, etc.)

<sup>(2)</sup> En el caso de tipos fijos no se cumplimentará la columna de margen ponderado y se indicará el tipo de interés medio ponderado de los activos a tipo fijo en la columna "tipo de interés medio ponderado"



S.05.5

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No Periodo: 1er Trimestre Ejercicio: 2016

#### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

| CUADRO E  |                     | Situación actu | al 31/03/201 | 6                   | Situa | Situación cierre anual anterior 31/12/2015 |      |                     |   |                     | Situación inicial 30/11/2006 |                     |           |  |
|---|---------------------|----------------|--------------|---------------------|-------|--|------|---------------------|---|---------------------|------------------------------|---------------------|-----------|--|
| Tipo de interés nominal                           | Nº de activos vivos |                | Principal    | Principal pendiente |       | Nº de activos vivos                        |      | Principal pendiente |   | Nº de activos vivos |                              | Principal pendiente |           |  |
| Inferior al 1%                                    | 1500                | 4.458          | 1521         | 430.059             | 1542  | 4.518                                      | 1563 | 440.731             | 1 | 584                 | 0                            | 1605                | 0         |  |
| 1% - 1,49%  | 1501                | 7              | 1522         | 1.411               | 1543  | 6  | 1564 | 1.237               | 1 | 585                 | 0                            | 1606                | 0         |  |
| 1,5% - 1,99%                                      | 1502                | 4              | 1523         | 403                 | 1544  | 4  | 1565 | 420                 | 1 | 586                 | 0                            | 1607                | 0         |  |
| 2% - 2,49%  | 1503                | 0              | 1524         | 0                   | 1545  | 0  | 1566 | 0                   | 1 | 587                 | 0                            | 1608                | 0         |  |
| 2,5% - 2,99%                                      | 1504                | 2              | 1525         | 317                 | 1546  | 2  | 1567 | 325                 | 1 | 588                 | 690                          | 1609                | 110.829   |  |
| 3% - 3,49%  | 1505                | 0              | 1526         | 0                   | 1547  | 0  | 1568 | 0                   | 1 | 589                 | 2.841                        | 1610                | 468.359   |  |
| 3,5% - 3,99%                                      | 1506                | 0              | 1527         | 0                   | 1548  | 0  | 1569 | 0                   | 1 | 590                 | 1.749                        | 1611                | 266.924   |  |
| 4% - 4,49%  | 1507                | 0              | 1528         | 0                   | 1549  | 0  | 1570 | 0                   | 1 | 591                 | 987                          | 1612                | 153.888   |  |
| 4,5% - 4,99%                                      | 1508                | 0              | 1529         | 0                   | 1550  | 0  | 1571 | 0                   | 1 | 592                 | 0                            | 1613                | 0         |  |
| 5% - 5,49%  | 1509                | 0              | 1530         | 0                   | 1551  | 0  | 1572 | 0                   | 1 | 593                 | 0                            | 1614                | 0         |  |
| 5,5% - 5,99%                                      | 1510                | 0              | 1531         | 0                   | 1552  | 0  | 1573 | 0                   | 1 | 594                 | 0                            | 1615                | 0         |  |
| 6% - 6,49%  | 1511                | 0              | 1532         | 0                   | 1553  | 0  | 1574 | 0                   | 1 | 595                 | 0                            | 1616                | 0         |  |
| 6,5% - 6,99%                                      | 1512                | 0              | 1533         | 0                   | 1554  | 0  | 1575 | 0                   | 1 | 596                 | 0                            | 1617                | 0         |  |
| 7% - 7,49%  | 1513                | 0              | 1534         | 0                   | 1555  | 0  | 1576 | 0                   | 1 | 597                 | 0                            | 1618                | 0         |  |
| 7,5% - 7,99%                                      | 1514                | 0              | 1535         | 0                   | 1556  | 0  | 1577 | 0                   | 1 | 598                 | 0                            | 1619                | 0         |  |
| 8% - 8,49%  | 1515                | 0              | 1536         | 0                   | 1557  | 0  | 1578 | 0                   | 1 | 599                 | 0                            | 1620                | 0         |  |
| 8,5% - 8,99%                                      | 1516                | 0              | 1537         | 0                   | 1558  | 0  | 1579 | 0                   | 1 | 600                 | 0                            | 1621                | 0         |  |
| 9% - 9,49%  | 1517                | 0              | 1538         | 0                   | 1559  | 0  | 1580 | 0                   | 1 | 601                 | 0                            | 1622                | 0         |  |
| 9,5% - 9,99%                                      | 1518                | 0              | 1539         | 0                   | 1560  | 0  | 1581 | 0                   | 1 | 602                 | 0                            | 1623                | 0         |  |
| Superior al 10%                                   | 1519                | 0              | 1540         | 0                   | 1561  | 0  | 1582 | 0                   | 1 | 603                 | 0                            | 1624                | 0         |  |
| Total   | 1520                | 4.471          | 1541         | 432.190             | 1562  | 4.530                                      | 1583 | 442.713             | 1 | 604                 | 6.267                        | 1625                | 1.000.000 |  |
| Tipo de interés medio ponderado de los activos(%) |                     |                | 9542         | 0,77                |       |  | 9584 | 0,83                |   |                     |                              | 1626                | 3,46      |  |
| Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%) |                     |                | 9543         | 0,22                |       |  | 9585 | 0,25                |   |                     |                              | 1627                | 3,84      |  |



S.05.5

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No Periodo: 1er Trimestre Ejercicio: 2016

### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

| CUADRO F  |            | Situación actual 31/03/2016 |            | Situaci | ón cierre anual anterior 31/12/2015 | Situación inicial 30/11/2006 |         |          |  |  |
|---|------------|-----------------------------|------------|---------|-------------------------------------|------------------------------|---------|----------|--|--|
| Concentración   | Porcentaje | CNAE (2)                    | Porcentaje |         | CNAE (2)                            | Porcentaje                   |         | CNAE (2) |  |  |
| Diez primeros deudores/emisores con más concentración | 2000 1,61  |                             | 2030       | 1,59    |                                     | 2060                         | 1,30    |          |  |  |
| Sector: (1)   | 2010 0,00  | 2020 0                      | 2040       | 0,00    | 2050 0                              | 2070                         | 0,00 20 | 80 0     |  |  |

<sup>(1)</sup> Indíquese denominación del sector con mayor concentración

<sup>(2)</sup> Incluir código CNAE con dos nivels de agregación



S.05.5

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No Periodo: 1er Trimestre Ejercicio: 2016

#### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

Situación inicial 30/11/2006 CUADRO G Situación actual 31/03/2016 Principal pendiente en Principal pendiente en Principal pendiente en Principal pendiente en Nº de pasivos emitidos Divisa/Pasivos emitidos por el fondo Nº de pasivos emitidos Divisa Divisa euros euros Euro - EUR 3000 15.650 3060 439.043 3110 439.043 3170 20.000 3230 1.000.000 3250 1.000.000 EEUU Dólar - USDR 3010 3070 3120 3180 3240 3260 Japón Yen - JPY 3020 3080 3130 3190 3250 3270 Reino Unido Libra - GBP 3030 3090 3140 3200 3260 3280 Otras 3040 3150 3210 3290 439.043 3050 15.650 3160 3220 20.000 3300 1.000.000 Total



|   | S.06 |
|---|------|
| Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA |      |
| Denominación del compartimento:   |      |
| Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.                             |      |
| Estados agregados: No   |      |
| Periodo: 1er Trimestre  |      |
| Ejercicio: 2016   |      |
| NOTAS EXPLICATIVAS  Contiene  Información adicional en fichero adjunto                |      |
| INFORME DE AUDITOR  |      |
|   |      |
|   |      |