

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8778
NIF Fondo: V64606262
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2019

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:
(sólo se cumplimentará en el supuesto de que se produzca el reenvío con alguna modificación de la información periódica)

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	165.678	1001	181.751
I. Activos financieros a largo plazo	0002	165.678	1002	181.751
1. Activos titulizados	0003	165.678	1003	181.751
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005		1005	
1.3 Préstamos hipotecarios	0006	156.314	1006	177.090
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	9.643	1025	5.236
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-279	1027	-575
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	

S.01

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	31.694	1041	33.792
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	11.570	1042	11.267
V. Activos financieros a corto plazo	0043	18.305	1043	18.987
1. Activos titulizados	0044	18.279	1044	18.851
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046		1046	
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	17.050	1047	18.627
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	10	1065	8
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	14	1066	17
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	1.180	1067	176
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	61	1068	49
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-36	1069	-25
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	25	1074	135
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	135
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	
3.5 Otros	0079	25	1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	69	1082	20
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	69	1084	20
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	1.751	1085	3.518
1. Tesorería	0086	1.751	1086	3.518
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	197.372	1088	215.544

S.01

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	157.174	1089	170.452
I. Provisiones a largo plazo	0090		1090	
1. Provisión garantías financieras	0091		1091	
2. Provisión por margen de intermediación	0092		1092	
3. Otras provisiones	0093		1093	
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	157.174	1094	170.452
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	148.403	1095	164.810
1.1 Series no subordinadas	0096	136.636	1096	153.643
1.2 Series subordinadas	0097	42.700	1097	42.700
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	-30.933	1098	-31.533
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101	0	1101	0
2.1 Préstamo subordinado	0102	0	1102	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105		1105	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	8.770	1108	5.643
3.1 Derivados de cobertura	0109	8.770	1109	5.643
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	
4.1 Garantías financieras	0113		1113	
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

S.01

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) PASIVO CORRIENTE	0117	48.969	1117	50.734
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	
V. Provisiones a corto plazo	0119		1119	
1. Provisión garantías financieras	0120		1120	
2. Provisión por margen de intermediación	0121		1121	
3. Otras provisiones	0122		1122	
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	48.967	1123	50.712
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	48.695	1124	50.308
1.1 Series no subordinadas	0125	48.686	1125	50.295
1.2 Series subordinadas	0126		1126	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	-4.913	1127	-4.589
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	9	1128	13
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	4.913	1129	4.589
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	0	1131	0
2.1 Préstamo subordinado	0132	412	1132	412
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	-596	1135	-584
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	0	1136	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	183	1137	171
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	231	1139	222
3.1 Derivados de cobertura	0140	231	1140	222
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	41	1143	182
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	41	1144	182
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146	1	1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	1	1148	22
1. Comisiones	0149	1	1149	1
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	1	1150	1
1.2 Comisión administrador	0151	1.750	1151	1.602
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	2.521	1153	2.521
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-4.271	1155	-4.124
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	0	1157	21
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-8.770	1158	-5.643
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-8.770	1160	-5.643
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	197.372	1162	215.544

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2019		Acumulado anterior 30/09/2018
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	813	1201	780	2201	2.076	3201	2.325
1.1 Activos titulizados	0202	813	1202	780	2202	2.076	3202	2.325
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-114	1204	-116	2204	-345	3204	-344
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-106	1205	-107	2205	-320	3205	-318
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-4	1206	-4	2206	-12	3206	-11
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-4	1207	-5	2207	-14	3207	-14
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-526	1208	-527	2208	-1.421	3208	-1.708
A) MARGEN DE INTERESES	0209	173	1209	137	2209	310	3209	273
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216	3	1216	2	2216	14	3216	6
7. Otros gastos de explotación	0217	-306	1217	-411	2217	-748	3217	-924
7.1 Servicios exteriores	0218	-160	1218	-161	2218	-382	3218	-439
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-17	1219	-11	2219	-35	3219	-56
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	-143	1222	-150	2222	-347	3222	-384
7.2 Tributos	0223	-58	1223	-195	2223	-175	3223	-356
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-88	1224	-55	2224	-191	3224	-129
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-9	1225	-10	2225	-27	3225	-30
7.3.2 Comisión administrador	0226	-70	1226	-42	2226	-147	3226	-89
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-2	1227	-2	2227	-7	3227	-7
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228		3228	
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	-7	1230	-1	2230	-10	3230	-4
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	462	1231	98	2231	254	3231	-394
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	462	1232	98	2232	254	3232	-394
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233		3233	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234	0	2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	89	1238	64	2238	288	3238	259
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-421	1239	111	2239	-118	3239	779
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241		3241	
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2019		Acumulado anterior 30/09/2018
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-227	1300	-58	2300	-181	3300	84
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	61	1301	180	2301	493	3301	673
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	530	1302	725	2302	1.920	3302	2.401
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	0	1303	-1	2303	-1	3303	-3
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	210	1304	246	2304	665	3304	746
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-675	1305	-786	2305	-2.078	3305	-2.456
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	-4	1306	-5	2306	-14	3306	-14
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-11	1309	-12	2309	-34	3309	-37
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-9	1310	-10	2310	-27	3310	-30
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-2	1312	-2	2312	-7	3312	-7
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-277	1315	-226	2315	-640	3315	-552
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	-278	1320	-251	2320	-649	3320	-625
3.6 Otros cobros de explotación	0321	1	1321	25	2321	10	3321	72
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	116	1322	-307	2322	-1.586	3322	-835
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	116	1325	-307	2325	-1.586	3325	-893
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	3.086	1326	3.485	2326	8.927	3326	10.525
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.394	1327	2.445	2327	5.212	3327	7.668
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	256	1328	194	2328	1.191	3328	556
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	489	1329	2	2329	489	3329	10
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	332	1330	243	2330	1.210	3330	525
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-5.440	1331	-6.676	2331	-18.615	3331	-20.177
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332	0	2332	0	3332	58
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336	0	2336	0	3336	58
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-111	1337	-365	2337	-1.767	3337	-751
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	1.862	1338	2.791	2338	3.518	3338	3.176
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	1.751	1339	2.426	2339	1.751	3339	2.426

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2019		Acumulado anterior 30/09/2018
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-293	1357	-91	2357	-4.549	3357	64
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-293	1358	-91	2358	-4.549	3358	64
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	526	1360	527	2360	1.421	3360	1.708
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-233	1362	-436	2362	3.128	3362	-1.772
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368		3368	
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369		3369	
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A28000727 BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2019								Situación cierre anual anterior 31/12/2018								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381		0401		0421		0441		1381		1401		1421		1441		2381		2401		2421		2441	
Préstamos hipotecarios	0382	5,88	0402	15	0422	22	0442	3,77	1382	2,69	1402	16	1422	1	1442	4,47	2382	0,62	2402	0	2422	0	2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A28000727 BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	148	0467	63	0474		0481	14	0488	77	0495	13.289	0502	1	0509	13.366
De 1 a 3 meses	0461		0468		0475		0482		0489		0496		0503		0510	
De 3 a 6 meses	0462	85	0469	70	0476		0483	22	0490	91	0497	8.838	0504		0511	8.929
De 6 a 9 meses	0463	2	0470	5	0477		0484	1	0491	6	0498	58	0505		0512	64
De 9 a 12 meses	0464	7	0471	102	0478		0485	9	0492	111	0499	529	0506		0513	639
Más de 12 meses	0465	6	0472	1.004	0479		0486	29	0493	1.033	0500	218	0507		0514	1.251
Total	0466	248	0473	1.243	0480		0487	75	0494	1.318	0501	22.932	0508	1	1515	24.251

Impagados con garantía real (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total		Valor garantía		Valor Garantía con Tasación > 2 años		% Deuda / v. Tasación	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total													
Hasta 1 mes	0515	148	0522	63	0529		0536	14	0543	77	0550	13.289	0557	1	0564	13.366	0571	38.469	0578	38.469	0584	34,75
De 1 a 3 meses	0516		0523		0530		0537		0544		0551		0558		0565		0572		0579		0585	
De 3 a 6 meses	0517	85	0524	70	0531		0538	22	0545	91	0552	8.838	0559		0566	8.929	0573	24.907	0580	24.907	0586	35,85
De 6 a 9 meses	0518	2	0525	5	0532		0539	1	0546	6	0553	58	0560		0567	64	0574	366	0581	366	0587	17,62
De 9 a 12 meses	0519	7	0526	102	0533		0540	9	0547	111	0554	529	0561		0568	639	0575	1.877	0582	1.877	0588	34,06
Más de 12 meses	0520	6	0527	1.004	0534		0541	29	0548	1.033	0555	218	0562		0569	1.251	0576	2.328	0583	2.328	0589	53,76
Total	0521	248	0528	1.243	0535		0542	75	0549	1.318	0556	22.932	0563	1	0570	24.251	0577	67.947			0590	35,69

S.05.1

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A28000727 BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 21/06/2007	
Inferior a 1 año	0600	1.223	1600	177	2600	270
Entre 1 y 2 años	0601	2.838	1601	431	2601	314
Entre 2 y 3 años	0602	814	1602	4.716	2602	265
Entre 3 y 4 años	0603	851	1603	597	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	1.882	1604	1.204	2604	857
Entre 5 y 10 años	0605	14.197	1605	15.652	2605	28.835
Superior a 10 años	0606	162.383	1606	178.353	2606	669.459
Total	0607	184.188	1607	201.128	2607	700.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	16,12	1608	16,72	2608	24,55

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 21/06/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	13,42	1609	12,67	2609	2,73

S.05.1
Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2019
Entidades cedentes de los activos titulizados: A28000727 BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 21/06/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.364	0630	84.004	1620	1.337	1630	82.293	2620	844	2630	86.252
40% - 60%	0621	740	0631	88.861	1621	776	1631	95.394	2621	1.009	2631	164.209
60% - 80%	0622	90	0632	11.246	1622	166	1632	21.740	2622	2.238	2632	392.368
80% - 100%	0623		0633		1623	5	1633	894	2623	288	2633	57.171
100% - 120%	0624		0634		1624	2	1634	398	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625		0635		1625	2	1635	148	2625		2635	
140% - 160%	0626	1	0636	77	1626	1	1636	82	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627	2	1637	180	2627	0	2637	0
Total	0628	2.195	0638	184.188	1628	2.291	1638	201.128	2628	4.379	2638	700.000
Media ponderada (%)	0639	40,34	0649		1639	42,58	1649		2639	63,71	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A28000727 BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 21/06/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	1,17	1650	1,22	2650	4,28
Tipo de interés nominal máximo	0651	5,25	1651	5,25	2651	6,80
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,05	1652	0,02	2652	2,85

S.05.1

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A28000727 BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 21/06/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	227	0683	17.225	1660	240	1683	19.162	2660	614	2683	97.316
Aragón	0661	21	0684	1.156	1661	22	1684	1.380	2661	53	2684	7.110
Asturias	0662	90	0685	5.151	1662	91	1685	5.453	2662	154	2685	18.144
Baleares	0663	32	0686	3.310	1663	33	1686	3.655	2663	56	2686	9.519
Canarias	0664	68	0687	5.594	1664	69	1687	5.894	2664	127	2687	16.765
Cantabria	0665	17	0688	1.217	1665	18	1688	1.424	2665	33	2688	4.484
Castilla-León	0666	111	0689	6.122	1666	115	1689	6.687	2666	197	2689	25.221
Castilla La Mancha	0667	54	0690	4.223	1667	55	1690	4.525	2667	102	2690	15.088
Cataluña	0668	460	0691	52.412	1668	484	1691	56.793	2668	863	2691	166.892
Ceuta	0669	2	0692	369	1669	2	1692	385	2669	1	2692	296
Extremadura	0670	30	0693	1.481	1670	32	1693	1.684	2670	59	2693	6.014
Galicia	0671	454	0694	28.092	1671	469	1694	30.602	2671	817	2694	97.501
Madrid	0672	353	0695	34.548	1672	374	1695	38.225	2672	693	2695	134.630
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673		2696	
Murcia	0674	45	0697	3.358	1674	48	1697	3.651	2674	124	2697	20.582
Navarra	0675	7	0698	578	1675	7	1698	690	2675	7	2698	1.925
La Rioja	0676	2	0699	108	1676	2	1699	123	2676	7	2699	875
Comunidad Valenciana	0677	163	0700	13.177	1677	168	1700	14.149	2677	349	2700	53.581
País Vasco	0678	59	0701	6.066	1678	63	1701	6.649	2678	123	2701	24.057
Total España	0679	2.195	0702	184.188	1679	2.292	1702	201.128	2679	4.379	2702	700.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680		2703	
Resto	0681		0704		1681		1704		2681		2704	
Total general	0682	2.195	0705	184.188	1682	2.292	1705	201.128	2682	4.379	2705	700.000

S.05.1
Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2019
Entidades cedentes de los activos titulizados: A28000727 BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 21/06/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	3,09			1710	2,93			2710	2,04		
Sector	0711	33,75	0712	29	1711	32,89	1712	29	2711	0	2712	

S.05.2

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2019			Situación cierre anual anterior 31/12/2018			Situación inicial 21/06/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0332235011	A2	4.928	37.606	185.322	4.928	41.383	203.937	4.928	100.000	492.800			
ES0332235029	B	249	100.000	24.900	249	100.000	24.900	249	100.000	24.900			
ES0332235003	A1	1.750	0	0	1.750	0	0	1.750	100.000	175.000			
ES0332235037	C	73	100.000	7.300	73	100.000	7.300	73	100.000	7.300			
ES0332235045	D	105	100.000	10.500	105	100.000	10.500	105	100.000	10.500			
Total		0723	7.105	0724	228.022	1723	7.105	1724	246.637	2723	7.105	2724	710.500

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado	0738	0739					
			0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736			0737				
ES0332235003	A1	NS	EURIBOR 3 MESES	0,05	0	0	0	SI	0	0	0						
ES0332235011	A2	S	EURIBOR 3 MESES	0,17	0	0	0	SI	153.623	31.699	185.322						
ES0332235029	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,35	0,01	0	11	SI	24.900	0	24.911	-13.135					
ES0332235037	C	S	EURIBOR 3 MESES	0,70	0,36	0	249	SI	7.300	0	7.550	-7.550					
ES0332235045	D	S	EURIBOR 3 MESES	4	3,66	8	4.653	SI	10.500	0	15.161	-15.161					
Total						0740	9	0741	4.913	0743	196.323	0744	31.699	0745	232.944	0746	-35.846

	Situación actual 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 21/06/2007		
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,18	0748	0,17	0749

S.05.2
Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2019
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2019								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2018							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0332235003	A1		175.000		10.280		175.000		10.280								
ES0332235011	A2	5.440	307.478	0	63.681	6.676	282.822	0	63.681								
ES0332235029	B	0	0	0	3.822	0	0	1	3.822								
ES0332235037	C	0	0	0	1.189	0	0	0	1.189								
ES0332235045	D	0	0	0	1.719	0	0	0	1.719								
Total		0754	5.440	0755	482.478	0756	0	0757	80.691	1754	6.676	1755	457.822	1756	1	1757	80.691

S.05.2

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 21/06/2007
				0762	0763	0764
ES0332235003	A1	26/06/2007	SYP	AAA	AAA	
ES0332235011	A2	22/10/2015	MDY	B1	B1	
ES0332235003	A1	26/06/2007	MDY	Aaa	Aaa	
ES0332235011	A2	02/05/2018	SYP	B+	B+	
ES0332235029	B	26/11/2012	MDY	Ca	Ca	
ES0332235029	B	31/08/2018	SYP	D	D	
ES0332235037	C	26/11/2012	MDY	C	C	
ES0332235037	C	21/01/2014	SYP	D	D	
ES0332235045	D	18/05/2011	MDY	C	C	
ES0332235045	D	16/09/2010	SYP	D	D	

S.05.2
Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2019
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 21/06/2007	
Inferior a 1 año	0765	0	1765	0	2765	175.000
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	
Entre 2 y 3 años	0767	0	1767	203.937	2767	
Entre 3 y 4 años	0768	185.322	1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769	
Entre 5 y 10 años	0770	42.700	1770	42.700	2770	535.500
Superior a 10 años	0771		1771	0	2771	
Total	0772	228.022	1772	246.637	2772	710.500
Vida residual media ponderada (años)	0773	3,96	1773	0	2773	4,66

S.05.3

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo		Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 21/06/2007	
1	Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	0	1775	0	2775	10.500
1.1	Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	10.500	1776	10.500	2776	10.500
1.2	Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	0	1777	0	2777	1
1.3	Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	
1.4	Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	
1.5	Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	
2	Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	
2.1	Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	
2.2	Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783	Notas Explicativas	2783	
2.3	Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	
2.4	Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3	Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	
3.1	Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	
3.2	Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3	Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4	Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	
4	Subordinación de series (S/N)	0791	N	1791	N	2791	S
4.1	Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	0	1792	0	2792	24,63
5	Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1	Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2	Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3	Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 21/06/2007	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Permuta 1	CAIXABANK	Trimestral	Será igual a los cobros por intereses de los Préstamos recibidos por el Fondo e ingresados en la Cuenta de Tesorería durante el Período de Liquidación de la Parte A, entre el Importe Nominal, multiplicado por 360 y dividido por los días efectivos existentes en dicho Período de Liquidación	En cada Fecha de Liquidación será el saldo medio diario de los Préstamos Hipotecarios que se encuentran al corriente de pago durante los tres meses naturales anteriores a dicha Fecha de Liquidación. A efectos del cálculo del saldo medio diario de los Préstamos Hipotecarios se tendrá en cuenta las fecha con la que el banco Pastor recibe los pagos de los deudores de dichos préstamos y no el del abono por parte del banco al fondo.	Será para cada periodo de Liquidación de la Parte B del tipo de Interés Nominal Medio Ponderado de los Bonos, excluida la Serie D, más un margen del 0,60% .	En cada Fecha de Liquidación será el saldo medio diario de los Préstamos Hipotecarios que se encuentran al corriente de pago durante los tres meses naturales anteriores a dicha Fecha de Liquidación. A efectos del cálculo del saldo medio diario de los Préstamos Hipotecarios se tendrá en cuenta las fecha con la que el banco Pastor recibe los pagos de los deudores de dichos préstamos y no el del abono por parte del banco al fondo.	-9.001	-5.865	-23.141	
Total							0808 -9.001	0809 -5.865	0810 -23.141	

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 21/06/2007		Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 21/06/2007			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
	Situación actual 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación actual 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación actual 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Última Fecha Pago									
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	29.493	7006	24.557	7009	18,72	7012	17,42	7015	18,78		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	29.493	7008	24.557	7011	18,72	7014	17,42	7017	18,78	7018	FOLLETO INFORMATIVO (PAG 168)
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	27.171	7024	24.330	7027	12,26	7030	15,16	7033	11,36		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	1.081	7025	2	7028	2,38	7031	0,84	7034	3,08		
Total Fallidos					7023	28.252	7026	24.332	7029	14,64	7032	16	7035	14,44	7036	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES 4.9.3. (PAG 50)

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Última Fecha Pago		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
3. Que en la fecha de determinación anterior a la fecha de pago correspondiente, el importe del saldo vivo de los préstamos hipotecarios sea igual o superior al 10 por 100 del saldo inicial de los mismos en la fecha de constitución del fondo.	10	26,56	26,55	FOLLETO INFORMATIVO. APARTADO 4.9.4
2. Que el saldo vivo de los préstamos hipotecarios dudosos no exceda del 1,25% del saldo vivo pendientes de los préstamos hipotecarios.	1,25	19,24	19,25	FOLLETO INFORMATIVO. APARTADO 4.9.4
2. Que el saldo vivo de los préstamos hipotecarios dudosos no exceda del 1% del saldo vivo pendiente de los préstamos hipotecarios.	1	19,24	19,25	FOLLETO INFORMATIVO. APARTADO 4.9.4 (pag. 53)
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Se procederá al postergamiento de este pago al (vii) lugar en el caso de que en la Fecha de Pago correspondiente el saldo vivo pendiente acumulado de los préstamos hipotecarios fallidos fuera superior al 10% del importe inicial de la emisión de bonos, exc	10	5,96	10,38	Folleto Informativo Pag 121
Se procederá al postergamiento de este pago al (viii) lugar en el caso de que en la Fecha de Pago correspondiente el saldo vivo pendiente acumulado de los préstamos hipotecarios fallidos fuera superior al 6,70% del importe inicial de la emisión de bonos,	6,70	5,96	10,38	Folleto Informativo pag 121
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
- En la fecha de determinación anterior a la fecha de pago correspondiente, el saldo vivo pendiente de los préstamos hipotecarios no fallidos con impago igual o superior a 90 días sea mayor al 1% del saldo vivo pendiente de los préstamos hipotecarios no f	1	16,46	15,25	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL A LA NOTA DE VALORES. APARTADO 3.4.2.2.
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

S.05.5

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	1862	0	2862	Días del mes /Base 360	3862	0,010	4862	0	5862	0	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	BANCO PASTOR, S.A.	1863	0	2863		3863	0,020	4863	0	5863	0	6863	Trimestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BNP PARIBAS ESPAÑA, S.A. BNP PARIBAS ESPAÑA, S.A.	1864	2	2864		3864	0	4864	0	5864	0	6864	Trimestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	S
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	N
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	BANCO POPULAR
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo adicional 3.4.8

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo											Total		
		31/03/2019	30/06/2019	30/09/2019											
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872														
Margen de intereses	0873	100	37	173											310
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	547	-755	462											254
Dotaciones a provisiones (neto)	0875		0	0											0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876	108	91	89											288
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-240	-191	-303											-734
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	516	-818	421	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	118
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879														0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880	-516		-421											-936
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881														0
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	0	818	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	818
Comisión variable pagada	0883														0
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884														0

S.05.5

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

S.06

Denominación Fondo: GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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