

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A.
Número de registro del Fondo: 8715
NIF Fondo: V85076677
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: SI
Fecha: 31/12/2019

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)

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2019		Periodo anterior 31/12/2018
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	1.318.512	1001	1.454.075
I. Activos financieros a largo plazo	0002	1.318.512	1002	1.454.075
1. Activos titulizados	0003	1.318.512	1003	1.454.075
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	1.314.438	1005	1.450.296
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	17.939	1025	21.094
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-13.865	1027	-17.315
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	304.869	1041	321.220
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	159.487	1043	173.418
1. Activos titulizados	0044	159.487	1044	173.418
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	155.100	1046	167.767
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	0
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	392	1065	454
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	38	1066	39
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	21.398	1067	28.939
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	105	1068	145
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-17.547	1069	-23.926
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	20	1082	17
1. Comisiones	0083	20	1083	17
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	145.362	1085	147.784
1. Tesorería	0086	145.362	1086	147.784
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	1.623.381	1088	1.775.295

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2019		Periodo anterior 31/12/2018
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	1.415.136	1089	1.554.731
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	1.415.136	1094	1.554.731
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	1.322.699	1095	1.459.678
1.1 Series no subordinadas	0096	1.034.299	1096	1.173.136
1.2 Series subordinadas	0097	288.400	1097	286.541
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	0
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	86.850	1101	87.723
2.1 Préstamo subordinado	0102	133.488	1102	133.488
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	-46.638	1105	-45.766
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	3.156	1108	3.903
3.1 Derivados de cobertura	0109	3.156	1109	3.903
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	2.432	1112	3.428
4.1 Garantías financieras	0113	2.432	1113	3.428
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: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) PASIVO CORRIENTE	0117	211.401	1117	224.467
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	211.295	1123	224.325
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	191.762	1124	205.104
1.1 Series no subordinadas	0125	188.698	1125	199.927
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	1.859
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	3.064	1128	3.319
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	19.319	1131	19.067
2.1 Préstamo subordinado	0132	847	1132	847
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		1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	443	1136	462
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	18.029	1137	17.759
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	170	1139	148
3.1 Derivados de cobertura	0140	170	1140	148
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	44	1143	4
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	44	1144	4
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	106	1148	143
1. Comisiones	0149	58	1149	55
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	45	1150	46
1.2 Comisión administrador	0151	1.737	1151	1.574
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	7	1152	9
1.4 Comisión variable	0153	3.870	1153	3.870
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-5.602	1155	-5.444
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	49	1157	87
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-3.156	1158	-3.903
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-3.156	1160	-3.903
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	1.623.381	1162	1.775.295

S.02

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2019

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2019		Acumulado anterior 31/12/2018
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	3.477	1201	4.968	2201	11.687	3201	17.485
1.1 Activos titulizados	0202	3.477	1202	4.968	2202	11.687	3202	17.485
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203		3203	
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-5.220	1204	-5.738	2204	-21.497	3204	-23.590
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-4.571	1205	-5.041	2205	-18.842	3205	-20.764
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-649	1206	-697	2206	-2.655	3206	-2.826
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-178	1208	-195	2208	-552	3208	-1.960
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-1.921	1209	-965	2209	-10.362	3209	-8.065
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	0	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-135	1217	-1.751	2217	-498	3217	-2.351
7.1 Servicios exteriores	0218	-23	1218	-12	2218	-26	3218	-15
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-7	1219	-26	2219	-9	3219	-29
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	-16	1222	14	2222	-17	3222	14
7.2 Tributos	0223	-1	1223	-1	2223	-2	3223	-2
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-111	1224	-1.738	2224	-469	3224	-2.334
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-62	1225	-112	2225	-249	3225	-347
7.3.2 Comisión administrador	0226	-34	1226	-45	2226	-158	3226	-192
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-10	1227	-13	2227	-48	3227	-50
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	-1.482	2228		3228	-1.638
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	-4	1230	-86	2230	-15	3230	-108
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	5.917	1231	11.210	2231	9.829	3231	20.795
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	5.917	1232	11.210	2232	9.829	3232	20.795
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	0	1238	0	2238		3238	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-3.861	1239	-8.493	2239	1.031	3239	-10.380
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

S.03

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2019

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2019		Acumulado anterior 31/12/2018
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-2.678	1300	-11.796	2300	-11.615	3300	-15.519
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-2.475	1301	-7.451	2301	-10.241	3301	-10.935
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	3.566	1302	5.211	2302	11.790	3302	17.854
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-5.939	1303	-6.623	2303	-19.097	3303	-21.184
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	134	1304	357	2304	552	3304	1.020
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-236	1305	-1.175	2305	-1.083	3305	-3.380
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	-5.221	2307	-2.404	3307	-5.244
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-76	1309	-3.299	2309	-295	3309	-3.615
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-63	1310	-130	2310	-245	3310	-346
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	-97	2311	0	3311	-99
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-13	1312	-13	2312	-50	3312	-50
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	-3.058	2313	0	3313	-3.119
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	-1	2314	0	3314	-2
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-128	1315	-1.046	2315	-1.078	3315	-969
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	-153	1320	-1.059	2320	-1.118	3320	-984
3.6 Otros cobros de explotación	0321	25	1321	12	2321	40	3321	15
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	9.986	1322	1.375	2322	9.195	3322	6.439
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulación	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	9.944	1325	9.995	2325	9.153	3325	15.059
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	21.800	1326	23.134	2326	86.621	3326	93.321
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	20.094	1327	137.682	2327	57.858	3327	177.382
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	5.871	1328	8.326	2328	14.741	3328	28.120
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-37.821	1331	-159.146	2331	-150.066	3331	-283.764
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	42	1332	-8.620	2332	42	3332	-8.620
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	-8.620	2334	0	3334	-8.620
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	42	1336	0	2336	42	3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	7.308	1337	-10.421	2337	-2.420	3337	-9.080
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	138.054	1338	158.206	2338	147.781	3338	156.864
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	145.362	1339	147.784	2339	145.362	3339	147.784

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2019

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2019		Acumulado anterior 31/12/2018
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	369	1357	1.524	2357	196	3357	1.190
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	369	1358	1.524	2358	196	3358	1.190
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	178	1360	195	2360	552	3360	1.960
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-547	1362	-1.720	2362	-748	3362	-3.150
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: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86201993 LIBERBANK, S.A. | A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2019								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	2,61	0401	0	0421	0	0441	3,59	1381	3,40	1401	0	1421	0	1441	3,11	2381	12,23	2401	2,14	2421	0	2441	0
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382	0	2402	0	2422	0	2442	0
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383	0	2403	0	2423	0	2443	0
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384	0	2404	0	2424	0	2444	0
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385	0	2405	0	2425	0	2445	0
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386	0	2406	0	2426	0	2446	0
Prestamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387	0	2407	0	2427	0	2447	0
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388	0	2408	0	2428	0	2448	0
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389	0	2409	0	2429	0	2449	0
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390	0	2410	0	2430	0	2450	0
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391	0	2411	0	2431	0	2451	0
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392	0	2412	0	2432	0	2452	0
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393	0	2413	0	2433	0	2453	0
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394	0	2414	0	2434	0	2454	0
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395	0	2415	0	2435	0	2455	0
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396	0	2416	0	2436	0	2456	0
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397	0	2417	0	2437	0	2457	0
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398	0	2418	0	2438	0	2458	0
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399	0	2419	0	2439	0	2459	0

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86201993 LIBERBANK, S.A. | A95653077 KUTXABANK

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	386	0467	121	0474	13	0481	0	0488	135	0495	37.130	0502	10	0509	37.274
De 1 a 3 meses	0461	205	0468	190	0475	26	0482	-1	0489	216	0496	20.265	0503	7	0510	20.487
De 3 a 6 meses	0462	27	0469	53	0476	2	0483	2	0490	57	0497	2.639	0504	0	0511	2.696
De 6 a 9 meses	0463	23	0470	58	0477	4	0484	8	0491	70	0498	2.274	0505	0	0512	2.344
De 9 a 12 meses	0464	11	0471	40	0478	1	0485	3	0492	44	0499	989	0506	0	0513	1.033
Más de 12 meses	0465	284	0472	21.245	0479	98	0486	1.027	0493	22.371	0500	11.974	0507	0	0514	34.345
Total	0466	936	0473	21.709	0480	144	0487	1.040	0494	22.892	0501	75.271	0508	17	1515	98.180

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	386	0522	121	0529	13	0536	0	0543	135	0550	37.130	0557	10	0564	37.274	0571	68.193	0578	29.169	0584	54,66
De 1 a 3 meses	0516	205	0523	190	0530	26	0537	-1	0544	216	0551	20.265	0558	7	0565	20.487	0572	36.623	0579	18.652	0585	55,94
De 3 a 6 meses	0517	27	0524	53	0531	2	0538	2	0545	57	0552	2.639	0559	0	0566	2.696	0573	4.871	0580	772	0586	55,34
De 6 a 9 meses	0518	23	0525	58	0532	4	0539	8	0546	70	0553	2.274	0560	0	0567	2.344	0574	3.863	0581	1.430	0587	60,68
De 9 a 12 meses	0519	11	0526	40	0533	1	0540	3	0547	44	0554	989	0561	0	0568	1.033	0575	1.861	0582	708	0588	55,52
Más de 12 meses	0520	284	0527	21.245	0534	98	0541	1.027	0548	22.371	0555	11.974	0562	0	0569	34.345	0576	53.053	0583	17.814	0589	64,74
Total	0521	936	0528	21.709	0535	144	0542	1.040	0549	22.892	0556	75.271	0563	17	0570	98.180	0577	168.465			0590	58,28

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86201993 LIBERBANK, S.A. | A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 19/04/2007	
Inferior a 1 año	0600	814	1600	746	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	1.751	1601	1.421	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	2.924	1602	2.908	2602	31
Entre 3 y 4 años	0603	6.347	1603	4.383	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	9.141	1604	8.302	2604	670
Entre 5 y 10 años	0605	92.423	1605	88.250	2605	11.672
Superior a 10 años	0606	1.395.476	1606	1.562.087	2606	7.321.426
Total	0607	1.508.876	1607	1.668.096	2607	7.333.799
Vida residual media ponderada (años)	0608	16,65	1608	17,47	2608	

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 19/04/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	15,40	1609	14,32	2609	

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 31/12/2019
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86201993 LIBERBANK, S.A. A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 19/04/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	5.445	0630	237.465	1620	4.624	1630	198.322	2620	3.720	2630	359.538
40% - 60%	0621	8.295	0631	751.051	1621	8.404	1631	757.282	2621	3.443	2631	373.552
60% - 80%	0622	3.714	0632	487.510	1622	4.938	1632	638.837	2622	19.547	2632	2.634.917
80% - 100%	0623	176	0633	29.298	1623	407	1633	69.558	2623	25.490	2633	3.965.792
100% - 120%	0624	10	0634	1.294	1624	12	1634	1.568	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625	9	0635	1.073	1625	4	1635	476	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	1	0636	122	1626	6	1636	867	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	9	0637	1.062	1627	10	1637	1.187	2627	0	2637	0
Total	0628	17.659	0638	1.508.876	1628	18.405	1638	1.668.096	2628	52.200	2638	7.333.799
Media ponderada (%)	0639	54,28	0649		1639	56,49	1649		2639		2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86201993 LIBERBANK, S.A. | A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 19/04/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,60	1650	0,66	2650	4,98
Tipo de interés nominal máximo	0651	11,93	1651	6,50	2651	8,37
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,01	1652	0,06	2652	2,25

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 31/12/2019
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86201993 LIBERBANK, S.A. A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 19/04/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	95	0683	9.471	1660	99	1683	10.392	2660	5.902	2683	748.521
Aragón	0661	292	0684	24.861	1661	304	1684	27.567	2661	779	2684	110.741
Asturias	0662	15	0685	1.318	1662	18	1685	1.447	2662	478	2685	57.694
Baleares	0663	4	0686	389	1663	4	1686	415	2663	1.528	2686	143.445
Canarias	0664	3	0687	135	1664	4	1687	228	2664	388	2687	50.490
Cantabria	0665	2.076	0688	163.699	1665	2.149	1688	179.655	2665	2.771	2688	373.605
Castilla-León	0666	349	0689	28.883	1666	361	1689	31.645	2666	2.063	2689	254.764
Castilla La Mancha	0667	2.901	0690	257.271	1667	3.001	1690	280.099	2667	4.412	2690	624.352
Cataluña	0668	149	0691	15.559	1668	156	1691	17.285	2668	3.745	2691	681.862
Ceuta	0669	0	0692	0	1669	0	1692	0	2669	1	2692	235
Extremadura	0670	7	0693	371	1670	7	1693	398	2670	348	2693	40.333
Galicia	0671	94	0694	9.741	1671	98	1694	10.966	2671	5.673	2694	601.415
Madrid	0672	2.692	0695	274.723	1672	2.827	1695	303.898	2672	5.635	2695	962.504
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	25	2696	2.736
Murcia	0674	97	0697	9.208	1674	105	1697	10.550	2674	393	2697	53.582
Navarra	0675	35	0698	3.703	1675	36	1698	4.117	2675	673	2698	107.854
La Rioja	0676	244	0699	20.355	1676	251	1699	22.600	2676	1.996	2699	267.238
Comunidad Valenciana	0677	1.085	0700	94.026	1677	1.131	1700	104.267	2677	3.587	2700	500.959
País Vasco	0678	7.520	0701	594.970	1678	7.852	1701	662.268	2678	11.799	2701	1.750.756
Total España	0679	17.658	0702	1.508.683	1679	18.403	1702	1.667.799	2679	52.196	2702	7.333.086
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	1	0704	193	1681	2	1704	297	2681	4	2704	713
Total general	0682	17.659	0705	1.508.876	1682	18.405	1705	1.668.096	2682	52.200	2705	7.333.799

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 31/12/2019
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86201993 LIBERBANK, S.A. A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 19/04/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,28			1710	0,27			2710	16,29		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/12/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2019			Situación cierre anual anterior 31/12/2018			Situación inicial 19/04/2007		
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722
ES0312273008	A	13.912	37.925	527.612	13.912	42.316	588.701	13.912	100.000	1.391.200
ES0312273016	B	810	100.000	81.000	810	100.000	81.000	810	100.000	81.000
ES0312273024	C	135	100.000	13.500	135	100.000	13.500	135	100.000	13.500
ES0312273032	D	143	100.000	14.300	143	100.000	14.300	143	100.000	14.300
ES0312273081	A	1.753	38.967	68.309	1.753	43.664	76.543	1.753	100.000	175.300
ES0312273099	B	126	100.000	12.600	126	100.000	12.600	126	100.000	12.600
ES0312273107	C	82	100.000	8.200	82	100.000	8.200	82	100.000	8.200
ES0312273115	D	38	100.000	3.800	38	100.000	3.800	38	100.000	3.800
ES0312273248	A	7.160	32.800	234.851	7.160	36.518	261.470	7.160	100.000	716.000
ES0312273255	B	456	100.000	45.600	456	100.000	45.600	456	100.000	45.600
ES0312273263	C	280	100.000	28.000	280	100.000	28.000	280	100.000	28.000
ES0312273271	D	104	100.000	10.400	104	100.000	10.400	104	100.000	10.400
ES0312273362	A	9.555	32.399	309.568	9.555	37.017	353.698	9.555	100.000	955.500
ES0312273370	B	305	100.000	30.500	305	100.000	30.500	305	100.000	30.500
ES0312273388	C	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000
ES0312273396	D	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000
ES0312273446	A	2.035	40.617	82.656	2.035	45.528	92.650	2.035	100.000	203.500
ES0312273453	B	127	100.000	12.700	127	100.000	12.700	127	100.000	12.700
ES0312273461	C	103	100.000	10.300	103	100.000	10.300	103	100.000	10.300
ES0312273479	D	35	100.000	3.500	35	100.000	3.500	35	100.000	3.500
ES0312273156	D							11	100.000	1.100
ES0312273149	C							31	100.000	3.100
ES0312273131	B							74	100.000	7.400
ES0312273123	A							974	100.000	97.400
ES0312273164	A							3.691	100.000	369.100
ES0312273198	D							48	100.000	4.800

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

ES0312273180	C											80	100.000	8.000		
ES0312273172	B											180	100.000	18.000		
ES0312273313	D											153	100.000	15.300		
ES0312273305	C											216	100.000	21.600		
ES0312273297	B											369	100.000	36.900		
ES0312273289	A											8.262	100.000	826.200		
ES0312273438	D											124	100.000	12.400		
ES0312273420	C											380	100.000	38.000		
ES0312273412	B											446	100.000	44.600		
ES0312273404	A											8.550	100.000	855.000		
ES0312273511	D											60	100.000	6.000		
ES0312273503	C											51	100.000	5.100		
ES0312273495	B											135	100.000	13.500		
ES0312273487	A											1.454	100.000	145.400		
ES0312273040	A											898	100.000	89.800		
ES0312273057	B											56	100.000	5.600		
ES0312273065	C											41	100.000	4.100		
ES0312273073	D											5	100.000	500		
ES0312273206	A											4.375	100.000	437.500		
ES0312273214	B											450	100.000	45.000		
ES0312273222	C											110	100.000	11.000		
ES0312273230	D											65	100.000	6.500		
ES0312273321	A											1.350	100.000	135.000		
ES0312273339	B											63	100.000	6.300		
ES0312273347	C											51	100.000	5.100		
ES0312273354	D											36	100.000	3.600		
ES0312273529	A											1.622	100.000	162.200		
ES0312273537	B											170	100.000	17.000		
ES0312273545	C											160	100.000	16.000		
ES0312273552	D											48	100.000	4.800		
ES0312273560	A											1.112	100.000	111.200		
ES0312273578	B											63	100.000	6.300		
ES0312273586	C											50	100.000	5.000		
ES0312273594	D											25	100.000	2.500		
Total		0723	37.299		0724	1.511.397	1723	37.299		1724	1.661.463	2723	73.338		2724	7.333.800

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/12/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos:

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
ES0312273008	A	NS	FIJO	0	1,17	1.691	0	SI	527.612	0	529.303			
ES0312273016	B	S	FIJO	0	1,30	288	0	SI	81.000	0	81.288			
ES0312273024	C	S	FIJO	0	1,65	61	0	SI	13.500	0	13.561			
ES0312273032	D	S	FIJO	0	3	118	0	SI	14.300	0	14.418			
ES0312273081	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,17	0	0	0	SI	68.309	0	68.309			
ES0312273099	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,30	0,07	0	0	SI	12.600	0	12.600			
ES0312273107	C	S	EURIBOR 6 MESES	0,65	0,42	3	0	SI	8.200	0	8.203			
ES0312273115	D	S	EURIBOR 6 MESES	2	1,77	8	0	SI	3.800	0	3.808			
ES0312273248	A	NS	FIJO	0	1,30	284	0	SI	234.851	0	235.136			
ES0312273255	B	S	FIJO	0	1,60	68	0	SI	45.600	0	45.668			
ES0312273263	C	S	FIJO	0	2,50	65	0	SI	28.000	0	28.065			
ES0312273271	D	S	FIJO	0	3,50	34	0	SI	10.400	0	10.434			
ES0312273362	A	NS	FIJO	0	1,30	331	0	SI	309.568	0	309.899			
ES0312273370	B	S	FIJO	0	1,60	40	0	SI	30.500	0	30.540			
ES0312273388	C	S	FIJO	0	2	12	0	SI	7.000	0	7.012			
ES0312273396	D	S	FIJO	0	3	17	0	SI	7.000	0	7.017			
ES0312273446	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,30	0,07	0	0	SI	82.656	0	82.656			
ES0312273453	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,60	0,37	8	0	SI	12.700	0	12.708			
ES0312273461	C	S	EURIBOR 6 MESES	1	0,77	19	0	SI	10.300	0	10.319			
ES0312273479	D	S	EURIBOR 6 MESES	2	1,77	16	0	SI	3.500	0	3.516			
Total						0740	3.064	0741	0743	1.511.397	0744	0745	1.514.461	0746

	Situación actual 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 19/04/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	1,19	0748	1,18	0749	4,77

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/12/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2019				Situación periodo comparativo anterior 31/12/2018			
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
ES0312273446	A		120.844		21.270		110.850		21.224
ES0312273453	B		0		1.947		0		1.901
ES0312273461	C		0		2.047		0		1.968
ES0312273479	D		0		1.093		0		1.031
ES0312273123	A		97.400		12.067	29.367	97.400	0	12.067
ES0312273131	B		7.400		1.225	5.479	7.400	1	1.225
ES0312273149	C		3.100		632	2.297	3.100	4	632
ES0312273156	D		1.100		392	816	1.100	7	392
ES0312273016	B		0	101	19.670		0	102	18.619
ES0312273024	C		0	21	3.869		0	22	3.647
ES0312273008	A		793.241	627	243.781		732.151	700	231.102
ES0312273032	D		0	41	6.296		0	42	5.868
ES0312273362	A	20.361	645.932	2.139	137.649	21.166	601.802	2.430	133.217
ES0312273370	B	0	0	243	7.377	0	0	243	6.890
ES0312273388	C	0	0	70	2.035	0	0	70	1.896
ES0312273396	D	0	0	105	2.891	0	0	105	2.681
ES0312273081	A	3.556	106.991	0	23.871	4.902	98.757	0	23.871
ES0312273099	B	0	0	4	2.102	0	0	2	2.095
ES0312273107	C	0	0	18	1.726	0	0	16	1.692
ES0312273115	D	0	0	35	1.441	0	0	34	1.373
ES0312273164	A		369.100		42.626	50.056	369.100	0	42.626
ES0312273172	B		18.000		3.290	18.000	18.000	30	3.290
ES0312273180	C		8.000		2.261	8.000	8.000	50	2.261
ES0312273198	D		4.800		1.890	4.800	4.800	54	1.890
ES0312273255	B	0	0	368	11.387	0	0	368	10.657

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

ES0312273263	C		0	0	353	10.014	0	0	353	9.314							
ES0312273271	D		0	0	183	4.967	0	0	183	4.603							
ES0312273248	A	13.904	481.149	1.630	110.348	14.263	454.530	1.807	107.033								
ES0312273289	A		477.571		88.463		477.571		88.463								
ES0312273297	B		0		5.963		0		5.963								
ES0312273305	C		0		4.310		0		4.310								
ES0312273313	D		0		4.505		0		4.505								
ES0312273412	B		0		6.759		0		6.759								
ES0312273420	C		0		7.197		0		7.197								
ES0312273404	A		534.620		79.662		534.620		79.662								
ES0312273438	D		0		3.522		0		3.522								
ES0312273487	A		145.400		13.362		145.400		13.362								
ES0312273495	B		13.500		1.885		13.500		1.885								
ES0312273503	C		5.100		877		5.100		877								
ES0312273511	D		6.000		1.517		6.000		1.517								
Total		0754	37.821	0755	3.839.247	0756	5.939	0757	898.186	1754	159.146	1755	3.689.181	1756	6.623	1757	873.089

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/12/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos:

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 31/12/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 19/04/2007
				0762	0763	0764
ES0312273008	A	25/09/2019	FCH	A+	A-	A-
ES0312273008	A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0312273016	B	29/04/2013	MDY	Ba3	Ba3	Baa2
ES0312273024	C	29/04/2013	MDY	B3	B3	Ba2
ES0312273032	D	29/04/2013	MDY	Caa3	Caa3	B3
ES0312273081	A	21/03/2017	FCH	A+	A+	AAA
ES0312273081	A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0312273099	B	29/11/2018	FCH	A+	A+	A
ES0312273099	B	29/06/2018	MDY	A2	A2	Ba3
ES0312273107	C	29/11/2018	FCH	BB+	BB+	BBB-
ES0312273107	C	29/06/2018	MDY	Ba2	Ba2	B3
ES0312273115	D	12/12/2016	FCH	CCC	CCC	BB-
ES0312273115	D	08/10/2010	MDY	C	C	C
ES0312273248	A	25/09/2019	FCH	AA+	AA	AAA
ES0312273248	A	25/07/2018	SYP	AAA	AAA	AA
ES0312273255	B	22/02/2017	FCH	B	B	A
ES0312273263	C	17/04/2012	FCH	CCC	CCC	BBB-
ES0312273271	D	17/04/2012	FCH	CC	CC	BB
ES0312273362	A	23/12/2016	FCH	A-	A-	AA-
ES0312273362	A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aa2
ES0312273370	B	14/11/2017	FCH	CCC	CCC	BB
ES0312273370	B	25/09/2014	MDY	Ba2	Ba2	A2
ES0312273388	C	23/01/2015	MDY	B1	B1	Baa3
ES0312273396	D	10/07/2015	MDY	Caa1	Caa1	Ba2
ES0312273446	A	25/09/2019	FCH	A	A-	AAA
ES0312273446	A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

ES0312273453	B	25/09/2019	FCH	A	A-	A
ES0312273453	B	27/12/2018	MDY	A1	A1	B2
ES0312273461	C	25/09/2019	FCH	BBB-	B+	BBB-
ES0312273461	C	27/12/2018	MDY	Ba3	Ba3	Caa1
ES0312273479	D	13/04/2015	FCH	CCC	CCC	BB-
ES0312273479	D	27/12/2018	MDY	Caa3	Caa3	C

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Periodo de la declaración: 31/12/2019
Mercados de cotización de los valores emitidos:

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 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 19/04/2007	
Inferior a 1 año	0765	1.511.397	1765	0	2765	0
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	0
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	31
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768	670
Entre 4 y 5 años	0769		1769	430.241	2769	11.672
Entre 5 y 10 años	0770		1770	1.013.822	2770	571.471
Superior a 10 años	0771		1771	217.400	2771	6.749.956
Total	0772	1.511.397	1772	1.661.463	2772	7.333.800
Vida residual media ponderada (años)	0773	0	1773	2,60	2773	29,52

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2019

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 19/04/2007	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	102.483	1775	107.976	2775	165.253
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	133.488	1776	136.104	2776	165.253
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	6,78	1777	6,50	2777	2
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	0
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	0
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	0
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	0
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	80,92	1792	82,64	2792	90,14
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	

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2019

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 31/12/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 19/04/2007	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Permuta 1	CECABANK S.A.	SEMESTRAL	La suma de los intereses devengados, vencidos e ingresados al Fondo durante el Periodo de Liquidación que vence de los Activos de la Serie correspondiente, disminuida en el importe de los Intereses Corridos que, en su caso, hubiere pagado el Fondo durante el mismo Periodo de Liquidación entre (ii) el Importe Nominal, multiplicado por 360 y dividido por los días efectivos existentes en dicho Periodo de Liquidación	el Saldo Vivo de los Activos (una vez deducidos los Activos Fallidos) en la Fecha de Determinación anterior que no se encuentren con retrasos en el pago de los importes vencidos por más de noventa (90) días en la Fecha de Determinación en curso (incluidos los Activos totalmente amortizados durante el Periodo de Determinación)	Tipo de Interés de Referencia de los Bonos fijado para el correspondiente Periodo de Devengo de Intereses de los Bonos más un margen del 0,50%	El Saldo Vivo de los Activos (una vez deducidos los Activos Fallidos) en la Fecha de Determinación anterior que no se encuentren con retrasos en el pago de los importes vencidos por más de noventa (90) días en la Fecha de Determinación en curso (incluidos los Activos totalmente amortizados durante el Periodo de Determinación)		0	-9.427	

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Permuta 1	KUTXABANK	SEMESTRAL	La suma de los intereses devengados, vencidos e ingresados al Fondo durante el Periodo de Liquidación que vence de los Activos de la Serie correspondiente, disminuida en el importe de los Intereses Corridos que, en su caso, hubiere pagado el Fondo durante el mismo Periodo de Liquidación entre (ii) el Importe Nominal multiplicado por 360 y dividido por los días efectivos existentes en dicho Periodo de Liquidación	el Saldo Vivo de los Activos (una vez deducidos los Activos Fallidos) en la Fecha de Determinación anterior que no se encuentren con retrasos en el pago de los importes vencidos por más de noventa (90) días en la Fecha de Determinación en curso (incluidos los Activos totalmente amortizados durante el Periodo de Determinación)	Tipo de Interés de Referencia de los Bonos fijado para el correspondiente Periodo de Devengo de Intereses de los Bonos más un margen del 50%	el Saldo Vivo de los Activos (una vez deducidos los Activos Fallidos) en la Fecha de Determinación anterior que no se encuentren con retrasos en el pago de los importes vencidos por más de noventa (90) días en la Fecha de Determinación en curso (incluidos los Activos totalmente amortizados durante el Periodo de Determinación)			0	-9.427		
Total							0808		0809		0810	-18.855

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2019

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 31/12/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 19/04/2007	Situación actual 31/12/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 19/04/2007		
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: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2019

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 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación actual 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	0	7003	22.542	7006	30.361	7009	2,83	7012	2,46	7015	3,10		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	22.542	7008	30.361	7011	2,83	7014	2,46	7017	22.541.967	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	0	7020	0	7021	22.056	7024	29.481	7027	2,18	7030	3,28	7033	2,40		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	22.056	7026	29.481	7029	2,18	7032	3,28	7035	2,40	7036	

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

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2019

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
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
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: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2019

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		1862		2862		3862		4862		5862		6862		7862		8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864		1864		2864		3864		4864		5864		6864		7864		8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 31/12/2019

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo											Total	
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872													
Margen de intereses	0873													
Deterioro de activos financieros (neto)	0874													
Dotaciones a provisiones (neto)	0875													
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876													
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877													
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878													
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879													
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880													
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881													
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882													
Comisión variable pagada	0883													
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884													

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2019

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: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2019

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

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