

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8484
NIF Fondo: V84776335
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: 31/12/2018

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: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2018		Periodo anterior 31/12/2017
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	143.738	1001	167.359
I. Activos financieros a largo plazo	0002	143.738	1002	167.359
1. Activos titulizados	0003	143.738	1003	167.359
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	135.367	1004	156.552
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	7.657	1005	9.903
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	4.736	1025	6.205
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-4.022	1027	-5.300
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 Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	31.763	1041	30.052
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	229	1042	258
V. Activos financieros a corto plazo	0043	21.708	1043	21.680
1. Activos titulizados	0044	21.708	1044	21.680
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	19.715	1045	20.534
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	1.689	1046	974
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	0
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	61	1065	80
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	23	1066	16
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	1.453	1067	515
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	51	1068	54
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-1.284	1069	-492
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	12	1082	4
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	12	1084	4
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	9.815	1085	8.109
1. Tesorería	0086	9.815	1086	8.109
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	175.502	1088	197.411

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2018		Periodo anterior 31/12/2017
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	149.162	1089	170.890
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	149.162	1094	170.890
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	139.122	1095	162.164
1.1 Series no subordinadas	0096	113.522	1096	136.564
1.2 Series subordinadas	0097	25.600	1097	25.600
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101	4.706	1101	4.554
2.1 Préstamo subordinado	0102	5.000	1102	5.000
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-294	1105	-446
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	3.784	1108	4.172
3.1 Derivados de cobertura	0109	3.784	1109	4.172
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	1.550	1112	
4.1 Garantías financieras	0113	1.550	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: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) PASIVO CORRIENTE	0117	30.124	1117	30.693
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	30.100	1123	30.660
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	28.969	1124	29.649
1.1 Series no subordinadas	0125	28.966	1125	29.645
1.2 Series subordinadas	0126		1126	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	4	1128	3
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	642	1131	638
2.1 Préstamo subordinado	0132	586	1132	586
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	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	0	1136	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	55	1137	51
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	192	1139	245
3.1 Derivados de cobertura	0140	192	1140	245
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	297	1143	128
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	297	1144	128
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	24	1148	32
1. Comisiones	0149	3	1149	3
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	3	1150	3
1.2 Comisión administrador	0151	115	1151	100
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	1	1152	1
1.4 Comisión variable	0153		1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-115	1155	-100
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	21	1157	29
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-3.784	1158	-4.172
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-3.784	1160	-4.172
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	175.502	1162	197.411

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2018		Acumulado anterior 31/12/2017
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	382	1201	635	2201	2.055	3201	2.893
1.1 Activos titulizados	0202	382	1202	635	2202	2.055	3202	2.893
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-17	1204	-16	2204	-65	3204	-64
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-16	1205	-15	2205	-61	3205	-60
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1	1206	-1	2206	-4	3206	-4
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-381	1208	-499	2208	-1.655	3208	-2.356
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-16	1209	121	2209	335	3209	473
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	-58	1217	-84	2217	-664	3217	-396
7.1 Servicios exteriores	0218	-40	1218	-23	2218	-61	3218	-27
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-16	1219	-1	2219	-19	3219	-2
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	-24	1222	-22	2222	-42	3222	-25
7.2 Tributos	0223	-1	1223	-7	2223	-10	3223	-21
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-18	1224	-54	2224	-594	3224	-348
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-11	1225	-13	2225	-47	3225	-50
7.3.2 Comisión administrador	0226	-4	1226	-5	2226	-18	3226	-21
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-3	1227	-3	2227	-10	3227	-10
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	-34	2228	-519	3228	-267
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	186	1231	-43	2231	455	3231	-172
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	186	1232	-43	2232	455	3232	-172
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	-14	1238	-5	2238	11	3238	-5
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-97	1239	11	2239	-136	3239	100
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 Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2018		Acumulado anterior 31/12/2017
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-387	1300	164	2300	1.354	3300	-243
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	323	1301	214	2301	468	3301	425
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	651	1302	641	2302	2.238	3302	2.980
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-17	1303	-15	2303	-61	3303	-60
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	118	1304	128	2304	509	3304	568
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-429	1305	-540	2305	-2.218	3305	-3.046
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	-1	3307	-16
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-14	1309	-50	2309	-579	3309	-625
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-11	1310	-13	2310	-47	3310	-53
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	-1	2311	-3	3311	-4
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-2	1312	-2	2312	-10	3312	-10
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	-34	2313	-519	3313	-558
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-697	1315	0	2315	1.464	3315	-44
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	-17	1320	0	2320	-86	3320	-44
3.6 Otros cobros de explotación	0321	-680	1321	0	2321	1.551	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	1.202	1322	1.013	2322	352	3322	-879
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	1.202	1325	1.013	2325	352	3325	-728
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	1.546	1326	2.791	2326	7.124	3326	11.202
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	2.720	1327	2.452	2327	9.714	3327	8.690
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	2.079	1328	849	2328	7.128	3328	3.516
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	108	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-5.143	1331	-5.078	2331	-23.722	3331	-24.135
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332	0	2332	0	3332	-151
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	-151
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336	0	2336	0	3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	815	1337	1.177	2337	1.706	3337	-1.123
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	9.000	1338	6.932	2338	8.109	3338	9.232
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	9.815	1339	8.109	2339	9.815	3339	8.109

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2018		Acumulado anterior 31/12/2017
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	-613	1357	-589	2357	-1.267	3357	-134
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-613	1358	-589	2358	-1.267	3358	-134
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	381	1360	499	2360	1.655	3360	2.356
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	232	1362	91	2362	-388	3362	-2.222
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 Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A. | A48265169 BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2018								Situación cierre anual anterior 31/12/2017								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	3,84	0400	0,23	0420	0	0440	4,91	1380	3,47	1400	0,15	1420	0	1440	4,30	2380	0,59	2400	0,09	2420	0	2440	0		
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	0,01	0401	0	0421	0	0441	12,83	1381	3,17	1401	0	1421	0	1441	3,78	2381	0	2401	0	2421	0	2441	0	2441	0
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A. | A48265169 BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, 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	171	0467	63	0474	17	0481		0488	80	0495	11.761	0502	2	0509	11.843
De 1 a 3 meses	0461	25	0468	21	0475	6	0482	0	0489	26	0496	2.236	0503	1	0510	2.263
De 3 a 6 meses	0462	7	0469	13	0476	2	0483	1	0490	17	0497	441	0504		0511	457
De 6 a 9 meses	0463	3	0470	3	0477	0	0484	1	0491	5	0498	166	0505		0512	170
De 9 a 12 meses	0464	4	0471	18	0478	2	0485	4	0492	23	0499	165	0506		0513	188
Más de 12 meses	0465	54	0472	1.418	0479	47	0486	764	0493	2.229	0500	3.964	0507		0514	6.193
Total	0466	264	0473	1.537	0480	74	0487	769	0494	2.380	0501	18.732	0508	3	1515	21.115

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	171	0522	63	0529	17	0536		0543	80	0550	11.761	0557	2	0564	11.843	0571	32.057	0578	32.057	0584	36,94
De 1 a 3 meses	0516	25	0523	21	0530	6	0537	0	0544	26	0551	2.236	0558	1	0565	2.263	0572	5.227	0579	5.227	0585	43,29
De 3 a 6 meses	0517	7	0524	13	0531	2	0538	1	0545	17	0552	441	0559		0566	457	0573	1.255	0580	1.255	0586	36,43
De 6 a 9 meses	0518	3	0525	3	0532	0	0539	1	0546	5	0553	166	0560		0567	170	0574	518	0581	518	0587	32,88
De 9 a 12 meses	0519	4	0526	18	0533	2	0540	4	0547	23	0554	165	0561		0568	188	0575	747	0582	747	0588	25,19
Más de 12 meses	0520	54	0527	1.418	0534	47	0541	764	0548	2.229	0555	3.964	0562		0569	6.193	0576	9.777	0583	9.777	0589	63,34
Total	0521	264	0528	1.537	0535	74	0542	769	0549	2.380	0556	18.732	0563	3	0570	21.115	0577	49.582			0590	42,58

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A. | A48265169 BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 13/07/2006	
Inferior a 1 año	0600	627	1600	363	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	851	1601	1.102	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.033	1602	1.450	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	1.641	1603	1.297	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	2.872	1604	2.291	2604	139
Entre 5 y 10 años	0605	24.360	1605	25.041	2605	4.432
Superior a 10 años	0606	139.234	1606	163.138	2606	670.429
Total	0607	170.617	1607	194.681	2607	675.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	13,93	1608	14,73	2608	25,63

Antigüedad	Situación actual 31/12/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 13/07/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	14,45	1609	13,46	2609	2,23

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A. | A48265169 BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 13/07/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.314	0630	50.438	1620	1.286	1630	50.417	2620	544	2630	50.806
40% - 60%	0621	923	0631	74.019	1621	959	1631	78.775	2621	851	2631	85.978
60% - 80%	0622	443	0632	44.789	1622	609	1632	63.235	2622	1.931	2632	225.662
80% - 100%	0623	11	0633	1.270	1623	19	1633	2.148	2623	2.238	2633	312.554
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624	0	2634	0
120% - 140%	0625	1	0635	101	1625		1635		2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626	1	1636	105	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627	0	2637	0
Total	0628	2.692	0638	170.617	1628	2.874	1638	194.681	2628	5.564	2638	675.000
Media ponderada (%)	0639	48,09	0649		1639	50,65	1649		2639	75,16	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A. | A48265169 BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 13/07/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	1,14	1650	1,37	2650	3,46
Tipo de interés nominal máximo	0651	5,50	1651	5,50	2651	5,05
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,01	1652	0,05	2652	2,10

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A. A48265169 BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 13/07/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	1.124	0683	53.574	1660	1.212	1683	60.976	2660	2.615	2683	248.238
Aragón	0661	5	0684	296	1661	5	1684	322	2661	9	2684	959
Asturias	0662		0685		1662		1685		2662	0	2685	0
Baleares	0663		0686		1663		1686		2663	0	2686	0
Canarias	0664		0687		1664		1687		2664	0	2687	0
Cantabria	0665		0688		1665		1688		2665	0	2688	0
Castilla-León	0666		0689		1666		1689		2666	2	2689	286
Castilla La Mancha	0667		0690		1667		1690		2667	6	2690	922
Cataluña	0668	450	0691	44.876	1668	480	1691	51.778	2668	927	2691	152.931
Ceuta	0669	1	0692	26	1669	1	1692	30	2669	1	2692	70
Extremadura	0670		0693		1670		1693		2670	0	2693	0
Galicia	0671		0694		1671		1694		2671	1	2694	187
Madrid	0672	39	0695	2.451	1672	39	1695	2.737	2672	162	2695	24.868
Melilla	0673	4	0696	196	1673	4	1696	217	2673	14	2696	1.435
Murcia	0674	3	0697	97	1674	3	1697	107	2674	4	2697	384
Navarra	0675	1.049	0698	67.937	1675	1.112	1698	77.078	2675	1.784	2698	238.126
La Rioja	0676	6	0699	573	1676	6	1699	616	2676	7	2699	1.190
Comunidad Valenciana	0677	2	0700	45	1677	2	1700	61	2677	14	2700	2.221
País Vasco	0678	9	0701	548	1678	10	1701	759	2678	18	2701	3.183
Total España	0679	2.692	0702	170.617	1679	2.874	1702	194.681	2679	5.564	2702	675.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	2.692	0705	170.617	1682	2.874	1705	194.681	2682	5.564	2705	675.000

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A. A48265169 BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 13/07/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,56			1710	1,45			2710	0,77		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2018			Situación cierre anual anterior 31/12/2017			Situación inicial 13/07/2006					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0312252010	B	122	100.000	12.200	122	100.000	12.200	122	100.000	12.200			
ES0312252002	A	6.494	21.941	142.488	6.494	25.594	166.210	6.494	100.000	649.400			
ES0312252028	C	134	100.000	13.400	134	100.000	13.400	134	100.000	13.400			
Total		0723	6.750	0724	168.088	1723	6.750	1724	191.810	2723	6.750	2724	675.000

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado				
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739		
ES0312252002	A	NS	EURIBOR 3 MESES	0,15	0	0	0	SI	142.488	0	142.488			
ES0312252010	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,40	0,08	1	0	SI	12.200	0	12.201			
ES0312252028	C	S	EURIBOR 3 MESES	0,70	0,38	3	0	SI	13.400	0	13.403			
Total						0740	4	0741	0743	168.088	0744	0745	168.092	0746

	Situación actual 31/12/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 13/07/2006
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,04	0748
			0,03
			0749
			3,37

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/12/2018
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2018								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2017							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0312252002	A	5.143	506.912	0	85.088	5.078	483.190	0	85.088								
ES0312252010	B	0	0	2	2.399	0	0	2	2.390								
ES0312252028	C	0	0	14	3.141	0	0	12	3.090								
Total		0754	5.143	0755	506.912	0756	17	0757	90.628	1754	5.078	1755	483.190	1756	15	1757	90.568

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/12/2018
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 31/12/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 13/07/2006
				0762	0763	0764
ES0312252002	A	29/06/2018	MDY	Aa2	A1	Aaa
ES0312252002	A	25/07/2018	SYP	AA	BBB	AAA
ES0312252010	B	29/06/2018	MDY	Baa2	Baa3	A1
ES0312252010	B	25/07/2018	SYP	A-	B	A
ES0312252028	C	11/12/2017	MDY	Caa1	Caa1	Baa3
ES0312252028	C	25/07/2018	SYP	BB	B-	BBB-

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/12/2018
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 31/12/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 13/07/2006	
Inferior a 1 año	0765	0	1765		2765	
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	
Entre 3 y 4 años	0768	142.488	1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769	
Entre 5 y 10 años	0770	25.600	1770	191.810	2770	649.400
Superior a 10 años	0771		1771		2771	25.600
Total	0772	168.088	1772	191.810	2772	675.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	3,63	1773	6,28	2773	8,59

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 13/07/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	4.896	1775	5.000	2775	5.738
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	5.000	1776	5.000	2776	5.738
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	2,91	1777	2,61	2777	0
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783	Notas Explicativas	2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	84,77	1792	86,65	2792	96,20
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

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 31/12/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 13/07/2006	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Permuta 1	CECABANK S.A	TRIMESTRAL	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 0,60 % .	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)	-3.976	-4.418	-8.109	
Total							0808 -3.976	0809 -4.418	0810 -8.109	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

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 31/12/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 13/07/2006	Situación actual 31/12/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 13/07/2006		
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 Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

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 31/12/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación actual 31/12/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Última Fecha Pago											
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	2.273	7006	930	7009	3,63	7012	3,55	7015	3,54		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	2.273	7008	930	7011	3,63	7014	3,55	7017	2.273.189	7018	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	2.189	7024	882	7027	3,08	7030	2,95	7033	3,09		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	2.189	7026	882	7029	3,08	7032	2,95	7035	3,09	7036	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Última Fecha Pago		
	0850	1850	2850	3850	
	0851	1851	2851	3851	
	0852	1852	2852	3852	
	0853	1853	2853	3853	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

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
el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) es superior al % establecido para cada ISIN	1	3,97	3,87	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)
el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) es superior al % establecido para cada ISIN	1,25	3,97	3,87	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera superior al porcentaje recogido del Saldo Vivo de los Activos que no tengan la consideración de Activos Fallidos	1	0,57	0,46	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.1
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861
a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) en la fecha de Determinación correspondiente a la Fecha de Pago en curso sea inferior al porcentaje establecido del Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Constitución sin que se ha	10	24,50	24,90	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



S.05.5

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

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 365	3862	0,030	4862	150	5862	30	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	1863	0	2863	Días del mes /Base 365	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Trimestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BANCO SANTANDER, S.A.	1864	10	2864	Días del mes /Días año	3864	0	4864	0	5864	0	6864	Trimestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

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 Mare Nostrum , BBVA , Caixabank
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo adicional 3.4.6.4

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total		
		31/03/2018	30/06/2018	30/09/2018	31/12/2018									
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872													
Margen de intereses	0873	238	1	115	-15									339
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	149	42	78	186									455
Dotaciones a provisiones (neto)	0875	0												0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876	0		25	-14									11
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-38	-24	-28	-59									-149
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	349	19	190	97	0	0	0	0	0	0	0	0	655
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879	0												0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880	-289	0		-97									-386
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881	-60	-116	-343										-519
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	0	97	153	0	0	0	0	0	0	0	0	0	250
Comisión variable pagada	0883	60	116	343										519
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884	0												

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2018

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												

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2018

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