

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: SLF, FONDO DE TITULIZACION
Número de registro del Fondo: 201900006
NIF Fondo: V88305701
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: SI
Fondo Privado: SI
Estados agregados: SI
Fecha: 30/09/2021

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: SLF, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	79.993	1001	92.868
I. Activos financieros a largo plazo	0002	79.993	1002	92.868
1. Activos titulizados	0003	79.993	1003	92.868
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	18.479	1005	10.071
1.3 Préstamos hipotecarios	0006	0	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	181	1023	181
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	62.669	1025	86.022
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-1.335	1027	-3.406
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	

	S.01
Denominación Fondo: SLF, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 30/09/2021	

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	43.373	1041	43.604
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	38.950	1043	40.627
1. Activos titulizados	0044	38.950	1044	40.627
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	447	1046	416
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064	0	1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	0	1065	207
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066		1066	
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	38.125	1067	39.460
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	413	1068	556
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-35	1069	-12
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
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	341	1082	349
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	341	1084	349
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	4.083	1085	2.627
1. Tesorería	0086	4.083	1086	2.627
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	123.366	1088	136.471

S.01
Denominación Fondo: SLF, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 30/09/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	110.634	1089	122.225
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	110.634	1094	122.225
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	110.634	1095	122.225
1.1 Series no subordinadas	0096	126.123	1096	136.171
1.2 Series subordinadas	0097		1097	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	-15.489	1098	-13.946
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101		1101	
2.1 Préstamo subordinado	0102		1102	
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105		1105	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108		1108	
3.1 Derivados de cobertura	0109		1109	
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	
4.1 Garantías financieras	0113		1113	
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

	S.01
Denominación Fondo: SLF, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 30/09/2021	

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) PASIVO CORRIENTE	0117	12.732	1117	14.246
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	12.473	1123	13.946
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	12.104	1124	13.490
1.1 Series no subordinadas	0125	11.981	1125	11.981
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	123	1128	132
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	1.377
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131		1131	
2.1 Préstamo subordinado	0132		1132	
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		1136	
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137		1137	
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139		1139	
3.1 Derivados de cobertura	0140		1140	
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	369	1143	457
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	369	1144	457
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	259	1148	300
1. Comisiones	0149	259	1149	300
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	2	1150	0
1.2 Comisión administrador	0151	257	1151	300
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152		1152	
1.4 Comisión variable	0153		1153	
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155		1155	
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	0	1157	0
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158		1158	
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160		1160	
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	123.366	1162	136.471

	S.02
Denominación Fondo: SLF, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 30/09/2021	

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2021		Acumulado anterior 30/09/2020
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	5.383	1201	-1.244	2201	12.927	3201	2.249
1.1 Activos titulizados	0202	5.383	1202	-1.244	2202	12.927	3202	2.249
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203		3203	
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-2.884	1204	-3.031	2204	-8.801	3204	-9.058
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-2.882	1205	-3.029	2205	-8.795	3205	-9.053
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	0	1206	0	2206		3206	
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-2	1207	-2	2207	-6	3207	-4
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	0	1208	0	2208		3208	
A) MARGEN DE INTERESES	0209	2.499	1209	-4.274	2209	4.126	3209	-6.809
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		3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-1.022	1217	-1.124	2217	-3.273	3217	-3.018
7.1 Servicios exteriores	0218	-234	1218	-683	2218	-898	3218	-1.250
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219	-442	2219	-2	3219	-1.009
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	-1	2220		3220	-1
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	-234	1222	-240	2222	-897	3222	-240
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	-1	3223	-5
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-789	1224	-441	2224	-2.374	3224	-1.763
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-10	1225	-8	2225	-27	3225	-25
7.3.2 Comisión administrador	0226	-781	1226	-433	2226	-2.348	3226	-1.738
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227		3227	
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228		3228	
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	2	1230	0	2230	0	3230	
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-977	1231	-1.749	2231	-2.396	3231	-2.406
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-977	1232	-1.749	2232	-2.396	3232	-2.406
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	-500	1239	7.147	2239	1.543	3239	12.233
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241		3241	
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: SLF, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2021

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2021		Acumulado anterior 30/09/2020
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-2.840	1300	-3.317	2300	-10.921	3300	-10.088
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-1.850	1301	-1.810	2301	-7.541	3301	-6.564
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	1.103	1302	693	2302	2.644	3302	1.520
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-2.951	1303	-2.500	2303	-10.180	3303	-8.079
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	3305	0
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-2	1308	-3	2308	-5	3308	-5
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-758	1309	-648	2309	-2.415	3309	-2.044
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-8	1310	-9	2310	-24	3310	-26
2.2 Comisión administrador	0311	-750	1311	-639	2311	-2.391	3311	-2.018
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	0
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-232	1315	-860	2315	-965	3315	-1.480
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	-234	1320	-860	2320	-967	3320	-1.480
3.6 Otros cobros de explotación	0321	2	1321	0	2321	2	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	2.785	1322	3.298	2322	12.377	3322	7.287
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	2.785	1325	3.298	2325	12.377	3325	7.287
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	-14.001	1326	3.298	2326	0	3326	0
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	22.425	1327	0	2327	22.425	3327	9.606
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	0	1328	0	2328	0	3328	0
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	-5.638	1331	0	2331	-10.048	3331	-2.319
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332	0	2332	0	3332	0
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336	0	2336	0	3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-55	1337	-19	2337	1.456	3337	-2.801
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	4.138	1338	1.876	2338	2.627	3338	4.658
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	4.083	1339	1.857	2339	4.083	3339	1.857

Denominación Fondo: SLF, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2021

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2021		Acumulado anterior 30/09/2020
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 periodo	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	0	1357	0	2357	0	3357	0
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	0	1358	0	2358	0	3358	0
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	0	1360	0	2360	0	3360	0
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0362	0	1362	0	2362	0	3362	0
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 periodo	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 periodo	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: SLF, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: 00B232781 FIRE HOLDCO S.À R.L.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2021								Situación cierre anual anterior 31/12/2020								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	0	0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	83,55	0401		0421		0441		1381	87,47	1401		1421		1441		2381	0	2401	0	2421	0	2441	0
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Prestamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390	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		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399	0,71	0419		0439		0459		1399	0,19	1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

SLF, FT

S.05.1															
Denominación Fondo: SLF, FT															
Denominación del compartimento:															
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.															
Estados agregados: SI															
Fecha: 30/09/2021															
Entidades cedentes de los activos titulizados: 00B232781 FIRE HOLDCO S.À R.L.															

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	305	0467	5.755	0474	62	0481	2.012	0488	7.830	0495	13.523	0502	22	0509	21.374
De 1 a 3 meses	0461	38	0468	739	0475	7	0482	213	0489	960	0496	1.691	0503	2	0510	2.653
De 3 a 6 meses	0462	59	0469	1.481	0476	15	0483	566	0490	2.062	0497	2.362	0504	4	0511	4.428
De 6 a 9 meses	0463	37	0470	568	0477	7	0484	219	0491	794	0498	1.628	0505	2	0512	2.424
De 9 a 12 meses	0464	49	0471	860	0478	10	0485	248	0492	1.118	0499	2.894	0506	5	0513	4.018
Más de 12 meses	0465	1.484	0472	28.770	0479	312	0486	10.852	0493	39.934	0500	59.628	0507	85	0514	99.647
Total	0466	1.972	0473	38.174	0480	413	0487	14.111	0494	52.697	0501	81.727	0508	118	1515	134.543

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	300	0522	5.750	0529	62	0536	2.012	0543	7.825	0550	13.528	0557	22	0564	21.374	0571	37.931	0578	37.931	0584	56,35
De 1 a 3 meses	0516	37	0523	739	0530	7	0537	213	0544	960	0551	1.691	0558	2	0565	2.653	0572	6.996	0579	6.996	0585	37,92
De 3 a 6 meses	0517	59	0524	1.481	0531	15	0538	566	0545	2.062	0552	2.362	0559	4	0566	4.428	0573	11.252	0580	11.252	0586	39,35
De 6 a 9 meses	0518	37	0525	568	0532	7	0539	219	0546	794	0553	1.628	0560	2	0567	2.424	0574	7.963	0581	7.963	0587	30,44
De 9 a 12 meses	0519	47	0526	859	0533	10	0540	248	0547	1.117	0554	2.896	0561	5	0568	4.018	0575	10.060	0582	10.060	0588	39,94
Más de 12 meses	0520	1.467	0527	28.744	0534	312	0541	10.851	0548	39.908	0555	59.653	0562	85	0569	99.646	0576	288.480	0583	288.480	0589	34,54
Total	0521	1.947	0528	38.142	0535	413	0542	14.110	0549	52.665	0556	81.758	0563	118	0570	134.542	0577	362.682			0590	37,10

SLF, FT

S.05.1
Denominación Fondo: SLF, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 30/09/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: 00B232781 FIRE HOLDCO S.À R.L.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 16/01/2020	
Inferior a 1 año	0600	2.705	1600	2.376	2600	2.692
Entre 1 y 2 años	0601	1.465	1601	999	2601	627
Entre 2 y 3 años	0602	1.459	1602	1.430	2602	1.152
Entre 3 y 4 años	0603	1.475	1603	3.185	2603	1.671
Entre 4 y 5 años	0604	1.760	1604	5.634	2604	1.795
Entre 5 y 10 años	0605	12.917	1605	14.070	2605	13.675
Superior a 10 años	0606	98.121	1606	108.457	2606	124.928
Total	0607	119.900	1607	136.150	2607	146.540
Vida residual media ponderada (años)	0608	19,71	1608	19,06	2608	20,81

Antigüedad	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 16/01/2020	
Antigüedad media ponderada (años)	0609		1609	12	2609	10,48

SLF, FT

	S.05.1
Denominación Fondo: SLF, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 30/09/2021	
Entidades cedentes de los activos titulizados: 00B232781 FIRE HOLDCO S.À R.L.	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 16/01/2020			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.096	0630	46.182	1620	1.037	1630	43.337	2620	631	2630	19.874
40% - 60%	0621	258	0631	19.736	1621	494	1631	35.128	2621	710	2631	46.050
60% - 80%	0622	150	0632	13.020	1622	346	1632	29.903	2622	432	2632	36.185
80% - 100%	0623	82	0633	8.574	1623	143	1633	12.939	2623	242	2633	23.865
100% - 120%	0624	64	0634	7.227	1624	67	1634	5.510	2624	101	2634	8.503
120% - 140%	0625	30	0635	3.354	1625	59	1635	4.906	2625	64	2635	4.736
140% - 160%	0626	22	0636	2.769	1626	27	1636	1.983	2626	43	2636	3.385
superior al 160%	0627	70	0637	9.857	1627	45	1637	2.445	2627	77	2637	3.759
Total	0628	1.772	0638	110.719	1628	2.218	1638	136.150	2628	2.300	2638	146.359
Media ponderada (%)	0639	70,85	0649		1639		1649		2639	70,99	2649	

SLF, FT

S.05.1
Denominación Fondo: SLF, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 30/09/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: 00B232781 FIRE HOLDCO S.À R.L.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 16/01/2020	
Tipo de interés medio ponderado	0650	1,37	1650	1,58	2650	1,53
Tipo de interés nominal máximo	0651	7	1651	8,50	2651	8,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,01	1652	0,01	2652	0,10

SLF, FT

	S.05.1
Denominación Fondo: SLF, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 30/09/2021	
Entidades cedentes de los activos titulizados: 00B232781 FIRE HOLDCO S.À R.L.	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 16/01/2020			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	303	0683	14.826	1660	303	1683	16.559	2660	318	2683	17.533
Aragón	0661	6	0684	356	1661	6	1684	438	2661	6	2684	440
Asturias	0662	13	0685	503	1662	13	1685	546	2662	13	2685	919
Baleares	0663	147	0686	8.094	1663	147	1686	8.502	2663	160	2686	9.561
Canarias	0664	75	0687	3.916	1664	75	1687	4.791	2664	78	2687	4.818
Cantabria	0665	1	0688	9	1665	1	1688	0	2665	1	2688	0
Castilla-León	0666	52	0689	2.721	1666	52	1689	3.200	2666	52	2689	3.258
Castilla La Mancha	0667	62	0690	2.487	1667	62	1690	2.786	2667	62	2690	2.907
Cataluña	0668	500	0691	32.149	1668	508	1691	36.498	2668	537	2691	39.446
Ceuta	0669	1	0692	0	1669	1	1692	80	2669	1	2692	65
Extremadura	0670	13	0693	533	1670	13	1693	579	2670	13	2693	631
Galicia	0671	11	0694	475	1671	11	1694	475	2671	11	2694	475
Madrid	0672	449	0695	28.894	1672	450	1695	32.706	2672	469	2695	36.484
Melilla	0673	3	0696	114	1673	3	1696	114	2673	3	2696	113
Murcia	0674	112	0697	5.143	1674	113	1697	6.254	2674	113	2697	6.207
Navarra	0675	0	0698	0	1675	0	1698	0	2675		2698	
La Rioja	0676	3	0699	113	1676	3	1699	124	2676	3	2699	124
Comunidad Valenciana	0677	441	0700	18.479	1677	445	1700	21.379	2677	463	2700	22.432
País Vasco	0678	12	0701	1.089	1678	12	1701	1.120	2678	12	2701	1.127
Total España	0679	2.204	0702	119.900	1679	2.218	1702	136.150	2679	2.315	2702	146.540
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680		2703	
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681		2704	
Total general	0682	2.204	0705	119.900	1682	2.218	1705	136.150	2682	2.315	2705	146.540

SLF, FT

	S.05.1
Denominación Fondo: SLF, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 30/09/2021	
Entidades cedentes de los activos titulizados: 00B232781 FIRE HOLDCO S.À R.L.	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 16/01/2020			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	3,46			1710	2,77			2710	3,32		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

SLF, FT

	S.05.2
Denominación Fondo: SLF, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Periodo de la declaración: 30/09/2021	
Mercados de cotización de los valores emitidos:	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación Inicial 16/01/2020						
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	
276122300001	UNICO	1		138.103.97 2	138.104		1		148.152.1 10	148.152		1		151.065.4 29	151.065	
Total		0723	1		0724	138.104	1723	1		1724	148.152	2723	1		2724	151.065

SLF, FT

S.05.2
Denominación Fondo: SLF, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Periodo de la declaración: 30/09/2021
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	Denomina ción serie	Grado de subordina ción	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados		Intereses impagados		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado					
		0730													0731			0732
276122300001	UNICO	NS	FIJO	0	0	123		0		SI	138.104		0		138.227		-15.489	
Total						0740	123	0741	0		0743	138.104	0744	0	0745	138.227	0746	-15.489

	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 16/01/2020	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747		0748	8	0749	

SLF, FT

	S.05.2
Denominación Fondo: SLF, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Periodo de la declaración: 30/09/2021	
Mercados de cotización de los valores emitidos:	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2021								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2020							
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	
276122300001	UNICO	5.638		12.961		2.951		21.056		0		2.319		2.500		8.080	
Total		0754	5.638	0755	12.961	0756	2.951	0757	21.056	1754	0	1755	2.319	1756	2.500	1757	8.080

SLF, FT

	S.05.2
Denominación Fondo: SLF, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Periodo de la declaración: 30/09/2021	
Mercados de cotización de los valores emitidos:	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

				Calificación		
Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Situación actual 30/09/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 16/01/2020
		0760	0761	0762	0763	0764

SLF, FT

	S.05.2
Denominación Fondo: SLF, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Periodo de la declaración: 30/09/2021	
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 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 16/01/2020
Inferior a 1 año	0765		1765		2765
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769
Entre 5 y 10 años	0770	138.104	1770	148.152	2770
Superior a 10 años	0771		1771		2771
Total	0772	138.104	1772	148.152	2772
Vida residual media ponderada (años)	0773	9	1773	9,70	2773

SLF, FT

S.05.3

Denominación Fondo: SLF, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo		Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 16/01/2020	
1	Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	0	1775	0	2775	
1.1	Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	0	1776	0	2776	
1.2	Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	0	1777	0	2777	
1.3	Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	Notas explicativas
1.4	Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	Notas explicativas
1.5	Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	Notas explicativas
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	Notas explicativas
2.3	Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	Notas explicativas
2.4	Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	Notas explicativas
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	Notas explicativas
3.3	Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	Notas explicativas
3.4	Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	Notas explicativas
4	Subordinación de series (S/N)	0791	N	1791	N	2791	N
4.1	Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	100	1792	100	2792	100
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	

SLF, FT

	S.05.3
Denominación Fondo: SLF, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 30/09/2021	

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS			Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)						Otras características
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 16/01/2020		
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806		1806		2806		
Total							0808		0809		0810		

SLF, FT

S.05.3

Denominación Fondo: SLF, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Naturaleza riesgo cubierto		Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 16/01/2020		Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020			
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	

SLF, FT

S.05.4															
Denominación Fondo: SLF, FT															
Denominación del compartimento:															
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.															
Estados agregados: SI															
Fecha: 30/09/2021															

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

					Importe impagado acumulado				Ratio						Ref. Folleto	
Concepto	Meses impago		Días impago		Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Última Fecha Pago			
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	3	7002	90	7003	51.762	7006	54.858	7009	84,35	7012	75,48	7015			
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	51.762	7008	54.858	7011	84,35	7014	75,48	7017		7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	0	7020	0	7021	0	7024	0	7027		7030		7033			
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028		7031		7034			
Total Fallidos					7023	0	7026	0	7029		7032		7035		7036	

	Ratio						Ref. Folleto	
Otras ratios relevantes	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Última Fecha Pago			
	0850		1850		2850		3850	
	0851		1851		2851		3851	
	0852		1852		2852		3852	
	0853		1853		2853		3853	

SLF, FT

	S.05.4
Denominación Fondo: SLF, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 30/09/2021	

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

SLF, FT

S.05.5																
Denominación Fondo: SLF, FT																
Denominación del compartimento:																
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.																
Estados agregados: SI																
Fecha: 30/09/2021																

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Minimo (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	1862	20	2862	365	3862	0,010	4862	150	5862		6862	MENSUAL	7862	N	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	

SLF, FT

	S.05.5
Denominación Fondo: SLF, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 30/09/2021	

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	FIRE HOLDCO
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													

SLF, FT

	S.05.5
Denominación Fondo: SLF, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 30/09/2021	

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													

SLF, FT

	S.06
Denominación Fondo: SLF, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 30/09/2021	

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
