

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO III, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA
Número de registro del Fondo: 4936
NIF Fondo: V83799296
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2020

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

S.01

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2020		Periodo anterior 31/12/2019
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	67.403	1001	75.015
I. Activos financieros a largo plazo	0002	67.403	1002	75.015
1. Activos titulizados	0003	67.403	1003	75.015
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	67.314	1004	74.955
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005		1005	
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	598	1025	591
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-510	1027	-531
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: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	26.244	1041	26.898
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	15.293	1043	14.998
1. Activos titulizados	0044	15.235	1044	14.879
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	15.178	1045	14.835
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046		1046	
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		1064	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	7	1065	12
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	0	1066	0
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	332	1067	312
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	1	1068	1
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-284	1069	-282
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	58	1074	120
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	57	1077	119
3.4 Garantías financieras	0078	1	1078	1
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	0	1082	0
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	10.951	1085	11.900
1. Tesorería	0086	10.951	1086	11.900
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	93.647	1088	101.914

S.01

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2020		Periodo anterior 31/12/2019
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	71.609	1089	83.573
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	71.609	1094	83.573
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	63.994	1095	75.850
1.1 Series no subordinadas	0096	56.445	1096	68.300
1.2 Series subordinadas	0097	7.550	1097	7.550
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	7.569	1101	7.612
2.1 Préstamo subordinado	0102	8.000	1102	8.000
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	-431	1105	-388
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	46	1108	111
3.1 Derivados de cobertura	0109	46	1109	111
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: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) PASIVO CORRIENTE	0117	22.084	1117	18.451
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	22.066	1123	18.418
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	21.998	1124	18.297
1.1 Series no subordinadas	0125	21.991	1125	18.293
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	6	1128	4
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	63	1131	50
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	7	1136	4
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	56	1137	46
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	5	1139	70
3.1 Derivados de cobertura	0140	5	1140	70
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	1	1143	1
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	1	1144	1
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	18	1148	33
1. Comisiones	0149	14	1149	13
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	9	1150	9
1.2 Comisión administrador	0151	26	1151	22
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	5	1152	4
1.4 Comisión variable	0153	247	1153	247
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-273	1155	-268
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	5	1157	20
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-46	1158	-111
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-46	1160	-111
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	93.647	1162	101.914

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2020		Acumulado anterior 30/06/2019
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	71	1201	79	2201	76	3201	157
1.1 Activos titulizados	0202	71	1202	79	2202	76	3202	157
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-27	1204	-24	2204	-50	3204	-47
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-7	1205	-6	2205	-12	3205	-13
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-8	1206	-7	2206	-13	3206	-14
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-12	1207	-10	2207	-25	3207	-21
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-5	1208	-49	2208	-49	3208	-90
A) MARGEN DE INTERESES	0209	39	1209	6	2209	-23	3209	20
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	
7. Otros gastos de explotación	0217	-20	1217	-19	2217	-44	3217	-39
7.1 Servicios exteriores	0218	-1	1218	-1	2218	-8	3218	-3
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219	0	2219	-2	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	-1	1222	-1	2222	-6	3222	-1
7.2 Tributos	0223	-1	1223	-1	2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-18	1224	-18	2224	-36	3224	-36
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-10	1225	-10	2225	-20	3225	-20
7.3.2 Comisión administrador	0226	-2	1226	-3	2226	-4	3226	-5
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-6	1227	-5	2227	-11	3227	-10
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	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-92	1231	-137	2231	19	3231	-136
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-92	1232	-137	2232	19	3232	-136
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	72	1239	151	2239	48	3239	156
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 Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2020		Acumulado anterior 30/06/2019
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-46	1300	-7	2300	-6	3300	-45
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-20	1301	17	2301	48	3301	9
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	41	1302	80	2302	197	3302	140
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-5	1303	-6	2303	-9	3303	-13
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	8	1304	32	2304	11	3304	65
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-53	1305	-78	2305	-125	3305	-163
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	-12	1306	-10	2306	-25	3306	-21
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-15	1309	-15	2309	-31	3309	-30
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-10	1310	-10	2310	-21	3310	-20
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	-5	2312	-10	3312	-10
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	-10	1315	-9	2315	-24	3315	-24
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	-10	1320	-9	2320	-24	3320	-24
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	1
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-275	1322	-154	2322	-943	3322	-866
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	-217	1325	-154	2325	-886	3325	-866
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	2.867	1326	3.125	2326	5.733	3326	6.322
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	378	1327	1.171	2327	1.424	3327	2.376
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	40	1328	45	2328	115	3328	95
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	-3.502	1331	-4.495	2331	-8.158	3331	-9.659
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-57	1332	0	2332	-57	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	-57	1336	0	2336	-57	3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-321	1337	-161	2337	-949	3337	-910
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	11.272	1338	11.966	2338	11.900	3338	12.715
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	10.951	1339	11.805	2339	10.951	3339	11.805

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2020		Acumulado anterior 30/06/2019
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	12	1357	-69	2357	16	3357	-76
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	12	1358	-69	2358	16	3358	-76
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	5	1360	49	2360	49	3360	90
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-16	1362	19	2362	-64	3362	-15
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

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2020								Situación cierre anual anterior 31/12/2019								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	1,12	0400	0,90	0420	0	0440	4,21	1380	1	1400	0,83	1420	0	1440	4,94	2380	0	2400	0	2420	0	2440	0
Certificados de transmisión de hipoteca	0381		0401		0421		0441		1381		1401		1421		1441		2381		2401		2421		2441	
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	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, 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	1	0467	0	0474		0481		0488	0	0495	87	0502	0	0509	87
De 1 a 3 meses	0461	1	0468	1	0475	0	0482		0489	1	0496	14	0503		0510	15
De 3 a 6 meses	0462	1	0469	1	0476	0	0483		0490	1	0497	0	0504		0511	2
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	6	0477	0	0484	0	0491	6	0498	131	0505		0512	137
De 9 a 12 meses	0464		0471		0478		0485		0492		0499		0506		0513	
Más de 12 meses	0465	7	0472	325	0479	1	0486	12	0493	338	0500	467	0507		0514	805
Total	0466	11	0473	334	0480	1	0487	12	0494	347	0501	699	0508	0	1515	1.046

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	1	0522	0	0529		0536		0543	0	0550	87	0557	0	0564	87	0571	402	0578	402	0584	21,74
De 1 a 3 meses	0516	1	0523	1	0530	0	0537		0544	1	0551	14	0558		0565	15	0572	179	0579	179	0585	8,49
De 3 a 6 meses	0517	1	0524	1	0531	0	0538		0545	1	0552	0	0559		0566	2	0573	127	0580	127	0586	1,23
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	6	0532	0	0539	0	0546	6	0553	131	0560		0567	137	0574	331	0581	331	0587	41,45
De 9 a 12 meses	0519		0526		0533		0540		0547		0554		0561		0568		0575		0582		0588	
Más de 12 meses	0520	7	0527	325	0534	1	0541	12	0548	338	0555	467	0562		0569	805	0576	1.726	0583	1.726	0589	46,66
Total	0521	11	0528	334	0535	1	0542	12	0549	347	0556	699	0563	0	0570	1.046	0577	2.764			0590	37,86

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 30/10/2003	
Inferior a 1 año	0600	339	1600	270	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	1.478	1601	957	2601	5
Entre 2 y 3 años	0602	4.955	1602	4.560	2602	74
Entre 3 y 4 años	0603	1.108	1603	3.629	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	1.969	1604	1.782	2604	942
Entre 5 y 10 años	0605	25.760	1605	28.186	2605	17.654
Superior a 10 años	0606	47.815	1606	51.311	2606	781.325
Total	0607	83.423	1607	90.694	2607	800.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	9,68	1608	9,98	2608	23,84

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 30/10/2003	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	17,51	1609	17,02	2609	0,88

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 30/10/2003			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.998	0630	82.743	1620	2.012	1630	84.570	2620	1.330	2630	120.736
40% - 60%	0621	2	0631	275	1621	64	1631	5.719	2621	2.069	2631	250.252
60% - 80%	0622	1	0632	405	1622	1	1632	405	2622	2.722	2632	429.012
80% - 100%	0623		0633		1623		1633		2623	0	2633	0
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624	0	2634	0
120% - 140%	0625		0635		1625		1635		2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627	0	2637	0
Total	0628	2.001	0638	83.423	1628	2.077	1638	90.694	2628	6.121	2638	800.000
Media ponderada (%)	0639	24,49	0649		1639	25,28	1649		2639	59,77	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 30/10/2003	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,27	1650	0,30	2650	3,23
Tipo de interés nominal máximo	0651	3,07	1651	3,07	2651	4,61
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,05	1652	0,05	2652	2,46

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 30/10/2003			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	360	0683	12.875	1660	374	1683	14.162	2660	1.019	2683	111.584
Aragón	0661	57	0684	1.792	1661	59	1684	1.951	2661	154	2684	19.063
Asturias	0662	37	0685	1.040	1662	40	1685	1.144	2662	112	2685	11.235
Baleares	0663	59	0686	2.102	1663	61	1686	2.293	2663	171	2686	19.621
Canarias	0664	83	0687	3.420	1664	85	1687	3.655	2664	280	2687	32.670
Cantabria	0665	44	0688	1.348	1665	46	1688	1.516	2665	152	2688	16.101
Castilla-León	0666	77	0689	2.412	1666	80	1689	2.622	2666	253	2689	27.619
Castilla La Mancha	0667	4	0690	284	1667	4	1690	299	2667	9	2690	1.365
Cataluña	0668	211	0691	10.137	1668	216	1691	10.810	2668	641	2691	95.142
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	0
Extremadura	0670		0693		1670		1693		2670	0	2693	0
Galicia	0671	53	0694	1.968	1671	55	1694	2.122	2671	168	2694	17.628
Madrid	0672	700	0695	34.469	1672	730	1695	37.549	2672	2.248	2695	336.840
Melilla	0673	1	0696	4	1673	1	1696	8	2673	1	2696	131
Murcia	0674	42	0697	1.455	1674	43	1697	1.565	2674	93	2697	10.259
Navarra	0675	33	0698	1.380	1675	37	1698	1.540	2675	105	2698	14.323
La Rioja	0676	15	0699	728	1676	15	1699	765	2676	37	2699	4.996
Comunidad Valenciana	0677	156	0700	5.349	1677	159	1700	5.797	2677	414	2700	45.905
País Vasco	0678	69	0701	2.659	1678	72	1701	2.894	2678	264	2701	35.518
Total España	0679	2.001	0702	83.423	1679	2.077	1702	90.694	2679	6.121	2702	800.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	2.001	0705	83.423	1682	2.077	1705	90.694	2682	6.121	2705	800.000

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 30/10/2003			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	2,80			1710	2,67			2710	0,90		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2020			Situación cierre anual anterior 31/12/2019			Situación inicial 30/10/2003					
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			
ES0370143002	A	7.760	10.108	78.436	7.760	11.159	86.594	7.760	100.000	776.000			
ES0370143010	B	240	31.457	7.550	240	31.457	7.550	240	100.000	24.000			
Total		0723	8.000	0724	85.985	1723	8.000	1724	94.143	2723	8.000	2724	800.000

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2020

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		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas	
						0730	0731			0732	0733	0734	0735			0742
ES0370143002	A	NS	EURIBOR 3 MESES	0,25	0	0	0	0	SI	78.436	0	0	0	78.436		
ES0370143010	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,65	0,40	6	0	0	SI	7.550	0	0	0	7.556		
Total						0740	6	0741	0	0743	85.985	0744	0	0745	85.992	0746

	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 30/10/2003	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,02	0748	0,02	0749	0,04

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2020								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2019							
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								
ES0370143002	A	3.502	697.564	0	119.847	4.495	681.097	0	119.847								
ES0370143010	B	0	16.450	5	6.746	0	16.450	6	6.725								
Total		0754	3.502	0755	714.015	0756	5	0757	126.593	1754	4.495	1755	697.547	1756	6	1757	126.572

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/06/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 30/10/2003
				0762	0763	0764
ES0370143002	A	26/04/2018	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0370143002	A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0370143002	A	25/07/2018	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0370143010	B	08/06/2020	FCH	A	A	A
ES0370143010	B	27/12/2018	MDY	Aa3	Aa3	A2
ES0370143010	B	17/06/2019	SYP	AA+	AA+	A

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente				
	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 30/10/2003
Inferior a 1 año	0765	85.985	1765	94.143	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		1770		2770
Superior a 10 años	0771		1771		2771
Total	0772	85.985	1772	94.143	2772
Vida residual media ponderada (años)	0773	0,51	1773	0	2773
					800.000
					800.000
					13,52

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 30/10/2003	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	7.722	1775	7.694	2775	13.200
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	8.000	1776	8.000	2776	13.200
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	8,98	1777	8,17	2777	1
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783	Notas Explicativas	2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	91,22	1792	91,98	2792	97
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 Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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 30/06/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 30/10/2003	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Permuta 1	BARCLAYS BANK PLC	TRIMESTRAL	Intereses ordinarios y de demora percibidos por el Fondo durante el Periodo de Liquidación el Importe Nominal, multiplicado por 360 y dividido por los días efectivos existentes en dicho Periodo de Liquidación	Suma de los Importes Nocionales Individuales. Importe Nocional Individual de cada Préstamo Hipotecario : se dividirán (i) las sumas percibidas por el Fondo en concepto de intereses ordinarios y de demora en cada uno de los Préstamos Hipotecarios, entre (ii) el tipo anual de interés de referencia aplicado en el correspondiente Préstamo Hipotecario, incrementado en un margen de 45 puntos básicos (0,45%)	Importe Nocional del Periodo de Liquidación por el tipo de interés EURIBOR a 3 meses incrementado en 43 puntos básicos (0,43%).	Suma de los Importes Nocionales Individuales. Importe Nocional Individual de cada Préstamo Hipotecario : se dividirán (i) las sumas percibidas por el Fondo en concepto de intereses ordinarios y de demora en cada uno de los Préstamos Hipotecarios, entre (ii) el tipo anual de interés de referencia aplicado en el correspondiente Préstamo Hipotecario, incrementado en un margen de 45 puntos básicos (0,45%)	-51	-180	-601	
Total							0808 -51	0809 -180	0810 -601	

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 30/10/2003		Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 30/10/2003			
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 Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/06/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación actual 30/06/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Última Fecha Pago							
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	346	7006	325	7009	1,12	7012	1	7015	1,07		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	346	7008	325	7011	1,12	7014	1	7017	345.511	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	338	7024	314	7027	0,95	7030	0,89	7033	0,81		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	338	7026	314	7029	0,95	7032	0,89	7035	0,81	7036	FOLLETO INFORMA TIVO. CAPÍTULO II. APARTAD O II.11.3.2.4

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Última Fecha Pago		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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
a) El importe a que asciende el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias en morosidad que presenten más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, sea superior al % establecido para cada ISIN del Saldo Vivo de los Activos en es	2	0,16	0,27	FOLLETO INFORMATIVO. CAPÍTULO II. APARTADO II.11.3.2.1
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
(iii) Cuando en la Fecha de Determinación correspondiente a la Fecha de Pago en curso el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera igual o superior al porcentaje recogido	1	1,97	1,94	FOLLETO INFORMATIVO. CAPÍTULO V. APARTADO V.3.4
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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	0,020	4862	150	5862	30	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	CAIXABANK, S.A.	1863	0	2863	Días del mes /Días año	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Trimestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	SOCIETE GENERALE	1864	5	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	

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2020

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	Caixabank
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	IV.1.2

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
		31/03/2020	30/06/2020										
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872												
Margen de intereses	0873	-62	39										-23
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	111	-92										19
Dotaciones a provisiones (neto)	0875	0											0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876												0
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-24	-20										-44
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	24	-72	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-48
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879												0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880	-24											-24
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881												0
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	0	72	0	0	0	0	0	0	0	0	0	72
Comisión variable pagada	0883												0
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884												0

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

S.06

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario III FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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