

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION
Número de registro del Fondo: 202000009
NIF Fondo: V01616598
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: 31/12/2020

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)

Derivado del proceso de Auditoría se han efectuado modificaciones en los Estados por reclasificaciones, sin que afecte a resultados

S01 Balance. Pasivo. Modificación importe celda 0126, 0127 y 0128
S01 Balance. Pasivo. Modificación importe celda 0144, 0150, 0151, 0152 y 0155
S02. Cuenta de Pérdidas y Ganancias. Modificación importe celdas 0205, 0225, 0226, 0227 y 0239
S02. Cuenta de Pérdidas y Ganancias. Modificación importe celdas 2205, 2225, 2226, 2227 y 2239
S05.1 Cuadros E, F Y G. Modificación varias celdas , número de activos totales cedidos
S05.2 Cuadros A, B y E. .Modificación varias celdas , modificar intereses devengados y nominal de las emisiones.

Denominación Fondo: HT Working Capital, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2020		Periodo anterior 31/12/2019
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001		1001	
I. Activos financieros a largo plazo	0002		1002	
1. Activos titulizados	0003		1003	
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
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		1025	
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027		1027	
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: HT Working Capital, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	8.158	1041	0
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	7.794	1043	0
1. Activos titulizados	0044	7.794	1044	0
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
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	7.794	1064	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065		1065	
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066		1066	0
1.23 Activos dudosos -principal-	0067		1067	0
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068		1068	0
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069		1069	0
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	0
3. Otros activos financieros	0074		1074	
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077		1077	
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	0	1082	
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	0	1084	
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	363	1085	
1. Tesorería	0086	363	1086	
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	8.158	1088	0

Denominación Fondo: HT Working Capital, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2020		Periodo anterior 31/12/2019
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089		1089	
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		1094	
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095		1095	
1.1 Series no subordinadas	0096		1096	
1.2 Series subordinadas	0097		1097	
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		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	

Denominación Fondo: HT Working Capital, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) PASIVO CORRIENTE	0117	8.158	1117	0
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	7.932	1123	0
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	7.195	1124	0
1.1 Series no subordinadas	0125	7.560	1125	
1.2 Series subordinadas	0126		1126	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	-370	1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	5	1128	0
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	0
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	737	1143	
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	302	1144	
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146	435	1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	226	1148	
1. Comisiones	0149	6	1149	
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	3	1150	
1.2 Comisión administrador	0151	2	1151	
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	1	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	219	1157	
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	8.158	1162	0

Denominación Fondo: HT Working Capital, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2020

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2020		Acumulado anterior 31/12/2019
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	41	1201		2201	41	3201	
1.1 Activos titulizados	0202	41	1202		2202	41	3202	
1.2 Otros activos financieros	0203		1203		2203		3203	
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-5	1204	0	2204	-5	3204	
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-5	1205		2205	-5	3205	
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206		1206		2206		3206	
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208		1208	0	2208		3208	
A) MARGEN DE INTERESES	0209	35	1209	0	2209	35	3209	
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210		1210	0	2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211		1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212		1212		2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213		1213		2213		3213	
4.4 Otros	0214		1214		2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215		1215		2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216		1216		2216		3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-406	1217		2217	-406	3217	0
7.1 Servicios exteriores	0218	-311	1218		2218	-311	3218	
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-196	1219		2219	-196	3219	
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220		1220		2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221		1221		2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	-116	1222		2222	-116	3222	
7.2 Tributos	0223	-6	1223		2223	-6	3223	
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-89	1224		2224	-89	3224	0
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-84	1225		2225	-84	3225	
7.3.2 Comisión administrador	0226	-2	1226		2226	-2	3226	
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-1	1227		2227	-1	3227	
7.3.4 Comisión variable	0228		1228		2228		3228	
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	-2	1229		2229	-2	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230		1230		2230		3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231		1231		2231		3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232		1232		2232		3232	0
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233		1233		2233		3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234		1234		2234		3234	0
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235		1235		2235		3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236		1236		2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237		1237		2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238		1238		2238		3238	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	370	1239		2239	370	3239	
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241		1241		2241		3241	
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: HT Working Capital, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2020

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2020		Acumulado anterior 31/12/2019
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-1	1300		2300	-1	3300	
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	0	1301		2301	0	3301	
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	0	1302		2302	0	3302	
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	0	1303		2303	0	3303	
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304		2304	0	3304	
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305		2305	0	3305	
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306		2306	0	3306	
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307		2307	0	3307	
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308		2308	0	3308	
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-81	1309		2309	-81	3309	
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-81	1310		2310	-81	3310	
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311		2311	0	3311	
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312		2312	0	3312	
2.4 Comisión variable	0313	0	1313		2313	0	3313	
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314		2314	0	3314	
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	80	1315		2315	80	3315	
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316		2316	0	3316	
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317		2317	0	3317	
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318		2318	0	3318	
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319		2319	0	3319	
3.5 Otros pagos de explotación	0320	-5	1320		2320	-5	3320	
3.6 Otros cobros de explotación	0321	85	1321		2321	85	3321	
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	364	1322		2322	364	3322	
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	7.560	1323		2323	7.560	3323	
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	-7.195	1324		2324	-7.195	3324	
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	0	1325		2325	0	3325	
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	0	1326		2326	0	3326	
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	0	1327		2327	0	3327	
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	0	1328		2328	0	3328	
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329		2329	0	3329	
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330		2330	0	3330	
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	0	1331		2331	0	3331	
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332		2332	0	3332	
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333		2333	0	3333	
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334		2334	0	3334	
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335		2335	0	3335	
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336		2336	0	3336	
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	363	1337		2337	363	3337	
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	0	1338		2338	0	3338	
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	363	1339		2339	363	3339	

Denominación Fondo: HT Working Capital, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2020

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2020		Acumulado anterior 31/12/2019
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350		2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351		2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352		2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353		2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354		2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0355	0	1355		2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356		2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	0	1357		2357	0	3357	
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	0	1358		2358	0	3358	
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359		2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	0	1360		2360	0	3360	
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361		2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0362	0	1362		2362	0	3362	
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363		2363	0	3363	
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		2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365		2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366		2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367		2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0368	0	1368		2368		3368	
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369		2369		3369	
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370		2370	0	3370	

Denominación Fondo: HT Working Capital, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2020								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		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381		0401		0421		0441		1381		1401		1421		1441		2381		2401		2421		2441	
Préstamos hipotecarios	0382		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: HT Working Capital, FT															
Denominación del compartimento:															
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.															
Estados agregados: SI															
Fecha: 31/12/2020															
Entidades cedentes de los activos titulizados:															

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	0	0467	0	0474	0	0481	0	0488	0	0495	0	0502	0	0509	0
De 1 a 3 meses	0461	0	0468	0	0475	0	0482	0	0489	0	0496	0	0503	0	0510	0
De 3 a 6 meses	0462	0	0469	0	0476	0	0483	0	0490	0	0497	0	0504	0	0511	0
De 6 a 9 meses	0463	0	0470	0	0477	0	0484	0	0491	0	0498	0	0505	0	0512	0
De 9 a 12 meses	0464	0	0471	0	0478	0	0485	0	0492	0	0499	0	0506	0	0513	0
Más de 12 meses	0465	0	0472	0	0479	0	0486	0	0493	0	0500	0	0507	0	0514	0
Total	0466	0	0473	0	0480	0	0487	0	0494	0	0501	0	0508	0	1515	0

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	0	0522	0	0529	0	0536	0	0543	0	0550	0	0557	0	0564	0	0571	0	0578	0	0584	
De 1 a 3 meses	0516	0	0523	0	0530	0	0537	0	0544	0	0551	0	0558	0	0565	0	0572	0	0579	0	0585	
De 3 a 6 meses	0517	0	0524	0	0531	0	0538	0	0545	0	0552	0	0559	0	0566	0	0573	0	0580	0	0586	
De 6 a 9 meses	0518	0	0525	0	0532	0	0539	0	0546	0	0553	0	0560	0	0567	0	0574	0	0581	0	0587	
De 9 a 12 meses	0519	0	0526	0	0533	0	0540	0	0547	0	0554	0	0561	0	0568	0	0575	0	0582	0	0588	
Más de 12 meses	0520	0	0527	0	0534	0	0541	0	0548	0	0555	0	0562	0	0569	0	0576	0	0583	0	0589	
Total	0521	0	0528	0	0535	0	0542	0	0549	0	0556	0	0563	0	0570	0	0577	0			0590	

S.05.1
Denominación Fondo: HT Working Capital, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 31/12/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente				
	Situación actual 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 01/12/2020
Inferior a 1 año	0600	7.794	1600		2600 177
Entre 1 y 2 años	0601	0	1601		2601
Entre 2 y 3 años	0602	0	1602		2602
Entre 3 y 4 años	0603	0	1603		2603
Entre 4 y 5 años	0604	0	1604		2604
Entre 5 y 10 años	0605	0	1605		2605
Superior a 10 años	0606	0	1606		2606
Total	0607	7.794	1607		2607 177
Vida residual media ponderada (años)	0608	0,26	1608		2608 0,35

Antigüedad	Situación actual 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 01/12/2020
Antigüedad media ponderada (años)	0609		1609		2609

	S.05.1
Denominación Fondo: HT Working Capital, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 31/12/2020	
Entidades cedentes de los activos titulizados:	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 01/12/2020			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	0	0630	0	1620		1630		2620		2630	
40% - 60%	0621	0	0631	0	1621		1631		2621		2631	
60% - 80%	0622	0	0632	0	1622		1632		2622		2632	
80% - 100%	0623	0	0633	0	1623		1633		2623		2633	
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624		1634		2624		2634	
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625		1635		2625		2635	
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626		1636		2626		2636	
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627		1637		2627		2637	
Total	0628	0	0638	0	1628		1638		2628		2638	
Media ponderada (%)	0639		0649		1639		1649		2639		2649	

S.05.1
Denominación Fondo: HT Working Capital, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 31/12/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 01/12/2020	
Tipo de interés medio ponderado	0650	7,87	1650		2650	
Tipo de interés nominal máximo	0651	7,87	1651		2651	
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0	1652		2652	

	S.05.1
Denominación Fondo: HT Working Capital, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 31/12/2020	
Entidades cedentes de los activos titulizados:	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 01/12/2020			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	0	0683	0	1660		1683		2660		2683	
Aragón	0661	0	0684	0	1661		1684		2661		2684	
Asturias	0662	2	0685	486	1662		1685		2662		2685	
Baleares	0663	0	0686	0	1663		1686		2663		2686	
Canarias	0664	0	0687	0	1664		1687		2664		2687	
Cantabria	0665	0	0688	0	1665		1688		2665		2688	
Castilla-León	0666	5	0689	1.042	1666		1689		2666		2689	
Castilla La Mancha	0667	4	0690	78	1667		1690		2667		2690	
Cataluña	0668	12	0691	2.431	1668		1691		2668	1	2691	177
Ceuta	0669	0	0692	0	1669		1692		2669		2692	
Extremadura	0670	0	0693	0	1670		1693		2670		2693	
Galicia	0671	0	0694	0	1671		1694		2671		2694	
Madrid	0672	0	0695	0	1672		1695		2672		2695	
Melilla	0673	0	0696	0	1673		1696		2673		2696	
Murcia	0674	1	0697	24	1674		1697		2674		2697	
Navarra	0675	0	0698	0	1675		1698		2675		2698	
La Rioja	0676	0	0699	0	1676		1699		2676		2699	
Comunidad Valenciana	0677	6	0700	1.500	1677		1700		2677		2700	
País Vasco	0678	10	0701	2.233	1678		1701		2678		2701	
Total España	0679	40	0702	7.794	1679		1702		2679	1	2702	177
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680		1703		2680		2703	
Resto	0681	0	0704	0	1681		1704		2681		2704	
Total general	0682	40	0705	7.794	1682		1705		2682	1	2705	177

HT Working Capital, FT

	S.05.1
Denominación Fondo: HT Working Capital, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 31/12/2020	
Entidades cedentes de los activos titulizados:	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 01/12/2020			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	98,69			1710				2710			
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

HT Working Capital, FT

	S.05.2
Denominación Fondo: HT Working Capital, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Periodo de la declaración: 31/12/2020	
Mercados de cotización de los valores emitidos: Otros	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 01/12/2020								
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
ES0505526006	Pagare1	9		100.000	200				0			2		100.000	200			
ES0505526014	Pagare2	53		100.000	5.078							0		0	0			
ES0505526022	Pagare3	23		100.000	2.282							0		0	0			
Total		0723	85		0724	7.560	1723			1724		2723	2		2724	200		

HT Working Capital, FT

S.05.2											
Denominación Fondo: HT Working Capital, FT											
Denominación del compartimento:											
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.											
Estados agregados: SI											
Periodo de la declaración: 31/12/2020											
Mercados de cotización de los valores emitidos: Otros											

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
ES0505526006	Pagare1	NS	FIJO	0	1	0		0		NO	200		0		200			
ES0505526014	Pagare2	NS	FIJO	0	2,18	4		0		NO	5.078		0		5.082			
ES0505526022	Pagare3	NS	FIJO	0	1,08	1		0		NO	2.282		0		2.283		-370	
Total						0740	5	0741	0		0743	7.560	0744	0	0745	7.565	0746	-370

	Situación actual 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 01/12/2020	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	1,83	0748		0749	2,10

HT Working Capital, FT

	S.05.2
Denominación Fondo: HT Working Capital, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Periodo de la declaración: 31/12/2020	
Mercados de cotización de los valores emitidos: Otros	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2020								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2019							
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	
ES0505526014	Pagare2																
ES0505526022	Pagare3																
ES0505526006	Pagare1																
Total		0754		0755		0756		0757		1754		1755		1756		1757	

HT Working Capital, FT

	S.05.2
Denominación Fondo: HT Working Capital, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Periodo de la declaración: 31/12/2020	
Mercados de cotización de los valores emitidos: Otros	

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		
		0760	0761	Situación actual 31/12/2020 0762	Situación cierre anual anterior 31/12/2019 0763	Situación inicial 01/12/2020 0764
ES0505526014	Pagare2	23/11/2020	OTROS	A+		
ES0505526022	Pagare3	23/11/2020	OTROS	A+		
ES0505526006	Pagare1	23/11/2020	OTROS	A+		

HT Working Capital, FT

	S.05.2
Denominación Fondo: HT Working Capital, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Periodo de la declaración: 31/12/2020	
Mercados de cotización de los valores emitidos: Otros	

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 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 01/12/2020	
Inferior a 1 año	0765	2.482	1765		2765	200
Entre 1 y 2 años	0766	5.078	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	7.560	1772		2772	200
Vida residual media ponderada (años)	0773	1,56	1773		2773	0,30

	S.05.3
Denominación Fondo: HT Working Capital, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 31/12/2020	

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo		Situación actual 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 01/12/2020	
1	Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775		1775		2775	
1.1	Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776		1776		2776	
1.2	Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777		1777		2777	
1.3	Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778		2778	Notas Explicativas
1.4	Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779		2779	Notas Explicativas
1.5	Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780		2780	Notas Explicativas
2	Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781		1781		2781	
2.1	Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782		1782		2782	
2.2	Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783		2783	Notas Explicativas
2.3	Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784		2784	Notas Explicativas
2.4	Rating requerido de la contrapartida	0785	Notas Explicativas	1785		2785	Notas Explicativas
3	Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786		1786		2786	
3.1	Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787		1787		2787	
3.2	Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788		2788	Notas Explicativas
3.3	Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789		2789	Notas Explicativas
3.4	Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790		2790	Notas Explicativas
4	Subordinación de series (S/N)	0791	N	1791		2791	N
4.1	Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	100	1792		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	

HT Working Capital, FT

S.05.3											
Denominación Fondo: HT Working Capital, FT											
Denominación del compartimento:											
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.											
Estados agregados: SI											
Fecha: 31/12/2020											

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 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 01/12/2020		
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806		1806		2806		
Total							0808		0809		0810		

S.05.3													
Denominación Fondo: HT Working Capital, FT													
Denominación del compartimento:													
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.													
Estados agregados: SI													
Fecha: 31/12/2020													

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 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 01/12/2020		Situación actual 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 01/12/2020			
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	

HT Working Capital, FT

S.05.4															
Denominación Fondo: HT Working Capital, FT															
Denominación del compartimento:															
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.															
Estados agregados: SI															
Fecha: 31/12/2020															

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 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación actual 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Última Fecha Pago			
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	0	7003	0	7006		7009		7012		7015			
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	0	7008		7011		7014		7017	0	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	0	7020	0	7021	0	7024		7027		7030		7033			
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025		7028		7031		7034			
Total Fallidos					7023	0	7026		7029	0	7032		7035	0	7036	

	Ratio						Ref. Folleto	
Otras ratios relevantes	Situación actual 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Última Fecha Pago			
	0850		1850		2850		3850	
	0851		1851		2851		3851	
	0852		1852		2852		3852	
	0853		1853		2853		3853	

HT Working Capital, FT

	S.05.4
Denominación Fondo: HT Working Capital, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 31/12/2020	

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
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

HT Working Capital, FT

	S.05.5
Denominación Fondo: HT Working Capital, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 31/12/2020	

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		1862		2862		3862		4862		5862		6862		7862		8862	
Comisión administrador	0863		1863	0	2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864		1864		2864		3864		4864		5864		6864		7864		8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

	S.05.5
Denominación Fondo: HT Working Capital, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 31/12/2020	

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

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

HT Working Capital, FT

	S.05.5
Denominación Fondo: HT Working Capital, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 31/12/2020	

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: HT Working Capital, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	
Estados agregados: SI	
Fecha: 31/12/2020	

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