

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A.
Número de registro del Fondo: 8715
NIF Fondo: V85076677
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: SI
Fecha: 31/12/2021

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)

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2021		Periodo anterior 31/12/2020
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	1.033.998	1001	1.186.683
I. Activos financieros a largo plazo	0002	1.033.998	1002	1.186.683
1. Activos titulizados	0003	1.033.998	1003	1.186.683
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	1.027.988	1005	1.183.749
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	6.010	1025	16.660
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	0	1027	-13.726
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 Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	280.166	1041	286.961
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	155.739	1043	150.420
1. Activos titulizados	0044	155.739	1044	150.420
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	155.325	1046	146.988
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	174	1065	316
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	15	1066	13
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	232	1067	19.421
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	8	1068	81
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-15	1069	-16.399
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	21	1082	21
1. Comisiones	0083	21	1083	21
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	124.406	1085	136.520
1. Tesorería	0086	124.406	1086	136.520
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	1.314.164	1088	1.473.644

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2021		Periodo anterior 31/12/2020
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	1.109.940	1089	1.270.816
I. Provisiones a largo plazo	0090		1090	
1. Provisión garantías financieras	0091		1091	
2. Provisión por margen de intermediación	0092		1092	
3. Otras provisiones	0093		1093	
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	1.109.940	1094	1.270.816
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	1.040.366	1095	1.189.950
1.1 Series no subordinadas	0096	762.554	1096	907.811
1.2 Series subordinadas	0097	277.812	1097	282.139
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	66.053	1101	75.741
2.1 Préstamo subordinado	0102	133.488	1102	133.488
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-67.436	1105	-57.747
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	1.892	1108	3.056
3.1 Derivados de cobertura	0109	1.892	1109	3.056
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	1.629	1112	2.069
4.1 Garantías financieras	0113	1.629	1113	2.069
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) PASIVO CORRIENTE	0117	206.116	1117	205.884
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	205.994	1123	205.779
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	182.299	1124	183.863
1.1 Series no subordinadas	0125	179.790	1125	178.345
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	2.725
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	2.509	1128	2.792
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	23.594	1131	21.683
2.1 Préstamo subordinado	0132	847	1132	847
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	410	1136	414
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	22.338	1137	20.423
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	99	1139	193
3.1 Derivados de cobertura	0140	99	1140	193
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	2	1143	40
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	2	1144	40
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	121	1148	105
1. Comisiones	0149	57	1149	48
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	36	1150	39
1.2 Comisión administrador	0151	2.019	1151	1.886
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	21	1152	9
1.4 Comisión variable	0153	3.870	1153	3.870
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-5.890	1155	-5.756
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	64	1157	57
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-1.892	1158	-3.056
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-1.892	1160	-3.056
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	1.314.164	1162	1.473.644

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2021		Acumulado anterior 31/12/2020
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	1.021	1201	2.268	2201	5.306	3201	8.352
1.1 Activos titulizados	0202	1.021	1202	2.268	2202	5.306	3202	8.352
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203		3203	
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-4.328	1204	-4.841	2204	-17.847	3204	-19.835
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-3.742	1205	-4.193	2205	-15.513	3205	-17.232
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-585	1206	-649	2206	-2.335	3206	-2.603
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-94	1208	-166	2208	-467	3208	-516
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-3.401	1209	-2.739	2209	-13.009	3209	-11.999
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	11	3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-148	1217	-168	2217	-492	3217	-552
7.1 Servicios exteriores	0218	-63	1218	-38	2218	-73	3218	-88
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	-2	2219	-6	3219	-6
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	-62	1222	-36	2222	-67	3222	-83
7.2 Tributos	0223	0	1223	-1	2223	0	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-85	1224	-130	2224	-419	3224	-462
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-19	1225	-62	2225	-202	3225	-232
7.3.2 Comisión administrador	0226	-32	1226	-37	2226	-133	3226	-148
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-13	1227	-13	2227	-62	3227	-52
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	-22	1230	-18	2230	-22	3230	-30
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	2.099	1231	-13	2231	3.668	3231	1.287
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	2.099	1232	-13	2232	3.668	3232	1.287
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	1.450	1239	2.920	2239	9.822	3239	11.264
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241		3241	
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

S.03

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2021		Acumulado anterior 31/12/2020
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-3.370	1300	-3.043	2300	-12.042	3300	-10.524
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-3.212	1301	-2.771	2301	-11.301	3301	-9.765
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	1.098	1302	2.214	2302	5.480	3302	8.473
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-4.254	1303	-4.749	2303	-15.798	3303	-17.506
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	-49	1304	160	2304	-42	3304	387
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-6	1305	-158	2305	-519	3305	-879
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	-238	2307	-422	3307	-238
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	1.311	1309	-71	2309	-255	3309	-311
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-53	1310	-58	2310	-205	3310	-225
2.2 Comisión administrador	0311	1.376	1311	0	2311	0	3311	-32
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-13	1312	-13	2312	-50	3312	-50
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	-3
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-1.470	1315	-201	2315	-486	3315	-448
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	-1.711	1320	-201	2320	-2.056	3320	-448
3.6 Otros cobros de explotación	0321	242	1321	0	2321	1.570	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	3.293	1322	6.677	2322	-41	3322	1.682
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	3.293	1325	6.677	2325	-41	3325	1.682
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	20.666	1326	20.834	2326	83.266	3326	84.755
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	16.422	1327	18.700	2327	58.409	3327	48.000
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	3.278	1328	2.416	2328	9.148	3328	9.303
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-37.074	1331	-35.273	2331	-150.864	3331	-140.376
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	-77	1337	3.634	2337	-12.083	3337	-8.842
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	124.484	1338	132.886	2338	136.489	3338	145.362
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	124.406	1339	136.520	2339	124.406	3339	136.520

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2021		Acumulado anterior 31/12/2020
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 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	181	1357	360	2357	697	3357	-416
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	181	1358	360	2358	697	3358	-416
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	94	1360	166	2360	467	3360	516
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-275	1362	-526	2362	-1.164	3362	-100
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 Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2021								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		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	2,69	0401	0	0421	0	0441	4,58	1381	2,64	1401	0	1421	0	1441	3,39	2381	12,23	2401	2,14	2421	0	2441	0
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382	0	2402	0	2422	0	2442	0
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383	0	2403	0	2423	0	2443	0
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384	0	2404	0	2424	0	2444	0
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385	0	2405	0	2425	0	2445	0
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386	0	2406	0	2426	0	2446	0
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387	0	2407	0	2427	0	2447	0
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388	0	2408	0	2428	0	2448	0
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389	0	2409	0	2429	0	2449	0
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390	0	2410	0	2430	0	2450	0
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391	0	2411	0	2431	0	2451	0
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392	0	2412	0	2432	0	2452	0
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393	0	2413	0	2433	0	2453	0
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394	0	2414	0	2434	0	2454	0
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395	0	2415	0	2435	0	2455	0
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396	0	2416	0	2436	0	2456	0
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397	0	2417	0	2437	0	2457	0
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398	0	2418	0	2438	0	2458	0
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399	0	2419	0	2439	0	2459	0

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	257	0467	92	0474	4	0481	0	0488	95	0495	21.896	0502	3	0509	21.995
De 1 a 3 meses	0461	106	0468	101	0475	12	0482	-1	0489	112	0496	10.652	0503	2	0510	10.766
De 3 a 6 meses	0462	31	0469	53	0476	6	0483	3	0490	62	0497	3.029	0504	0	0511	3.091
De 6 a 9 meses	0463	12	0470	26	0477	0	0484	1	0491	28	0498	589	0505	0	0512	617
De 9 a 12 meses	0464	13	0471	58	0478	0	0485	1	0492	60	0499	1.071	0506	0	0513	1.131
Más de 12 meses	0465	16	0472	94	0479	2	0486	6	0493	102	0500	1.320	0507	0	0514	1.422
Total	0466	435	0473	424	0480	24	0487	11	0494	459	0501	38.558	0508	5	1515	39.022

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	257	0522	92	0529	4	0536	0	0543	95	0550	21.896	0557	3	0564	21.995	0571	44.170	0578	11.954	0584	49,80
De 1 a 3 meses	0516	106	0523	101	0530	12	0537	-1	0544	112	0551	10.652	0558	2	0565	10.766	0572	20.873	0579	8.843	0585	51,58
De 3 a 6 meses	0517	31	0524	53	0531	6	0538	3	0545	62	0552	3.029	0559	0	0566	3.091	0573	6.462	0580	2.823	0586	47,84
De 6 a 9 meses	0518	12	0525	26	0532	0	0539	1	0546	28	0553	589	0560	0	0567	617	0574	1.741	0581	650	0587	35,44
De 9 a 12 meses	0519	13	0526	58	0533	0	0540	1	0547	60	0554	1.071	0561	0	0568	1.131	0575	2.432	0582	211	0588	46,49
Más de 12 meses	0520	16	0527	94	0534	2	0541	6	0548	102	0555	1.320	0562	0	0569	1.422	0576	2.888	0583	319	0589	49,23
Total	0521	435	0528	424	0535	24	0542	11	0549	459	0556	38.558	0563	5	0570	39.022	0577	78.566			0590	49,67

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/04/2007	
Inferior a 1 año	0600	687	1600	786	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	2.625	1601	1.682	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	4.835	1602	4.547	2602	31
Entre 3 y 4 años	0603	7.524	1603	7.052	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	10.120	1604	10.234	2604	670
Entre 5 y 10 años	0605	114.234	1605	104.220	2605	11.672
Superior a 10 años	0606	1.049.528	1606	1.238.298	2606	7.321.426
Total	0607	1.189.554	1607	1.366.818	2607	7.333.799
Vida residual media ponderada (años)	0608	14,99	1608	15,81	2608	

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/04/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	17,37	1609	16,39	2609	

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 31/12/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86201993 LIBERBANK, S.A. A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 19/04/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	7.280	0630	330.411	1620	6.482	1630	292.458	2620	3.720	2630	359.538
40% - 60%	0621	6.838	0631	625.333	1621	7.839	1631	716.452	2621	3.443	2631	373.552
60% - 80%	0622	1.773	0632	233.810	1622	2.624	1632	351.243	2622	19.547	2632	2.634.917
80% - 100%	0623	0	0633	0	1623	38	1633	6.667	2623	25.490	2633	3.965.792
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	15.891	0638	1.189.554	1628	16.983	1638	1.366.818	2628	52.200	2638	7.333.799
Media ponderada (%)	0639	47,80	0649		1639	50,83	1649		2639		2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/04/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,35	1650	0,52	2650	4,98
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,75	1651	6,75	2651	8,37
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,01	1652	0,02	2652	2,25

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 19/04/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	82	0683	7.131	1660	92	1683	8.791	2660	5.902	2683	748.521
Aragón	0661	270	0684	20.302	1661	287	1684	23.055	2661	779	2684	110.741
Asturias	0662	14	0685	963	1662	15	1685	1.259	2662	478	2685	57.694
Baleares	0663	4	0686	335	1663	4	1686	362	2663	1.528	2686	143.445
Canarias	0664	2	0687	106	1664	2	1687	118	2664	388	2687	50.490
Cantabria	0665	1.886	0688	127.662	1665	2.020	1688	148.003	2665	2.771	2688	373.605
Castilla-León	0666	313	0689	22.763	1666	334	1689	26.136	2666	2.063	2689	254.764
Castilla La Mancha	0667	2.651	0690	210.420	1667	2.814	1690	236.645	2667	4.412	2690	624.352
Cataluña	0668	134	0691	12.428	1668	145	1691	14.274	2668	3.745	2691	681.862
Ceuta	0669	0	0692	0	1669	0	1692	0	2669	1	2692	235
Extremadura	0670	6	0693	297	1670	6	1693	342	2670	348	2693	40.333
Galicia	0671	84	0694	7.745	1671	93	1694	8.918	2671	5.673	2694	601.415
Madrid	0672	2.409	0695	216.095	1672	2.579	1695	248.031	2672	5.635	2695	962.504
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	25	2696	2.736
Murcia	0674	89	0697	7.436	1674	95	1697	8.655	2674	393	2697	53.582
Navarra	0675	31	0698	2.872	1675	32	1698	3.267	2675	673	2698	107.854
La Rioja	0676	218	0699	15.957	1676	233	1699	18.358	2676	1.996	2699	267.238
Comunidad Valenciana	0677	961	0700	73.295	1677	1.047	1700	85.861	2677	3.587	2700	500.959
País Vasco	0678	6.737	0701	463.747	1678	7.184	1701	534.560	2678	11.799	2701	1.750.756
Total España	0679	15.891	0702	1.189.554	1679	16.982	1702	1.366.635	2679	52.196	2702	7.333.086
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	1	1704	184	2681	4	2704	713
Total general	0682	15.891	0705	1.189.554	1682	16.983	1705	1.366.818	2682	52.200	2705	7.333.799

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 31/12/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86201993 LIBERBANK, S.A. A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 19/04/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,33			1710	0,30			2710	16,29		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/12/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2021			Situación cierre anual anterior 31/12/2020			Situación inicial 19/04/2007		
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722
ES0312273008	A	13.912	29.262	407.092	13.912	33.892	471.505	13.912	100.000	1.391.200
ES0312273016	B	810	100.000	81.000	810	100.000	81.000	810	100.000	81.000
ES0312273024	C	135	100.000	13.500	135	100.000	13.500	135	100.000	13.500
ES0312273032	D	143	100.000	14.300	143	100.000	14.300	143	100.000	14.300
ES0312273081	A	1.753	32.239	56.515	1.753	36.597	64.155	1.753	100.000	175.300
ES0312273099	B	126	80.234	10.109	126	86.016	10.838	126	100.000	12.600
ES0312273107	C	82	80.234	6.579	82	85.219	6.988	82	100.000	8.200
ES0312273115	D	38	80.234	3.049	38	85.219	3.238	38	100.000	3.800
ES0312273248	A	7.160	25.368	181.634	7.160	29.211	209.153	7.160	100.000	716.000
ES0312273255	B	456	100.000	45.600	456	100.000	45.600	456	100.000	45.600
ES0312273263	C	280	100.000	28.000	280	100.000	28.000	280	100.000	28.000
ES0312273271	D	104	100.000	10.400	104	100.000	10.400	104	100.000	10.400
ES0312273362	A	9.555	23.832	227.712	9.555	28.023	267.755	9.555	100.000	955.500
ES0312273370	B	305	100.000	30.500	305	100.000	30.500	305	100.000	30.500
ES0312273388	C	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000
ES0312273396	D	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000
ES0312273446	A	2.035	34.099	69.391	2.035	36.161	73.588	2.035	100.000	203.500
ES0312273453	B	127	78.380	9.954	127	100.000	12.700	127	100.000	12.700
ES0312273461	C	103	78.435	8.079	103	100.000	10.300	103	100.000	10.300
ES0312273479	D	35	78.315	2.741	35	100.000	3.500	35	100.000	3.500
ES0312273156	D							11	100.000	1.100
ES0312273149	C							31	100.000	3.100
ES0312273131	B							74	100.000	7.400
ES0312273123	A							974	100.000	97.400
ES0312273164	A							3.691	100.000	369.100
ES0312273198	D							48	100.000	4.800

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

ES0312273180	C											80	100.000	8.000		
ES0312273172	B											180	100.000	18.000		
ES0312273313	D											153	100.000	15.300		
ES0312273305	C											216	100.000	21.600		
ES0312273297	B											369	100.000	36.900		
ES0312273289	A											8.262	100.000	826.200		
ES0312273438	D											124	100.000	12.400		
ES0312273420	C											380	100.000	38.000		
ES0312273412	B											446	100.000	44.600		
ES0312273404	A											8.550	100.000	855.000		
ES0312273511	D											60	100.000	6.000		
ES0312273503	C											51	100.000	5.100		
ES0312273495	B											135	100.000	13.500		
ES0312273487	A											1.454	100.000	145.400		
ES0312273040	A											898	100.000	89.800		
ES0312273057	B											56	100.000	5.600		
ES0312273065	C											41	100.000	4.100		
ES0312273073	D											5	100.000	500		
ES0312273206	A											4.375	100.000	437.500		
ES0312273214	B											450	100.000	45.000		
ES0312273222	C											110	100.000	11.000		
ES0312273230	D											65	100.000	6.500		
ES0312273321	A											1.350	100.000	135.000		
ES0312273339	B											63	100.000	6.300		
ES0312273347	C											51	100.000	5.100		
ES0312273354	D											36	100.000	3.600		
ES0312273529	A											1.622	100.000	162.200		
ES0312273537	B											170	100.000	17.000		
ES0312273545	C											160	100.000	16.000		
ES0312273552	D											48	100.000	4.800		
ES0312273560	A											1.112	100.000	111.200		
ES0312273578	B											63	100.000	6.300		
ES0312273586	C											50	100.000	5.000		
ES0312273594	D											25	100.000	2.500		
Total		0723	37.299		0724	1.220.156	1723	37.299		1724	1.371.020	2723	73.338		2724	7.333.800

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/12/2021

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	0738	0739					
													0730	0731	0732	0733	0734
ES0312273008	A	NS	FIJO	0	1,17	1.318	0	SI	407.092	0	408.410						
ES0312273016	B	S	FIJO	0	1,30	291	0	SI	81.000	0	81.291						
ES0312273024	C	S	FIJO	0	1,65	62	0	SI	13.500	0	13.562						
ES0312273032	D	S	FIJO	0	3	119	0	SI	14.300	0	14.419						
ES0312273081	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,17	0	0	0	SI	56.515	0	56.515						
ES0312273099	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,30	0	0	0	SI	10.109	0	10.109						
ES0312273107	C	S	EURIBOR 6 MESES	0,65	0,14	1	0	SI	6.579	0	6.580						
ES0312273115	D	S	EURIBOR 6 MESES	2	1,49	6	0	SI	3.049	0	3.055						
ES0312273248	A	NS	FIJO	0	1,30	214	0	SI	181.634	0	181.847						
ES0312273255	B	S	FIJO	0	1,60	66	0	SI	45.600	0	45.666						
ES0312273263	C	S	FIJO	0	2,50	63	0	SI	28.000	0	28.063						
ES0312273271	D	S	FIJO	0	3,50	33	0	SI	10.400	0	10.433						
ES0312273362	A	NS	FIJO	0	1,30	243	0	SI	227.712	0	227.956						
ES0312273370	B	S	FIJO	0	1,60	40	0	SI	30.500	0	30.540						
ES0312273388	C	S	FIJO	0	2	12	0	SI	7.000	0	7.012						
ES0312273396	D	S	FIJO	0	3	17	0	SI	7.000	0	7.017						
ES0312273446	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,30	0	0	0	SI	69.391	0	69.391						
ES0312273453	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,60	0,08	2	0	SI	9.954	0	9.957						
ES0312273461	C	S	EURIBOR 6 MESES	1	0,48	11	0	SI	8.079	0	8.090						
ES0312273479	D	S	EURIBOR 6 MESES	2	1,48	12	0	SI	2.741	0	2.753						
Total						0740	2.509	0741		0743	1.220.156	0744		0745	1.222.665	0746	

	Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/04/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	1,19	0748	1,19	0749	4,77

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/12/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2021				Situación periodo comparativo anterior 31/12/2020			
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
ES0312273446	A		134.109		21.270		129.912		21.270
ES0312273453	B		2.746		1.990		0		1.977
ES0312273461	C		2.221		2.162		0		2.113
ES0312273479	D		759		1.200		0		1.151
ES0312273123	A		97.400		12.067		97.400		12.067
ES0312273131	B		7.400		1.225		7.400		1.225
ES0312273149	C		3.100		632		3.100		632
ES0312273156	D		1.100		392		1.100		392
ES0312273016	B		0		21.776		0		20.723
ES0312273024	C		0		4.315		0		4.092
ES0312273032	D		0		7.154		0		6.725
ES0312273008	A		913.760		250.728		849.347		245.398
ES0312273362	A	19.801	750.809	1.613	148.953	19.385	710.766	1.872	145.604
ES0312273370	B	0	0	245	8.354	0	0	245	7.866
ES0312273388	C	0	0	70	2.316	0	0	70	2.176
ES0312273396	D	0	0	105	3.311	0	0	105	3.101
ES0312273081	A	3.981	118.785	0	23.880	0	111.145	9	23.880
ES0312273099	B	0	2.491	0	2.112	1.762	1.762	10	2.112
ES0312273107	C	0	1.621	5	1.770	1.212	1.212	21	1.761
ES0312273115	D	0	751	23	1.556	562	562	36	1.509
ES0312273164	A		369.100		42.626		369.100		42.626
ES0312273172	B		18.000		3.290		18.000		3.290
ES0312273180	C		8.000		2.261		8.000		2.261
ES0312273198	D		4.800		1.890		4.800		1.890
ES0312273255	B	0	0	370	12.850	0	0	372	12.122

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

ES0312273263	C	0	0	355	11.418	0	0	357	10.720								
ES0312273271	D	0	0	184	5.697	0	0	185	5.334								
ES0312273248	A	13.292	534.366	1.284	115.956	12.353	506.847	1.467	113.338								
ES0312273289	A		477.571		88.463		477.571		88.463								
ES0312273297	B		0		5.963		0		5.963								
ES0312273305	C		0		4.310		0		4.310								
ES0312273313	D		0		4.505		0		4.505								
ES0312273412	B		0		6.759		0		6.759								
ES0312273420	C		0		7.197		0		7.197								
ES0312273404	A		534.620		79.662		534.620		79.662								
ES0312273438	D		0		3.522		0		3.522								
ES0312273487	A		145.400		13.362		145.400		13.362								
ES0312273495	B		13.500		1.885		13.500		1.885								
ES0312273503	C		5.100		877		5.100		877								
ES0312273511	D		6.000		1.517		6.000		1.517								
Total		0754	37.074	0755	4.153.509	0756	4.254	0757	931.174	1754	35.273	1755	4.002.645	1756	4.749	1757	915.378

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/12/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Calificación				
		Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Situación actual 31/12/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 19/04/2007
		0760	0761	0762	0763	0764
ES0312273008	A	25/09/2019	FCH	A+	A+	A-
ES0312273008	A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0312273016	B	29/04/2013	MDY	Ba3	Ba3	Baa2
ES0312273024	C	29/04/2013	MDY	B3	B3	Ba2
ES0312273032	D	29/04/2013	MDY	Caa3	Caa3	B3
ES0312273081	A	28/07/2021	FCH	AAA	A+	AAA
ES0312273081	A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0312273099	B	29/11/2018	FCH	A+	A+	A
ES0312273099	B	29/09/2021	MDY	Aa3	A2	Ba3
ES0312273107	C	29/11/2018	FCH	BB+	BB+	BBB-
ES0312273107	C	29/06/2018	MDY	Ba2	Ba2	B3
ES0312273115	D	12/12/2016	FCH	CCC	CCC	BB-
ES0312273115	D	08/10/2010	MDY	C	C	C
ES0312273248	A	25/09/2019	FCH	AA+	AA+	AAA
ES0312273248	A	25/07/2018	SYP	AAA	AAA	AA
ES0312273255	B	28/07/2021	FCH	BB+	B	A
ES0312273263	C	17/04/2012	FCH	CCC	CCC	BBB-
ES0312273271	D	17/04/2012	FCH	CC	CC	BB
ES0312273362	A	28/07/2021	FCH	A+	A-	AA-
ES0312273362	A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aa2
ES0312273370	B	29/09/2021	FCH	CCC	CCC	BB
ES0312273370	B	26/04/2021	MDY	Ba1	Ba2	A2
ES0312273388	C	15/07/2020	FCH	BBB-		
ES0312273388	C	23/01/2015	MDY	B1	B1	Baa3
ES0312273396	D	10/07/2015	MDY	Caa1	Caa1	Ba2
ES0312273446	A	28/07/2021	FCH	AAA	A	AAA

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

ES0312273446	A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0312273453	B	28/07/2021	FCH	A+	A	A
ES0312273453	B	27/12/2018	MDY	A1	A1	B2
ES0312273461	C	28/07/2021	FCH	A	BBB-	BBB-
ES0312273461	C	27/12/2018	MDY	Ba3	Ba3	Caa1
ES0312273479	D	28/07/2021	FCH	B+	CCC	BB-
ES0312273479	D	27/12/2018	MDY	Caa3	Caa3	C

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Periodo de la declaración: 31/12/2021
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/04/2007	
Inferior a 1 año	0765		1765		2765	0
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	0
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	31
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768	670
Entre 4 y 5 años	0769	227.712	1769		2769	11.672
Entre 5 y 10 años	0770	759.132	1770	1.151.720	2770	571.471
Superior a 10 años	0771	233.312	1771	219.300	2771	6.749.956
Total	0772	1.220.156	1772	1.371.020	2772	7.333.800
Vida residual media ponderada (años)	0773	6,75	1773	7,29	2773	29,52

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/04/2007	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	89.312	1775	98.483	2775	165.253
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	133.488	1776	133.488	2776	165.253
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	7,32	1777	7,18	2777	2
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	0
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	0
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783	Notas Explicativas	2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	0
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	0
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	77,23	1792	79,21	2792	90,14
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

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 31/12/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 19/04/2007	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Permuta 1	KUTXABANK	SEMESTRAL	La suma de los intereses devengados, vencidos e ingresados al Fondo durante el Periodo de Liquidación que vence de los Activos de la Serie correspondiente, disminuida en el importe de los Intereses Corridos que, en su caso, hubiere pagado el Fondo durante el mismo Periodo de Liquidación entre (ii) el Importe Nominal multiplicado por 360 y dividido por los días efectivos existentes en dicho Periodo de Liquidación	el Saldo Vivo de los Activos (una vez deducidos los Activos Fallidos) en la Fecha de Determinación anterior que no se encuentren con retrasos en el pago de los importes vencidos por más de noventa (90) días en la Fecha de Determinación en curso (incluidos los Activos totalmente amortizados durante el Periodo de Determinación)	Tipo de Interés de Referencia de los Bonos fijado para el correspondiente Periodo de Devengo de Intereses de los Bonos más un margen del 50%	el Saldo Vivo de los Activos (una vez deducidos los Activos Fallidos) en la Fecha de Determinación anterior que no se encuentren con retrasos en el pago de los importes vencidos por más de noventa (90) días en la Fecha de Determinación en curso (incluidos los Activos totalmente amortizados durante el Periodo de Determinación)		0	-9.427	

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

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

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)			Valor en libros (miles de euros)			Otras características	
	Situación actual 31/12/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 19/04/2007	Situación actual 31/12/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 19/04/2007		
Préstamos hipotecarios	0811	1811	2811	0829	1829	2829	3829	
Cédulas hipotecarias	0812	1812	2812	0830	1830	2830	3830	
Préstamos a promotores	0813	1813	2813	0831	1831	2831	3831	
Préstamos a PYMES	0814	1814	2814	0832	1832	2832	3832	
Préstamos a empresas	0815	1815	2815	0833	1833	2833	3833	
Préstamos corporativos	0816	1816	2816	0834	1834	2834	3834	
Cédulas territoriales	0817	1817	2817	0835	1835	2835	3835	
Bonos de tesorería	0818	1818	2818	0836	1836	2836	3836	
Deuda subordinada	0819	1819	2819	0837	1837	2837	3837	
Créditos AAPP	0820	1820	2820	0838	1838	2838	3838	
Préstamos consumo	0821	1821	2821	0839	1839	2839	3839	
Préstamos automoción	0822	1822	2822	0840	1840	2840	3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823	1823	2823	0841	1841	2841	3841	
Cuentas a cobrar	0824	1824	2824	0842	1842	2842	3842	
Derechos de crédito futuros	0825	1825	2825	0843	1843	2843	3843	
Bonos de titulización	0826	1826	2826	0844	1844	2844		
Total	0827	1827	2827	0845	1845	2845	3845	

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	0	7003	22.705	7006	20.592	7009	3,46	7012	3,09	7015	3,58		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	22.705	7008	20.592	7011	3,46	7014	3,09	7017	22.704.966	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	0	7020	0	7021	22.454	7024	20.246	7027	2,80	7030	2,49	7033	2,84		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	22.454	7026	20.246	7029	2,80	7032	2,49	7035	2,84	7036	

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

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

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862		1862		2862		3862		4862		5862		6862		7862		8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864		1864		2864		3864		4864		5864		6864		7864		8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 31/12/2021

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	
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	

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

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

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														

S.06

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2021

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