

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: bonos de titulización de la Serie AyT Colaterales Global Hipotecario Caja Cantabria I
Número de registro del compartimento: 9122
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	90.215	1001	97.094
I. Activos financieros a largo plazo	0002	90.215	1002	97.094
1. Activos titulizados	0003	90.215	1003	97.094
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	90.184	1005	97.041
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	292	1025	529
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-261	1027	-477
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. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	18.072	1041	19.944
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	9.633	1043	9.269
1. Activos titulizados	0044	9.633	1044	9.269
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	9.524	1046	9.126
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	19	1065	24
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	1	1066	2
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	838	1067	1.174
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	5	1068	10
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-755	1069	-1.067
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	
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	
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	11	1082	10
1. Comisiones	0083	11	1083	10
2. Otros	0084		1084	
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	8.428	1085	10.664
1. Tesorería	0086	8.428	1086	10.664
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	108.287	1088	117.037

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	98.108	1089	104.511
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	98.108	1094	104.511
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	90.315	1095	97.240
1.1 Series no subordinadas	0096	63.815	1096	70.740
1.2 Series subordinadas	0097	26.500	1097	26.500
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	5.525	1101	5.160
2.1 Préstamo subordinado	0102	8.050	1102	8.050
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	-2.525	1105	-2.890
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	2.238	1108	2.078
3.1 Derivados de cobertura	0109	2.238	1109	2.078
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	31	1112	32
4.1 Garantías financieras	0113	31	1113	32
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. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) PASIVO CORRIENTE	0117	12.417	1117	14.605
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	
V. Provisiones a corto plazo	0119		1119	
1. Provisión garantías financieras	0120		1120	
2. Provisión por margen de intermediación	0121		1121	
3. Otras provisiones	0122		1122	
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	12.415	1123	14.585
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	9.777	1124	11.959
1.1 Series no subordinadas	0125	9.773	1125	11.916
1.2 Series subordinadas	0126		1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	4	1128	43
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	2.614	1131	2.489
2.1 Préstamo subordinado	0132	288	1132	288
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	1	1136	48
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	2.325	1137	2.153
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	24	1139	137
3.1 Derivados de cobertura	0140	24	1140	137
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	1	1143	1
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	1	1144	1
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	1	1148	20
1. Comisiones	0149	1	1149	20
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	1	1150	7
1.2 Comisión administrador	0151	205	1151	197
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	1	1152	7
1.4 Comisión variable	0153		1153	
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-205	1155	-191
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	0	1157	0
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-2.238	1158	-2.078
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-2.238	1160	-2.078
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	108.287	1162	117.037

S.02

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2020		Acumulado anterior 30/09/2019
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	117	1201	164	2201	445	3201	496
1.1 Activos titulizados	0202	117	1202	164	2202	445	3202	496
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203		3203	
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-79	1204	-106	2204	-241	3204	-312
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-39	1205	-60	2205	-116	3205	-176
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-40	1206	-46	2206	-125	3206	-135
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-81	1208	-59	2208	-305	3208	-243
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-42	1209	-1	2209	-101	3209	-58
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216		3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-24	1217	-18	2217	-76	3217	-56
7.1 Servicios exteriores	0218	-3	1218	0	2218	-18	3218	-1
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219	0	2219	-1	3219	-1
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	-3	1222	0	2222	-17	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-21	1224	-18	2224	-57	3224	-55
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-6	1225	-7	2225	-19	3225	-22
7.3.2 Comisión administrador	0226	-3	1226	-3	2226	-8	3226	-9
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-6	1227	-6	2227	-19	3227	-19
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	-6	1230	-2	2230	-11	3230	-5
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	0	1231	-102	2231	528	3231	70
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	-102	2232	528	3232	70
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	66	1239	121	2239	-351	3239	44
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. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2020		Acumulado anterior 30/09/2019
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-197	1300	-142	2300	-200	3300	-908
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-162	1301	-111	2301	-121	3301	-70
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	117	1302	170	2302	455	3302	498
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-79	1303	-127	2303	-158	3303	-231
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	75	1304	156	2304	147	3304	295
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-275	1305	-310	2305	-565	3305	-632
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-25	1309	-26	2309	-82	3309	-52
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-12	1310	-13	2310	-25	3310	-27
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	-32	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-13	1312	-13	2312	-25	3312	-25
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-10	1315	-5	2315	3	3315	-786
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	-9	1320	-5	2320	-28	3320	-786
3.6 Otros cobros de explotación	0321	-1	1321	0	2321	31	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-2.474	1322	-2.520	2322	-2.036	3322	-2.671
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulación	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	-2.474	1325	-2.520	2325	-2.036	3325	-2.671
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	1.367	1326	1.453	2326	4.132	3326	4.208
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	364	1327	340	2327	1.997	3327	2.450
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	93	1328	172	2328	904	3328	666
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	-4.298	1331	-4.486	2331	-9.068	3331	-9.994
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	-2.671	1337	-2.663	2337	-2.236	3337	-3.578
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	11.099	1338	10.486	2338	10.664	3338	11.402
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	8.428	1339	7.824	2339	8.428	3339	7.824

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2020		Acumulado anterior 30/09/2019
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-267	1357	-74	2357	-465	3357	-236
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-267	1358	-74	2358	-465	3358	-236
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	81	1360	59	2360	305	3360	243
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	186	1362	15	2362	159	3362	-7
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. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2020								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	1,12	0401	0	0421	0	0441	2,84	1381	1,58	1401	0	1421	0	1441	3,05	2381	1,38	2401	0,11	2421	0	2441	0
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I
Denominación del compartimento: 9122
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86201993 LIBERBANK, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	24	0467	7	0474	0	0481		0488	8	0495	1.802	0502	0	0509	1.810
De 1 a 3 meses	0461	7	0468	4	0475	1	0482		0489	5	0496	446	0503	0	0510	451
De 3 a 6 meses	0462		0469		0476		0483		0490		0497		0504		0511	
De 6 a 9 meses	0463		0470		0477		0484		0491		0498		0505		0512	
De 9 a 12 meses	0464		0471		0478		0485		0492		0499		0506		0513	
Más de 12 meses	0465	12	0472	838	0479	5	0486	48	0493	891	0500	292	0507		0514	1.183
Total	0466	43	0473	849	0480	6	0487	48	0494	903	0501	2.540	0508	0	1515	3.444

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	24	0522	7	0529	0	0536		0543	8	0550	1.802	0557	0	0564	1.810	0571	3.512	0578	3.512	0584	51,53
De 1 a 3 meses	0516	7	0523	4	0530	1	0537		0544	5	0551	446	0558	0	0565	451	0572	880	0579	880	0585	51,22
De 3 a 6 meses	0517		0524		0531		0538		0545		0552		0559		0566		0573		0580		0586	
De 6 a 9 meses	0518		0525		0532		0539		0546		0553		0560		0567		0574		0581		0587	
De 9 a 12 meses	0519		0526		0533		0540		0547		0554		0561		0568		0575		0582		0588	
Más de 12 meses	0520	12	0527	838	0534	5	0541	48	0548	891	0555	292	0562		0569	1.183	0576	2.155	0583	2.155	0589	54,92
Total	0521	43	0528	849	0535	6	0542	48	0549	903	0556	2.540	0563	0	0570	3.444	0577	6.547			0590	52,60

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007	
Inferior a 1 año	0600	8	1600		2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	59	1601	112	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	7	1602	9	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	16	1603	19	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	316	1604		2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	6.746	1605	4.211	2605	403
Superior a 10 años	0606	93.687	1606	103.519	2606	229.597
Total	0607	100.839	1607	107.871	2607	230.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	16,76	1608	17,42	2608	28,04

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	15,03	1609	14,28	2609	2,90

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I
Denominación del compartimento: 9122
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86201993 LIBERBANK, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				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	343	0630	13.070	1620	292	1630	11.070	2620	84	2630	2.088
40% - 60%	0621	717	0631	59.572	1621	688	1631	57.142	2621	26	2631	2.479
60% - 80%	0622	252	0632	28.091	1622	354	1632	39.332	2622	220	2632	27.552
80% - 100%	0623	1	0633	106	1623	2	1633	328	2623	1.370	2633	197.881
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624	0	2634	0
120% - 140%	0625		0635		1625		1635		2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627	0	2637	0
Total	0628	1.313	0638	100.839	1628	1.336	1638	107.871	2628	1.700	2638	230.000
Media ponderada (%)	0639	52,75	0649		1639	54,96	1649		2639	85,43	2649	

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,52	1650	0,53	2650	5,24
Tipo de interés nominal máximo	0651	5,10	1651	5,10	2651	6,29
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,08	1652	0,09	2652	4,50

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I
Denominación del compartimento: 9122
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86201993 LIBERBANK, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				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	2	0683	224	1660	2	1683	232	2660	4	2683	703
Aragón	0661	1	0684	72	1661	1	1684	74	2661	1	2684	214
Asturias	0662	8	0685	477	1662	8	1685	497	2662	16	2685	1.680
Baleares	0663		0686		1663		1686		2663	0	2686	0
Canarias	0664		0687		1664		1687		2664	0	2687	0
Cantabria	0665	1.128	0688	82.035	1665	1.148	1688	88.062	2665	1.439	2688	183.170
Castilla-León	0666	24	0689	1.899	1666	26	1689	2.132	2666	30	2689	4.412
Castilla La Mancha	0667	6	0690	720	1667	6	1690	749	2667	7	2690	1.336
Cataluña	0668	27	0691	3.349	1668	27	1691	3.489	2668	35	2691	7.495
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	0
Extremadura	0670	1	0693	66	1670	1	1693	69	2670	2	2693	420
Galicia	0671	89	0694	8.889	1671	89	1694	9.295	2671	125	2694	22.698
Madrid	0672		0695		1672		1695		2672	0	2695	0
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674		0697		1674		1697		2674	0	2697	0
Navarra	0675	25	0698	2.883	1675	26	1698	3.033	2675	39	2698	7.480
La Rioja	0676	2	0699	226	1676	2	1699	238	2676	2	2699	392
Comunidad Valenciana	0677		0700		1677		1700		2677	0	2700	0
País Vasco	0678		0701		1678		1701		2678	0	2701	0
Total España	0679	1.313	0702	100.839	1679	1.336	1702	107.871	2679	1.700	2702	230.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	1.313	0705	100.839	1682	1.336	1705	107.871	2682	1.700	2705	230.000

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I
Denominación del compartimento: 9122
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86201993 LIBERBANK, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 19/04/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	2,86			1710	2,89			2710	3		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I
Denominación del compartimento: 9122
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2020
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2020			Situación cierre anual anterior 31/12/2019			Situación inicial 19/04/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0312273446	A	2.035	36.161	73.588	2.035	40.617	82.656	2.035	100.000	203.500			
ES0312273453	B	127	100.000	12.700	127	100.000	12.700	127	100.000	12.700			
ES0312273461	C	103	100.000	10.300	103	100.000	10.300	103	100.000	10.300			
ES0312273479	D	35	100.000	3.500	35	100.000	3.500	35	100.000	3.500			
Total		0723	2.300	0724	100.088	1723	2.300	1724	109.156	2723	2.300	2724	230.000

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I
Denominación del compartimento: 9122
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2020
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas	
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados		Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		0738	0739	
						0730	0731			0732	0733	0734	0735			0742
ES0312273446	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,30	0	0	0	SI	73.588	0	73.588					
ES0312273453	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,60	0,24	0	0	SI	12.700	0	12.700					
ES0312273461	C	S	EURIBOR 6 MESES	1	0,64	2	0	SI	10.300	0	10.302					
ES0312273479	D	S	EURIBOR 6 MESES	2	1,64	1	0	SI	3.500	0	3.501					
Total						0740	4	0741	0743	100.088	0744	0745	100.092	0746		

	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,15	0748	0,23	0749	5,59

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2020								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2019							
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								
ES0312273446	A	4.298	129.912	0	21.270	4.486	120.844	31	21.270								
ES0312273453	B	0	0	16	1.977	0	0	24	1.947								
ES0312273461	C	0	0	34	2.113	0	0	40	2.047								
ES0312273479	D	0	0	29	1.151	0	0	32	1.093								
Total		0754	4.298	0755	129.912	0756	79	0757	26.512	1754	4.486	1755	120.844	1756	127	1757	26.356

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 19/04/2007
				0762	0763	0764
ES0312273446	A	25/09/2019	FCH	A	A	AAA
ES0312273446	A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0312273453	B	25/09/2019	FCH	A	A	A
ES0312273453	B	27/12/2018	MDY	A1	A1	B2
ES0312273461	C	25/09/2019	FCH	BBB-	BBB-	BBB-
ES0312273461	C	27/12/2018	MDY	Ba3	Ba3	Caa1
ES0312273479	D	13/04/2015	FCH	CCC	CCC	BB-
ES0312273479	D	27/12/2018	MDY	Caa3	Caa3	C

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I
Denominación del compartimento: 9122
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2020
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007	
Inferior a 1 año	0765		1765	0	2765	
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769	73.588	1769		2769	
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770	82.656	2770	203.500
Superior a 10 años	0771	26.500	1771	26.500	2771	26.500
Total	0772	100.088	1772	109.156	2772	230.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	8,10	1773	6,87	2773	10,51

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	8.036	1775	7.414	2775	8.050
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	8.050	1776	8.050	2776	8.050
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	7,70	1777	6,79	2777	3
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783	Notas Explicativas	2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	73,52	1792	75,72	2792	88,48
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. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 19/04/2007	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
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)	-2.262	-2.215	-5.157	
Total							0808 -2.262	0809 -2.215	0810 -5.157	

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007		Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		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. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
	Situación actual 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación actual 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación actual 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Última Fecha Pago									
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	891	7006	1.269	7009	1,25	7012	1,65	7015	1,34		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	891	7008	1.269	7011	1,25	7014	1,65	7017	891.288	7018	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	884	7024	1.264	7027	1,08	7030	1,42	7033	1,07		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	884	7026	1.264	7029	1,08	7032	1,42	7035	1,07	7036	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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
si el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) es superior al % establecido para cada ISIN.	0,75	0,12	0,22	NOTA DE VALORES 4.9.2.B (IV) Y CONDICIONES FINALES
si el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) es superior al % establecido para cada ISIN.	1	0,12	0,22	NOTA DE VALORES 4.9.2.B (IV) Y CONDICIONES FINALES
si el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) es superior al % establecido para cada ISIN.	1,25	0,12	0,22	NOTA DE VALORES 4.9.2.B (IV) Y CONDICIONES FINALES
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Saldo Vivo de los Activos Fallidos acumulados represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo.	10	4,07	4,07	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6. Y CONDICIONES FINALES
Saldo Vivo de los Activos Fallidos acumulados represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo	7	4,07	4,07	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6. Y CONDICIONES FINALES
Saldo Vivo de los Activos Fallidos acumulados represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo	5	4,07	4,07	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6. Y CONDICIONES FINALES
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
b) Cuando el saldo acumulado de los Activos Fallidos sea superior al porcentaje recogido del Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Cesión (PORCENTAJE DE ACTIVOS FALLIDOS)	3,20	4,07	4,07	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.1 y CONDICIONES FNALES
a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera superior al porcentaje recogido del Saldo Vivo de los Activos que no tengan la consideración de Activos Fallidos (PORCENTAJE)	1	0,12	0,22	MODULO ADICIONAL 3.4.2.1 Y CONDICIONES FINALES
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861
a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos no Fallidos en la fecha de Determinación correspondiente a la Fecha de Pago en curso sea inferior al porcentaje establecido del Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Constitución sin que se haya ejercitado la opci	10	43,40	43,52	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I
Denominación del compartimento: 9122
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	1862	6	2862	Días del mes /Base 360	3862	0,020	4862	0	5862	0	6862	Semestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	Caja de Ahorros de Santander y Cantabria	1863	0	2863	Días del mes /Base 365	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Semestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BANCO SANTANDER, S.A.	1864	25	2864	Días del mes /Base 365	3864	0	4864	0	5864	0	6864	Semestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I
Denominación del compartimento: 9122
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Liberbank
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo adicional 3.4.6

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. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)	Fecha cálculo										Total	
	0885	20/03/2020	21/09/2020									
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885											
Saldo inicial	0886	7.414	7.919									
Cobros del periodo	0887	5.674	4.801									
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-32	-25									
Pagos por derivados	0889	-290	-275									
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-7.919	-7.967									
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-4.847	-4.377									
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0									
Resto pagos/retenciones	0893	0	0									
Saldo disponible	0894	0	75									
Liquidación de comisión variable	0895	0	75									

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

S.06

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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