

**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: 30/09/2019

**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: 30/09/2019

| BALANCE (miles de euros)                                |      | Periodo actual<br>30/09/2019 |      | Periodo anterior<br>31/12/2018 |
|---|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>ACTIVO</b>   |      |                              |      |                                |
| <b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>                           | 0001 | 97.916                       | 1001 | 106.674                        |
| <b>I. Activos financieros a largo plazo</b>             | 0002 | 97.916                       | 1002 | 106.674                        |
| 1. Activos titulizados                                  | 0003 | 97.916                       | 1003 | 106.674                        |
| 1.1 Participaciones hipotecarias                        | 0004 |                              | 1004 |                                |
| 1.2 Certificados de transmisión hipotecaria             | 0005 | 97.904                       | 1005 | 106.575                        |
| 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 | 417                          | 1025 | 604                            |
| 1.23 Activos dudosos -intereses y otros-                | 0026 |                              | 1026 |                                |
| 1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-) | 0027 | -405                         | 1027 | -506                           |
| 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 |                                |
| <b>II. Activos por impuesto diferido</b>                | 0039 |                              | 1039 |                                |
| <b>III. Otros activos no corrientes</b>                 | 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: 30/09/2019

| BALANCE (miles de euros)                                   |      | Periodo actual<br>30/09/2019 |      | Periodo anterior<br>31/12/2018 |
|--|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>                                 | 0041 | 18.787                       | 1041 | 20.859                         |
| <b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>  | 0042 |                              | 1042 |                                |
| <b>V. Activos financieros a corto plazo</b>                | 0043 | 10.951                       | 1043 | 9.449                          |
| 1. Activos titulizados                                     | 0044 | 10.951                       | 1044 | 9.449                          |
| 1.1 Participaciones hipotecarias                           | 0045 |                              | 1045 |                                |
| 1.2 Certificados de transmisión hipotecaria                | 0046 | 10.886                       | 1046 | 9.172                          |
| 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 | 25                           | 1065 | 27                             |
| 1.22 Intereses vencidos e impagados                        | 0066 | 3                            | 1066 | 2                              |
| 1.23 Activos dudosos -principal-                           | 0067 | 1.341                        | 1067 | 1.520                          |
| 1.24 Activos dudosos -intereses-                           | 0068 | 10                           | 1068 | 11                             |
| 1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)    | 0069 | -1.313                       | 1069 | -1.282                         |
| 1.26 Ajustes por operaciones de cobertura                  | 0070 |                              | 1070 |                                |
| 2. Derivados   | 0071 |                              | 1071 |                                |
| 2.1 Derivados de cobertura                                 | 0072 |                              | 1072 |                                |
| 2.2 Derivados de negociación                               | 0073 |                              | 1073 |                                |
| 3. Otros activos financieros                               | 0074 |                              | 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 |                              | 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 |                                |
| <b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>                   | 0082 | 12                           | 1082 | 8                              |
| 1. Comisiones  | 0083 | 12                           | 1083 | 8                              |
| 2. Otros   | 0084 |                              | 1084 |                                |
| <b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b> | 0085 | 7.824                        | 1085 | 11.402                         |
| 1. Tesorería   | 0086 | 7.824                        | 1086 | 11.402                         |
| 2. Otros activos líquidos equivalentes                     | 0087 |                              | 1087 |                                |
| <b>TOTAL ACTIVO</b>  | 0088 | 116.703                      | 1088 | 127.533                        |

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: 30/09/2019

| BALANCE (miles de euros)                                  |      | Periodo actual<br>30/09/2019 |      | Periodo anterior<br>31/12/2018 |
|---|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>PASIVO</b>   |      |                              |      |                                |
| <b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>                             | 0089 | 105.501                      | 1089 | 115.261                        |
| <b>I. Provisiones a largo plazo</b>                       | 0090 |                              | 1090 |                                |
| 1. Provisión garantías financieras                        | 0091 |                              | 1091 |                                |
| 2. Provisión por margen de intermediación                 | 0092 |                              | 1092 |                                |
| 3. Otras provisiones                                      | 0093 |                              | 1093 |                                |
| <b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>              | 0094 | 105.501                      | 1094 | 115.261                        |
| 1. Obligaciones y otros valores emitidos                  | 0095 | 97.991                       | 1095 | 106.949                        |
| 1.1 Series no subordinadas                                | 0096 | 71.491                       | 1096 | 82.308                         |
| 1.2 Series subordinadas                                   | 0097 | 26.500                       | 1097 | 24.641                         |
| 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 | 5.005                        | 1101 | 5.040                          |
| 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 | -3.045                       | 1105 | -3.010                         |
| 2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos             | 0106 |                              | 1106 |                                |
| 2.6 Ajustes por operaciones de cobertura                  | 0107 |                              | 1107 |                                |
| 3. Derivados  | 0108 | 2.443                        | 1108 | 2.450                          |
| 3.1 Derivados de cobertura                                | 0109 | 2.443                        | 1109 | 2.450                          |
| 3.2 Derivados de negociación                              | 0110 |                              | 1110 |                                |
| 3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0111 |                              | 1111 |                                |
| 4. Otros pasivos financieros                              | 0112 | 62                           | 1112 | 822                            |
| 4.1 Garantías financieras                                 | 0113 | 62                           | 1113 | 822                            |
| 4.1 Otros   | 0114 |                              | 1114 |                                |
| 4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0115 |                              | 1115 |                                |
| <b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>                 | 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: 30/09/2019

| BALANCE (miles de euros)   |      | Periodo actual<br>30/09/2019 |      | Periodo anterior<br>31/12/2018 |
|--|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>B) PASIVO CORRIENTE</b>   | 0117 | 13.645                       | 1117 | 14.722                         |
| <b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b> | 0118 |                              | 1118 |                                |
| <b>V. Provisiones a corto plazo</b>  | 0119 |                              | 1119 |                                |
| 1. Provisión garantías financieras   | 0120 |                              | 1120 |                                |
| 2. Provisión por margen de intermediación  | 0121 |                              | 1121 |                                |
| 3. Otras provisiones   | 0122 |                              | 1122 |                                |
| <b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>                                     | 0123 | 13.643                       | 1123 | 14.692                         |
| 1. Obligaciones y otros valores emitidos   | 0124 | 11.170                       | 1124 | 12.261                         |
| 1.1 Series no subordinadas   | 0125 | 11.165                       | 1125 | 10.343                         |
| 1.2 Series subordinadas  | 0126 | 0                            | 1126 | 1.859                          |
| 1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0127 |                              | 1127 |                                |
| 1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos                                    | 0128 | 5                            | 1128 | 59                             |
| 1.5 Intereses vencidos e impagados   | 0129 |                              | 1129 |                                |
| 1.6 Ajustes por operaciones de cobertura   | 0130 |                              | 1130 |                                |
| 2. Deudas con entidades de crédito   | 0131 | 2.446                        | 1131 | 2.311                          |
| 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 | 5                            | 1136 | 50                             |
| 2.6 Intereses vencidos e impagados   | 0137 | 2.153                        | 1137 | 1.973                          |
| 2.7 Ajustes por operaciones de cobertura   | 0138 |                              | 1138 |                                |
| 3. Derivados   | 0139 | 27                           | 1139 | 121                            |
| 3.1 Derivados de cobertura   | 0140 | 27                           | 1140 | 121                            |
| 3.2 Derivados de negociación   | 0141 |                              | 1141 |                                |
| 3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0142 |                              | 1142 |                                |
| 4. Otros pasivos financieros   | 0143 | 0                            | 1143 | 0                              |
| 4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar   | 0144 | 0                            | 1144 | 0                              |
| 4.2 Garantías financieras  | 0145 |                              | 1145 |                                |
| 4.3 Otros  | 0146 |                              | 1146 |                                |
| 4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0147 |                              | 1147 |                                |
| <b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>  | 0148 | 2                            | 1148 | 29                             |
| 1. Comisiones  | 0149 | 2                            | 1149 | 15                             |
| 1.1 Comisión sociedad gestora  | 0150 | 1                            | 1150 | 8                              |
| 1.2 Comisión administrador   | 0151 | 194                          | 1151 | 185                            |
| 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 | -194                         | 1155 | -185                           |
| 1.7 Otras comisiones   | 0156 |                              | 1156 |                                |
| 2. Otros   | 0157 | 0                            | 1157 | 15                             |
| <b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>       | 0158 | -2.443                       | 1158 | -2.450                         |
| <b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>                       | 0159 |                              | 1159 |                                |
| <b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>                                      | 0160 | -2.443                       | 1160 | -2.450                         |
| <b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>                 | 0161 |                              | 1161 |                                |
| <b>TOTAL PASIVO</b>  | 0162 | 116.703                      | 1162 | 127.533                        |

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: 30/09/2019

| CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)                              |      | P. corriente actual (3. trimestre) |      | P. corriente anterior (3. trimestre) |      | Acumulado actual 30/09/2019 |      | Acumulado anterior 30/09/2018 |
|--|------|------------------------------------|------|--------------------------------------|------|-----------------------------|------|-------------------------------|
| <b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>                                | 0201 | 164                                | 1201 | 272                                  | 2201 | 496                         | 3201 | 741                           |
| 1.1 Activos titulizados  | 0202 | 164                                | 1202 | 272                                  | 2202 | 496                         | 3202 | 741                           |
| 1.2 Otros activos financieros  | 0203 | 0                                  | 1203 | 0                                    | 2203 |                             | 3203 |                               |
| <b>2. Intereses y cargas asimilados</b>                                      | 0204 | -106                               | 1204 | -97                                  | 2204 | -312                        | 3204 | -287                          |
| 2.1 Obligaciones y otros valores emitidos                                    | 0205 | -60                                | 1205 | -52                                  | 2205 | -176                        | 3205 | -156                          |
| 2.2 Deudas con entidades de crédito  | 0206 | -46                                | 1206 | -44                                  | 2206 | -135                        | 3206 | -132                          |
| 2.3 Otros pasivos financieros  | 0207 | 0                                  | 1207 | 0                                    | 2207 |                             | 3207 |                               |
| <b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b> | 0208 | -59                                | 1208 | -97                                  | 2208 | -243                        | 3208 | -337                          |
| <b>A) MARGEN DE INTERESES</b>  | 0209 | -1                                 | 1209 | 78                                   | 2209 | -58                         | 3209 | 116                           |
| <b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>                        | 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 |                               |
| <b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>                                       | 0215 | 0                                  | 1215 | 0                                    | 2215 |                             | 3215 |                               |
| <b>6. Otros ingresos de explotación</b>                                      | 0216 | 0                                  | 1216 | 0                                    | 2216 |                             | 3216 |                               |
| <b>7. Otros gastos de explotación</b>  | 0217 | -18                                | 1217 | -19                                  | 2217 | -56                         | 3217 | -58                           |
| 7.1 Servicios exteriores   | 0218 | 0                                  | 1218 | 0                                    | 2218 | -1                          | 3218 | -1                            |
| 7.1.1 Servicios de profesionales independientes                              | 0219 | 0                                  | 1219 | 0                                    | 2219 | -1                          | 3219 | 0                             |
| 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 | 0                                  | 1222 | 0                                    | 2222 | 0                           | 3222 | 0                             |
| 7.2 Tributos   | 0223 | 0                                  | 1223 | 0                                    | 2223 | 0                           | 3223 | 0                             |
| 7.3 Otros gastos de gestión corriente  | 0224 | -18                                | 1224 | -19                                  | 2224 | -55                         | 3224 | -57                           |
| 7.3.1 Comisión sociedad gestora  | 0225 | -7                                 | 1225 | -8                                   | 2225 | -22                         | 3225 | -23                           |
| 7.3.2 Comisión administrador   | 0226 | -3                                 | 1226 | -3                                   | 2226 | -9                          | 3226 | -10                           |
| 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 | -2                                 | 1230 | -2                                   | 2230 | -5                          | 3230 | -5                            |
| <b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>                            | 0231 | -102                               | 1231 | 650                                  | 2231 | 70                          | 3231 | 1.603                         |
| 8.1 Deterioro neto de activos titulizados                                    | 0232 | -102                               | 1232 | 650                                  | 2232 | 70                          | 3232 | 1.603                         |
| 8.2 Deterioro neto de otros activos financieros                              | 0233 | 0                                  | 1233 | 0                                    | 2233 |                             | 3233 |                               |
| <b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>                                    | 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 |                               |
| <b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>            | 0238 | 0                                  | 1238 | 0                                    | 2238 |                             | 3238 |                               |
| <b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>                               | 0239 | 121                                | 1239 | -708                                 | 2239 | 44                          | 3239 | -1.662                        |
| <b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>                                       | 0240 | 0                                  | 1240 | 0                                    | 2240 | 0                           | 3240 | 0                             |
| <b>12. Impuesto sobre beneficios</b>   | 0241 | 0                                  | 1241 | 0                                    | 2241 |                             | 3241 |                               |
| <b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>  | 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: 30/09/2019

| ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)                                    |      | P. corriente actual (3. trimestre) |      | P. corriente anterior (3. trimestre) |      | Acumulado actual 30/09/2019 |      | Acumulado anterior 30/09/2018 |
|--|------|------------------------------------|------|--------------------------------------|------|-----------------------------|------|-------------------------------|
| <b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>                          | 0300 | -142                               | 1300 | 3                                    | 2300 | -908                        | 3300 | 223                           |
| <b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>                    | 0301 | -111                               | 1301 | -55                                  | 2301 | -70                         | 3301 | 52                            |
| 1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados                                | 0302 | 170                                | 1302 | 273                                  | 2302 | 498                         | 3302 | 751                           |
| 1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos              | 0303 | -127                               | 1303 | -104                                 | 2303 | -231                        | 3303 | -209                          |
| 1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura                             | 0304 | 156                                | 1304 | 145                                  | 2304 | 295                         | 3304 | 294                           |
| 1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura                              | 0305 | -310                               | 1305 | -368                                 | 2305 | -632                        | 3305 | -784                          |
| 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                             |
| <b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>                  | 0309 | -26                                | 1309 | -27                                  | 2309 | -52                         | 3309 | -54                           |
| 2.1 Comisión sociedad gestora  | 0310 | -13                                | 1310 | -14                                  | 2310 | -27                         | 3310 | -29                           |
| 2.2 Comisión administrador   | 0311 | 0                                  | 1311 | 0                                    | 2311 | 0                           | 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                             |
| <b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>        | 0315 | -5                                 | 1315 | 85                                   | 2315 | -786                        | 3315 | 225                           |
| 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 | -5                                 | 1320 | -16                                  | 2320 | -786                        | 3320 | -34                           |
| 3.6 Otros cobros de explotación  | 0321 | 0                                  | 1321 | 101                                  | 2321 | 0                           | 3321 | 259                           |
| <b>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>                 | 0322 | -2.520                             | 1322 | -1.876                               | 2322 | -2.671                      | 3322 | -1.822                        |
| <b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulación</b>              | 0323 | 0                                  | 1323 | 0                                    | 2323 | 0                           | 3323 | 0                             |
| <b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>                  | 0324 | 0                                  | 1324 | 0                                    | 2324 | 0                           | 3324 | 0                             |
| <b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b> | 0325 | -2.520                             | 1325 | -1.876                               | 2325 | -2.671                      | 3325 | -1.822                        |
| 6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados                     | 0326 | 1.453                              | 1326 | 1.412                                | 2326 | 4.208                       | 3326 | 4.429                         |
| 6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados                    | 0327 | 340                                | 1327 | 761                                  | 2327 | 2.450                       | 3327 | 2.104                         |
| 6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados          | 0328 | 172                                | 1328 | 812                                  | 2328 | 666                         | 3328 | 1.912                         |
| 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 | -4.486                             | 1331 | -4.861                               | 2331 | -9.994                      | 3331 | -10.266                       |
| <b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>                     | 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                             |
| <b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>              | 0337 | -2.663                             | 1337 | -1.873                               | 2337 | -3.578                      | 3337 | -1.599                        |
| Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo                                  | 0338 | 10.486                             | 1338 | 10.690                               | 2338 | 11.402                      | 3338 | 10.416                        |
| Efectivo o equivalentes al final del periodo                                     | 0339 | 7.824                              | 1339 | 8.817                                | 2339 | 7.824                       | 3339 | 8.817                         |

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: 30/09/2019

| INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)   |             | P. corriente actual (3. trimestre) |             | P. corriente anterior (3. trimestre) |             | Acumulado actual 30/09/2019 |             | Acumulado anterior 30/09/2018 |
|--|-------------|------------------------------------|-------------|--------------------------------------|-------------|-----------------------------|-------------|-------------------------------|
| <b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>  |             |                                    |             |                                      |             |                             |             |                               |
| 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        |                               |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>                   | <b>0356</b> | <b>0</b>                           | <b>1356</b> | <b>0</b>                             | <b>2356</b> |                             | <b>3356</b> |                               |
| <b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>  |             |                                    |             |                                      |             |                             |             |                               |
| 2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración  | 0357        | -74                                | 1357        | -75                                  | 2357        | -236                        | 3357        | -60                           |
| 2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración   | 0358        | -74                                | 1358        | -75                                  | 2358        | -236                        | 3358        | -60                           |
| 2.1.2 Efecto fiscal  | 0359        | 0                                  | 1359        | 0                                    | 2359        |                             | 3359        |                               |
| 2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias  | 0360        | 59                                 | 1360        | 97                                   | 2360        | 243                         | 3360        | 337                           |
| 2.3 Otras reclasificaciones  | 0361        | 0                                  | 1361        | 0                                    | 2361        |                             | 3361        |                               |
| 2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período  | 0362        | 15                                 | 1362        | -22                                  | 2362        | -7                          | 3362        | -277                          |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>  | <b>0363</b> | <b>0</b>                           | <b>1363</b> | <b>0</b>                             | <b>2363</b> | <b>0</b>                    | <b>3363</b> | <b>0</b>                      |
| <b>3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>   |             |                                    |             |                                      |             |                             |             |                               |
| 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        |                               |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>  | <b>0369</b> | <b>0</b>                           | <b>1369</b> | <b>0</b>                             | <b>2369</b> |                             | <b>3369</b> |                               |
| <b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>  | <b>0370</b> | <b>0</b>                           | <b>1370</b> | <b>0</b>                             | <b>2370</b> | <b>0</b>                    | <b>3370</b> | <b>0</b>                      |



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: 30/09/2019

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

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

| Ratios (%)                                   | Situación actual 30/09/2019 |      |                 |   |                               |   |                                 |   | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |      |                 |   |                               |   |                                 |      | 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                        | 1,59 | 0401            | 0 | 0421                          | 0 | 0441                            | 3 | 1381                                       | 1,80 | 1401            | 0 | 1421                          | 0 | 1441                            | 2,54 | 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: 30/09/2019

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          | 41        | 0467                        | 14           | 0474                                 | 1         | 0481                                    |           | 0488  | 14           | 0495                           | 3.704        | 0502           | 1        | 0509        | 3.718        |
| De 1 a 3 meses                   | 0461          | 23        | 0468                        | 23           | 0475                                 | 2         | 0482                                    |           | 0489  | 25           | 0496                           | 1.859        | 0503           | 0        | 0510        | 1.884        |
| De 3 a 6 meses                   | 0462          | 1         | 0469                        | 1            | 0476                                 | 0         | 0483                                    | 0         | 0490  | 1            | 0497                           | 49           | 0504           |          | 0511        | 50           |
| 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          | 13        | 0472                        | 1.340        | 0479                                 | 10        | 0486                                    | 84        | 0493  | 1.434        | 0500                           | 368          | 0507           |          | 0514        | 1.802        |
| <b>Total</b>                     | 0466          | <b>78</b> | 0473                        | <b>1.377</b> | 0480                                 | <b>13</b> | 0487                                    | <b>84</b> | 0494  | <b>1.475</b> | 0501                           | <b>5.979</b> | 0508           | <b>1</b> | 1515        | <b>7.455</b> |

| 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          | 41        | 0522                        | 14           | 0529                                 | 1         | 0536                                    |           | 0543  | 14           | 0550                           | 3.704        | 0557           | 1        | 0564        | 3.718        | 0571           | 6.538         | 0578                                 | 6.538 | 0584                  | 56,87        |
| De 1 a 3 meses                               | 0516          | 23        | 0523                        | 23           | 0530                                 | 2         | 0537                                    |           | 0544  | 25           | 0551                           | 1.859        | 0558           | 0        | 0565        | 1.884        | 0572           | 3.402         | 0579                                 | 3.402 | 0585                  | 55,38        |
| De 3 a 6 meses                               | 0517          | 1         | 0524                        | 1            | 0531                                 | 0         | 0538                                    | 0         | 0545  | 1            | 0552                           | 49           | 0559           |          | 0566        | 50           | 0573           | 84            | 0580                                 | 84    | 0586                  | 59,72        |
| 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          | 13        | 0527                        | 1.340        | 0534                                 | 10        | 0541                                    | 84        | 0548  | 1.434        | 0555                           | 368          | 0562           |          | 0569        | 1.802        | 0576           | 2.836         | 0583                                 | 2.836 | 0589                  | 63,55        |
| <b>Total</b>                                 | 0521          | <b>78</b> | 0528                        | <b>1.377</b> | 0535                                 | <b>13</b> | 0542                                    | <b>84</b> | 0549  | <b>1.475</b> | 0556                           | <b>5.979</b> | 0563           | <b>1</b> | 0570        | <b>7.455</b> | 0577           | <b>12.861</b> |                                      |       | 0590                  | <b>57,97</b> |

|  |
|--|
| <b>S.05.1</b>  |
| <b>Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I</b> |
| <b>Denominación del compartimento: 9122</b>  |
| <b>Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.</b>                           |
| <b>Estados agregados: NO</b>   |
| <b>Fecha: 30/09/2019</b>   |
| <b>Entidades cedentes de los activos titulizados: A86201993 LIBERBANK, S.A.</b>            |

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO C**

| Vida residual de los activos titulizados (miles de euros) | Principal pendiente         |                |  |                |                              |                |
|---|-----------------------------|----------------|--|----------------|------------------------------|----------------|
|   | Situación actual 30/09/2019 |                | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |                | Situación inicial 19/04/2007 |                |
| Inferior a 1 año  | 0600                        | 1              | 1600                                       | 73             | 2600                         | 0              |
| Entre 1 y 2 años  | 0601                        | 18             | 1601                                       |                | 2601                         | 0              |
| Entre 2 y 3 años  | 0602                        | 109            | 1602                                       | 173            | 2602                         | 0              |
| Entre 3 y 4 años  | 0603                        | 10             | 1603                                       | 12             | 2603                         |                |
| Entre 4 y 5 años  | 0604                        | 21             | 1604                                       | 24             | 2604                         | 0              |
| Entre 5 y 10 años   | 0605                        | 4.097          | 1605                                       | 3.806          | 2605                         | 403            |
| Superior a 10 años  | 0606                        | 106.292        | 1606                                       | 113.783        | 2606                         | 229.597        |
| <b>Total</b>  | 0607                        | <b>110.548</b> | 1607                                       | <b>117.871</b> | 2607                         | <b>230.000</b> |
| <b>Vida residual media ponderada (años)</b>               | 0608                        | <b>17,64</b>   | 1608                                       | <b>18,32</b>   | 2608                         | <b>28,04</b>   |

| Antigüedad                        | Principal pendiente         |       |  |       |                              |      |
|-----------------------------------|-----------------------------|-------|--|-------|------------------------------|------|
|                                   | Situación actual 30/09/2019 |       | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |       | Situación inicial 19/04/2007 |      |
| Antigüedad media ponderada (años) | 0609                        | 14,03 | 1609                                       | 13,29 | 2609                         | 2,90 |

**AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I**

|  |
|--|
| <b>S.05.1</b>  |
| <b>Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I</b> |
| <b>Denominación del compartimento: 9122</b>  |
| <b>Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.</b>                           |
| <b>Estados agregados: NO</b>   |
| <b>Fecha: 30/09/2019</b>   |
| <b>Entidades cedentes de los activos titulizados: A86201993 LIBERBANK, S.A.</b>            |

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO D**

| Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros) | Situación actual 30/09/2019 |              |                     |                | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |              |                     |                | 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                        | 288          | 0630                | 11.024         | 1620                                       | 247          | 1630                | 9.498          | 2620                         | 84           | 2630                | 2.088          |
| 40% - 60%   | 0621                        | 682          | 0631                | 56.889         | 1621                                       | 623          | 1631                | 51.319         | 2621                         | 26           | 2631                | 2.479          |
| 60% - 80%   | 0622                        | 378          | 0632                | 42.307         | 1622                                       | 499          | 1632                | 56.488         | 2622                         | 220          | 2632                | 27.552         |
| 80% - 100%  | 0623                        | 2            | 0633                | 328            | 1623                                       | 4            | 1633                | 566            | 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              |
| <b>Total</b>  | 0628                        | <b>1.350</b> | 0638                | <b>110.548</b> | 1628                                       | <b>1.373</b> | 1638                | <b>117.871</b> | 2628                         | <b>1.700</b> | 2638                | <b>230.000</b> |
| <b>Media ponderada (%)</b>  | 0639                        | <b>55,68</b> | 0649                |                | 1639                                       | <b>57,80</b> | 1649                |                | 2639                         | <b>85,43</b> | 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:** 30/09/2019

**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<br>30/09/2019 |      | Situación cierre anual anterior<br>31/12/2018 |      | Situación inicial 19/04/2007 |      |
|---|--------------------------------|------|---|------|------------------------------|------|
|   |                                |      |   |      |                              |      |
| Tipo de interés medio ponderado                 | 0650                           | 0,53 | 1650  | 0,57 | 2650                         | 5,24 |
| Tipo de interés nominal máximo                  | 0651                           | 5,10 | 1651  | 5,10 | 2651                         | 6,29 |
| Tipo de interés nominal mínimo                  | 0652                           | 0,17 | 1652  | 0,16 | 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: 30/09/2019

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 30/09/2019 |              |                     |                | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |              |                     |                | 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                | 235            | 1660                                       | 3            | 1683                | 391            | 2660                         | 4            | 2683                | 703            |
| Aragón   | 0661                        | 1            | 0684                | 75             | 1661                                       | 1            | 1684                | 77             | 2661                         | 1            | 2684                | 214            |
| Asturias   | 0662                        | 10           | 0685                | 560            | 1662                                       | 10           | 1685                | 590            | 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                        | 1.160        | 0688                | 90.330         | 1665                                       | 1.175        | 1688                | 95.457         | 2665                         | 1.439        | 2688                | 183.170        |
| Castilla-León  | 0666                        | 26           | 0689                | 2.167          | 1666                                       | 27           | 1689                | 2.410          | 2666                         | 30           | 2689                | 4.412          |
| Castilla La Mancha   | 0667                        | 6            | 0690                | 759            | 1667                                       | 6            | 1690                | 788            | 2667                         | 7            | 2690                | 1.336          |
| Cataluña   | 0668                        | 27           | 0691                | 3.560          | 1668                                       | 28           | 1691                | 3.915          | 2668                         | 35           | 2691                | 7.495          |
| Ceuta  | 0669                        |              | 0692                |                | 1669                                       |              | 1692                |                | 2669                         | 0            | 2692                | 0              |
| Extremadura  | 0670                        | 1            | 0693                | 75             | 1670                                       | 1            | 1693                | 78             | 2670                         | 2            | 2693                | 420            |
| Galicia  | 0671                        | 89           | 0694                | 9.450          | 1671                                       | 93           | 1694                | 10.503         | 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                        | 26           | 0698                | 3.096          | 1675                                       | 27           | 1698                | 3.406          | 2675                         | 39           | 2698                | 7.480          |
| La Rioja   | 0676                        | 2            | 0699                | 242            | 1676                                       | 2            | 1699                | 255            | 2676                         | 2            | 2699                | 392            |
| Comunidad Valenciana   | 0677                        |              | 0700                |                | 1677                                       |              | 1700                |                | 2677                         | 0            | 2700                | 0              |
| País Vasco   | 0678                        |              | 0701                |                | 1678                                       |              | 1701                |                | 2678                         | 0            | 2701                | 0              |
| <b>Total España</b>  | 0679                        | <b>1.350</b> | 0702                | <b>110.548</b> | 1679                                       | <b>1.373</b> | 1702                | <b>117.871</b> | 2679                         | <b>1.700</b> | 2702                | <b>230.000</b> |
| Otros países Unión Europea                                   | 0680                        |              | 0703                |                | 1680                                       |              | 1703                |                | 2680                         | 0            | 2703                | 0              |
| Resto  | 0681                        |              | 0704                |                | 1681                                       |              | 1704                |                | 2681                         | 0            | 2704                | 0              |
| <b>Total general</b>   | 0682                        | <b>1.350</b> | 0705                | <b>110.548</b> | 1682                                       | <b>1.373</b> | 1705                | <b>117.871</b> | 2682                         | <b>1.700</b> | 2705                | <b>230.000</b> |

**AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I**

|  |
|--|
| <b>S.05.1</b>  |
| <b>Denominación Fondo:</b> AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I |
| <b>Denominación del compartimento:</b> 9122  |
| <b>Denominación de la gestora:</b> HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.                           |
| <b>Estados agregados:</b> NO   |
| <b>Fecha:</b> 30/09/2019   |
| <b>Entidades cedentes de los activos titulizados:</b> A86201993 LIBERBANK, S.A.            |

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

| Concentración   | Situación actual 30/09/2019 |      |      |  | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |      |      |  | Situación inicial 19/04/2007 |   |      |   |
|---|-----------------------------|------|------|--|--|------|------|--|------------------------------|---|------|---|
|   | Porcentaje                  |      | CNAE |  | Porcentaje                                 |      | CNAE |  | Porcentaje                   |   | CNAE |   |
| Diez primeros deudores/emisores con más concentración | 0710                        | 2,86 |      |  | 1710                                       | 2,78 |      |  | 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: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO A**

| (miles de euros) |                    | Situación actual 30/09/2019 |         |                   | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |         |                   | 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                       | 40.617  | 82.656            | 2.035                                      | 45.528  | 92.650            | 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             |       |      |         |
| <b>Total</b>     |                    | 0723                        | 2.300   | 0724              | 109.156                                    | 1723    | 2.300             | 1724                         | 119.150 | 2723              | 2.300 | 2724 | 230.000 |



|   |
|---|
| 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: 30/09/2019   |
| 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                 | 0736               |         |      | 0737            |   |         |      |  |
| ES0312273446     | A                  | NS                     | EURIBOR 6 MESES      | 0,30   | 0             | 0                    | 0                   | SI                                    | 82.656               | 0                  | 82.656  |      |                 |   |         |      |  |
| ES0312273453     | B                  | S                      | EURIBOR 6 MESES      | 0,60   | 0,23          | 1                    | 0                   | SI                                    | 12.700               | 0                  | 12.701  |      |                 |   |         |      |  |
| ES0312273461     | C                  | S                      | EURIBOR 6 MESES      | 1      | 0,63          | 2                    | 0                   | SI                                    | 10.300               | 0                  | 10.302  |      |                 |   |         |      |  |
| ES0312273479     | D                  | S                      | EURIBOR 6 MESES      | 2      | 1,63          | 2                    | 0                   | SI                                    | 3.500                | 0                  | 3.502   |      |                 |   |         |      |  |
| <b>Total</b>     |                    |                        |                      |        |               | 0740                 | 5                   | 0741                                  | 0                    | 0743               | 109.156 | 0744 | 0               | 0745  | 109.161 | 0746 |  |

|  | Situación actual 30/09/2019 |      | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |      | Situación inicial 19/04/2007 |      |
|--|-----------------------------|------|--|------|------------------------------|------|
| Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%) | 0747                        | 0,23 | 0748                                       | 0,17 | 0749                         | 5,59 |

**AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I**

|  |
|--|
| <b>S.05.2</b>  |
| <b>Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I</b> |
| <b>Denominación del compartimento: 9122</b>  |
| <b>Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.</b>                           |
| <b>Estados agregados: NO</b>   |
| <b>Periodo de la declaración: 30/09/2019</b>   |
| <b>Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF</b>                                |

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO C**

| (miles de euros) |                    | Situación actual 30/09/2019 |         |                  |         |                   |         |                  |        | Situación periodo comparativo anterior 30/09/2018 |       |                  |         |                   |     |                  |        |
|------------------|--------------------|-----------------------------|---------|------------------|---------|-------------------|---------|------------------|--------|---|-------|------------------|---------|-------------------|-----|------------------|--------|
| 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                  | 4.486                       | 120.844 | 31               | 21.270  | 4.861             | 110.850 | 14               | 21.224 |   |       |                  |         |                   |     |                  |        |
| ES0312273453     | B                  | 0                           | 0       | 24               | 1.947   | 0                 | 0       | 21               | 1.901  |   |       |                  |         |                   |     |                  |        |
| ES0312273461     | C                  | 0                           | 0       | 40               | 2.047   | 0                 | 0       | 38               | 1.968  |   |       |                  |         |                   |     |                  |        |
| ES0312273479     | D                  | 0                           | 0       | 32               | 1.093   | 0                 | 0       | 31               | 1.031  |   |       |                  |         |                   |     |                  |        |
| <b>Total</b>     |                    | 0754                        | 4.486   | 0755             | 120.844 | 0756              | 127     | 0757             | 26.356 | 1754  | 4.861 | 1755             | 110.850 | 1756              | 104 | 1757             | 26.125 |

**AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I**

|  |
|--|
| <b>S.05.2</b>  |
| <b>Denominación Fondo:</b> AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I |
| <b>Denominación del compartimento:</b> 9122  |
| <b>Denominación de la gestora:</b> HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.                           |
| <b>Estados agregados:</b> NO   |
| <b>Periodo de la declaración:</b> 30/09/2019   |
| <b>Mercados de cotización de los valores emitidos:</b> 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 30/09/2019 | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 | 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-                        | B+   | 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                            |

|  |
|--|
| <b>S.05.2</b>  |
| <b>Denominación Fondo:</b> AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I |
| <b>Denominación del compartimento:</b> 9122  |
| <b>Denominación de la gestora:</b> HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.                           |
| <b>Estados agregados:</b> NO   |
| <b>Periodo de la declaración:</b> 30/09/2019   |
| <b>Mercados de cotización de los valores emitidos:</b> 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 30/09/2019 |                | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |                | Situación inicial 19/04/2007 |                |
| Inferior a 1 año   | 0765                        | 0              | 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                        |                | 1769                                       |                | 2769                         |                |
| Entre 5 y 10 años  | 0770                        | 82.656         | 1770                                       | 119.150        | 2770                         | 203.500        |
| Superior a 10 años   | 0771                        | 26.500         | 1771                                       |                | 2771                         | 26.500         |
| <b>Total</b>   | <b>0772</b>                 | <b>109.156</b> | <b>1772</b>                                | <b>119.150</b> | <b>2772</b>                  | <b>230.000</b> |
| <b>Vida residual media ponderada (años)</b>  | <b>0773</b>                 | <b>6,87</b>    | <b>1773</b>                                | <b>0</b>       | <b>2773</b>                  | <b>10,51</b>   |

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: 30/09/2019

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

| Información sobre las mejoras crediticias del Fondo  | Situación actual 30/09/2019 |                    | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |                    | Situación inicial 19/04/2007 |       |
|--|-----------------------------|--------------------|--|--------------------|------------------------------|-------|
|  | Código                      | Valor              | Código                                     | Valor              | Código                       | Valor |
| 1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)  | 0775                        | 7.414              | 1775                                       | 6.725              | 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                        | 6,79               | 1777                                       | 5,64               | 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                        | 75,72              | 1792                                       | 77,76              | 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: 30/09/2019

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 30/09/2019 | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 | 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) | -2.469                      | -2.571                                     | -5.157                       |      |
| <b>Total</b>         |               |                              |  |   |  |   | 0808 -2.469                 | 0809 -2.571                                | 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: 30/09/2019

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO B**

| GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS<br>Naturaleza riesgo cubierto | Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros) |  |   |  |                              |  | Valor en libros (miles de euros) |  |   |  |                              |  | Otras características |  |
|--|---|--|---|--|------------------------------|--|----------------------------------|--|---|--|------------------------------|--|-----------------------|--|
|  | Situación actual<br>30/09/2019                      |  | Situación cierre anual<br>anterior 31/12/2018 |  | Situación inicial 19/04/2007 |  | Situación actual 30/09/2019      |  | Situación cierre anual<br>anterior 31/12/2018 |  | 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                         |  |                       |  |
| <b>Total</b>   | 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: 30/09/2019

**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 30/09/2019 | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 | Situación actual 30/09/2019 | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 | Última Fecha Pago |      |      |      |              |           |      |   |
| 1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a  | 7000         | 0  | 7002        | 90 | 7003                        | 1.435                                      | 7006                        | 1.617                                      | 7009              | 1,66 | 7012 | 1,80 | 7015         | 1,78      |      |   |
| 2. Activos Morosos por otras razones                              |              |    |             |    | 7004                        |  | 7007                        |  | 7010              |      | 7013 |      | 7016         |           |      |   |
| Total Morosos   |              |    |             |    | 7005                        | 1.435                                      | 7008                        | 1.617                                      | 7011              | 1,66 | 7014 | 1,80 | 7017         | 1.435.465 | 7018 | FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES |
| 3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a | 7019         | 18 | 7020        | 0  | 7021                        | 1.434                                      | 7024                        | 1.605                                      | 7027              | 1,54 | 7030 | 1,51 | 7033         | 1,54      |      |   |
| 4. Activos Fallidos por otras razones                             |              |    |             |    | 7022                        | 0  | 7025                        | 0  | 7028              | 0    | 7031 | 0    | 7034         | 0         |      |   |
| Total Fallidos  |              |    |             |    | 7023                        | 1.434                                      | 7026                        | 1.605                                      | 7029              | 1,54 | 7032 | 1,51 | 7035         | 1,54      | 7036 | FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES |

| Otras ratios relevantes | Ratio                       |  |  |  | Ref. Folleto |      |
|-------------------------|-----------------------------|--|--|--|--------------|------|
|                         | Situación actual 30/09/2019 |  | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |  |              |      |
|                         | 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: 30/09/2019

**INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO**

**CUADRO B**

| TRIGGERS   | Límite | % Actual | Última Fecha Pago | Referencia Folleto   |
|--|--------|----------|-------------------|--|
| <b>Amortización secuencial: series</b>   | 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   | 0,17     | 0,17              | 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      | 0,17     | 0,17              | 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   | 0,17     | 0,17              | NOTA DE VALORES 4.9.2.B (IV) Y CONDICIONES FINALES                 |
| <b>Diferimiento/postergamiento intereses: series</b>   | 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 |
| <b>No Reducción del Fondo de Reserva</b>   | 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      | 0,17     | 0,17              | MODULO ADICIONAL 3.4.2.1 Y CONDICIONES FINALES                     |
| <b>OTROS TRIGGERS</b>  | 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     | 47,46    | 47,46             | 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**

|  |
|--|
| <b>S.05.5</b>  |
| <b>Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I</b> |
| <b>Denominación del compartimento: 9122</b>  |
| <b>Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.</b>                           |
| <b>Estados agregados: NO</b>   |
| <b>Fecha: 30/09/2019</b>   |

**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                  |  |

|  |
|--|
| <b>S.05.5</b>  |
| <b>Denominación Fondo:</b> AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I |
| <b>Denominación del compartimento:</b> 9122  |
| <b>Denominación de la gestora:</b> HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.                           |
| <b>Estados agregados:</b> NO   |
| <b>Fecha:</b> 30/09/2019   |

**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 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|---|---------------|-------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
|   |               |       |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| <b>Ingresos y gastos del periodo de cálculo</b>   | 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          |       |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| <b>Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)</b> | 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          |       |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

|  |
|--|
| <b>S.05.5</b>  |
| <b>Denominación Fondo:</b> AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I |
| <b>Denominación del compartimento:</b> 9122  |
| <b>Denominación de la gestora:</b> HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.                           |
| <b>Estados agregados:</b> NO   |
| <b>Fecha:</b> 30/09/2019   |

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

| Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)    | Fecha cálculo |            |            |  |  |  |  |  |  |  | Total |  |
|--|---------------|------------|------------|--|--|--|--|--|--|--|-------|--|
|  | 0885          | 20/03/2019 | 20/09/2019 |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto             | 0885          | 20/03/2019 | 20/09/2019 |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Saldo inicial  | 0886          | 6.725      | 7.372      |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Cobros del periodo   | 0887          | 6.613      | 4.996      |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable | 0888          | -32        | -32        |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Pagos por derivados  | 0889          | -322       | -310       |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Retención importe Fondo de Reserva                               | 0890          | -7.372     | -7.414     |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos              | 0891          | -5.612     | -4.613     |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Pagos por deudas con entidades de crédito                        | 0892          | 0          | 0          |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Resto pagos/retenciones  | 0893          | 0          | 0          |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Saldo disponible   | 0894          | 0          | 0          |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Liquidación de comisión variable                                 | 0895          | 0          | 0          |  |  |  |  |  |  |  |       |  |

**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: 30/09/2019**

**NOTAS EXPLICATIVAS**



**INFORME DE AUDITOR**

**INFORME SOBRE EL CUMPLIMIENTO DE LAS POLÍTICAS DE GESTIÓN DE ACTIVOS Y DE RIESGOS**