

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: HT ABANCA RMBS I, FONDO DE TITULIZACION
Número de registro del Fondo: 10661
NIF Fondo: V87477246
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2021

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	618.007	1001	644.875
I. Activos financieros a largo plazo	0002	618.007	1002	644.875
1. Activos titulizados	0003	618.007	1003	644.875
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	617.633	1004	644.244
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005		1005	
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	
1.18 Bonos de titulización	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	1.013	1025	1.002
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-639	1027	-371
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	93.362	1041	94.559
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	43.580	1043	40.519
1. Activos titulizados	0044	43.580	1044	40.519
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	43.351	1045	40.205
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046		1046	
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	
1.18 Bonos de titulización	0062		1062	
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	7	1065	18
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	195	1066	257
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	71	1067	62
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	2	1068	2
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-46	1069	-24
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	0	1084	
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	49.783	1085	54.039
1. Tesorería	0086	49.783	1086	54.039
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	711.370	1088	739.434

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	660.674	1089	687.578
I. Provisiones a largo plazo	0090		1090	
1. Provisión garantías financieras	0091		1091	
2. Provisión por margen de intermediación	0092		1092	
3. Otras provisiones	0093		1093	
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	660.674	1094	687.578
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	458.174	1095	485.024
1.1 Series no subordinadas	0096	458.174	1096	485.024
1.2 Series subordinadas	0097		1097	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101	202.500	1101	202.554
2.1 Préstamo subordinado	0102	202.500	1102	202.554
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105		1105	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108		1108	
3.1 Derivados de cobertura	0109		1109	
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	
4.1 Garantías financieras	0113		1113	
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) PASIVO CORRIENTE	0117	50.696	1117	51.855
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	
V. Provisiones a corto plazo	0119		1119	
1. Provisión garantías financieras	0120		1120	
2. Provisión por margen de intermediación	0121		1121	
3. Otras provisiones	0122		1122	
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	50.186	1123	51.222
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	50.112	1124	51.134
1.1 Series no subordinadas	0125	50.112	1125	51.134
1.2 Series subordinadas	0126		1126	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128		1128	0
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	73	1131	87
2.1 Préstamo subordinado	0132	27	1132	27
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	46	1136	60
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137		1137	
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139		1139	
3.1 Derivados de cobertura	0140		1140	
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	1	1143	1
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	1	1144	1
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	510	1148	634
1. Comisiones	0149	510	1149	597
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	25	1150	21
1.2 Comisión administrador	0151	13	1151	14
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	3	1152	3
1.4 Comisión variable	0153	469	1153	559
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155		1155	
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	0	1157	37
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158		1158	
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160		1160	
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	711.370	1162	739.434

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2021		Acumulado anterior 30/06/2020
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	622	1201	812	2201	1.337	3201	1.739
1.1 Activos titulizados	0202	622	1202	812	2202	1.337	3202	1.739
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-56	1204	-285	2204	-111	3204	-415
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	0	1205	-85	2205		3205	-85
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-56	1206	-200	2206	-111	3206	-330
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	0	1208	0	2208		3208	
A) MARGEN DE INTERESES	0209	565	1209	528	2209	1.226	3209	1.325
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216		3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-450	1217	-528	2217	-936	3217	-1.325
7.1 Servicios exteriores	0218	-2	1218	-2	2218	-3	3218	-8
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219	0	2219	-1	3219	-2
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	-2	1222	-2	2222	-2	3222	-6
7.2 Tributos	0223	-1	1223	-1	2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-447	1224	-525	2224	-932	3224	-1.316
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-30	1225	-27	2225	-56	3225	-54
7.3.2 Comisión administrador	0226	-17	1226	-18	2226	-34	3226	-36
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-3	1227	-3	2227	-5	3227	-6
7.3.4 Comisión variable	0228	-398	1228	-478	2228	-838	3228	-1.221
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-116	1231	0	2231	-290	3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-116	1232	0	2232	-290	3232	0
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233		3233	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234	0	2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238		3238	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	0	1239	0	2239		3239	
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241		3241	
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2021		Acumulado anterior 30/06/2020
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	203	1300	-23	2300	225	3300	0
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	609	1301	760	2301	1.285	3301	1.547
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	659	1302	892	2302	1.409	3302	1.802
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	0	1303	0	2303	0	3303	0
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	3305	0
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	-50	1307	-132	2307	-124	3307	-255
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-366	1309	-749	2309	-1.019	3309	-1.508
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-25	1310	-27	2310	-52	3310	-55
2.2 Comisión administrador	0311	-17	1311	-18	2311	-34	3311	-37
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-3	1312	-3	2312	-5	3312	-5
2.4 Comisión variable	0313	-321	1313	-702	2313	-928	3313	-1.412
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-40	1315	-34	2315	-41	3315	-39
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	-40	1320	-34	2320	-41	3320	-39
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-1.209	1322	-1.074	2322	-4.482	3322	-4.348
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	-1.182	1325	-1.020	2325	-4.427	3325	-4.294
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	0	1326	0	2326	0	3326	0
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	4.707	1327	2.935	2327	10.639	3327	7.278
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	6.408	1328	6.493	2328	12.806	3328	12.993
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	-12.297	1331	-10.448	2331	-27.872	3331	-24.566
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-27	1332	-54	2332	-54	3332	-54
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	-27	1334	-54	2334	-54	3334	-54
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336	0	2336	0	3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-1.006	1337	-1.098	2337	-4.256	3337	-4.348
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	50.789	1338	49.416	2338	54.039	3338	52.666
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	49.783	1339	48.318	2339	49.783	3339	48.318

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2021		Acumulado anterior 30/06/2020
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	0	1357	0	2357	0	3357	0
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	0	1358	0	2358	0	3358	0
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	0	1360	0	2360	0	3360	0
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	0	1362	0	2362	0	3362	0
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368		3368	
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369		3369	
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2021								Situación cierre anual anterior 31/12/2020								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380	0,06	0400	0	0420	0	0440	-81,36	1380	0,06	1400	0	1420	0	1440	2,88	2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	0,22	0401	0	0421	0	0441	-100,47	1381	0,21	1401	0	1421	0	1441	2,88	2381		2401		2421		2441	
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382	0	1402	0	1422	0	1442	0	2382	7,52	2402	1,57	2422	0,55	2442	0
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	
Prestamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, 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	6.324	0467	2.134	0474	194	0481		0488	2.328	0495	654.274	0502	6	0509	656.608
De 1 a 3 meses	0461	11	0468	6	0475	1	0482		0489	7	0496	1.517	0503	0	0510	1.524
De 3 a 6 meses	0462		0469		0476		0483		0490		0497		0504		0511	
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	3	0477	0	0484	0	0491	4	0498	146	0505		0512	150
De 9 a 12 meses	0464	1	0471	3	0478	0	0485	1	0492	4	0499	104	0506		0513	108
Más de 12 meses	0465	9	0472	65	0479	2	0486	19	0493	86	0500	762	0507		0514	848
Total	0466	6.346	0473	2.211	0480	197	0487	20	0494	2.428	0501	656.804	0508	6	1515	659.239

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	6.324	0522	2.134	0529	194	0536		0543	2.328	0550	654.274	0557	6	0564	656.608	0571	1.517.032	0578	1.517.032	0584	43,28
De 1 a 3 meses	0516	11	0523	6	0530	1	0537		0544	7	0551	1.517	0558	0	0565	1.524	0572	3.254	0579	3.254	0585	46,84
De 3 a 6 meses	0517		0524		0531		0538		0545		0552		0559		0566		0573		0580		0586	
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	3	0532	0	0539	0	0546	4	0553	146	0560		0567	150	0574	347	0581	347	0587	43,31
De 9 a 12 meses	0519	1	0526	3	0533	0	0540	1	0547	4	0554	104	0561		0568	108	0575	210	0582	210	0588	51,53
Más de 12 meses	0520	9	0527	65	0534	2	0541	19	0548	86	0555	762	0562		0569	848	0576	1.850	0583	1.850	0589	45,86
Total	0521	6.346	0528	2.211	0535	197	0542	20	0549	2.428	0556	656.804	0563	6	0570	659.239	0577	1.522.692			0590	43,29

S.05.1

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/05/2016	
Inferior a 1 año	0600	443	1600	163	2600	2
Entre 1 y 2 años	0601	760	1601	423	2601	38
Entre 2 y 3 años	0602	991	1602	1.491	2602	79
Entre 3 y 4 años	0603	1.503	1603	1.447	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	2.375	1604	2.175	2604	1.958
Entre 5 y 10 años	0605	25.102	1605	25.551	2605	15.252
Superior a 10 años	0606	630.895	1606	654.263	2606	882.671
Total	0607	662.068	1607	685.513	2607	900.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	20,65	1608	21,08	2608	25,36

Antigüedad	Situación actual 30/06/2021					
	Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/05/2016			
Antigüedad media ponderada (años)	0609	11,58	1609	11,07	2609	6,44

S.05.1

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 19/05/2016			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	2.221	0630	147.786	1620	2.173	1630	145.389	2620	1.421	2630	108.399
40% - 60%	0621	2.604	0631	309.259	1621	2.620	1631	313.301	2621	2.282	2631	294.173
60% - 80%	0622	1.508	0632	198.239	1622	1.651	1632	219.026	2622	3.229	2632	470.878
80% - 100%	0623	49	0633	6.783	1623	56	1633	7.797	2623	165	2633	26.550
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624		2634	
120% - 140%	0625		0635		1625		1635		2625		2635	
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626		2636	
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627		2637	
Total	0628	6.382	0638	662.068	1628	6.500	1638	685.513	2628	7.097	2638	900.000
Media ponderada (%)	0639	50,69	0649		1639	51,38	1649		2639	58,66	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/05/2016	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,43	1650	0,47	2650	0,24
Tipo de interés nominal máximo	0651	2,66	1651	2,88	2651	3,36
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,01	1652	0,01	2652	0,81

S.05.1
Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 19/05/2016			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	516	0683	58.773	1660	528	1683	60.941	2660	562	2683	77.707
Aragón	0661	15	0684	1.420	1661	15	1684	1.466	2661	16	2684	1.941
Asturias	0662	52	0685	5.397	1662	53	1685	5.723	2662	57	2685	7.693
Baleares	0663	136	0686	19.686	1663	137	1686	20.024	2663	149	2686	24.685
Canarias	0664	51	0687	4.947	1664	52	1687	5.111	2664	57	2687	6.300
Cantabria	0665	58	0688	5.976	1665	58	1688	6.108	2665	60	2688	7.564
Castilla-León	0666	202	0689	20.899	1666	207	1689	21.623	2666	230	2689	28.637
Castilla La Mancha	0667	59	0690	7.079	1667	60	1690	7.229	2667	64	2690	9.174
Cataluña	0668	796	0691	117.378	1668	814	1691	121.848	2668	901	2691	160.124
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	
Extremadura	0670	24	0693	2.125	1670	25	1693	2.251	2670	25	2693	2.754
Galicia	0671	3.442	0694	286.343	1671	3.506	1694	297.069	2671	3.829	2694	392.378
Madrid	0672	326	0695	50.165	1672	332	1695	51.873	2672	374	2695	71.841
Melilla	0673	1	0696	72	1673	1	1696	75	2673	1	2696	106
Murcia	0674	46	0697	4.871	1674	48	1697	5.015	2674	54	2697	6.532
Navarra	0675	14	0698	1.495	1675	14	1698	1.522	2675	18	2698	2.363
La Rioja	0676	3	0699	345	1676	3	1699	350	2676	4	2699	720
Comunidad Valenciana	0677	498	0700	55.882	1677	501	1700	57.227	2677	530	2700	71.464
País Vasco	0678	143	0701	19.212	1678	146	1701	20.059	2678	166	2701	28.017
Total España	0679	6.382	0702	662.068	1679	6.500	1702	685.513	2679	7.097	2702	900.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680		2703	
Resto	0681		0704		1681		1704		2681		2704	
Total general	0682	6.382	0705	662.068	1682	6.500	1705	685.513	2682	7.097	2705	900.000

S.05.1
Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 19/05/2016			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,87			1710	0,86			2710	0,75		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	

S.05.2

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2021			Situación cierre anual anterior 31/12/2020			Situación inicial 19/05/2016					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0305136006	UNICO	7.380	68.873	508.286	7.380	72.650	536.158	7.380	100.000	738.000			
Total		0723	7.380	0724	508.286	1723	7.380	1724	536.158	2723	7.380	2724	738.000

S.05.2

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
			0730	0731	0732	0733	0734		0735	0742	0736		0737			0738	0739
ES0305136006	UNICO	NS	EURIBOR 3 MESES	0,30	0	0	0		SI	508.286		0		508.286			
Total						0740		0741		0743	508.286	0744		0745	508.286	0746	

	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/05/2016	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0	0748	0	0749	

S.05.2

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2021								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2020							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0305136006	UNICO	12.297	229.714	0	234	10.448	181.615	0	127								
Total		0754	12.297	0755	229.714	0756		0757	234	1754	10.448	1755	181.615	1756		1757	127

S.05.2

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 19/05/2016
				0762	0763	0764
ES0305136006	UNICO	24/05/2016	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305136006	UNICO	24/05/2016	SYP	AA	AA	AA

S.05.2
Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2021
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente				
	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/05/2016
Inferior a 1 año	0765		1765	0	2765
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769
Entre 5 y 10 años	0770	508.286	1770		2770
Superior a 10 años	0771		1771	536.158	2771
Total	0772	508.286	1772	536.158	2772
Vida residual media ponderada (años)	0773	9,06	1773	0	2773
					8,37

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/05/2016	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	40.500	1775	40.500	2775	40.500
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	40.500	1776	40.500	2776	40.500
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	7,97	1777	7,55	2777	5
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	100	1792	100	2792	100
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características		
Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 19/05/2016			
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806		
Total						0808		0809		0810	

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)			Valor en libros (miles de euros)			Otras características	
	Situación actual 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 19/05/2016	Situación actual 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 19/05/2016		
Préstamos hipotecarios	0811	1811	2811	0829	1829	2829	3829	
Cédulas hipotecarias	0812	1812	2812	0830	1830	2830	3830	
Préstamos a promotores	0813	1813	2813	0831	1831	2831	3831	
Préstamos a PYMES	0814	1814	2814	0832	1832	2832	3832	
Préstamos a empresas	0815	1815	2815	0833	1833	2833	3833	
Préstamos corporativos	0816	1816	2816	0834	1834	2834	3834	
Cédulas territoriales	0817	1817	2817	0835	1835	2835	3835	
Bonos de tesorería	0818	1818	2818	0836	1836	2836	3836	
Deuda subordinada	0819	1819	2819	0837	1837	2837	3837	
Créditos AAPP	0820	1820	2820	0838	1838	2838	3838	
Préstamos consumo	0821	1821	2821	0839	1839	2839	3839	
Préstamos automoción	0822	1822	2822	0840	1840	2840	3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823	1823	2823	0841	1841	2841	3841	
Cuentas a cobrar	0824	1824	2824	0842	1842	2842	3842	
Derechos de crédito futuros	0825	1825	2825	0843	1843	2843	3843	
Bonos de titulización	0826	1826	2826	0844	1844	2844		
Total	0827	1827	2827	0845	1845	2845	3845	

S.05.4

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
	Situación actual 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación actual 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación actual 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Última Fecha Pago									
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	3	7002	0	7003	94	7006	80	7009	0,16	7012	0,16	7015	0,17		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	94	7008	80	7011	0,16	7014	0,16	7017	93.777	7018	FOLLETO INFORMATIVO.MODULO ADICIONAL.3.3.4
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	81	7024	51	7027	0,10	7030	0,06	7033	0,10		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	81	7026	51	7029	0,10	7032	0,06	7035	0,10	7036	FOLLETO INFORMATIVO.NOTA DE VALORES. APARTADO 4.1.10

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Última Fecha Pago		
	0850	1850	2850	3850	
	0851	1851	2851	3851	
	0852	1852	2852	3852	
	0853	1853	2853	3853	

S.05.4

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO


CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
a) Que el importe a que ascienda la suma del Saldo Vivo de los Activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos y que no tengan la consideración de Activos Fallidos (los ?Activos Morosos?), fuera superior al	1,15	0,06	0,06	3. ESTRUCTURA Y TESORERIA (3.4.2) pag.121 Folleto
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

S.05.5

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	1862	18	2862	Días del mes /Días año	3862	0,010	4862	0	5862	0	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.	1863	0	2863	Días del mes /Días año	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Trimestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BANCO SANTANDER, S.A.	1864	3	2864		3864	0	4864	0	5864	0	6864	Trimestral	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	S
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	N
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Abanca
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo adicional 3.4.6.5

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
		31/03/2021	30/06/2021										
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872												
Margen de intereses	0873	661	565										1.226
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	-175	-115										-290
Dotaciones a provisiones (neto)	0875												0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876												0
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-46	-52										-98
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	440	398	0	0	0	0	0	0	0	0	0	838
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879												0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880												0
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881	-440	-398										-838
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Comisión variable pagada	0883	607	321										928
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884												

S.05.5

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

S.06

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

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