

# ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.00

## I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Número de registro del Fondo: **8300**

NIF Fondo: **V84532506**

Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Número de registro del compartimento: **8683**

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

NIF gestora: **A80732142**

Estados agregados: **No**

Periodo: **3er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

## II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/09/2016		Periodo Anterior 31/12/2015
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0008	0	1008	2.000.000
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0010	0	1010	2.000.000
1. Valores representativos de deuda	0100	0	1100	0
1.1 Bancos centrales	0101	0	1101	0
1.2 Administraciones Públicas españolas	0102	0	1102	0
1.3 Entidades de crédito	0103	0	1103	0
1.4 Otros sectores residentes	0104	0	1104	0
1.5 Administraciones Públicas no residentes	0105	0	1105	0
1.6 Otros sectores no residentes	0106	0	1106	0
1.7 Activos dudosos	0107	0	1107	0
1.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0108		1108	
1.9 Intereses y gastos devengados no vencidos	0109	0	1109	0
1.10 Ajustes por operaciones de cobertura	0110	0	1110	0
2. Derechos de crédito	0200	0	1200	2.000.000
2.1 Participaciones hipotecarias	0201	0	1201	0
2.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0202	0	1202	0
2.3 Préstamos hipotecarios	0203	0	1203	0
2.4 Cédulas Hipotecarias	0204	0	1204	2.000.000
2.5 Préstamos a promotores	0205	0	1205	0
2.6 Préstamos a PYMES	0206	0	1206	0
2.7 Préstamos a empresas	0207	0	1207	0
2.8 Préstamos Corporativos	0208	0	1208	0
2.9 Cédulas territoriales	0209	0	1209	0
2.10 Bonos de Tesorería	0210	0	1210	0
2.11 Deuda Subordinada	0211	0	1211	0
2.12 Créditos AAPP	0212	0	1212	0
2.13 Préstamos Consumo	0213	0	1213	0
2.14 Préstamos automoción	0214	0	1214	0
2.15 Cuotas de Arrendamiento financiero (leasing)	0215	0	1215	0
2.16 Cuentas a cobrar	0216	0	1216	0
2.17 Derechos de crédito futuros	0217	0	1217	0
2.18 Bonos de titulización	0218	0	1218	0
2.19 Otros	0219	0	1219	0
2.20 Activos dudosos	0220	0	1220	0
2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0221		1221	
2.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0222	0	1222	0
2.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0223	0	1223	0
3. Derivados	0230	0	1230	0
3.1 Derivados de cobertura	0231	0	1231	0
3.2 Derivados de negociación	0232	0	1232	0
4. Otros activos financieros	0240	0	1240	0
4.1 Garantías financieras	0241	0	1241	0
4.2 Otros	0242	0	1242	0
<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0250	0	1250	0
<b>III. Otros activos no corrientes</b>	0260	0	1260	0

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: <b>AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS</b>
Denominación del compartimento: <b>AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS</b>
Denominación de la gestora: <b>HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.</b>
Estados agregados: <b>No</b>
Periodo: <b>3er Trimestre</b>
Ejercicio: <b>2016</b>

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/09/2016		Periodo Anterior 31/12/2015
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0270	2.051.005	1270	71.019
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0280	0	1280	0
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0290	2.043.005	1290	63.019
1. Deudores y otras cuentas a cobrar	0300	0	1300	0
2. Valores representativos de deuda	0310	0	1310	0
2.1 Bancos centrales	0311	0	1311	0
2.2 Administraciones Públicas españolas	0312	0	1312	0
2.3 Entidades de crédito	0313	0	1313	0
2.4 Otros sectores residentes	0314	0	1314	0
2.5 Administraciones Públicas no residentes	0315	0	1315	0
2.6 Otros sectores no residentes	0316	0	1316	0
2.7 Activos dudosos	0317	0	1317	0
2.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0318		1318	
2.9 Intereses y gastos devengados no vencidos	0319	0	1319	0
2.10 Ajustes por operaciones de cobertura	0320	0	1320	0
2.11 Intereses vencidos e impagados	0330	0	1330	0
3. Derechos de crédito	0400	2.043.005	1400	63.019
3.1 Participaciones hipotecarias	0401	0	1401	0
3.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0402	0	1402	0
3.3 Préstamos hipotecarios	0403	0	1403	0
3.4 Cédulas Hipotecarias	0404	2.000.000	1404	0
3.5 Préstamos a promotores	0405	0	1405	0
3.6 Préstamos a PYMES	0406	0	1406	0
3.7 Préstamos a empresas	0407	0	1407	0
3.8 Préstamos Corporativos	0408	0	1408	0
3.9 Cédulas territoriales	0409	0	1409	0
3.10 Bonos de Tesorería	0410	0	1410	0
3.11 Deuda Subordinada	0411	0	1411	0
3.12 Créditos AAPP	0412	0	1412	0
3.13 Préstamos Consumo	0413	0	1413	0
3.14 Préstamos automoción	0414	0	1414	0
3.15 Arrendamiento financiero	0415	0	1415	0
3.16 Cuentas a cobrar	0416	0	1416	0
3.17 Derechos de crédito futuros	0417	0	1417	0
3.18 Bonos de titulización	0418	0	1418	0
3.19 Otros	0419	0	1419	0
3.20 Activos dudosos	0420	0	1420	0
3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0421		1421	
3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0422	43.005	1422	63.019
3.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0423	0	1423	0
3.24 Intereses vencidos e impagados	0424	0	1424	0
4. Derivados	0430	0	1430	0
4.1 Derivados de cobertura	0431	0	1431	0
4.2 Derivados de negociación	0432	0	1432	0
5. Otros activos financieros	0440	0	1440	0
5.1 Garantías financieras	0441	0	1441	0
5.2 Otros	0442	0	1442	0
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0450	0	1450	0
1. Comisiones	0451	0	1451	0
2. Otros	0452	0	1452	0
<b>VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes</b>	0460	8.000	1460	8.000
1. Tesorería	0461	8.000	1461	8.000
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462	0	1462	0

TOTAL ACTIVO	0500	2.051.005	1500	2.071.019
--------------	------	-----------	------	-----------

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS				
Denominación del compartimento: AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS				
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.				
Estados agregados: No				
Periodo: 3er Trimestre				
Ejercicio: 2016				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/09/2016		Periodo Anterior 31/12/2015
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0650	0	1650	2.007.994
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0660	0	1660	0
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0700	0	1700	2.007.994
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	0	1710	2.000.000
1.1 Series no subordinadas	0711	0	1711	2.000.000
1.2 Series subordinadas	0712	0	1712	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0713		1713	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0714	0	1714	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0715	0	1715	0
2. Deudas con entidades de crédito	0720	0	1720	7.994
2.1 Préstamo subordinado	0721	0	1721	0
2.2 Crédito línea de liquidez	0722	0	1722	8.000
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0723	0	1723	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0724		1724	-6
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0725	0	1725	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0726	0	1726	0
3. Derivados	0730	0	1730	0
3.1 Derivados de cobertura	0731	0	1731	0
3.2 Derivados de negociación	0732	0	1732	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0733		1733	
4. Otros pasivos financieros	0740	0	1740	0
4.1 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0741		1741	
4.2 Otros	0742	0	1742	0
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	0750	0	1750	0
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0760	2.051.005	1760	63.025
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0770	0	1770	0
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	0780	0	1780	0
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	0800	2.051.005	1800	63.026
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	7	1810	7
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	2.042.521	1820	62.514
2.1 Series no subordinadas	0821	2.000.000	1821	0
2.2 Series subordinadas	0822	0	1822	0
2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0823		1823	
2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0824	42.521	1824	62.514
2.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0825	0	1825	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0826	0	1826	0
3. Deudas con entidades de crédito	0830	8.039	1830	68
3.1 Préstamo subordinado	0831	0	1831	0
3.2 Crédito línea de liquidez	0832	8.000	1832	0
3.3 Otras deudas con entidades de crédito	0833	0	1833	0
3.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0834	-7	1834	
3.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0835	46	1835	68
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836	0	1836	0
3.7 Intereses vencidos e impagados	0837	0	1837	0
4. Derivados	0840	0	1840	0
4.1 Derivados de cobertura	0841	0	1841	0
4.2 Derivados de negociación	0842	0	1842	0
4.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0843		1843	
5. Otros pasivos financieros	0850	438	1850	437
5.1 Importe bruto	0851	438	1851	437
5.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0852		1852	

<b>VII. Ajustes por periodificación</b>	0900	0	1900	-1
1. Comisiones	0910	0	1910	0
1.1 Comisión sociedad gestora	0911	0	1911	0
1.2 Comisión administrador	0912	0	1912	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0913	0	1913	0
1.4 Comisión variable - resultados realizados	0914	1	1914	1
1.5 Comisión variable - resultados no realizados	0915	0	1915	0
1.6 Otras comisiones del cedente	0916	0	1916	0
1.7 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0917	-1	1917	-1
1.8 Otras comisiones	0918	0	1918	0
2. Otros	0920	0	1920	-1
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0930	0	1930	0
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0940	0	1940	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0950	0	1950	0
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0960	0	1960	0
<b>XI. Gastos de constitución en transición</b>	0970		1970	
<b>TOTAL PASIVO</b>	1000	2.051.005	2000	2.071.019

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.02

Denominación del Fondo: AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS  
 Denominación del compartimento: AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS  
 Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.  
 Estados agregados: No  
 Periodo: 3er Trimestre  
 Ejercicio: 2016

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. Corriente Actual 3er trimestre		P. Corriente Anterior 3er trimestre		Acumulado Actual 30/09/2016		Acumulado Anterior 31/12/2015
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0100		1100	0	2100	60.073	3100	
1.1 Valores representativos de deuda	0110		1110	0	2110	0	3110	
1.2 Derechos de crédito	0120		1120	0	2120	60.073	3120	
1.3 Otros activos financieros	0130		1130	0	2130	0	3130	
<b>2. Intereses y cargas asimiladas</b>	0200		1200		2200	-60.008	3200	
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210		1210		2210	-60.008	3210	
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220		1220		2220		3220	
2.3 Otros pasivos financieros	0230		1230		2230		3230	
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0240		1240	0	2240	0	3240	
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0250		1250	0	2250	65	3250	
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	0300		1300	0	2300	0	3300	
4.1 Ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0310		1310	0	2310	0	3310	
4.2 Activos financieros disponibles para la venta	0320		1320	0	2320	0	3320	
4.3 Otros	0330		1330	0	2330	0	3330	
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0400		1400	0	2400	0	3400	
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0500		1500	0	2500	0	3500	
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0600		1600		2600	-65	3600	
7.1 Servicios exteriores	0610		1610		2610	-65	3610	
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611		1611		2611		3611	
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0612		1612		2612	-65	3612	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0613		1613		2613		3613	
7.1.4 Otros servicios	0614		1614		2614		3614	
7.2 Tributos	0620		1620		2620		3620	
7.3 Otros gastos de gestión corrientes	0630		1630		2630		3630	
7.3.1 Comisión de sociedad gestora	0631		1631		2631		3631	
7.3.2 Comisión administrador	0632		1632		2632		3632	
7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos	0633		1633		2633		3633	
7.3.4 Comisión variable - resultados realizados (neto)	0634		1634		2634		3634	
7.3.5 Comisión variables - resultados no realizados (neto)	0635		1635		2635		3635	
7.3.6 Otras comisiones del cedente	0636		1636		2636		3636	
7.3.7 Otros gastos	0637		1637		2637		3637	
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0700		1700	0	2700		3700	
8.1 Deterioro neto de valores representativos de deuda	0710		1710	0	2710	0	3710	
8.2 Deterioro neto de derechos de crédito	0720		1720	0	2720	0	3720	
8.3 Deterioro neto de derivados	0730		1730	0	2730	0	3730	
8.4 Deterioro neto de otros activos financieros	0740		1740	0	2740	0	3740	
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	0750		1750	0	2750	0	3750	
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0800		1800	0	2800	0	3800	
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0850		1850	0	2850	0	3850	
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0900		1900	0	2900	0	3900	
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0950		1950	0	2950	0	3950	
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	3000		4000	0	5000	0	6000	

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.03

Denominación del Fondo: <b>AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS</b>
Denominación del compartimento: <b>AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS</b>
Denominación de la gestora: <b>HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.</b>
Estados agregados: <b>No</b>
Periodo: <b>3er Trimestre</b>
Ejercicio: <b>2016</b>

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		Periodo Actual		Mismo Periodo año Anterior
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN</b>	8000	0	9000	0
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	8100	86	9100	0
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	80.086	9110	0
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-80.000	9120	0
1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados	8130	0	9130	0
1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras	8140	0	9140	0
1.5 Intereses pagados por préstamos y créditos en entidades de crédito	8150	0	9150	0
1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	8160	0	9160	0
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo</b>	8200	-86	9200	0
2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora	8210	0	9210	0
2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados	8220	0	9220	0
2.3 Comisiones pagadas al agente financiero	8230	0	9230	0
2.4 Comisiones variables pagadas	8240	0	9240	0
2.5 Otras comisiones	8250	-86	9250	0
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo</b>	8300	0	9300	0
3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos	8310	0	9310	0
3.2 Pagos de provisiones	8320	0	9320	0
3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta	8325	0	9325	0
3.4 Otros	8330	0	9330	0
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION</b>	8350	0	9350	0
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	8400	0	9400	0
4.1 Cobros por emisión de valores de titulización	8410	0	9410	0
4.2 Pagos por emisión de valores de titulización (aseguramiento colocación)	8420	0	9420	0
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	8500	0	9500	0
5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito	8510	0	9510	0
5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras	8520	0	9520	0
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones</b>	8600	0	9600	0
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	0	9610	0
6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados	8620	0	9620	0
6.3 Pagos por amortización de valores de titulización	8630	0	9630	0
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	8700	0	9700	0
7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos	8710	0	9710	0
7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos	8720	0	9720	0
7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso	8730	0	9730	0
7.4 Administraciones públicas - Pasivo	8740	0	9740	0
7.5 Otros deudores y acreedores	8750	0	9750	0
7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras	8770	0	9770	0
7.7 Cobros de Subvenciones	8780	0	9780	0
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	8800	0	9800	0
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	8.000	9900	0
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	8.000	9990	0



ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.04

Denominación del Fondo: AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS  
 Denominación del compartimento: AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS  
 Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.  
 Estados agregados: No  
 Periodo: 3er Trimestre  
 Ejercicio: 2016

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		Periodo Actual 30/09/2016		Mismo Periodo año Anterior 30/09/2015
<b>1 Activos financieros disponibles para la venta</b>				
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6010	0	7010	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6020	0	7020	0
1.1.2 Efecto fiscal	6021	0	7021	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6022	0	7022	0
1.3 Otras reclasificaciones	6030	0	7030	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6040	0	7040	0
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>6100</b>	<b>0</b>	<b>7100</b>	<b>0</b>
<b>2 Cobertura de los flujos de efectivo</b>				
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6110	0	7110	0
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6120	0	7120	0
2.1.2 Efecto fiscal	6121	0	7121	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6122	0	7122	0
2.3 Otras reclasificaciones	6130	0	7130	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6140	0	7140	0
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>6200</b>	<b>0</b>	<b>7200</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 periodo	6310	0	7310	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6320	0	7320	0
3.1.2 Efecto fiscal	6321	0	7321	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6322	0	7322	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6330	0	7330	0
<b>Total Ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>6400</b>	<b>0</b>	<b>7400</b>	<b>0</b>
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>6500</b>	<b>0</b>	<b>7500</b>	<b>0</b>

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**  
 Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANCO MARENOSTRUM, S.A. - BILBAO BIZKAIA KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA - CAIXABANK - CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA - CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKO AURREZKI KUTXA - LIBERBANK - NOVACAIXAGALICIA - UNICAJA - UNNIM BANC, S.A**

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

Tipología de activos titulizados	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 16/03/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)	
Participaciones hipotecarias	0001		0030		0060		0090		0120		0150	
Certificados de transmisión hipotecaria	0002		0031		0061		0091		0121		0151	
Préstamos hipotecarios	0003		0032		0062		0092		0122		0152	
Cédulas hipotecarias	0004	11	0033	2.000.000	0063	11	0093	2.000.000	0123	11	0153	2.000.000
Préstamos a promotores	0005		0034		0064		0094		0124		0154	
Préstamos a PYMES	0007		0036		0066		0096		0126		0156	
Préstamos a empresas	0008		0037		0067		0097		0127		0157	
Préstamos Corporativos	0009		0038		0068		0098		0128		0158	
Cédulas territoriales	0010		0039		0069		0099		0129		0159	
Bonos de tesorería	0011		0040		0070		0100		0130		0160	
Deuda subordinada	0012		0041		0071		0101		0131		0161	
Créditos AAPP	0013		0042		0072		0102		0132		0162	
Préstamos consumo	0014		0043		0073		0103		0133		0163	
Préstamos automoción	0015		0044		0074		0104		0134		0164	
Arrendamiento financiero	0016		0045		0075		0105		0135		0165	
Cuentas a cobrar	0017		0046		0076		0106		0136		0166	
Derechos de crédito futuros	0018		0047		0077		0107		0137		0167	
Bonos de titulización	0019		0048		0078		0108		0138		0168	
Otros	0020		0049		0079		0109		0139		0169	
<b>Total</b>	<b>0021</b>	<b>11</b>	<b>0050</b>	<b>2.000.000</b>	<b>0080</b>	<b>11</b>	<b>0110</b>	<b>2.000.000</b>	<b>0140</b>	<b>11</b>	<b>0170</b>	<b>2.000.000</b>

(1) Entendido como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**  
 Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANCO MARENOSTRUM, S.A. - BILBAO BIZKAIA KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA - CAIXABANK - CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA - CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKO AURREZKI KUTXA - LIBERBANK - NOVACAIXAGALICIA - UNICAJA - UNNIM BANC, S.A**

**INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN**

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)*

**CUADRO B**

Movimiento de la cartera de activos titulizados/Tasa de amortización anticipada	Situación actual 30/09/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015	
Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior	0196	0	0206	0
Derechos de crédito dados de baja por dación/adjudicación de bienes desde el cierre anual anterior	0197		0207	
Amortización ordinaria desde el cierre anual anterior	0200		0210	
Amortización anticipada desde el cierre anual anterior	0201		0211	
Total importe amortizado acumulado, incluyendo adjudicaciones y otros pagos en especie, desde el origen del Fondo	0202		0212	
Importe de principal pendiente de amortización de los nuevos activos incorporados en el periodo (1)	0203	0	0213	0
<b>Principal pendiente cierre del periodo (2)</b>	0204	2.000.000	0214	2.000.000
<b>Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)</b>	0205	0,00	0215	0,00

(1) En fondos abiertos, importe de principal pendiente de reembolso en la fecha de presentación de la información de los nuevos activos incorporados en el periodo

(2) Importe del principal pendiente de reembolso de la totalidad de los activos (incluidas las nuevas incorporaciones del periodo) a fecha del informe

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**  
 Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANCO MARENOSTRUM, S.A. - BILBAO BIZKAIA KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA - CAIXABANK - CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA - CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKO AURREZKI KUTXA - LIBERBANK - NOVACAIXAGALICIA - UNICAJA - UNNIM BANC, S.A.**

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO C

Total Impagados (1)	Nº de activos	Importe impagado						Principal pendiente no vencido	Deuda Total			
		Principal pendiente vencido		Intereses ordinarios (2)		Total						
Hasta 1 mes	0700	0	0710	0	0720	0	0730	0	0740	0	0750	0
De 1 a 3 meses	0701	0	0711	0	0721	0	0731	0	0741	0	0751	0
De 3 a 6 meses	0703	0	0713	0	0723	0	0733	0	0743	0	0753	0
De 6 a 9 meses	0704	0	0714	0	0724	0	0734	0	0744	0	0754	0
De 9 a 12 meses	0705	0	0715	0	0725	0	0735	0	0745	0	0755	0
De 12 meses a 2 años	0706	0	0716	0	0726	0	0736	0	0746	0	0756	0
Más de 2 años	0708	0	0718	0	0728	0	0738	0	0748	0	0758	0
<b>Total</b>	<b>0709</b>	<b>0</b>	<b>0719</b>	<b>0</b>	<b>0729</b>	<b>0</b>	<b>0739</b>	<b>0</b>	<b>0749</b>	<b>0</b>	<b>0759</b>	<b>0</b>

(1) La distribución de los activos vencidos impagados entre los distintos tramos señalados se realizará en función de la antigüedad de la primera cuota vencida y no cobrada. Los intervalos se entenderán excluido el de inicio e incluido el final (p.e. De 1 a 3 meses, esto es: superior a 1 mes y menor o igual a 3 meses)

(2) Importe de intereses cuyo devengo, en su caso, se ha interrumpido conforme lo establecido en el apartado 12 de la norma 13ª de la Circular(p.e. De 1 a 3 meses, esto es: superior a 1 mes y menor o igual a 3 meses)

Impagados con garantía real (2)	Nº de activos	Importe impagado						Principal pendiente no vencido	Deuda Total	Valor garantía (3)	Valor Garantía con Tasación > 2 años (4)	% Deuda/v. Tasación				
		Principal pendiente vencido		Intereses ordinarios		Total										
Hasta 1 mes	0772	0	0782	0	0792	0	0802	0	0812	0	0822	0	0832	0	0842	0,00
De 1 a 3 meses	0773	0	0783	0	0793	0	0803	0	0813	0	0823	0	0833	0	0843	0,00
De 3 a 6 meses	0774	0	0784	0	0794	0	0804	0	0814	0	0824	0	0834	0	0844	0,00
De 6 a 9 meses	0775	0	0785	0	0795	0	0805	0	0815	0	0825	0	0835	0	0845	0,00
De 9 a 12 meses	0776	0	0786	0	0796	0	0806	0	0816	0	0826	0	0836	0	0846	0,00
De 12 meses a 2 años	0777	0	0787	0	0797	0	0807	0	0817	0	0827	0	0837	0	0847	0,00
Más de 2 años	0778	0	0788	0	0798	0	0808	0	0818	0	0828	0	0838	0	0848	0,00
<b>Total</b>	<b>0779</b>	<b>0</b>	<b>0789</b>	<b>0</b>	<b>0799</b>	<b>0</b>	<b>0809</b>	<b>0</b>	<b>0819</b>	<b>0</b>	<b>0829</b>	<b>0</b>	<b>0839</b>	<b>0</b>	<b>0849</b>	<b>0,00</b>

(2) La distribución de los activos vencidos impagados entre los distintos tramos señalados se realizará en función de la antigüedad de la primera cuota vencida y no cobrada. Los intervalos se entenderán excluido el de inicio e incluido el final (p.e. De 1 a 2 meses, estos es: superior a 1 mes y menor o igual a 2 meses)

(3) Cumplimentar con la última valoración disponible de tasación del inmueble o valor razonable de la garantía real (acciones o deuda pignoradas, etc.) si el valor de las mismas se ha considerado en el momento inicial del Fondo

(4) Se incluirá el valor de las garantías que tengan una tasación superior a dos años

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**  
 Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANCO MARENOSTRUM, S.A. - BILBAO BIZKAIA KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA - CAIXABANK - CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA - CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKO AURREZKI KUTXA - LIBERBANK - NOVACAIXAGALICIA - UNICAJA - UNNIM BANC, S.A**

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

CUADRO D	Situación actual 30/09/2016						Situación cierre anual anterior 31/12/2015						Escenario inicial					
	Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)		Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)		Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)	
Ratios de morosidad (1) (%)																		
Participaciones hipotecarias	0850		0868		0886		0904		0922		0940		0958		0976		0994	
Certificados de transmisión de hipoteca	0851		0869		0887		0905		0923		0941		0959		0977		0995	
Préstamos hipotecarios	0852		0870		0888		0906		0924		0942		0960		0978		0996	
Cédulas Hipotecarias	0853	0,00	0871	0,00	0889	0,00	0907	0,00	0925	0,00	0943	0,00	0961	0,00	0979	0,00	0997	0,00
Préstamos a promotores	0854		0872		0890		0908		0926		0944		0962		0980		0998	
Préstamos a PYMES	0855		0873		0891		0909		0927		0945		0963		0981		0999	
Préstamos a empresas	0856		0874		0892		0910		0928		0946		0964		0982		1000	
Préstamos Corporativos	0857		0875		0893		0911		0929		0947		0965		0983		1001	
Cédulas Territoriales	1066		1084		1102		1120		1138		1156		1174		1192		1210	
Bonos de Tesorería	0858		0876		0894		0912		0930		0948		0966		0984		1002	
Deuda subordinada	0859		0877		0895		0913		0931		0949		0967		0985		1003	
Créditos AAPP	0860		0878		0896		0914		0932		0950		0968		0986		1004	
Préstamos Consumo	0861		0879		0897		0915		0933		0951		0969		0987		1005	
Préstamos automoción	0862		0880		0898		0916		0934		0952		0970		0988		1006	
Cuotas arrendamiento financiero	0863		0881		0899		0917		0935		0953		0971		0989		1007	
Cuentas a cobrar	0864		0882		0900		0918		0936		0954		0972		0990		1008	
Derechos de crédito futuros	0865		0883		0901		0919		0937		0955		0973		0991		1009	
Bonos de titulización	0866		0884		0902		0920		0938		0956		0974		0992		1010	
Otros	0867		0885		0903		0921		0939		0957		0975		0993		1011	

(1) Estos ratios se referirán exclusivamente a la cartera de activos cedidos al Fondo(presentados en el balance en la partida de "derechos de crédito") y se expresaran en términos porcentuales

(A) Determinada por el cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos a la fecha de presentación de la información, y el principal pendiente (sin incluir intereses, e incluyendo principales impagados) del total activos dados de alta en el balance a la fecha de presentación de la información. La clasificación como dudosos se realizará con arreglo a lo previsto en las Normas 13ª y 23ª

(B) Determinada por el cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos a la fecha de presentación de la información, y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en el balance a la fecha de presentación de la información más el principal de los activos clasificados como fallidos. Se considerará la definición de fallidos recogida en la Circular (no necesariamente coincidentes con la definición de la escritura o folleto, recogidas en el estado 5.4)

(D) Determinada por el cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo período del año anterior y el importe de principal de activos clasificados como fallidos al cierre del mismo período del año anterior

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**  
 Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANCO MARENOSTRUM, S.A. - BILBAO BIZKAIA KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA - CAIXABANK - CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA - CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKO AURREZKI KUTXA - LIBERBANK - NOVACAIXAGALICIA - UNICAJA - UNNIM BANC, S.A**

### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)*

CUADRO E Vida residual de los activos cedidos al Fondo (1)	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 16/03/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior a 1 año	1300	11	1310	2.000.000	1320	0	1330	0	1340	0	1350	0
Entre 1 y 2 años	1301	0	1311	0	1321	11	1331	2.000.000	1341	0	1351	0
Entre 2 y 3 años	1302	0	1312	0	1322	0	1332	0	1342	0	1352	0
Entre 3 y 5 años	1303	0	1313	0	1323	0	1333	0	1343	0	1353	0
Entre 5 y 10 años	1304	0	1314	0	1324	0	1334	0	1344	0	1354	0
Superior a 10 años	1305	0	1315	0	1325	0	1335	0	1345	11	1355	2.000.000
<b>Total</b>	1306	11	1316	2.000.000	1326	11	1336	2.000.000	1346	11	1356	2.000.000
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	1307	0,50			1327	1,20			1347	10,02		

(1) Los intervalos se entenderán excluido el inicio del mismo e incluido el final (p.e. Entre 1 y 2 años: superior a 1 año y menor o igual a 2 años)

Antigüedad	Situación actual 30/09/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 16/03/2007	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	9,54	0632	8,79	0634	10,02

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**  
 Mercados de cotización de los valores emitidos: **AIAF**

### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)*

CUADRO A		Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Escenario inicial 16/03/2007			
		Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)		
Serie (2)		0001	0002	0003	0004	0005	0006	0007	0008	0009	0070	0080	0090
ES0312298112	Única	20.000	100	2.000.000	0,50	20.000	100	2.000.000	1,20	20.000	100	2.000.000	10,00
<b>Total</b>		8006	20.000	8025	2.000.000	8045	20.000	8065	2.000.000	8085	20.000	8105	2.000.000

(1) Importes en años. En caso de ser estimado se indicará en las notas explicativas las hipótesis de estimación

(2) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**  
 Mercados de cotización de los valores emitidos: **AIAF**

### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)*

CUADRO B		Intereses								Principal pendiente		Corrección de valor por repercusión de pérdidas						
		Denominación serie	Grado de subordinación (2)	Índice de referencia (3)	Margen (4)	Tipo aplicado	Base de cálculo de intereses	Días Acumulados (5)	Intereses Acumulados (6)	Intereses impagados	Principal no vencido			Principal impagado	Total pendiente			
Serie (1)		9950	9960	9970	9980	9990	9991	9993	9997	9994	9995	9998	9955					
ES0312298112	Única	NS	FIJO	0,00	4,00	365	194	42.521	0	2.000.000	0	2.042.521						
<b>Total</b>								9228	42.521	9105	0	9085	2.000.000	9095	0	9115	2.042.521	9227

(1) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

(2) La gestora deberá indicar si la serie es subordinada o no subordinada (S=Subordinada; NS=No subordinada)

(3) La gestora deberá cumplimentar el índice de referencia que corresponda en cada caso (EURIBOR un año, EURIBOR a tres meses...). En el caso de tipos fijos esta columna se cumplimentará con el término "fijo"

(4) En el caso de tipos fijos esta columna no se cumplimentará

(5) Días acumulados desde la última fecha de pago

(6) Intereses acumulados desde la última fecha de pago



## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**  
 Mercados de cotización de los valores emitidos: **AIAF**

### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)*

CUADRO C			Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015											
			Amortización principal		Intereses		Amortización principal		Intereses									
Serie (1)	Denominación serie	Fecha final (2)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)								
		7290	7300	7310	7320	7330	7340	7350	7360	7370								
ES0312298112	Única	25-05-2030	0	0	80.000	720.000	0	0	80.000	640.000								
<b>Total</b>			7305	0	7315	0	7325	80.000	7335	0	7345	80.000	7355	0	7365	80.000	7375	640.000

(1) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

(2) Entendiendo como fecha final aquella que de acuerdo con la documentación contractual determine la extinción del Fondo, siempre que no se haya producido previamente una causa de liquidación anticipada

(3) Total de pagos realizados desde el último cierre anual

(4) Total de pagos realizados desde la fecha de constitución del Fondo

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**  
 Mercados de cotización de los valores emitidos: **AIAF**

### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

#### CUADRO D

Serie (1)	Denominación serie	Calificación				
		Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Situación actual	Situación anual cierre anterior	Situación inicial
		3310	3330	3350	3360	3370
ES0312298112	Única	19-05-2016	SYP	BBB+	BBB-	AAA
ES0312298112	Única	02-11-2015	MDY	A2	A2	Aaa
ES0312298112	Única	10-02-2014	FCH	BBB-	BBB-	AAA

(1) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

(2) La gestora deberá cumplimentar la calificación crediticia otorgada por cada agencia de rating, cuya denominación también deberá ser cumplimentada, para serie - MDY para Moody's; SYP para Standard & Poors; FCH para Fitch; DBRS para Dominion Bond Rating Service -

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.3

Denominación del Fondo: <b>AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS</b> Denominación del compartimento: <b>AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS</b> Denominación de la gestora: <b>HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.</b> Estados agregados: <b>No</b> Periodo: <b>3er Trimestre</b> Ejercicio: <b>2016</b>
---

<b>INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS</b> <i>(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)</i>		<b>Situación actual</b> <b>30/09/2016</b>		<b>Situación cierre</b> <b>anual anterior</b> <b>31/12/2015</b>
1. Importe del Fondo de Reserva	0010	0	1010	0
2. Porcentaje que representa el Fondo de Reserva, u otras mejoras equivalentes, sobre el total de activos titulizados	0020	0,00	1020	0,00
3. Exceso de spread (%) (1)	0040	0,00	1040	0,00
4. Permuta financiera de intereses (S/N)	0050	No	1050	No
5. Permuta financiera de tipos de cambio (S/N)	0070	No	1070	No
6. Otras permutas financieras (S/N)	0080	No	1080	No
7. Importe disponible de la línea/s de liquidez (2)	0090	0	1090	0
8. Subordinación de series (S/N)	0110	No	1110	No
9. Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total de bonos (3)	0120	100,00	1120	100,00
10. Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales	0150	0	1150	0
11. Porcentaje que representa el aval sobre el total de los pasivos emitidos	0160	0,00	1160	0,00
12. Importe máximo de riesgo cubierto por derivados de crédito u otras garantías financieras adquiridas	0170	0	1170	0
13. Otros (S/N) (4)	0180	No	1180	No
(1) Diferencial existente entre los tipos de interés medios ponderados percibidos de la cartera de activos titulizados conforme se establece en el Cuadro 5.5.E y el tipo de interés medio de los pasivos emitidos cuya finalidad ha sido la adquisición de los activos (2) Se incluirá el importe total disponible de las distintas líneas de liquidez en caso de que haya más de una (3) Entendiendo como no subordinadas aquellas series que en la fecha se encuentren, respecto a las demás, en una posición anterior para el cobro de capital conforme al orden de prelación de pagos (4) La gestora deberá incluir una descripción de dichas mejoras crediticias en las notas explicativas en caso de que las consideren relevantes				

<b>Información sobre contrapartes de las mejoras crediticias</b>		<b>NIF</b>		<b>Denominación</b>
Contraparte del Fondo de Reserva u otras mejores equivalentes (5)	0200		1210	0
Permutas financieras de tipos de interés	0210		1220	0
Permutas financieras de tipos de cambio	0220		1230	0
Otras permutas financieras	0230		1240	0
Contraparte de la Línea de Liquidez	0240		1250	ICO
Entidad Avalista	0250		1260	0
Contraparte del derivado de crédito	0260		1270	0

(5) Si el Fondo de Reserva se ha constituido a través de títulos emitidos y se desconoce el titular de esos títulos no se cumplimentará

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.4

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**

### CIRCUNSTANCIAS ESPECÍFICAS ESTABLECIDAS CONTRACTUALMENTE EN EL FONDO

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)*

Concepto (1)	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio (2)				Ref. Folleto		
	Situación actual	Periodo anterior	Situación actual	Periodo anterior	Situación actual	Periodo anterior	Última Fecha Pago	Situación actual	Periodo anterior	Última Fecha Pago					
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	0010	0	0030	0	0100	0	0200	0	0300	0,00	0400	0,00	1120	0,00	
2. Activos Morosos por otras razones					0110	0	0210	0	0310	0,00	0410	0,00	1130	0,00	
<b>Total Morosos</b>					0120	0	0220	0	0320	0,00	0420	0,00	1140	0,00	1280
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	0050	0	0060	0	0130	0	0230	0	0330	0,00	0430	0,00	1050	0,00	
4. Activos Fallidos por otras razones					0140	0	0240	0	0340	0,00	0440	0,00	1160	0,00	
<b>Total Fallidos</b>					0150	0	0250	0	0350	0,00	0450	0,00	1200	0,00	1290

(1) En caso de existir definiciones adicionales a las recogidas en la presente tabla (moros cualificadas, fallidos subjetivos, etc) respecto a las que se establezca algún trigger se indicarán en la tabla de Otros ratios relevantes, indicando el nombre del ratio

(2) Los ratios se corresponden al importe total de activos fallidos o morosos entre el saldo vivo de los activos cedidos al fondo según se defina en la documentación contractual. En la columna Ref. Folleto se indicará el epígrafe o capítulo del folleto en el que el concepto esté definido

Otros ratios relevantes	Ratio (2)			Ref. Folleto
	Situación actual	periodo anterior	Última Fecha Pago	

TRIGGERS (3)	Limite	% Actual	Última Fecha		Ref. Folleto
			Pago	Pago	
Amortización secuencial: series (4)	0500	0520	0540		0560
Diferimiento/postergamiento intereses: series (5)	0506	0526	0546		0566
No Reducción del Fondo de Reserva (6)	0512	0532	0552	0572	
<b>OTROS TRIGGERS (3)</b>	0513	0523	0553		0573
IMPORTE MAXIMO DISPONIBLE LINEA LIQUIDEZ	2,40	2,40	2,40		Condiciones Finales VIII.16

(3) En caso de existir triggers adicionales a los recogidos en la presente tabla se indicarán su nombre o concepto debajo de OTROS TRIGGERS. Si los triggers recogidos expresamente en la tabla no están previstos en el Fondo, no se cumplimentarán

(4) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto al modo de amortización (prorrata/secuencial) de algunas de las series se indicarán las series afectadas indicando su ISIN, y en su defecto el nombre, el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

(5) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto al diferimiento o postergamiento de intereses de algunas de las series se indicarán las series afectadas indicando su ISIN o nombre, el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

(6) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto a la no reducción del fondo de reserva se indicará el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

--

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**

### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)*

Distribución geográfica de activos titulizados	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 16/03/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)	
Andalucía	0400	2	0426	300.000	0452	2	0478	300.000	0504	2	0530	300.000
Aragón	0401	0	0427	0	0453	0	0479	0	0505	0	0531	0
Asturias	0402	1	0428	300.000	0454	1	0480	300.000	0506	1	0532	300.000
Baleares	0403	1	0429	150.000	0455	1	0481	150.000	0507	1	0533	150.000
Canarias	0404	0	0430	0	0456	0	0482	0	0508	0	0534	0
Cantabria	0405	0	0431	0	0457	0	0483	0	0509	0	0535	0
Castilla-León	0406	0	0432	0	0458	0	0484	0	0510	0	0536	0
Castilla La Mancha	0407	1	0433	200.000	0459	1	0485	200.000	0511	1	0537	200.000
Cataluña	0408	1	0434	50.000	0460	1	0486	50.000	0512	1	0538	50.000
Ceuta	0409	0	0435	0	0461	0	0487	0	0513	0	0539	0
Extremadura	0410	1	0436	200.000	0462	1	0488	200.000	0514	1	0540	200.000
Galicia	0411	1	0437	50.000	0463	1	0489	50.000	0515	1	0541	50.000
Madrid	0412	1	0438	300.000	0464	1	0490	300.000	0516	1	0542	300.000
Meilla	0413	0	0439	0	0465	0	0491	0	0517	0	0543	0
Murcia	0414	0	0440	0	0466	0	0492	0	0518	0	0544	0
Navarra	0415	0	0441	0	0467	0	0493	0	0519	0	0545	0
La Rioja	0416	0	0442	0	0468	0	0494	0	0520	0	0546	0
Comunidad Valenciana	0417	0	0443	0	0469	0	0495	0	0521	0	0547	0
País Vasco	0418	2	0444	450.000	0470	2	0496	450.000	0522	2	0548	450.000
<b>Total España</b>	<b>0419</b>	<b>11</b>	<b>0445</b>	<b>2.000.000</b>	<b>0471</b>	<b>11</b>	<b>0497</b>	<b>2.000.000</b>	<b>0523</b>	<b>11</b>	<b>0549</b>	<b>2.000.000</b>
Otros países Unión europea	0420	0	0446	0	0472	0	0498	0	0524	0	0550	0
Resto	0422	0	0448	0	0474	0	0500	0	0526	0	0552	0
<b>Total general</b>	<b>0425</b>	<b>11</b>	<b>0450</b>	<b>2.000.000</b>	<b>0475</b>	<b>11</b>	<b>0501</b>	<b>2.000.000</b>	<b>0527</b>	<b>11</b>	<b>0553</b>	<b>2.000.000</b>

(1) Entendiendo como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**

### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)*

Divisa/Activos titulizados	Situación actual 30/09/2016						Situación cierre anual anterior 31/12/2015						Situación inicial 16/03/2007					
	Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)	
Euro - EUR	0571	11	0577	2.000.000	0583	2.000.000	0600	11	0606	2.000.000	0611	2.000.000	0620	11	0626	2.000.000	0631	2.000.000
EEUU Dólar - USD	0572	0	0578	0	0584	0	0601	0	0607	0	0612	0	0621	0	0627	0	0632	0
Japón Yen - JPY	0573	0	0579	0	0585	0	0602	0	0608	0	0613	0	0622	0	0628	0	0633	0
Reino Unido Libra - GBP	0574	0	0580	0	0586	0	0603	0	0609	0	0614	0	0623	0	0629	0	0634	0
Otras	0575	0			0587	0	0604	0			0615	0	0624	0			0635	0
<b>Total</b>	<b>0576</b>	<b>11</b>			<b>0588</b>	<b>2.000.000</b>	<b>0605</b>	<b>11</b>			<b>0616</b>	<b>2.000.000</b>	<b>0625</b>	<b>11</b>			<b>0636</b>	<b>2.000.000</b>

(1) Entendiendo como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**

### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)*

CUADRO C Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (1)	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 16/03/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	1100	0	1110	0	1120	0	1130	0	1140	0	1150	0
40% - 60%	1101	0	1111	0	1121	0	1131	0	1141	0	1151	0
60% - 80%	1102	0	1112	0	1122	0	1132	0	1142	0	1152	0
80% - 100%	1103	0	1113	0	1123	0	1133	0	1143	0	1153	0
100% - 120%	1104	0	1114	0	1124	0	1134	0	1144	0	1154	0
120% - 140%	1105	0	1115	0	1125	0	1135	0	1145	0	1155	0
140% - 160%	1106	0	1116	0	1126	0	1136	0	1146	0	1156	0
superior al 160%	1107	0	1117	0	1127	0	1137	0	1147	0	1157	0
<b>Total</b>	<b>1108</b>	<b>0</b>	<b>1118</b>	<b>0</b>	<b>1128</b>	<b>0</b>	<b>1138</b>	<b>0</b>	<b>1148</b>	<b>0</b>	<b>1158</b>	<b>0</b>
<b>Media ponderada (%)</b>			<b>1119</b>	<b>0,00</b>			<b>1139</b>	<b>0,00</b>			<b>1159</b>	<b>0,00</b>

(1) Distribución según el valor de la razón entre el importe pendiente de amortizar de los préstamos con garantía real y la última valoración disponible de tasación de los inmuebles hipotecados, o valor razonable de otras garantías reales, siempre que el valor de las mismas se haya considerado en el momento inicial del Fondo, expresada en porcentaje



## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**

### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)*

#### CUADRO D

Rendimiento índice del periodo	Número de activos vivos		Principal Pendiente		Margen ponderado s/ índice de referencia		Tipo de interés medio ponderado (2)	
Índice de referencia (1)	1400		1410		1420		1430	
TIPO FIJO	11		2.000.000		0,00		4,00	
<b>Total</b>	1405	11	1415	2.000.000	1425	0,00	1435	4,00

(1) La gestora deberá cumplimentar el índice de referencia que corresponda en cada caso (EURIBOR un año, LIBRO, etc.)

(2) En el caso de tipos fijos no se cumplimentará la columna de margen ponderado y se indicará el tipo de interés medio ponderado de los activos a tipo fijo en la columna "tipo de interés medio ponderado"

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**

**OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS**

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO E Tipo de interés nominal	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 16/03/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior al 1%	1500	0	1521	0	1542	0	1563	0	1584	0	1605	0
1% - 1,49%	1501	0	1522	0	1543	0	1564	0	1585	0	1606	0
1,5% - 1,99%	1502	0	1523	0	1544	0	1565	0	1586	0	1607	0
2% - 2,49%	1503	0	1524	0	1545	0	1566	0	1587	0	1608	0
2,5% - 2,99%	1504	0	1525	0	1546	0	1567	0	1588	0	1609	0
3% - 3,49%	1505	0	1526	0	1547	0	1568	0	1589	0	1610	0
3,5% - 3,99%	1506	0	1527	0	1548	0	1569	0	1590	0	1611	0
4% - 4,49%	1507	11	1528	2.000.000	1549	11	1570	2.000.000	1591	11	1612	2.000.000
4,5% - 4,99%	1508	0	1529	0	1550	0	1571	0	1592	0	1613	0
5% - 5,49%	1509	0	1530	0	1551	0	1572	0	1593	0	1614	0
5,5% - 5,99%	1510	0	1531	0	1552	0	1573	0	1594	0	1615	0
6% - 6,49%	1511	0	1532	0	1553	0	1574	0	1595	0	1616	0
6,5% - 6,99%	1512	0	1533	0	1554	0	1575	0	1596	0	1617	0
7% - 7,49%	1513	0	1534	0	1555	0	1576	0	1597	0	1618	0
7,5% - 7,99%	1514	0	1535	0	1556	0	1577	0	1598	0	1619	0
8% - 8,49%	1515	0	1536	0	1557	0	1578	0	1599	0	1620	0
8,5% - 8,99%	1516	0	1537	0	1558	0	1579	0	1600	0	1621	0
9% - 9,49%	1517	0	1538	0	1559	0	1580	0	1601	0	1622	0
9,5% - 9,99%	1518	0	1539	0	1560	0	1581	0	1602	0	1623	0
Superior al 10%	1519	0	1540	0	1561	0	1582	0	1603	0	1624	0
<b>Total</b>	<b>1520</b>	<b>11</b>	<b>1541</b>	<b>2.000.000</b>	<b>1562</b>	<b>11</b>	<b>1583</b>	<b>2.000.000</b>	<b>1604</b>	<b>11</b>	<b>1625</b>	<b>2.000.000</b>
<b>Tipo de interés medio ponderado de los activos(%)</b>			<b>9542</b>	<b>4,00</b>			<b>9584</b>	<b>4,00</b>			<b>1626</b>	<b>4,00</b>
<b>Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%)</b>			<b>9543</b>	<b>4,00</b>			<b>9585</b>	<b>4,00</b>			<b>1627</b>	<b>4,00</b>

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**

### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

Concentración	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 16/03/2007			
	Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	2000	97,50			2030	97,50			2060	97,50		
Sector: (1)	2010	100,00	2020	64	2040	100,00	2050	64	2070	100,00	2080	64

(1) Indíquese denominación del sector con mayor concentración

(2) Incluir código CNAE con dos niveles de agregación

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**

### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)*

#### CUADRO G

Divisa/Pasivos emitidos por el fondo	Situación actual 30/09/2016						Situación inicial 16/03/2007					
	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros		Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros	
Euro - EUR	3000	20.000	3060	2.000.000	3110	2.000.000	3170	20.000	3230	2.000.000	3250	2.000.000
EEUU Dólar - USDR	3010		3070		3120		3180		3240		3260	
Japón Yen - JPY	3020		3080		3130		3190		3250		3270	
Reino Unido Libra - GBP	3030		3090		3140		3200		3260		3280	
Otras	3040				3150		3210				3290	
<b>Total</b>	<b>3050</b>	<b>20.000</b>			<b>3160</b>	<b>2.000.000</b>	<b>3220</b>	<b>20.000</b>			<b>3300</b>	<b>2.000.000</b>

# ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.06

Denominación del Fondo: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
Denominación del compartimento: **AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
Estados agregados: **No**  
Periodo: **3er Trimestre**  
Ejercicio: **2016**

## NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene  
Información adicional  
en fichero adjunto

## INFORME DE AUDITOR