

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:

Número de registro del compartimento:

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

NIF gestora: **A80732142**

Estados agregados: **Si**

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:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: Si
Periodo: 3er Trimestre
Ejercicio: 2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/09/2016		Periodo Anterior 31/12/2015
--------------------------	--	------------------------------	--	--------------------------------

ACTIVO				
---------------	--	--	--	--

A) ACTIVO NO CORRIENTE	0008	13.201.853	1008	16.201.014
-------------------------------	------	------------	------	------------

I. Activos financieros a largo plazo	0010	13.201.853	1010	16.201.014
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	13.201.853	1200	16.201.014
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	13.201.853	1204	16.201.014
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
II. Activos por impuesto diferido	0250	0	1250	0
III. Otros activos no corrientes	0260	0	1260	0

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:				
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.				
Estados agregados: Si				
Periodo: 3er Trimestre				
Ejercicio: 2016				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/09/2016		Periodo Anterior 31/12/2015
B) ACTIVO CORRIENTE	0270	6.404.350	1270	9.539.660
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0280	0	1280	0
V. Activos financieros a corto plazo	0290	5.914.518	1290	8.865.627
1. Deudores y otras cuentas a cobrar	0300	1	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	5.914.517	1400	8.865.627
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	5.574.995	1404	8.470.000
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	339.522	1422	395.627
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
VI. Ajustes por periodificaciones	0450	0	1450	0
1. Comisiones	0451	0	1451	0
2. Otros	0452	0	1452	0
VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes	0460	489.832	1460	674.033
1. Tesorería	0461	489.832	1461	674.033
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462	0	1462	0

TOTAL ACTIVO	0500	19.606.203	1500	25.740.674
--------------	------	------------	------	------------

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:				
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.				
Estados agregados: Si				
Periodo: 3er Trimestre				
Ejercicio: 2016				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/09/2016		Periodo Anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0650	13.595.556	1650	16.666.801
I. Provisiones a largo plazo	0660	0	1660	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0700	13.595.556	1700	16.666.801
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	13.205.000	1710	16.205.000
1.1 Series no subordinadas	0711	13.205.000	1711	16.205.000
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	390.556	1720	461.801
2.1 Préstamo subordinado	0721	0	1721	0
2.2 Crédito línea de liquidez	0722	390.586	1722	461.837
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0723	0	1723	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0724	-30	1724	-36
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
III. Pasivos por impuesto diferido	0750	0	1750	0
B) PASIVO CORRIENTE	0760	6.010.647	1760	9.073.873
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0770	0	1770	0
V. Provisiones a corto plazo	0780	0	1780	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0800	6.010.459	1800	9.073.697
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	37	1810	131
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	5.907.759	1820	8.856.692
2.1 Series no subordinadas	0821	5.575.000	1821	8.470.000
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	332.759	1824	386.692
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	99.630	1830	212.545
3.1 Préstamo subordinado	0831	0	1831	0
3.2 Crédito línea de liquidez	0832	99.245	1832	212.108
3.3 Otras deudas con entidades de crédito	0833	0	1833	0
3.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0834	-7	1834	-7
3.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0835	389	1835	441
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836	0	1836	0
3.7 Intereses vencidos e impagados	0837	3	1837	3
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	3.033	1850	4.329
5.1 Importe bruto	0851	3.033	1851	4.329
5.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0852		1852	

VII. Ajustes por periodificación	0900	188	1900	176
1. Comisiones	0910	188	1910	176
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	194	1914	184
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	-6	1917	-8
1.8 Otras comisiones	0918	0	1918	0
2. Otros	0920	0	1920	0
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0930	0	1930	0
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0940	0	1940	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0950	0	1950	0
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0960	0	1960	0
XI. Gastos de constitución en transición	0970		1970	
TOTAL PASIVO	1000	19.606.203	2000	25.740.674

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:
 Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
 Estados agregados: Si
 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
1. Intereses y rendimientos asimilados	0100		1100	0	2100	491.079	3100	
1.1 Valores representativos de deuda	0110		1110	0	2110	0	3110	
1.2 Derechos de crédito	0120		1120	0	2120	490.113	3120	
1.3 Otros activos financieros	0130		1130	0	2130	966	3130	
2. Intereses y cargas asimiladas	0200		1200		2200	-489.677	3200	
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210		1210		2210	-488.711	3210	
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220		1220		2220		3220	
2.3 Otros pasivos financieros	0230		1230		2230	-966	3230	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0240		1240	0	2240	0	3240	
A) MARGEN DE INTERESES	0250		1250	0	2250	1.402	3250	
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	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	
5. Diferencias de cambio (neto)	0400		1400	0	2400	0	3400	
6. Otros ingresos de explotación	0500		1500	0	2500	14	3500	
7. Otros gastos de explotación	0600		1600		2600	-1.413	3600	
7.1 Servicios exteriores	0610		1610		2610	-666	3610	
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611		1611		2611	-1	3611	
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0612		1612		2612	-652	3612	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0613		1613		2613	-1	3613	
7.1.4 Otros servicios	0614		1614		2614	-12	3614	
7.2 Tributos	0620		1620		2620	-1	3620	
7.3 Otros gastos de gestión corrientes	0630		1630		2630	-746	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	-742	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	-4	3637	
8. Deterioro de activos financieros (neto)	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	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0750		1750	0	2750	0	3750	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0800		1800	0	2800	0	3800	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0850		1850	0	2850	-3	3850	
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0900		1900	0	2900	0	3900	
12. Impuesto sobre beneficios	0950		1950	0	2950	0	3950	
C) RESULTADO DEL PERIODO	3000		4000	0	5000	0	6000	

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.03

Denominación del Fondo: AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.				
Estados agregados: Si				
Periodo: 3er Trimestre				
Ejercicio: 2016				

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		Periodo Actual		Mismo Periodo año Anterior
A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN	8000	-72	9000	0
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	8100	1.369	9100	0
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	545.383	9110	0
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-544.014	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
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo	8200	-1.436	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	-732	9240	0
2.5 Otras comisiones	8250	-704	9250	0
3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo	8300	-5	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	-5	9330	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION	8350	-184.113	9350	0
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	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
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	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
6. Flujos de caja netos por amortizaciones	8600	0	9600	0
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	5.895.000	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	-5.895.000	9630	0
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	8700	-184.113	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	-184.113	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
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	8800	-184.185	9800	0
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	674.018	9900	0
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	489.833	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:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: Si
Periodo: 3er Trimestre
Ejercicio: 2016

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS <i>(miles de euros)</i>		Periodo Actual 30/09/2016		Mismo Periodo año Anterior 30/09/2015
1 Activos financieros disponibles para la venta				
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
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	6100	0	7100	0
2 Cobertura de los flujos de efectivo				
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
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	6200	0	7200	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 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
Total Ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	6400	0	7400	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	6500	0	7500	0

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:

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

Estados agregados: **SI**

Periodo: **3er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANCO CAJA TRES - BANCO MARENOSTRUM, S.A. - BANKIA - BBK BANK CAJA SUR, S.A. - CAIXABANK - CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT - CATALUNYA BANC, S.A. - 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 12/12/2005			
	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	149	0033	18.780.000	0063	198	0093	24.675.000	0123	408	0153	55.978.000
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	
Total	0021	149	0050	18.780.000	0080	198	0110	24.675.000	0140	408	0170	55.978.000

(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:
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**
 Estados agregados: **SI**
 Periodo: **3er Trimestre**
 Ejercicio: **2016**
 Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANCO CAJA TRES - BANCO MARENOSTRUM, S.A. - BANKIA - BBK BANK CAJA SUR, S.A. - CAIXABANK - CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT - CATALUNYA BANC, S.A. - 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	-5.895.000	0210	-5.095.000
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	-37.198.000	0212	-31.103.000
Importe de principal pendiente de amortización de los nuevos activos incorporados en el periodo (1)	0203	0	0213	0
Principal pendiente cierre del periodo (2)	0204	18.780.000	0214	24.675.000
Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)	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:

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

Estados agregados: **SI**

Periodo: **3er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANCO CAJA TRES - BANCO MARENOSTRUM, S.A. - BANKIA - BBK BANK CAJA SUR, S.A. - CAIXABANK - CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT - CATALUNYA BANC, S.A. - 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
Total	0709	0	0719	0	0729	0	0739	0	0749	0	0759	0

(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	1854	0	0844	0,00
De 6 a 9 meses	0775	0	0785	0	0795	0	0805	0	0815	0	0825	0	0835	0	1855	0	0845	0,00
De 9 a 12 meses	0776	0	0786	0	0796	0	0806	0	0816	0	0826	0	0836	0	1856	0	0846	0,00
De 12 meses a 2 años	0777	0	0787	0	0797	0	0807	0	0817	0	0827	0	0837	0	1857	0	0847	0,00
Más de 2 años	0778	0	0788	0	0798	0	0808	0	0818	0	0828	0	0838	0	1858	0	0848	0,00
Total	0779	0	0789	0	0799	0	0809	0	0819	0	0829	0	0839	0	0849	0,00		

(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 pignoral, 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 TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **SI**

Periodo: **3er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANCO CAJA TRES - BANCO MARENOSTRUM, S.A. - BANKIA - BBK BANK CAJA SUR, S.A. - CAIXABANK - CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT - CATALUNYA BANC, S.A. - 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)	
Participaciones hipotecarias	0850	0868	0886	0904	0922	0886	0940	0958	0976	0994								
Certificados de transmisión de hipoteca	0851	0869	0887	0905	0923	0887	0941	0959	0977	0995								
Préstamos hipotecarios	0852	0870	0888	0906	0924	0888	0942	0960	0978	0996								
Cédulas Hipotecarias	0853	0,00 0871	0,00 0889	0,00 0907	0,00 0925	0,00 0889	0,00 0943	0,00 0961	0,00 0979	0,00 0997	0,00							0,00
Préstamos a promotores	0854	0872	0890	0908	0926	0890	0944	0962	0980	0998								
Préstamos a PYMES	0855	0873	0891	0909	0927	0891	0945	0963	0981	0999								
Préstamos a empresas	0856	0874	0892	0910	0928	0892	0946	0964	0982	1000								
Préstamos Corporativos	0857	0875	0893	0911	0929	0893	0947	0965	0983	1001								
Cédulas Territoriales	1066	1084	1102	1120	1138	1102	1156	1174	1192	1210								
Bonos de Tesorería	0858	0876	0894	0912	0930	0894	0948	0966	0984	1002								
Deuda subordinada	0859	0877	0895	0913	0931	0895	0949	0967	0985	1003								
Créditos AAPP	0860	0878	0896	0914	0932	0896	0950	0968	0986	1004								
Préstamos Consumo	0861	0879	0897	0915	0933	0897	0951	0969	0987	1005								
Préstamos automoción	0862	0880	0898	0916	0934	0898	0952	0970	0988	1006								
Cuotas arrendamiento financiero	0863	0881	0899	0917	0935	0899	0953	0971	0989	1007								
Cuentas a cobrar	0864	0882	0900	0918	0936	0900	0954	0972	0990	1008								
Derechos de crédito futuros	0865	0883	0901	0919	0937	0901	0955	0973	0991	1009								
Bonos de titulización	0866	0884	0902	0920	0938	0902	0956	0974	0992	1010								
Otros	0867	0885	0903	0921	0939	0903	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 expresarán 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:
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**
 Estados agregados: **Si**
 Periodo: **3er Trimestre**
 Ejercicio: **2016**
 Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANCO CAJA TRES - BANCO MARENOSTRUM, S.A. - BANKIA - BBK BANK CAJA SUR, S.A. - CAIXABANK - CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT - CATALUNYA BANC, S.A. - 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 12/12/2005			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior a 1 año	1300	33	1310	5.575.000	1320	61	1330	8.470.000	1340	0	1350	0
Entre 1 y 2 años	1301	45	1311	6.235.000	1321	38	1331	5.810.000	1341	45	1351	7.740.000
Entre 2 y 3 años	1302	5	1312	425.000	1322	28	1332	3.425.000	1342	6	1352	750.000
Entre 3 y 5 años	1303	16	1313	2.000.000	1323	10	1333	925.000	1343	92	1353	14.568.000
Entre 5 y 10 años	1304	35	1314	3.000.000	1324	46	1334	4.500.000	1344	127	1354	18.025.000
Superior a 10 años	1305	15	1315	1.545.000	1325	15	1335	1.545.000	1345	138	1355	14.895.000
Total	1306	149	1316	18.780.000	1326	198	1336	24.675.000	1346	408	1356	55.978.000
Vida residual media ponderada (años)	1307	3,03			1327	2,95			1347	7,53		

(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 12/12/2005	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	9,71	0632	8,91	0634	6,01

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:

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

Estados agregados: SI

Periodo: 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)

Serie (2)	Denominación serie	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Escenario inicial 12/12/2005			
		Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)
		0001	0002	0003	0004	0005	0006	0007	0008	0009	0070	0080	0090
ES0312298245	Única	5.000	100	500.000	3,20	5.000	100	500.000	4,00	5.000	100	500.000	9,90
ES0312298237	Única	0	0	0	0,00	0	0	0	0,00	14.500	100	1.450.000	4,30
ES0312298229	Única	0	0	0	0,00	22.950	100	2.295.000	0,50	22.950	100	2.295.000	6,00
ES0312298211	Única	0	0	0	0,00	0	0	0	0,00	23.230	100	2.323.000	2,10
ES0312298203	Única	0	0	0	0,00	0	0	0	0,00	41.050	100	4.105.000	1,70
ES0312298195	Única	0	0	0	0,00	0	0	0	0,00	41.050	100	4.105.000	5,90
ES0312298187	Única	0	0	0	0,00	0	0	0	0,00	42.000	100	4.200.000	3,80
ES0312298179	Única	0	0	0	0,00	0	0	0	0,00	7.500	100	750.000	1,30
ES0312298161	Única	0	0	0	0,00	0	0	0	0,00	37.400	100	3.740.000	2,00
ES0312298153	Única	28.100	100	2.810.000	1,10	28.100	100	2.810.000	1,80	28.100	100	2.810.000	10,00
ES0312298146	Única	0	0	0	0,00	0	0	0	0,00	21.000	100	2.100.000	2,00
ES0312298138	Única	4.250	100	425.000	2,60	4.250	100	425.000	2,60	4.250	100	425.000	12,00
ES0312298120	Única	15.450	100	1.545.000	10,60	15.450	100	1.545.000	11,40	15.450	100	1.545.000	20,00
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
ES0312298104	Única	25.750	100	2.575.000	0,20	25.750	100	2.575.000	1,00	22.750	100	2.275.000	10,00
ES0312298096	Única	16.000	100	1.600.000	7,10	16.000	100	1.600.000	7,80	16.000	100	1.600.000	17,00
ES0312298088	Única	0	0	0	0,00	0	0	0	0,00	13.000	100	1.300.000	3,60
ES0312298070	Única	22.300	100	2.230.000	1,70	22.300	100	2.230.000	2,50	22.300	100	2.230.000	12,00
ES0312298062	Única	10.000	100	1.000.000	0,70	10.000	100	1.000.000	1,40	10.000	100	1.000.000	11,00
ES0312298054	Única	15.000	100	1.500.000	6,20	15.000	100	1.500.000	5,20	15.000	100	1.500.000	15,00
ES0312298047	Única	0	0	0	0,00	0	0	0	0,00	15.000	100	1.500.000	5,00
ES0312298039	Única	11.950	100	1.195.000	1,40	11.950	100	1.195.000	2,10	11.950	100	1.195.000	12,00
ES0312298021	Única	14.000	100	1.400.000	6,20	14.000	100	1.400.000	7,00	14.000	100	1.400.000	17,00
ES0312298013	Única	0	0	0	0,00	36.000	100	3.600.000	0,20	36.000	100	3.600.000	10,00
ES0312298005	Única	0	0	0	0,00	0	0	0	0,00	26.400	100	2.640.000	3,00
Total		8006	187.800	8025	18.780.000	8045	246.750	8065	24.675.000	8085	525.880	8105	52.588.000

(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:

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

Estados agregados: Si

Periodo: 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)

Serie (1)	Denominación serie	Grado de subordinación (2)	Índice de referencia (3)	Margen (4)	Tipo aplicado	Intereses				Principal pendiente		Corrección de valor por repercusión de pérdidas							
						Base de cálculo de intereses	Días Acumulados (5)	Intereses Acumulados (6)	Intereses impagados	Principal no vencido	Principal impagado	Total pendiente							
														9950	9960	9970	9980	9990	9991
ES0312298245	Única	NS	FIJO	0,00	4,50	365		304	18.689	0	500.000	0	518.689						
ES0312298153	Única	NS	EURIBOR 3 MESES	0,15	0,00	360		70	0	0	2.810.000	0	2.810.000						
ES0312298138	Única	NS	EURIBOR 3 MESES	0,07	0,00	360		38	0	0	425.000	0	425.000						
ES0312298120	Única	NS	FIJO	0,00	4,75	365		129	25.937	0	1.545.000	0	1.570.937						
ES0312298112	Única	NS	FIJO	0,00	4,00	365		194	42.521	0	2.000.000	0	2.042.521						
ES0312298104	Única	NS	FIJO	0,00	4,00	365		286	80.487	0	2.575.000	0	2.655.487						
ES0312298096	Única	NS	FIJO	0,00	4,25	365		342	63.541	0	1.600.000	0	1.663.541						
ES0312298070	Única	NS	FIJO	0,00	4,25	365		109	28.303	0	2.230.000	0	2.258.303						
ES0312298062	Única	NS	EURIBOR 3 MESES	0,07	0,00	360		36	0	0	1.000.000	0	1.000.000						
ES0312298054	Única	NS	FIJO	0,00	4,00	n/a		191	31.397	0	1.500.000	0	1.531.397						
ES0312298039	Única	NS	EURIBOR 3 MESES	0,10	0,00	360		40	0	0	1.195.000	0	1.195.000						
ES0312298021	Única	NS	FIJO	0,00	3,75	365		292	41.885	0	1.400.000	0	1.441.885						
Total									9228	332.760	9105	0	9085	18.780.000	9095	0	9115	19.112.760	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:

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

Estados agregados: **Si**

Periodo: **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								
ES0312298245	Única	14-12-2016	0	0	0	135.000	0	0	22.500	135.000								
ES0312298153	Única	14-12-2016	0	0	725	337.003	0	0	5.105	336.278								
ES0312298138	Única	14-12-2016	0	0	0	55.837	0	0	416	55.837								
ES0312298120	Única	14-12-2016	0	0	73.388	660.490	0	0	73.388	587.102								
ES0312298112	Única	14-12-2016	0	0	80.000	720.000	0	0	80.000	640.000								
ES0312298104	Única	14-12-2016	0	0	0	927.000	0	0	103.000	927.000								
ES0312298096	Única	14-12-2016	0	0	0	612.000	0	0	68.000	612.000								
ES0312298070	Única	14-12-2016	0	0	94.775	947.750	0	0	94.775	852.975								
ES0312298062	Única	14-12-2016	0	0	0	167.778	0	0	913	167.778								
ES0312298054	Única	14-12-2016	0	0	60.000	600.000	0	0	60.000	540.000								
ES0312298039	Única	14-12-2016	0	0	40	182.985	0	0	1.533	182.945								
ES0312298021	Única	14-12-2016	0	0	0	525.000	0	0	52.500	525.000								
Total			7305	0	7315	0	7325	308.928	7335	5.870.843	7345	0	7355	0	7365	562.130	7375	5.561.915

(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:

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

Estados agregados: Si

Periodo: 3er Trimestre

Ejercicio: 2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

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
ES0312298252	UNICO	22-10-2014	SYP	A+	A+	AAA
ES0312298252	UNICO	31-07-2014	MDY	Baa1	Baa1	Aaa
ES0312298245	Única	19-05-2016	SYP	BBB+	BBB+	AAA
ES0312298245	Única	02-11-2015	MDY	A2	A2	Aaa
ES0312298237	Única	23-06-2014	SYP	AA	AA	AAA
ES0312298237	Única	27-06-2012	MDY	Baa1	Baa1	Aaa
ES0312298229	Única	19-05-2016	SYP	BBB+	BBB+	AAA
ES0312298211	Única	01-08-2011	SYP	A+	A+	AAA
ES0312298211	Única	10-03-2011	FCH	AA-	AA-	AAA
ES0312298203	Única	01-08-2011	SYP	A+	A+	AAA
ES0312298203	Única	20-10-2011	MDY	A3	A3	Aaa
ES0312298203	Única	10-03-2011	FCH	AA-	AA-	AAA
ES0312298195	Única	18-08-2015	SYP	BBB+	BBB+	AAA
ES0312298195	Única	02-11-2015	MDY	A2	A2	Aaa
ES0312298195	Única	28-05-2015	FCH	BBB+	BBB+	AAA
ES0312298187	Única	16-10-2012	SYP	AA-	AA-	AAA
ES0312298187	Única	27-06-2012	MDY	Baa2	Baa2	Aaa
ES0312298187	Única	25-06-2012	FCH	BBB	BBB	AAA
ES0312298179	Única	01-08-2011	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0312298179	Única	25-03-2011	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0312298179	Única	10-03-2011	FCH	AA-	AA-	AAA
ES0312298161	Única	31-03-2008	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0312298161	Única	28-04-2008	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0312298161	Única	02-02-2009	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0312298153	Única	19-05-2016	SYP	BBB+	BBB-	AAA
ES0312298153	Única	02-11-2015	MDY	A2	A2	Aaa

ES0312298153	Única	10-02-2014	FCH	BBB+	BBB+	AAA
ES0312298146	Única	16-04-2008	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0312298146	Única	16-04-2008	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0312298146	Única	02-02-2009	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0312298138	Única	19-05-2016	SYP	BBB+	BBB-	AAA
ES0312298138	Única	19-06-2015	MDY	Aa3	Aa3	Aaa
ES0312298138	Única	14-08-2014	FCH	BBB+	BBB+	AAA
ES0312298120	Única	19-05-2016	SYP	BBB+	BBB-	AAA
ES0312298120	Única	02-06-2016	MDY	Aa3	A1	Aaa
ES0312298120	Única	28-05-2015	FCH	BBB+	BBB+	AAA
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
ES0312298104	Única	19-05-2016	SYP	BBB+	BBB-	AAA
ES0312298104	Única	02-11-2015	MDY	A1	A1	Aaa
ES0312298104	Única	28-05-2015	FCH	BBB+	BBB+	AAA
ES0312298096	Única	19-05-2016	SYP	BBB+	BBB-	AAA
ES0312298096	Única	25-01-2016	MDY	Aa2	Aa3	Aaa
ES0312298096	Única	28-05-2015	FCH	A-	A-	AAA
ES0312298088	Única	22-03-2013	SYP	A+	A+	AAA
ES0312298088	Única	27-06-2012	MDY	Baa1	Baa1	Aaa
ES0312298088	Única	25-06-2012	FCH	BBB	BBB	AAA
ES0312298070	Única	19-05-2016	SYP	BBB+	BBB-	AAA
ES0312298070	Única	02-11-2015	MDY	A1	A1	Aaa
ES0312298070	Única	28-05-2015	FCH	BBB-	BBB-	AAA
ES0312298062	Única	19-05-2016	SYP	BBB+	BBB-	AAA
ES0312298062	Única	19-06-2015	MDY	A1	A1	Aaa
ES0312298062	Única	14-08-2014	FCH	A-	A-	AAA
ES0312298054	Única	19-05-2016	SYP	BBB+	BBB-	AAA
ES0312298054	Única	25-01-2016	MDY	Aa3	A1	Aaa
ES0312298054	Única	25-06-2012	FCH	BBB	BBB	AAA
ES0312298047	Única	16-03-2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0312298047	Única	17-12-2009	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0312298047	Única	10-03-2011	FCH	AA	AA	AAA
ES0312298039	Única	19-05-2016	SYP	BBB+	BBB-	AAA
ES0312298039	Única	02-11-2015	MDY	A1	A1	Aaa
ES0312298039	Única	14-08-2014	FCH	A	A	AAA
ES0312298021	Única	19-05-2016	SYP	BBB+	BBB-	AAA
ES0312298021	Única	02-06-2016	MDY	Aa3	A1	Aaa
ES0312298021	Única	28-05-2015	FCH	BBB+	BBB+	AAA
ES0312298013	Única	18-08-2015	SYP	BBB-	BBB-	AAA
ES0312298013	Única	19-06-2015	MDY	A2	A2	Aaa
ES0312298013	Única	14-08-2014	FCH	BBB+	BBB+	AAA
ES0312298005	Única	01-08-2011	SYP	A+	A+	AAA
ES0312298005	Única	27-06-2012	MDY	Baa1	Baa1	Aaa
ES0312298005	Única	25-06-2012	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 cda 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: AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS Denominación del compartimento: Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. Estados agregados: Si Periodo: 3er Trimestre Ejercicio: 2016
--

INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS <i>(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)</i>		Situación actual 30/09/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015
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	0,00	1120	0,00
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				

Información sobre contrapartes de las mejoras crediticias		NIF		Denominación
Contraparte del Fondo de Reserva u otras mejoras 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	0
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:

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

Estados agregados: **SI**

Periodo: **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	
Total Morosos					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	
Total Fallidos					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	
OTROS TRIGGERS (3)	0513	0523	0553		0573

(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:

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

Estados agregados: **SI**

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 A Distribución geográfica de activos titulizados	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 12/12/2005			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)	
Andalucía	0400	26	0426	3.468.333	0452	33	0478	4.341.667	0504	56	0530	7.835.000
Aragón	0401	7	0427	620.000	0453	10	0479	945.000	0505	17	0531	1.615.000
Asturias	0402	5	0428	1.132.407	0454	6	0480	1.178.704	0506	12	0532	2.115.000
Baleares	0403	10	0429	1.355.926	0455	15	0481	1.937.963	0507	31	0533	3.975.000
Canarias	0404	4	0430	433.889	0456	6	0482	714.444	0508	14	0534	1.415.000
Cantabria	0405	3	0431	227.778	0457	4	0483	338.889	0509	13	0535	1.710.000
Castilla-León	0406	30	0432	2.506.185	0458	37	0484	2.898.593	0510	71	0536	6.671.000
Castilla La Mancha	0407	6	0433	765.185	0459	8	0485	822.593	0511	15	0537	2.030.000
Cataluña	0408	21	0434	2.009.556	0460	31	0486	3.316.778	0512	71	0538	8.880.000
Ceuta	0409	0	0435	0	0461	0	0487	0	0513	0	0539	0
Extremadura	0410	4	0436	510.000	0462	5	0488	570.000	0514	8	0540	850.000
Galicia	0411	11	0437	1.679.630	0463	14	0489	2.164.815	0515	25	0541	4.150.000
Madrid	0412	4	0438	800.000	0464	5	0490	900.000	0516	13	0542	2.450.000
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	2	0441	250.000	0467	2	0493	250.000	0519	11	0545	2.315.000
La Rioja	0416	1	0442	50.000	0468	1	0494	50.000	0520	5	0546	187.000
Comunidad Valenciana	0417	0	0443	0	0469	0	0495	0	0521	0	0547	0
País Vasco	0418	15	0444	2.971.111	0470	21	0496	4.245.556	0522	46	0548	9.780.000
Total España	0419	149	0445	18.780.000	0471	198	0497	24.675.002	0523	408	0549	55.978.000
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
Total general	0425	149	0450	18.780.000	0475	198	0501	24.675.002	0527	408	0553	55.978.000

(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:

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

Estados agregados: **Si**

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 B

Divisa/Activos titulizados	Situación actual 30/09/2016						Situación cierre anual anterior 31/12/2015						Situación inicial 12/12/2005					
	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	149	0577	18.780.000	0583	18.780.000	0600	198	0606	24.675.000	0611	24.675.000	0620	408	0626	55.978.000	0631	55.978.000
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
Total	0576	149			0588	18.780.000	0605	198			0616	24.675.000	0625	408			0636	55.978.000

(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:

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

Estados agregados: **SI**

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 C

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (1)	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 12/12/2005			
	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
Total	1108	0	1118	0	1128	0	1138	0	1148	0	1158	0
Media ponderada (%)			1119	0,00			1139	0,00			1159	0,00

(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:

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

Estados agregados: **Si**

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 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	106		13.350.000		0,00		4,16	
EURIBOR 3 MESES	43		5.430.000		0,14		0,02	
Total	1405	149	1415	18.780.000	1425	0,04	1435	2,96

(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:

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

Estados agregados: Si

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 12/12/2005			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior al 1%	1500	43	1521	5.430.000	1542	43	1563	5.430.000	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	16	1608	4.200.000
2,5% - 2,99%	1504	0	1525	0	1546	0	1567	0	1588	40	1609	3.600.000
3% - 3,49%	1505	0	1526	0	1547	0	1568	0	1589	3	1610	450.000
3,5% - 3,99%	1506	23	1527	1.400.000	1548	58	1569	5.000.000	1590	108	1611	11.113.000
4% - 4,49%	1507	63	1528	9.905.000	1549	63	1570	9.905.000	1591	104	1612	15.885.000
4,5% - 4,99%	1508	20	1529	2.045.000	1550	34	1571	4.340.000	1592	92	1613	14.295.000
5% - 5,49%	1509	0	1530	0	1551	0	1572	0	1593	45	1614	6.435.000
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
Total	1520	149	1541	18.780.000	1562	198	1583	24.675.000	1604	408	1625	55.978.000
Tipo de interés medio ponderado de los activos(%)			9542	1,34			9584	2,51			1626	4,06
Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%)			9543	2,80			9585	2,74			1627	3,69

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:

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

Estados agregados: **SI**

Periodo: **3er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

CUADRO F

Concentración	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 12/12/2005			
	Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	2000	51,61			2030	49,50			2060	42,73		
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:
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**
 Estados agregados: **Si**
 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 12/12/2005					
	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	187.800	3060	18.780.000	3110	18.780.000	3170	525.880	3230	52.588.000	3250	52.588.000
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	
Total	3050	187.800			3160	18.780.000	3220	525.880			3300	52.588.000

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:
Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**
Estados agregados: **Si**
Periodo: **3er Trimestre**
Ejercicio: **2016**

NOTAS EXPLICATIVAS

INFORME DE AUDITOR