

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A.
Número de registro del Fondo: 8715
NIF Fondo: V85076677
Denominación del compartimento: bonos de titulización de la Serie Ayt Colaterales Global Hipotecario CCM I
Número de registro del compartimento: 8953
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

S.01

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

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	269.128	1001	281.488
I. Activos financieros a largo plazo	0002	269.128	1002	281.488
1. Activos titulizados	0003	269.128	1003	281.488
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	268.606	1005	281.026
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	3.661	1025	3.188
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-3.138	1027	-2.727
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	

S.01

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

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	65.921	1041	67.697
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	27.985	1043	33.917
1. Activos titulizados	0044	27.985	1044	33.917
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	26.915	1046	32.205
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	19	1065	111
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	11	1066	27
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	7.245	1067	8.308
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	39	1068	46
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-6.244	1069	-6.779
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	10	1082	10
1. Comisiones	0083	10	1083	10
2. Otros	0084		1084	
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	37.925	1085	33.770
1. Tesorería	0086	37.925	1086	33.770
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	335.049	1088	349.185

S.01

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

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	293.209	1089	308.583
I. Provisiones a largo plazo	0090		1090	
1. Provisión garantías financieras	0091		1091	
2. Provisión por margen de intermediación	0092		1092	
3. Otras provisiones	0093		1093	
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	293.209	1094	308.583
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	270.204	1095	283.176
1.1 Series no subordinadas	0096	186.204	1096	199.176
1.2 Series subordinadas	0097	84.000	1097	84.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101	21.493	1101	23.840
2.1 Préstamo subordinado	0102	28.000	1102	28.000
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-6.507	1105	-4.160
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108		1108	
3.1 Derivados de cobertura	0109		1109	
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	1.512	1112	1.567
4.1 Garantías financieras	0113	1.512	1113	1.567
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

S.01

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

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) PASIVO CORRIENTE	0117	41.840	1117	40.602
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	
V. Provisiones a corto plazo	0119		1119	
1. Provisión garantías financieras	0120		1120	
2. Provisión por margen de intermediación	0121		1121	
3. Otras provisiones	0122		1122	
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	41.784	1123	40.565
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	36.915	1124	36.127
1.1 Series no subordinadas	0125	35.302	1125	35.675
1.2 Series subordinadas	0126		1126	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	1.613	1128	451
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	4.829	1131	4.396
2.1 Préstamo subordinado	0132	559	1132	559
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	213	1136	51
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	4.058	1137	3.786
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139		1139	
3.1 Derivados de cobertura	0140		1140	
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	40	1143	42
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	40	1144	42
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	56	1148	37
1. Comisiones	0149	26	1149	7
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	17	1150	7
1.2 Comisión administrador	0151	660	1151	636
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	9	1152	0
1.4 Comisión variable	0153		1153	
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-660	1155	-636
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	31	1157	30
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158		1158	
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160		1160	
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	335.049	1162	349.185

S.02

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

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2020		Acumulado anterior 30/09/2019
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	456	1201	817	2201	1.626	3201	2.694
1.1 Activos titulizados	0202	456	1202	817	2202	1.626	3202	2.694
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203		3203	
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-1.333	1204	-1.411	2204	-4.012	3204	-4.267
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.178	1205	-1.267	2205	-3.578	3205	-3.827
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-155	1206	-144	2206	-434	3206	-441
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	0	1208	0	2208		3208	
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-878	1209	-594	2209	-2.386	3209	-1.574
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216		3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-29	1217	-30	2217	-108	3217	-93
7.1 Servicios exteriores	0218	-3	1218	0	2218	-21	3218	-1
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219	0	2219	-1	3219	0
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	-3	1222	0	2222	-21	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-27	1224	-30	2224	-87	3224	-92
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-12	1225	-14	2225	-42	3225	-42
7.3.2 Comisión administrador	0226	-8	1226	-9	2226	-24	3226	-26
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-6	1227	-6	2227	-21	3227	-19
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228		3228	
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	-2	2230	0	3230	-5
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	105	1231	619	2231	124	3231	2.765
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	105	1232	619	2232	124	3232	2.765
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233		3233	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234	0	2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238		3238	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	802	1239	5	2239	2.371	3239	-1.098
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241		3241	
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

S.03

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

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2020		Acumulado anterior 30/09/2019
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	532	1300	801	2300	-800	3300	-2.414
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	535	1301	801	2301	-680	3301	-2.295
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	535	1302	801	2302	1.737	3302	2.683
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	0	1303	0	2303	-2.417	3303	-2.575
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	3305	0
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	-2.404
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	0	1309	0	2309	-37	3309	-39
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	0	1310	0	2310	-25	3310	-27
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	-12	3312	-12
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-3	1315	0	2315	-83	3315	-79
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	-3	1320	0	2320	-1.595	3320	-1.758
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	1.512	3321	1.679
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	5.323	1322	7.304	2322	4.955	3322	8.132
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	5.323	1325	7.304	2325	4.955	3325	8.132
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	3.676	1326	2.344	2326	11.280	3326	10.347
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.195	1327	4.017	2327	5.269	3327	7.389
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	451	1328	943	2328	1.751	3328	3.112
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	0	1331	0	2331	-13.345	3331	-12.715
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332	0	2332	0	3332	0
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336	0	2336	0	3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	5.854	1337	8.106	2337	4.155	3337	5.718
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	32.071	1338	33.183	2338	33.770	3338	35.571
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	37.925	1339	41.289	2339	37.925	3339	41.289

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

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2020		Acumulado anterior 30/09/2019
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	0	1357	0	2357	0	3357	0
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	0	1358	0	2358	0	3358	0
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	0	1360	0	2360	0	3360	0
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	0	1362	0	2362	0	3362	0
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368		3368	
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369		3369	
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

S.05.1

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

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2020								Situación cierre anual anterior 31/12/2019								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	3,56	0401	0	0421	0	0441	2,70	1381	3,54	1401	0	1421	0	1441	2,68	2381	0	2401	0	2421	0	2441	0
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

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

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	115	0467	25	0474	8	0481		0488	33	0495	11.661	0502	3	0509	11.698
De 1 a 3 meses	0461	30	0468	17	0475	5	0482	-1	0489	21	0496	2.728	0503	1	0510	2.750
De 3 a 6 meses	0462	2	0469	1	0476	0	0483	0	0490	2	0497	126	0504		0511	128
De 6 a 9 meses	0463	3	0470	3	0477	1	0484	2	0491	6	0498	289	0505		0512	295
De 9 a 12 meses	0464	4	0471	22	0478	2	0485	4	0492	29	0499	440	0506		0513	469
Más de 12 meses	0465	93	0472	7.217	0479	36	0486	434	0493	7.687	0500	2.747	0507		0514	10.434
Total	0466	247	0473	7.287	0480	51	0487	439	0494	7.777	0501	17.992	0508	4	1515	25.773

Impagados con garantía real (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total		Valor garantía		Valor Garantía con Tasación > 2 años		% Deuda / v. Tasación	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total													
Hasta 1 mes	0515	115	0522	25	0529	8	0536		0543	33	0550	11.661	0557	3	0564	11.698	0571	20.951	0578	20.951	0584	55,83
De 1 a 3 meses	0516	30	0523	17	0530	5	0537	-1	0544	21	0551	2.728	0558	1	0565	2.750	0572	5.351	0579	5.351	0585	51,40
De 3 a 6 meses	0517	2	0524	1	0531	0	0538	0	0545	2	0552	126	0559		0566	128	0573	223	0580	223	0586	57,15
De 6 a 9 meses	0518	3	0525	3	0532	1	0539	2	0546	6	0553	289	0560		0567	295	0574	456	0581	456	0587	64,64
De 9 a 12 meses	0519	4	0526	22	0533	2	0540	4	0547	29	0554	440	0561		0568	469	0575	865	0582	865	0588	54,19
Más de 12 meses	0520	93	0527	7.217	0534	36	0541	434	0548	7.687	0555	2.747	0562		0569	10.434	0576	15.376	0583	15.376	0589	67,86
Total	0521	247	0528	7.287	0535	51	0542	439	0549	7.777	0556	17.992	0563	4	0570	25.773	0577	43.222			0590	59,63

S.05.1

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

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007	
Inferior a 1 año	0600	235	1600	225	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	214	1601	247	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	401	1602	255	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	621	1603	428	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	802	1604	936	2604	154
Entre 5 y 10 años	0605	12.070	1605	10.979	2605	1.294
Superior a 10 años	0606	292.083	1606	311.658	2606	798.552
Total	0607	306.427	1607	324.727	2607	800.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	18,48	1608	19,08	2608	30,36

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	14,13	1609	13,39	2609	1,45

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie CCM I
Denominación del compartimento: 8953
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86201993 LIBERBANK, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 19/04/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	599	0630	23.835	1620	536	1630	21.737	2620	1	2630	181
40% - 60%	0621	2.218	0631	205.237	1621	2.179	1631	204.136	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	623	0632	75.893	1622	788	1632	97.177	2622	2.932	2632	417.145
80% - 100%	0623	10	0633	1.462	1623	12	1633	1.677	2623	2.489	2633	382.674
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624	0	2634	0
120% - 140%	0625		0635		1625		1635		2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627	0	2637	0
Total	0628	3.450	0638	306.427	1628	3.515	1638	324.727	2628	5.422	2638	800.000
Media ponderada (%)	0639	54,23	0649		1639	56,07	1649		2639	83,49	2649	

S.05.1

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

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,73	1650	0,81	2650	4,96
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,75	1651	6,75	2651	8,37
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,01	1652	0,01	2652	2,25

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie CCM I
Denominación del compartimento: 8953
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86201993 LIBERBANK, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 19/04/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	64	0683	6.569	1660	65	1683	6.834	2660	124	2683	20.037
Aragón	0661	4	0684	257	1661	4	1684	274	2661	7	2684	1.469
Asturias	0662		0685		1662		1685		2662	0	2685	0
Baleares	0663	1	0686	114	1663	1	1686	118	2663	1	2686	165
Canarias	0664		0687		1664		1687		2664	0	2687	0
Cantabria	0665		0688		1665		1688		2665	0	2688	0
Castilla-León	0666	24	0689	2.136	1666	24	1689	2.239	2666	37	2689	6.001
Castilla La Mancha	0667	2.485	0690	207.521	1667	2.528	1690	219.408	2667	3.692	2690	511.193
Cataluña	0668	26	0691	3.007	1668	26	1691	3.128	2668	35	2691	6.761
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	0
Extremadura	0670	4	0693	272	1670	4	1693	286	2670	5	2693	605
Galicia	0671		0694		1671		1694		2671	0	2694	0
Madrid	0672	477	0695	54.265	1672	491	1695	58.091	2672	798	2695	149.667
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	86	0697	7.814	1674	86	1697	8.151	2674	182	2697	25.809
Navarra	0675		0698		1675		1698		2675	0	2698	0
La Rioja	0676		0699		1676		1699		2676	0	2699	0
Comunidad Valenciana	0677	277	0700	24.244	1677	284	1700	25.960	2677	536	2700	77.422
País Vasco	0678	1	0701	41	1678	1	1701	46	2678	1	2701	158
Total España	0679	3.449	0702	306.240	1679	3.514	1702	324.534	2679	5.418	2702	799.287
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681	1	0704	186	1681	1	1704	193	2681	4	2704	713
Total general	0682	3.450	0705	306.427	1682	3.515	1705	324.727	2682	5.422	2705	800.000

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie CCM I
Denominación del compartimento: 8953
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86201993 LIBERBANK, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 19/04/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1			1710	0,98			2710	0,75		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie CCM I
Denominación del compartimento: 8953
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2020
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2020			Situación cierre anual anterior 31/12/2019			Situación inicial 19/04/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0312273248	A	7.160	30.937	221.506	7.160	32.800	234.851	7.160	100.000	716.000			
ES0312273255	B	456	100.000	45.600	456	100.000	45.600	456	100.000	45.600			
ES0312273263	C	280	100.000	28.000	280	100.000	28.000	280	100.000	28.000			
ES0312273271	D	104	100.000	10.400	104	100.000	10.400	104	100.000	10.400			
Total		0723	8.000	0724	305.506	1723	8.000	1724	318.851	2723	8.000	2724	800.000

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie CCM I
Denominación del compartimento: 8953
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2020
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas	
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados		Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		0738	0739
						0730	0731			0732	0733	0734	0735		
ES0312273248	A	NS	FIJO	0	1,30	994	0	SI	221.506	0	222.500				
ES0312273255	B	S	FIJO	0	1,60	252	0	SI	45.600	0	45.852				
ES0312273263	C	S	FIJO	0	2,50	242	0	SI	28.000	0	28.242				
ES0312273271	D	S	FIJO	0	3,50	126	0	SI	10.400	0	10.526				
Total						0740	1.613	0741	0743	305.506	0744	0745	307.119	0746	

	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	1,53	0748	1,52	0749	5,15

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie CCM I
Denominación del compartimento: 8953
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2020
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2020				Situación periodo comparativo anterior 30/09/2019							
Serie	Denominación serie	Amortización principal		Intereses		Amortización principal		Intereses					
		Pagos del periodo	Pagos acumulados	Pagos del periodo	Pagos acumulados	Pagos del periodo	Pagos acumulados	Pagos del periodo	Pagos acumulados				
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753				
ES0312273263	C		0		10.363		0		9.661				
ES0312273271	D		0		5.148		0		4.783				
ES0312273248	A		494.494		111.871		467.245		108.718				
ES0312273255	B		0		11.750		0		11.019				
Total		0754	0755	494.494	0756	0757	139.132	1754	1755	467.245	1756	1757	134.181

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie CCM I
Denominación del compartimento: 8953
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2020
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 19/04/2007
				0762	0763	0764
ES0312273248	A	25/09/2019	FCH	AA+	AA+	AAA
ES0312273248	A	25/07/2018	SYP	AAA	AAA	AA
ES0312273255	B	22/02/2017	FCH	B	B	A
ES0312273263	C	17/04/2012	FCH	CCC	CCC	BBB-
ES0312273271	D	17/04/2012	FCH	CC	CC	BB

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie CCM I
Denominación del compartimento: 8953
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2020
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente				
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007
Inferior a 1 año	0765	0	1765	0	2765
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769
Entre 5 y 10 años	0770	305.506	1770	318.851	2770
Superior a 10 años	0771		1771		2771
Total	0772	305.506	1772	318.851	2772
Vida residual media ponderada (años)	0773	0	1773	0	2773
					800.000
					800.000
					18,91

S.05.3

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

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo		Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007	
1	Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	26.999	1775	27.995	2775	28.000
1.1	Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	28.000	1776	28.000	2776	28.000
1.2	Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	8,84	1777	8,78	2777	3
1.3	Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	
1.4	Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	
1.5	Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	
2	Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	
2.1	Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	
2.2	Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783	Notas Explicativas	2783	
2.3	Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	
2.4	Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3	Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	
3.1	Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	
3.2	Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3	Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4	Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	
4	Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1	Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	72,50	1792	73,66	2792	89,50
5	Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1	Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2	Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3	Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

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

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

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

S.05.3

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

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007		Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

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

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación actual 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Última Fecha Pago							
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	7.723	7006	8.672	7009	5,15	7012	4,41	7015	5,26		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	7.723	7008	8.672	7011	5,15	7014	4,41	7017	7.722.873	7018	FOLLETO INFORMA TIVO. GLOSARIO DE DEFINICIO NES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	7.633	7024	8.412	7027	4,18	7030	3,40	7033	3,73		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	7.633	7026	8.412	7029	4,18	7032	3,40	7035	3,73	7036	FOLLETO INFORMA TIVO. GLOSARIO DE DEFINICIO NES

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

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

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
si el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) es superior al % establecido para cada ISIN	0,75	0,64	1,16	NOTA DE VALORES 4.9.2.B (IV)
si el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) es superior al % establecido para cada ISIN	1	0,64	1,16	NOTA DE VALORES 4.9.2.B (IV)
si el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) es superior al % establecido para cada ISIN	1,25	0,64	1,16	NOTA DE VALORES 4.9.2.B (IV)
La causa de Diferimiento de intereses del tramo B se producirá cuando el porcentaje que el saldo vivo acumulado de los Activos Fallidos representa respecto del Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de cesión supere el 10%.	10	11,98	11,98	4.9.2. Folleto Informativo VII. Condiciones Finales. Orden de Prelación de pagos
La causa de Diferimiento de intereses del tramo D se producirá cuando el porcentaje que el saldo vivo acumulado de los Activos Fallidos representa respecto del Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de cesión supere el 5%.	5	11,98	11,98	4.9.2. Folleto Informativo VII. Condiciones Finales. Orden de Prelación de pagos
La causa de Diferimiento de intereses del tramo C se producirá cuando el porcentaje que el saldo vivo acumulado de los Activos Fallidos representa respecto del Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de cesión supere el 7%.	7	11,98	11,98	4.9.2. Folleto Informativo VII. Condiciones Finales. Orden de Prelación de pagos
SUPUESTOS DE AMORTIZACIÓN SECUENCIAL:(ii) SUPUESTO DETERIORO DE LOS ACTIVOS: a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos no Fallidos en la fecha de Determinación correspondiente a la Fecha de Pago en curso sea inferior al porcentaje establecido del Saldo Vivo	10	37,36	38,19	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Saldo Vivo de los Activos Fallidos acumulados represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo	7	11,98	11,98	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6. Y CONDICIONES FINALES
Saldo Vivo de los Activos Fallidos acumulados represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo	5	11,98	11,98	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6. Y CONDICIONES FINALES
Saldo Vivo de los Activos Fallidos acumulados represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo	10	11,98	11,98	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6. Y CONDICIONES FINALES
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie CCM I

a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera superior al porcentaje recogido del Saldo Vivo de los Activos que no tengan la consideración de Activos Fallidos (PORCENTA	1	0,64	1,16	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.1 y CONDICIONES FNALES
b) Cuando el saldo acumulado de los Activos Fallidos sea superior al porcentaje recogido del Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Cesión (PORCENTAJE DE ACTIVOS FALLIDOS)	3,20	11,98	11,98	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.1 y CONDICIONES FNALES
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie CCM I
Denominación del compartimento: 8953
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	1862	3	2862	Días del mes /Días año	3862	0,020	4862	0	5862	0	6862	Semestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	Caja Castilla La Mancha	1863	0	2863	Días del mes /Base 365	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Semestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BANCO SANTANDER, S.A.	1864	25	2864	Días del mes /Base 365	3864	0	4864	0	5864	0	6864	Semestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie CCM I
Denominación del compartimento: 8953
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)	Fecha cálculo	Total											
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872												
Margen de intereses	0873												
Deterioro de activos financieros (neto)	0874												
Dotaciones a provisiones (neto)	0875												
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876												
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877												
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878												
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879												
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880												
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881												
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882												
Comisión variable pagada	0883												
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884												

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie CCM I
Denominación del compartimento: 8953
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885	28/05/2020											
Saldo inicial	0886	27.995											
Cobros del periodo	0887	14.810											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-44											
Pagos por derivados	0889	0											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-26.999											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-15.762											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0											
Resto pagos/retenciones	0893	0											
Saldo disponible	0894	0											
Liquidación de comisión variable	0895	0											

S.06

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

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

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