

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: HT ABANCA RMBS I, FONDO DE TITULIZACION
Número de registro del Fondo: 10661
NIF Fondo: V87477246
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020

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)

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	662.120	1001	689.069
I. Activos financieros a largo plazo	0002	662.120	1002	689.069
1. Activos titulizados	0003	662.120	1003	689.069
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	661.403	1004	688.763
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005		1005	
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	
1.18 Bonos de titulización	0021		1021	
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	1.055	1025	649
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-338	1027	-343
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	87.819	1041	95.317
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	39.051	1043	42.650
1. Activos titulizados	0044	39.051	1044	42.650
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	38.734	1045	42.295
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046		1046	
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	
1.18 Bonos de titulización	0062		1062	
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	9	1065	22
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	266	1066	321
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	58	1067	26
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	2	1068	2
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-19	1069	-14
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	
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	
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, pignoralos o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082		1082	
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084		1084	
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	48.767	1085	52.666
1. Tesorería	0086	48.767	1086	52.666
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	749.938	1088	784.386

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	704.871	1089	731.836
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	704.871	1094	731.836
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	502.290	1095	529.228
1.1 Series no subordinadas	0096	502.290	1096	529.228
1.2 Series subordinadas	0097		1097	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101	202.581	1101	202.608
2.1 Préstamo subordinado	0102	202.581	1102	202.608
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105		1105	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108		1108	
3.1 Derivados de cobertura	0109		1109	
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	
4.1 Garantías financieras	0113		1113	
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) PASIVO CORRIENTE	0117	45.067	1117	52.550
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	44.450	1123	51.902
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	44.339	1124	51.723
1.1 Series no subordinadas	0125	44.339	1125	51.723
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	0	1128	
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	110	1131	178
2.1 Préstamo subordinado	0132	27	1132	81
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	83	1136	97
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137		1137	
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139		1139	
3.1 Derivados de cobertura	0140		1140	
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	1	1143	1
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	1	1144	1
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	617	1148	648
1. Comisiones	0149	613	1149	612
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	26	1150	22
1.2 Comisión administrador	0151	14	1151	15
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	3	1152	2
1.4 Comisión variable	0153	570	1153	574
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155		1155	
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	4	1157	36
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	749.938	1162	784.386

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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	795	1201	695	2201	2.534	3201	3.066
1.1 Activos titulizados	0202	795	1202	695	2202	2.534	3202	3.066
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203		3203	
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-150	1204	-152	2204	-565	3204	-498
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-22	1205	0	2205	-107	3205	
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-128	1206	-152	2206	-458	3206	-498
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	645	1209	543	2209	1.969	3209	2.568
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216		3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-645	1217	-544	2217	-1.969	3217	-2.482
7.1 Servicios exteriores	0218	-3	1218	0	2218	-11	3218	-2
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	0	2219	-2	3219	-2
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	-3	1222	0	2222	-8	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-641	1224	-543	2224	-1.958	3224	-2.479
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-32	1225	-28	2225	-86	3225	-85
7.3.2 Comisión administrador	0226	-18	1226	-19	2226	-54	3226	-57
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-3	1227	-3	2227	-8	3227	-8
7.3.4 Comisión variable	0228	-589	1228	-494	2228	-1.810	3228	-2.329
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	0	1231	0	2231	0	3231	-86
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	0	2232	0	3232	-86
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233		3233	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234	0	2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238		3238	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	0	1239	0	2239		3239	
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241		3241	
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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	21	1300	149	2300	23	3300	-59
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	474	1301	880	2301	2.023	3301	2.230
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	799	1302	1.047	2302	2.600	3302	2.749
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-107	1303	0	2303	-107	3303	0
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	3305	0
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	-218	1307	-167	2307	-471	3307	-520
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-450	1309	-709	2309	-1.957	3309	-2.230
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-27	1310	-27	2310	-81	3310	-86
2.2 Comisión administrador	0311	-18	1311	-18	2311	-55	3311	-58
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-3	1312	-3	2312	-8	3312	-8
2.4 Comisión variable	0313	-402	1313	-662	2313	-1.814	3313	-2.078
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	-22	2315	-42	3315	-60
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	-22	2320	-42	3320	-60
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	429	1322	-734	2322	-3.922	3322	-6.712
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	456	1325	-707	2325	-3.839	3325	-6.631
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	0	1326	0	2326	0	3326	0
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	3.773	1327	4.305	2327	11.052	3327	15.139
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	6.439	1328	6.535	2328	19.432	3328	17.542
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	-9.756	1331	-11.546	2331	-34.322	3331	-39.313
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-27	1332	-27	2332	-83	3332	-81
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	-27	1334	-27	2334	-83	3334	-81
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	449	1337	-585	2337	-3.899	3337	-6.771
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	48.318	1338	49.905	2338	52.666	3338	56.091
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	48.767	1339	49.320	2339	48.767	3339	49.320

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, 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		0401		0421		0441		1381		1401		1421		1441		2381		2401		2421		2441	
Préstamos hipotecarios	0382	0,16	0402	0	0422	0	0442	2,60	1382	0,09	1402	0	1422	0	1442	3,02	2382	7,52	2402	1,57	2422	0,55	2442	0
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
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: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	6.500	0467	2.129	0474	266	0481		0488	2.395	0495	694.280	0502	9	0509	696.683
De 1 a 3 meses	0461	5	0468	2	0475	0	0482		0489	2	0496	427	0503	0	0510	429
De 3 a 6 meses	0462	3	0469	6	0476	0	0483	0	0490	7	0497	269	0504		0511	276
De 6 a 9 meses	0463		0470		0477		0484		0491		0498		0505		0512	
De 9 a 12 meses	0464	2	0471	13	0478	0	0485	1	0492	15	0499	150	0506		0513	165
Más de 12 meses	0465	7	0472	39	0479	2	0486	14	0493	55	0500	636	0507		0514	691
Total	0466	6.517	0473	2.189	0480	269	0487	16	0494	2.474	0501	695.761	0508	9	1515	698.244

Impagados con garantía real (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total		Valor garantía		Valor Garantía con Tasación > 2 años		% Deuda / v. Tasación	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total													
Hasta 1 mes	0515	6.500	0522	2.129	0529	266	0536		0543	2.395	0550	694.280	0557	9	0564	696.683	0571	1.559.577	0578	1.559.577	0584	44,67
De 1 a 3 meses	0516	5	0523	2	0530	0	0537		0544	2	0551	427	0558	0	0565	429	0572	1.222	0579	1.222	0585	35,10
De 3 a 6 meses	0517	3	0524	6	0531	0	0538	0	0545	7	0552	269	0559		0566	276	0573	761	0580	761	0586	36,27
De 6 a 9 meses	0518		0525		0532		0539		0546		0553		0560		0567		0574		0581		0587	
De 9 a 12 meses	0519	2	0526	13	0533	0	0540	1	0547	15	0554	150	0561		0568	165	0575	541	0582	541	0588	30,54
Más de 12 meses	0520	7	0527	39	0534	2	0541	14	0548	55	0555	636	0562		0569	691	0576	1.427	0583	1.427	0589	48,41
Total	0521	6.517	0528	2.189	0535	269	0542	16	0549	2.474	0556	695.761	0563	9	0570	698.244	0577	1.563.527			0590	44,66

S.05.1

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/05/2016	
Inferior a 1 año	0600	156	1600	205	2600	2
Entre 1 y 2 años	0601	502	1601	379	2601	38
Entre 2 y 3 años	0602	1.086	1602	720	2602	79
Entre 3 y 4 años	0603	1.564	1603	1.759	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	1.853	1604	2.037	2604	1.958
Entre 5 y 10 años	0605	25.010	1605	23.695	2605	15.252
Superior a 10 años	0606	671.079	1606	702.938	2606	882.671
Total	0607	701.250	1607	731.734	2607	900.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	21,33	1608	21,98	2608	25,36

Antigüedad	Situación actual 30/09/2020						Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/05/2016	
	Antigüedad media ponderada (años)	0609	10,82	1609	10,07	2609	6,44			

S.05.1
Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 19/05/2016			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	2.119	0630	143.589	1620	2.050	1630	139.753	2620	1.421	2630	108.399
40% - 60%	0621	2.622	0631	315.362	1621	2.548	1631	309.431	2621	2.282	2631	294.173
60% - 80%	0622	1.745	0632	233.396	1622	1.992	1632	270.476	2622	3.229	2632	470.878
80% - 100%	0623	64	0633	8.903	1623	84	1633	12.074	2623	165	2633	26.550
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624		2634	
120% - 140%	0625		0635		1625		1635		2625		2635	
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626		2636	
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627		2637	
Total	0628	6.550	0638	701.250	1628	6.674	1638	731.734	2628	7.097	2638	900.000
Media ponderada (%)	0639	51,84	0649		1639	52,94	1649		2639	58,66	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/05/2016	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,49	1650	0,49	2650	0,24
Tipo de interés nominal máximo	0651	2,88	1651	3,04	2651	3,36
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,01	1652	0,01	2652	0,81

S.05.1
Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 19/05/2016			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	531	0683	62.146	1660	537	1683	64.782	2660	562	2683	77.707
Aragón	0661	15	0684	1.486	1661	15	1684	1.545	2661	16	2684	1.941
Asturias	0662	53	0685	5.835	1662	53	1685	6.041	2662	57	2685	7.693
Baleares	0663	137	0686	20.214	1663	139	1686	21.029	2663	149	2686	24.685
Canarias	0664	52	0687	5.156	1664	52	1687	5.284	2664	57	2687	6.300
Cantabria	0665	58	0688	6.207	1665	58	1688	6.395	2665	60	2688	7.564
Castilla-León	0666	209	0689	22.003	1666	212	1689	22.861	2666	230	2689	28.637
Castilla La Mancha	0667	61	0690	7.425	1667	61	1690	7.678	2667	64	2690	9.174
Cataluña	0668	821	0691	124.269	1668	842	1691	130.168	2668	901	2691	160.124
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	
Extremadura	0670	25	0693	2.304	1670	25	1693	2.377	2670	25	2693	2.754
Galicia	0671	3.530	0694	303.860	1671	3.607	1694	317.087	2671	3.829	2694	392.378
Madrid	0672	339	0695	54.189	1672	348	1695	57.211	2672	374	2695	71.841
Melilla	0673	1	0696	76	1673	1	1696	79	2673	1	2696	106
Murcia	0674	49	0697	5.331	1674	49	1697	5.453	2674	54	2697	6.532
Navarra	0675	15	0698	1.675	1675	15	1698	1.720	2675	18	2698	2.363
La Rioja	0676	3	0699	353	1676	3	1699	362	2676	4	2699	720
Comunidad Valenciana	0677	504	0700	58.171	1677	510	1700	60.428	2677	530	2700	71.464
País Vasco	0678	147	0701	20.551	1678	147	1701	21.235	2678	166	2701	28.017
Total España	0679	6.550	0702	701.250	1679	6.674	1702	731.734	2679	7.097	2702	900.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680		2703	
Resto	0681		0704		1681		1704		2681		2704	
Total general	0682	6.550	0705	701.250	1682	6.674	1705	731.734	2682	7.097	2705	900.000

S.05.1
Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, 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 19/05/2016			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,84			1710	0,83			2710	0,75		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	

S.05.2

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2020

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 19/05/2016		
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722
ES0305136006	UNICO	7.380	74.069	546.629	7.380	78.720	580.951	7.380	100.000	738.000
Total		0723 7.380		0724 546.629	1723 7.380		1724 580.951	2723 7.380		2724 738.000

S.05.2

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2020

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							
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738		0739				
ES0305136006	UNICO	NS	EURIBOR 3 MESES	0,30	0	0	0	SI	546.629	0	546.629						
Total						0740	0	0741	0	0743	546.629	0744	0	0745	546.629	0746	

	Situación actual 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 19/05/2016
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0	0748
			0749

S.05.2

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2020

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								
ES0305136006	UNICO	9.756	191.371	107	234	11.546	146.173	0	127								
Total		0754	9.756	0755	191.371	0756	107	0757	234	1754	11.546	1755	146.173	1756		1757	127

S.05.2

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2020

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 19/05/2016
				0762	0763	0764
ES0305136006	UNICO	24/05/2016	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305136006	UNICO	24/05/2016	SYP	AA	AA	AA

S.05.2

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2020

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 19/05/2016
Inferior a 1 año	0765		1765	580.951	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	0	1770		2770
Superior a 10 años	0771	546.629	1771		2771
Total	0772	546.629	1772	580.951	2772
Vida residual media ponderada (años)	0773	9,58	1773	0	2773
					738.000
					738.000
					8,37

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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 19/05/2016	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	40.500	1775	40.500	2775	40.500
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	40.500	1776	40.500	2776	40.500
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	7,41	1777	6,97	2777	5
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783	Notas Explicativas	2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	100	1792	100	2792	100
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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 19/05/2016	
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Total						0808	0809	0810	

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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 19/05/2016		Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/05/2016			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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	3	7002	0	7003	77	7006	37	7009	0,16	7012	0,09	7015	0,13		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	77	7008	37	7011	0,16	7014	0,09	7017	76.905	7018	FOLLETO INFORMA TIVO.MOD ULO ADICIONA L.3.3.4
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	44	7024	33	7027	0,05	7030	0,05	7033	0,05		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	44	7026	33	7029	0,05	7032	0,05	7035	0,05	7036	FOLLETO INFORMA TIVO.NOT A DE VALORES. APARTAD O 4.1.10

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

S.05.4

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
a) Que el importe a que ascienda la suma del Saldo Vivo de los Activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos y que no tengan la consideración de Activos Fallidos (los ?Activos Morosos?), fuera superior al	1,15	0,11	0,08	3. ESTRUCTURA Y TESORERIA (3.4.2) pag.121 Folleto
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

S.05.5

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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	18	2862	Días del mes /Días año	3862	0,010	4862	0	5862	0	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.	1863	0	2863	Días del mes /Días año	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Trimestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BANCO SANTANDER, S.A.	1864	3	2864		3864	0	4864	0	5864	0	6864	Trimestral	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo											Total		
		31/03/2020	30/06/2020	30/09/2020											
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872														
Margen de intereses	0873	797	528	645											1.969
Deterioro de activos financieros (neto)	0874														0
Dotaciones a provisiones (neto)	0875														0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876														0
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-54	-50	-55											-159
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	743	478	589	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1.810
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879														0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880														0
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881	-743	-478	-589											-1.810
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Comisión variable pagada	0883	710	702	402											1.814
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884														

S.05.5

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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												
Saldo inicial	0886												
Cobros del periodo	0887												
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888												
Pagos por derivados	0889												
Retención importe Fondo de Reserva	0890												
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891												
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892												
Resto pagos/retenciones	0893												
Saldo disponible	0894												
Liquidación de comisión variable	0895												

S.06

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS I, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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