

# ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.00

## I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: **AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Número de registro del Fondo: **8950**

NIF Fondo: **V85306850**

Denominación del compartimento: **AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Número de registro del compartimento: **9318**

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

NIF gestora: **A80732142**

Estados agregados: **No**

Periodo: **3er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

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

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

<b>ACTIVO</b>				
---------------	--	--	--	--

<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0008	0	1008	18.529
-------------------------------	------	---	------	--------

<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0010	0	1010	18.529
---	------	---	------	--------

1. Valores representativos de deuda	0100	0	1100	0
1.1 Bancos centrales	0101	0	1101	0
1.2 Administraciones Públicas españolas	0102	0	1102	0
1.3 Entidades de crédito	0103	0	1103	0
1.4 Otros sectores residentes	0104	0	1104	0
1.5 Administraciones Públicas no residentes	0105	0	1105	0
1.6 Otros sectores no residentes	0106	0	1106	0
1.7 Activos dudosos	0107	0	1107	0
1.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0108		1108	
1.9 Intereses y gastos devengados no vencidos	0109	0	1109	0
1.10 Ajustes por operaciones de cobertura	0110	0	1110	0
2. Derechos de crédito	0200	0	1200	18.529
2.1 Participaciones hipotecarias	0201	0	1201	0
2.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0202	0	1202	0
2.3 Préstamos hipotecarios	0203	0	1203	0
2.4 Cédulas Hipotecarias	0204	0	1204	0
2.5 Préstamos a promotores	0205	0	1205	0
2.6 Préstamos a PYMES	0206	0	1206	0
2.7 Préstamos a empresas	0207	0	1207	17.925
2.8 Préstamos Corporativos	0208	0	1208	0
2.9 Cédulas territoriales	0209	0	1209	0
2.10 Bonos de Tesorería	0210	0	1210	0
2.11 Deuda Subordinada	0211	0	1211	0
2.12 Créditos AAPP	0212	0	1212	0
2.13 Préstamos Consumo	0213	0	1213	0
2.14 Préstamos automoción	0214	0	1214	0
2.15 Cuotas de Arrendamiento financiero (leasing)	0215	0	1215	0
2.16 Cuentas a cobrar	0216	0	1216	0
2.17 Derechos de crédito futuros	0217	0	1217	0
2.18 Bonos de titulización	0218	0	1218	0
2.19 Otros	0219	0	1219	0
2.20 Activos dudosos	0220	0	1220	3.471
2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0221		1221	-2.867
2.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0222	0	1222	0
2.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0223	0	1223	0
3. Derivados	0230	0	1230	0
3.1 Derivados de cobertura	0231	0	1231	0
3.2 Derivados de negociación	0232	0	1232	0
4. Otros activos financieros	0240	0	1240	0
4.1 Garantías financieras	0241	0	1241	0
4.2 Otros	0242	0	1242	0

<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0250	0	1250	0
--	------	---	------	---

<b>III. Otros activos no corrientes</b>	0260	0	1260	0
---	------	---	------	---

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

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

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/09/2016		Periodo Anterior 31/12/2015
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0270	37.939	1270	29.043
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0280	0	1280	0
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0290	21.148	1290	9.745
1. Deudores y otras cuentas a cobrar	0300	0	1300	0
2. Valores representativos de deuda	0310	0	1310	0
2.1 Bancos centrales	0311	0	1311	0
2.2 Administraciones Públicas españolas	0312	0	1312	0
2.3 Entidades de crédito	0313	0	1313	0
2.4 Otros sectores residentes	0314	0	1314	0
2.5 Administraciones Públicas no residentes	0315	0	1315	0
2.6 Otros sectores no residentes	0316	0	1316	0
2.7 Activos dudosos	0317	0	1317	0
2.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0318		1318	
2.9 Intereses y gastos devengados no vencidos	0319	0	1319	0
2.10 Ajustes por operaciones de cobertura	0320	0	1320	0
2.11 Intereses vencidos e impagados	0330	0	1330	0
3. Derechos de crédito	0400	21.148	1400	9.745
3.1 Participaciones hipotecarias	0401	0	1401	0
3.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0402	0	1402	0
3.3 Préstamos hipotecarios	0403	0	1403	0
3.4 Cédulas Hipotecarias	0404	0	1404	0
3.5 Préstamos a promotores	0405	0	1405	0
3.6 Préstamos a PYMES	0406	0	1406	0
3.7 Préstamos a empresas	0407	20.879	1407	9.559
3.8 Préstamos Corporativos	0408	0	1408	0
3.9 Cédulas territoriales	0409	0	1409	0
3.10 Bonos de Tesorería	0410	0	1410	0
3.11 Deuda Subordinada	0411	0	1411	0
3.12 Créditos AAPP	0412	0	1412	0
3.13 Préstamos Consumo	0413	0	1413	0
3.14 Préstamos automoción	0414	0	1414	0
3.15 Arrendamiento financiero	0415	0	1415	0
3.16 Cuentas a cobrar	0416	0	1416	0
3.17 Derechos de crédito futuros	0417	0	1417	0
3.18 Bonos de titulización	0418	0	1418	0
3.19 Otros	0419	0	1419	0
3.20 Activos dudosos	0420	3.285	1420	683
3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0421	-3.061	1421	-565
3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0422	36	1422	45
3.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0423	0	1423	0
3.24 Intereses vencidos e impagados	0424	9	1424	23
4. Derivados	0430	0	1430	0
4.1 Derivados de cobertura	0431	0	1431	0
4.2 Derivados de negociación	0432	0	1432	0
5. Otros activos financieros	0440	0	1440	0
5.1 Garantías financieras	0441	0	1441	0
5.2 Otros	0442	0	1442	0
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0450	0	1450	0
1. Comisiones	0451	0	1451	0
2. Otros	0452	0	1452	0
<b>VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes</b>	0460	16.791	1460	19.298
1. Tesorería	0461	16.791	1461	19.298
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462	0	1462	0

TOTAL ACTIVO	0500	37.939	1500	47.572
--------------	------	--------	------	--------

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

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

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/09/2016		Periodo Anterior 31/12/2015
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0650	0	1650	31.536
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0660	0	1660	0
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0700	0	1700	31.536
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	0	1710	18.732
1.1 Series no subordinadas	0711	0	1711	0
1.2 Series subordinadas	0712	0	1712	18.732
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0713		1713	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0714	0	1714	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0715	0	1715	0
2. Deudas con entidades de crédito	0720	0	1720	12.247
2.1 Préstamo subordinado	0721	0	1721	17.850
2.2 Crédito línea de liquidez	0722	0	1722	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0723	0	1723	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0724		1724	-5.603
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0725	0	1725	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0726	0	1726	0
3. Derivados	0730	0	1730	557
3.1 Derivados de cobertura	0731	0	1731	557
3.2 Derivados de negociación	0732	0	1732	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0733		1733	
4. Otros pasivos financieros	0740	0	1740	0
4.1 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0741		1741	
4.2 Otros	0742	0	1742	0
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	0750	0	1750	0
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0760	38.348	1760	16.593
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0770	0	1770	0
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	0780	0	1780	0
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	0800	38.348	1800	16.586
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	1	1810	148
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	21.661	1820	12.462
2.1 Series no subordinadas	0821	656	1821	10.066
2.2 Series subordinadas	0822	21.000	1822	2.268
2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0823		1823	
2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0824	5	1824	128
2.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0825	0	1825	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0826	0	1826	0
3. Deudas con entidades de crédito	0830	16.202	1830	3.699
3.1 Préstamo subordinado	0831	18.132	1831	282
3.2 Crédito línea de liquidez	0832	0	1832	0
3.3 Otras deudas con entidades de crédito	0833	0	1833	0
3.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0834	-5.659	1834	
3.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0835	5	1835	119
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836	0	1836	0
3.7 Intereses vencidos e impagados	0837	3.724	1837	3.298
4. Derivados	0840	484	1840	277
4.1 Derivados de cobertura	0841	484	1841	277
4.2 Derivados de negociación	0842	0	1842	0
4.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0843		1843	
5. Otros pasivos financieros	0850	0	1850	0
5.1 Importe bruto	0851	0	1851	0
5.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0852		1852	

<b>VII. Ajustes por periodificación</b>	0900	0	1900	7
1. Comisiones	0910	0	1910	3
1.1 Comisión sociedad gestora	0911	0	1911	3
1.2 Comisión administrador	0912	68	1912	66
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0913	0	1913	0
1.4 Comisión variable - resultados realizados	0914	138	1914	138
1.5 Comisión variable - resultados no realizados	0915	0	1915	0
1.6 Otras comisiones del cedente	0916	0	1916	0
1.7 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0917	-206	1917	-204
1.8 Otras comisiones	0918	0	1918	0
2. Otros	0920	0	1920	4
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0930	-409	1930	-557
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0940	0	1940	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0950	-409	1950	-557
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0960	0	1960	0
<b>XI. Gastos de constitución en transición</b>	0970		1970	
<b>TOTAL PASIVO</b>	1000	37.939	2000	47.572

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.02

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

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. Corriente Actual 3er trimestre		P. Corriente Anterior 3er trimestre		Acumulado Actual 30/09/2016		Acumulado Anterior 31/12/2015
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0100		1100	0	2100	845	3100	
1.1 Valores representativos de deuda	0110		1110	0	2110	0	3110	
1.2 Derechos de crédito	0120		1120	0	2120	845	3120	
1.3 Otros activos financieros	0130		1130	0	2130	0	3130	
<b>2. Intereses y cargas asimiladas</b>	0200		1200		2200	-628	3200	
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210		1210		2210	-316	3210	
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220		1220		2220	-312	3220	
2.3 Otros pasivos financieros	0230		1230		2230		3230	
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0240		1240	0	2240	-619	3240	
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0250		1250	0	2250	-402	3250	
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	0300		1300	0	2300	0	3300	
4.1 Ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0310		1310	0	2310	0	3310	
4.2 Activos financieros disponibles para la venta	0320		1320	0	2320	0	3320	
4.3 Otros	0330		1330	0	2330	0	3330	
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0400		1400	0	2400	0	3400	
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0500		1500	0	2500	0	3500	
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0600		1600		2600	-27	3600	
7.1 Servicios exteriores	0610		1610		2610		3610	
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611		1611		2611		3611	
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0612		1612		2612		3612	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0613		1613		2613		3613	
7.1.4 Otros servicios	0614		1614		2614		3614	
7.2 Tributos	0620		1620		2620	-2	3620	
7.3 Otros gastos de gestión corrientes	0630		1630		2630	-25	3630	
7.3.1 Comisión de sociedad gestora	0631		1631		2631	-8	3631	
7.3.2 Comisión administrador	0632		1632		2632	-2	3632	
7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos	0633		1633		2633		3633	
7.3.4 Comisión variable - resultados realizados (neto)	0634		1634		2634		3634	
7.3.5 Comisión variables - resultados no realizados (neto)	0635		1635		2635		3635	
7.3.6 Otras comisiones del cedente	0636		1636		2636		3636	
7.3.7 Otros gastos	0637		1637		2637	-15	3637	
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0700		1700	0	2700	370	3700	
8.1 Deterioro neto de valores representativos de deuda	0710		1710	0	2710	0	3710	
8.2 Deterioro neto de derechos de crédito	0720		1720	0	2720	370	3720	
8.3 Deterioro neto de derivados	0730		1730	0	2730	0	3730	
8.4 Deterioro neto de otros activos financieros	0740		1740	0	2740	0	3740	
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	0750		1750	0	2750	0	3750	
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0800		1800	0	2800	0	3800	
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0850		1850	0	2850	59	3850	
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0900		1900	0	2900	0	3900	
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0950		1950	0	2950	0	3950	
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	3000		4000	0	5000	0	6000	

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.03

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

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		Periodo Actual		Mismo Periodo año Anterior	
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN</b>	8000	-556	9000		0
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	8100	-525	9100		0
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	735	9110		0
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-439	9120		0
1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados	8130	-821	9130		0
1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras	8140	0	9140		0
1.5 Intereses pagados por préstamos y créditos en entidades de crédito	8150	0	9150		0
1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	8160	0	9160		0
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo</b>	8200	-11	9200		0
2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora	8210	-11	9210		0
2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados	8220	0	9220		0
2.3 Comisiones pagadas al agente financiero	8230	0	9230		0
2.4 Comisiones variables pagadas	8240	0	9240		0
2.5 Otras comisiones	8250	0	9250		0
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo</b>	8300	-20	9300		0
3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos	8310	0	9310		0
3.2 Pagos de provisiones	8320	0	9320		0
3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta	8325	0	9325		0
3.4 Otros	8330	-20	9330		0
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION</b>	8350	-1.951	9350		0
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	8400	0	9400		0
4.1 Cobros por emisión de valores de titulización	8410	0	9410		0
4.2 Pagos por emisión de valores de titulización (aseguramiento colocación)	8420	0	9420		0
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	8500	0	9500		0
5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito	8510	0	9510		0
5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras	8520	0	9520		0
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones</b>	8600	-1.951	9600		0
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	7.459	9610		0
6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados	8620	0	9620		0
6.3 Pagos por amortización de valores de titulización	8630	-9.410	9630		0
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	8700	0	9700		0
7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos	8710	0	9710		0
7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos	8720	0	9720		0
7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso	8730	0	9730		0
7.4 Administraciones públicas - Pasivo	8740	0	9740		0
7.5 Otros deudores y acreedores	8750	0	9750		0
7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras	8770	0	9770		0
7.7 Cobros de Subvenciones	8780	0	9780		0
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	8800	-2.507	9800		0
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	19.298	9900		0
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	16.791	9990		0



ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.04

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

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		Periodo Actual 30/09/2016		Mismo Periodo año Anterior 30/09/2015
<b>1 Activos financieros disponibles para la venta</b>				
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6010	0	7010	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6020	0	7020	0
1.1.2 Efecto fiscal	6021	0	7021	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6022	0	7022	0
1.3 Otras reclasificaciones	6030	0	7030	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6040	0	7040	0
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>6100</b>	<b>0</b>	<b>7100</b>	<b>0</b>
<b>2 Cobertura de los flujos de efectivo</b>				
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6110	-471	7110	0
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6120	-471	7120	0
2.1.2 Efecto fiscal	6121	0	7121	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6122	619	7122	0
2.3 Otras reclasificaciones	6130	0	7130	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6140	-148	7140	0
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>6200</b>	<b>0</b>	<b>7200</b>	<b>0</b>
<b>3 Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>				
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el periodo	6310	0	7310	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6320	0	7320	0
3.1.2 Efecto fiscal	6321	0	7321	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6322	0	7322	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6330	0	7330	0
<b>Total Ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>6400</b>	<b>0</b>	<b>7400</b>	<b>0</b>
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>6500</b>	<b>0</b>	<b>7500</b>	<b>0</b>

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**  
 Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANCO MARENOSTRUM, S.A.**

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

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

Tipología de activos titulizados	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 16/02/2009			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)		
Participaciones hipotecarias	0001		0030		0060		0090		0120		0150	
Certificados de transmisión hipotecaria	0002		0031		0061		0091		0121		0151	
Préstamos hipotecarios	0003		0032		0062		0092		0122		0152	
Cédulas hipotecarias	0004		0033		0063		0093		0123		0153	
Préstamos a promotores	0005		0034		0064		0094		0124		0154	
Préstamos a PYMES	0007		0036		0066		0096		0126		0156	
Préstamos a empresas	0008	359	0037	24.130	0067	424	0097	31.589	0127	1.289	0157	175.000
Préstamos Corporativos	0009		0038		0068		0098		0128		0158	
Cédulas territoriales	0010		0039		0069		0099		0129		0159	
Bonos de tesorería	0011		0040		0070		0100		0130		0160	
Deuda subordinada	0012		0041		0071		0101		0131		0161	
Créditos AAPP	0013		0042		0072		0102		0132		0162	
Préstamos consumo	0014		0043		0073		0103		0133		0163	
Préstamos automoción	0015		0044		0074		0104		0134		0164	
Arrendamiento financiero	0016		0045		0075		0105		0135		0165	
Cuentas a cobrar	0017		0046		0076		0106		0136		0166	
Derechos de crédito futuros	0018		0047		0077		0107		0137		0167	
Bonos de titulización	0019		0048		0078		0108		0138		0168	
Otros	0020		0049		0079		0109		0139		0169	
<b>Total</b>	<b>0021</b>	<b>359</b>	<b>0050</b>	<b>24.130</b>	<b>0080</b>	<b>424</b>	<b>0110</b>	<b>31.589</b>	<b>0140</b>	<b>1.289</b>	<b>0170</b>	<b>175.000</b>

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**  
 Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANCO MARENOSTRUM, S.A.**

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

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

#### CUADRO B

Movimiento de la cartera de activos titulizados/Tasa de amortización anticipada	Situación actual 30/09/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015	
	Código	Importe	Código	Importe
Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior	0196	0	0206	0
Derechos de crédito dados de baja por dación/adjudicación de bienes desde el cierre anual anterior	0197		0207	
Amortización ordinaria desde el cierre anual anterior	0200	-3.256	0210	-5.711
Amortización anticipada desde el cierre anual anterior	0201	-4.203	0211	-5.023
Total importe amortizado acumulado, incluyendo adjudicaciones y otros pagos en especie, desde el origen del Fondo	0202	-150.870	0212	-143.411
Importe de principal pendiente de amortización de los nuevos activos incorporados en el periodo (1)	0203	0	0213	0
<b>Principal pendiente cierre del periodo (2)</b>	0204	24.130	0214	31.589
<b>Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)</b>	0205	14,83	0215	13,72

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

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**  
 Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANCO MARENOSTRUM, S.A.**

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

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

Total Impagados (1)	Nº de activos	Importe impagado							Deuda Total			
		Principal pendiente vencido		Intereses ordinarios (2)		Total		Principal pendiente no vencido				
Hasta 1 mes	0700	44	0710	37	0720	7	0730	44	0740	2.695	0750	2.741
De 1 a 3 meses	0701	7	0711	12	0721	2	0731	14	0741	217	0751	232
De 3 a 6 meses	0703	5	0713	17	0723	3	0733	20	0743	206	0753	226
De 6 a 9 meses	0704	0	0714	0	0724	0	0734	0	0744	0	0754	0
De 9 a 12 meses	0705	0	0715	0	0725	0	0735	0	0745	0	0755	0
De 12 meses a 2 años	0706	8	0716	108	0726	16	0736	124	0746	552	0756	675
Más de 2 años	0708	27	0718	439	0728	199	0738	638	0748	1.929	0758	2.568
<b>Total</b>	<b>0709</b>	<b>91</b>	<b>0719</b>	<b>613</b>	<b>0729</b>	<b>227</b>	<b>0739</b>	<b>840</b>	<b>0749</b>	<b>5.599</b>	<b>0759</b>	<b>6.442</b>

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

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

Impagados con garantía real (2)	Nº de activos	Importe impagado							Deuda Total	Valor garantía (3)	Valor Garantía con Tasación > 2 años (4)	% Deuda/v. Tasación				
		Principal pendiente vencido		Intereses ordinarios		Total		Principal pendiente no vencido								
Hasta 1 mes	0772	42	0782	29	0792	7	0802	36	0812	2.658	0822	2.695	0832	28.297	0842	9,52
De 1 a 3 meses	0773	6	0783	11	0793	2	0803	13	0813	196	0823	209	0833	1.249	0843	16,70
De 3 a 6 meses	0774	4	0784	14	0794	3	0804	17	0814	206	0824	223	0834	1.278	0844	17,46
De 6 a 9 meses	0775	0	0785	0	0795	0	0805	0	0815	0	0825	0	0835	0	0845	0,00
De 9 a 12 meses	0776	0	0786	0	0796	0	0806	0	0816	0	0826	0	0836	0	0846	0,00
De 12 meses a 2 años	0777	8	0787	108	0797	16	0807	124	0817	552	0827	675	0837	3.834	0847	17,61
Más de 2 años	0778	20	0788	399	0798	198	0808	597	0818	1.929	0828	2.526	0838	6.270	0848	40,29
<b>Total</b>	<b>0779</b>	<b>80</b>	<b>0789</b>	<b>561</b>	<b>0799</b>	<b>226</b>	<b>0809</b>	<b>787</b>	<b>0819</b>	<b>5.541</b>	<b>0829</b>	<b>6.328</b>	<b>0839</b>	<b>40.928</b>	<b>0849</b>	<b>15,46</b>

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

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**  
 Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANCO MARENOSTRUM, S.A.**

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

CUADRO D	Situación actual 30/09/2016						Situación cierre anual anterior 31/12/2015						Escenario inicial					
	Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)		Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)		Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)	
Participaciones hipotecarias	0850	0868	0886				0904	0922	0940				0958	0976	0994			
Certificados de transmisión de hipoteca	0851	0869	0887				0905	0923	0941				0959	0977	0995			
Préstamos hipotecarios	0852	0870	0888				0906	0924	0942				0960	0978	0996			
Cédulas Hipotecarias	0853	0871	0889				0907	0925	0943				0961	0979	0997			
Préstamos a promotores	0854	0872	0890				0908	0926	0944				0962	0980	0998			
Préstamos a PYMES	0855	0873	0891				0909	0927	0945				0963	0981	0999			
Préstamos a empresas	0856	13,59 0874	0,00 0892	0,00	0,00		0910	12,99 0928	0,00 0946	0,00		0964	3,00 0982	0,37 1000	0,00			
Préstamos Corporativos	0857	0875	0893				0911	0929	0947				0965	0983	1001			
Cédulas Territoriales	1066	1084	1102				1120	1138	1156				1174	1192	1210			
Bonos de Tesorería	0858	0876	0894				0912	0930	0948				0966	0984	1002			
Deuda subordinada	0859	0877	0895				0913	0931	0949				0967	0985	1003			
Créditos AAPP	0860	0878	0896				0914	0932	0950				0968	0986	1004			
Préstamos Consumo	0861	0879	0897				0915	0933	0951				0969	0987	1005			
Préstamos automoción	0862	0880	0898				0916	0934	0952				0970	0988	1006			
Cuotas arrendamiento financiero	0863	0881	0899				0917	0935	0953				0971	0989	1007			
Cuentas a cobrar	0864	0882	0900				0918	0936	0954				0972	0990	1008			
Derechos de crédito futuros	0865	0883	0901				0919	0937	0955				0973	0991	1009			
Bonos de titulización	0866	0884	0902				0920	0938	0956				0974	0992	1010			
Otros	0867	0885	0903				0921	0939	0957				0975	0993	1011			

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

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

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

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento: **AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación de la gestora: **HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **3er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**  
 Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANCO MARENOSTRUM, S.A.**

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

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

CUADRO E Vida residual de los activos cedidos al Fondo (1)	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 16/02/2009			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior a 1 año	1300	56	1310	505	1320	54	1330	663	1340	0	1350	0
Entre 1 y 2 años	1301	21	1311	364	1321	39	1331	916	1341	0	1351	0
Entre 2 y 3 años	1302	34	1312	815	1322	25	1332	603	1342	106	1352	5.102
Entre 3 y 5 años	1303	89	1313	5.208	1323	91	1333	5.105	1343	275	1353	14.108
Entre 5 y 10 años	1304	106	1314	10.209	1324	137	1334	13.815	1344	409	1354	63.080
Superior a 10 años	1305	53	1315	7.028	1325	78	1335	10.488	1345	499	1355	92.711
<b>Total</b>	<b>1306</b>	<b>359</b>	<b>1316</b>	<b>24.129</b>	<b>1326</b>	<b>424</b>	<b>1336</b>	<b>31.590</b>	<b>1346</b>	<b>1.289</b>	<b>1356</b>	<b>175.001</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>1307</b>	<b>8,15</b>			<b>1327</b>	<b>8,73</b>			<b>1347</b>	<b>10,75</b>		

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

Antigüedad	Situación actual 30/09/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 16/02/2009	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	11,67	0632	10,83	0634	3,88

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

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

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

CUADRO A		Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Escenario inicial 16/02/2009			
		Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)		
Serie (2)		0001	0002	0003	0004	0005	0006	0007	0008	0009	0070	0080	0090
ES0312214150	D	105	100	10.500	1,00	105	100	10.500	2,20	105	100	10.500	10,60
ES0312214143	C	105	100	10.500	0,70	105	100	10.500	2,20	105	100	10.500	10,40
ES0312214135	B	184	4	656	0,50	184	55	10.066	0,80	184	100	18.400	8,50
ES0312214127	A	0	0	0	0,00	0	0	0	0,00	1.356	100	135.600	3,30
<b>Total</b>		<b>8006</b>	<b>394</b>	<b>8025</b>	<b>21.656</b>	<b>8045</b>	<b>394</b>	<b>8065</b>	<b>31.066</b>	<b>8085</b>	<b>1.750</b>	<b>8105</b>	<b>175.000</b>

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

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

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

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

Serie (1)	Denominación serie	Grado de subordinación (2)	Índice de referencia (3)	Margen (4)	Tipo aplicado	Intereses				Principal pendiente		Total pendiente	Corrección de valor por repercusión de pérdidas									
						Base de cálculo de intereses	Días Acumulados (5)	Intereses Acumulados (6)	Intereses impagados	Principal no vencido	Principal impagado											
														9950	9960	9970	9980	9990	9991	9993	9997	9994
ES0312214150	D	S	EURIBOR 6 MESES	2,50	2,29	360		5	3	0	10.500	0	10.503									
ES0312214143	C	S	EURIBOR 6 MESES	1,25	1,04	360		5	2	0	10.500	0	10.502									
ES0312214135	B	NS	EURIBOR 6 MESES	0,60	0,39	360		5	0	0	656	0	656									
ES0312214127	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,30	0,09	360		5	0	0	0	0	0									
<b>Total</b>											9228	5	9105	0	9085	21.656	9095	0	9115	21.661	9227	

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

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

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

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

(5) Días acumulados desde la última fecha de pago

(6) Intereses acumulados desde la última fecha de pago



## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

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

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

CUADRO C			Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015											
			Amortización principal		Intereses		Amortización principal		Intereses									
Serie (1)	Denominación serie	Fecha final (2)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)								
		7290	7300	7310	7320	7330	7340	7350	7360	7370								
ES0312214150	D	24-09-2037	0	0	263	2.647	0	0	281	2.384								
ES0312214143	C	24-09-2037	0	0	129	1.634	0	0	148	1.505								
ES0312214135	B	24-09-2037	9.410	17.744	47	1.875	8.334	8.334	130	1.828								
ES0312214127	A	24-09-2037	0	135.599	0	5.962	3.963	135.599	10	5.962								
<b>Total</b>			<b>7305</b>	<b>9.410</b>	<b>7315</b>	<b>153.343</b>	<b>7325</b>	<b>439</b>	<b>7335</b>	<b>12.118</b>	<b>7345</b>	<b>12.297</b>	<b>7355</b>	<b>143.933</b>	<b>7365</b>	<b>569</b>	<b>7375</b>	<b>11.679</b>

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

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

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

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

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

#### CUADRO D

Serie (1)	Denominación serie	Calificación				
		Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Situación actual	Situación anual cierre anterior	Situación inicial
		3310	3330	3350	3360	3370
ES0312214150	D	23-01-2015	MDY	Aa2	Aa2	Ca
ES0312214150	D	02-04-2015	FCH	A	A	BBB-
ES0312214143	C	23-01-2015	MDY	Aa2	Aa2	Caa3
ES0312214143	C	02-04-2015	FCH	AA+	AA+	BBB-
ES0312214135	B	23-01-2015	MDY	Aa2	Aa2	B3
ES0312214135	B	30-04-2014	FCH	AA+	AA+	A
ES0312214127	A	23-01-2015	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0312214127	A	30-04-2014	FCH	AA+	AA+	AAA

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

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.3

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

<b>INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS</b> <i>(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)</i>		<b>Situación actual</b> <b>30/09/2016</b>		<b>Situación cierre</b> <b>anual anterior</b> <b>31/12/2015</b>
1. Importe del Fondo de Reserva	0010	15.705	1010	16.078
2. Porcentaje que representa el Fondo de Reserva, u otras mejoras equivalentes, sobre el total de activos titulizados	0020	65,08	1020	50,90
3. Exceso de spread (%) (1)	0040	2,09	1040	2,28
4. Permuta financiera de intereses (S/N)	0050	Si	1050	Si
5. Permuta financiera de tipos de cambio (S/N)	0070	No	1070	No
6. Otras permutas financieras (S/N)	0080	No	1080	No
7. Importe disponible de la línea/s de liquidez (2)	0090	0	1090	0
8. Subordinación de series (S/N)	0110	Si	1110	Si
9. Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total de bonos (3)	0120	3,03	1120	32,40
10. Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales	0150	0	1150	0
11. Porcentaje que representa el aval sobre el total de los pasivos emitidos	0160	0,00	1160	0,00
12. Importe máximo de riesgo cubierto por derivados de crédito u otras garantías financieras adquiridas	0170	0	1170	0
13. Otros (S/N) (4)	0180	No	1180	No

(1) Diferencial existente entre los tipos de interés medios ponderados percibidos de la cartera de activos titulizados conforme se establece en el Cuadro 5.5.E y el tipo de interés medio de los pasivos emitidos cuya finalidad ha sido la adquisición de los activos

(2) Se incluirá el importe total disponible de las distintas líneas de liquidez en caso de que haya más de una

(3) Entendiendo como no subordinadas aquellas series que en la fecha se encuentren, respecto a las demás, en una posición anterior para el cobro de capital conforme al orden de prelación de pagos

(4) La gestora deberá incluir una descripción de dichas mejoras crediticias en las notas explicativas en caso de que las consideren relevantes

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

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.4

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

### CIRCUNSTANCIAS ESPECÍFICAS ESTABLECIDAS CONTRACTUALMENTE EN EL FONDO

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

Concepto (1)	Meses impago				Días impago				Importe impagado acumulado				Ratio (2)				Ref. Folleto
	0010		0030		0100		0200		Situación actual		Periodo anterior		Última Fecha Pago				
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a		3		0	782	0	901	0	13,47	0,00	13,00	14,71					
2. Activos Morosos por otras razones					0	0	0	0	0,00	0,00	0,00	0,00					
<b>Total Morosos</b>					782	0	901	0	13,47	0,00	13,00	14,71	1280				FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a		12		0	762	0	800	0	12,55	0,00	10,73	13,82					
4. Activos Fallidos por otras razones					0	0	0	0	0,00	0,00	0,00	0,00					
<b>Total Fallidos</b>					762	0	800	0	12,55	0,00	10,73	13,82	1290				FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES

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

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

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

TRIGGERS (3)	Límite	% Actual	Última Fecha Pago		Ref. Folleto
			0500	0520	
<b>Amortización secuencial: series (4)</b>					
Amortización Secuencial Fondo Reserva (211) Amortización Secuencial Fondo Reserva (211)	17.850.000,0 0	15.708.904,8 0	15.708.904,8 0	-	0560
Amortización Secuencial D (1047) Amortización Secuencial D (1047)	0,75	17,07	17,07		FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv) Y CONDICIONES FINALES

Amortización Secuencial D (1004) Amortización Secuencial D (1004)		0,75		1,04		1,04		FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv) Y CONDICIONES FINALES
Amortización Secuencial C (1046) Amortización Secuencial C (1046)		1,00		17,07		17,07		FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv) Y CONDICIONES FINALES
Amortización Secuencial C (1002) Amortización Secuencial C (1002)		1,00		1,04		1,04		FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv) Y CONDICIONES FINALES
Amortización Secuencial B (215) Amortización Secuencial B (215)		24,00		7,09		7,46		-
Amortización Secuencial B (1001) Amortización Secuencial B (1001)		1,25		1,04		1,04		FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv) Y CONDICIONES FINALES
Amortización Secuencial (210) Amortización Secuencial (210)		10,00		12,37		12,37		-
Amortización Secuencial (207) Amortización Secuencial (207)		0,00		0,00		0,00		-
Amortización Secuencial (1045) Amortización Secuencial (1045)		1,25		17,07		17,07		FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv) Y CONDICIONES FINALES
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series (5)</b>		<b>0506</b>		<b>0526</b>		<b>0546</b>		<b>0566</b>
Diferimiento o Postergamiento de Interes D (224) Diferimiento o Postergamiento de Interes D (224)		0,00		0,00		0,00		FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6. Y CONDICIONES FINALES
Diferimiento o Postergamiento de Interes D (214) Diferimiento o Postergamiento de Interes D (214)		12,00		7,09		7,46		FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6. Y CONDICIONES FINALES
Diferimiento o Postergamiento de Interes C (223) Diferimiento o Postergamiento de Interes C (223)		0,00		0,00		0,00		FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6. Y CONDICIONES FINALES
Diferimiento o Postergamiento de Interes C (213) Diferimiento o Postergamiento de Interes C (213)		18,00		7,09		7,46		FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6. Y CONDICIONES FINALES
Diferimiento o Postergamiento de Interes B (222) Diferimiento o Postergamiento de Interes B (222)		0,00		0,00		0,00		FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6. Y CONDICIONES FINALES
Diferimiento o Postergamiento de Interes B (212) Diferimiento o Postergamiento de Interes B (212)		24,00		7,09		7,46		FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6. Y CONDICIONES FINALES
<b>No Reducción del Fondo de Reserva (6)</b>	<b>0512</b>	<b>3,00</b>	<b>0532</b>	<b>8,00</b>	<b>0552</b>	<b>7,00</b>	<b>0572</b>	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.1 y CONDICIONES FINALES
<b>OTROS TRIGGERS (3)</b>		<b>0513</b>		<b>0523</b>		<b>0553</b>		<b>0573</b>
Deterioro Activos (208)		10,00		12,37		12,37		FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)
Deterioro Activos Fondo Reserva (209)		17.850.000,00		15.708.904,80		15.708.904,80		FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.1

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

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

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

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

--

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

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

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

Distribución geográfica de activos titulizados	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 16/02/2009			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)	
Andalucía	0400	346	0426	23.335	0452	408	0478	30.416	0504	1.207	0530	158.347
Aragón	0401	0	0427	0	0453	0	0479	0	0505	0	0531	0
Asturias	0402	0	0428	0	0454	0	0480	0	0506	0	0532	0
Baleares	0403	0	0429	0	0455	0	0481	0	0507	0	0533	0
Canarias	0404	0	0430	0	0456	0	0482	0	0508	0	0534	0
Cantabria	0405	0	0431	0	0457	0	0483	0	0509	0	0535	0
Castilla-León	0406	0	0432	0	0458	0	0484	0	0510	0	0536	0
Castilla La Mancha	0407	0	0433	0	0459	0	0485	0	0511	1	0537	430
Cataluña	0408	11	0434	742	0460	13	0486	816	0512	43	0538	5.164
Ceuta	0409	0	0435	0	0461	0	0487	0	0513	0	0539	0
Extremadura	0410	0	0436	0	0462	0	0488	0	0514	0	0540	0
Galicia	0411	0	0437	0	0463	0	0489	0	0515	1	0541	5.742
Madrid	0412	0	0438	0	0464	0	0490	0	0516	30	0542	3.848
Meilla	0413	1	0439	48	0465	2	0491	205	0517	6	0543	1.156
Murcia	0414	1	0440	6	0466	1	0492	152	0518	1	0544	313
Navarra	0415	0	0441	0	0467	0	0493	0	0519	0	0545	0
La Rioja	0416	0	0442	0	0468	0	0494	0	0520	0	0546	0
Comunidad Valenciana	0417	0	0443	0	0469	0	0495	0	0521	0	0547	0
País Vasco	0418	0	0444	0	0470	0	0496	0	0522	0	0548	0
<b>Total España</b>	<b>0419</b>	<b>359</b>	<b>0445</b>	<b>24.131</b>	<b>0471</b>	<b>424</b>	<b>0497</b>	<b>31.589</b>	<b>0523</b>	<b>1.289</b>	<b>0549</b>	<b>175.000</b>
Otros países Unión europea	0420	0	0446	0	0472	0	0498	0	0524	0	0550	0
Resto	0422	0	0448	0	0474	0	0500	0	0526	0	0552	0
<b>Total general</b>	<b>0425</b>	<b>359</b>	<b>0450</b>	<b>24.131</b>	<b>0475</b>	<b>424</b>	<b>0501</b>	<b>31.589</b>	<b>0527</b>	<b>1.289</b>	<b>0553</b>	<b>175.000</b>

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

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

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

Divisa/Activos titulizados	Situación actual 30/09/2016						Situación cierre anual anterior 31/12/2015						Situación inicial 16/02/2009					
	Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)	
Euro - EUR	0571	359	0577	24.130	0583	24.130	0600	424	0606	31.589	0611	31.589	0620	1.289	0626	175.000	0631	175.000
EEUU Dólar - USD	0572	0	0578	0	0584	0	0601	0	0607	0	0612	0	0621	0	0627	0	0632	0
Japón Yen - JPY	0573	0	0579	0	0585	0	0602	0	0608	0	0613	0	0622	0	0628	0	0633	0
Reino Unido Libra - GBP	0574	0	0580	0	0586	0	0603	0	0609	0	0614	0	0623	0	0629	0	0634	0
Otras	0575	0			0587	0	0604	0			0615	0	0624	0			0635	0
<b>Total</b>	<b>0576</b>	<b>359</b>			<b>0588</b>	<b>24.130</b>	<b>0605</b>	<b>424</b>			<b>0616</b>	<b>31.589</b>	<b>0625</b>	<b>1.289</b>			<b>0636</b>	<b>175.000</b>

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



## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

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

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

CUADRO C Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (1)	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 16/02/2009			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	1100	285	1110	17.946	1120	320	1130	22.593	1140	282	1150	39.105
40% - 60%	1101	45	1111	4.991	1121	55	1131	6.614	1141	320	1151	52.599
60% - 80%	1102	5	1112	464	1122	10	1132	1.150	1142	185	1152	37.233
80% - 100%	1103	0	1113	0	1123	0	1133	0	1143	6	1153	1.417
100% - 120%	1104	0	1114	0	1124	0	1134	0	1144	0	1154	0
120% - 140%	1105	0	1115	0	1125	0	1135	0	1145	0	1155	0
140% - 160%	1106	0	1116	0	1126	0	1136	0	1146	0	1156	0
superior al 160%	1107	0	1117	0	1127	0	1137	0	1147	0	1157	0
<b>Total</b>	<b>1108</b>	<b>335</b>	<b>1118</b>	<b>23.401</b>	<b>1128</b>	<b>385</b>	<b>1138</b>	<b>30.357</b>	<b>1148</b>	<b>793</b>	<b>1158</b>	<b>130.354</b>
<b>Media ponderada (%)</b>			<b>1119</b>	<b>29,59</b>			<b>1139</b>	<b>31,47</b>			<b>1159</b>	<b>48,83</b>

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

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

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

#### CUADRO D

Rendimiento índice del periodo	Número de activos		Principal Pendiente		Margen ponderado s/ índice de referencia		Tipo de interés medio ponderado (2)	
	vivos							
Índice de referencia (1)	1400		1410		1420		1430	
TIPO FIJO	4		45		0,00		6,44	
IRPH entidades	85		4.407		0,37		3,61	
IRPH cajas	1		3		0,00		3,54	
EURIBOR DÍA	5		377		1,20		4,08	
EURIBOR AÑO	264		19.298		1,14		3,63	
<b>Total</b>	<b>1405</b>	<b>359</b>	<b>1415</b>	<b>24.130</b>	<b>1425</b>	<b>0,99</b>	<b>1435</b>	<b>3,63</b>

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

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

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

CUADRO E Tipo de interés nominal	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 16/02/2009			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior al 1%	1500	6	1521	596	1542	4	1563	249	1584	0	1605	0
1% - 1,49%	1501	20	1522	456	1543	15	1564	790	1585	0	1606	0
1,5% - 1,99%	1502	11	1523	304	1544	24	1565	475	1586	0	1607	0
2% - 2,49%	1503	24	1524	772	1545	20	1566	832	1587	0	1608	0
2,5% - 2,99%	1504	17	1525	667	1546	24	1567	996	1588	0	1609	0
3% - 3,49%	1505	52	1526	4.112	1547	56	1568	5.129	1589	0	1610	0
3,5% - 3,99%	1506	103	1527	7.721	1548	118	1569	9.429	1590	1	1611	121
4% - 4,49%	1507	56	1528	4.582	1549	75	1570	6.461	1591	9	1612	1.136
4,5% - 4,99%	1508	45	1529	3.582	1550	57	1571	5.423	1592	8	1613	1.989
5% - 5,49%	1509	14	1530	998	1551	18	1572	1.405	1593	113	1614	19.767
5,5% - 5,99%	1510	6	1531	100	1552	6	1573	122	1594	242	1615	35.031
6% - 6,49%	1511	2	1532	216	1553	3	1574	231	1595	347	1616	60.925
6,5% - 6,99%	1512	1	1533	5	1554	1	1575	5	1596	244	1617	32.921
7% - 7,49%	1513	1	1534	10	1555	2	1576	27	1597	205	1618	18.872
7,5% - 7,99%	1514	1	1535	10	1556	1	1577	16	1598	56	1619	2.511
8% - 8,49%	1515	0	1536	0	1557	0	1578	0	1599	56	1620	1.533
8,5% - 8,99%	1516	0	1537	0	1558	0	1579	0	1600	7	1621	175
9% - 9,49%	1517	0	1538	0	1559	0	1580	0	1601	1	1622	19
9,5% - 9,99%	1518	0	1539	0	1560	0	1581	0	1602	0	1623	0
Superior al 10%	1519	0	1540	0	1561	0	1582	0	1603	0	1624	0
<b>Total</b>	<b>1520</b>	<b>359</b>	<b>1541</b>	<b>24.131</b>	<b>1562</b>	<b>424</b>	<b>1583</b>	<b>31.590</b>	<b>1604</b>	<b>1.289</b>	<b>1625</b>	<b>175.000</b>
<b>Tipo de interés medio ponderado de los activos(%)</b>			<b>9542</b>	<b>3,90</b>			<b>9584</b>	<b>3,94</b>			<b>1626</b>	<b>6,27</b>
<b>Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%)</b>			<b>9543</b>	<b>1,81</b>			<b>9585</b>	<b>1,66</b>			<b>1627</b>	<b>2,57</b>

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

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

CUADRO F Concentración	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 16/02/2009			
	Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	2000	18,76			2030	15,74			2060	17,00		
Sector: (1)	2010	10,06	2020	47	2040	10,61	2050	47	2070	0,00	2080	42

(1) Indíquese denominación del sector con mayor concentración

(2) Incluir código CNAE con dos niveles de agregación

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

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

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

#### CUADRO G

Divisa/Pasivos emitidos por el fondo	Situación actual 30/09/2016						Situación inicial 16/02/2009					
	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros		Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros	
Euro - EUR	3000	394	3060	21.656	3110	21.656	3170	1.750	3230	175.000	3250	175.000
EEUU Dólar - USDR	3010		3070		3120		3180		3240		3260	
Japón Yen - JPY	3020		3080		3130		3190		3250		3270	
Reino Unido Libra - GBP	3030		3090		3140		3200		3260		3280	
Otras	3040				3150		3210				3290	
<b>Total</b>	<b>3050</b>	<b>394</b>			<b>3160</b>	<b>21.656</b>	<b>3220</b>	<b>1.750</b>			<b>3300</b>	<b>175.000</b>

# ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.06

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

## NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene  
Información adicional  
en fichero adjunto

## INFORME DE AUDITOR