

#### I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: HT WORKING CAPITAL, FONDO DE TITULIZACION  
Número de registro del Fondo: 202000009  
NIF Fondo: V01616598  
Denominación del compartimento:  
Número de registro del compartimento:  
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.  
NIF Gestora: A80732142  
Fondo Abierto: SI  
Fondo Privado: SI  
Estados agregados: SI  
Fecha: 31/03/2021

#### 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 Working Capital, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

| BALANCE (miles de euros)                                |      | Periodo actual<br>31/03/2021 |      | Periodo anterior<br>31/12/2020 |
|---------------------------------------------------------|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>ACTIVO</b>                                           |      |                              |      |                                |
| <b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>                           | 0001 |                              | 1001 |                                |
| <b>I. Activos financieros a largo plazo</b>             | 0002 |                              | 1002 |                                |
| 1. Activos titulizados                                  | 0003 |                              | 1003 |                                |
| 1.1 Participaciones hipotecarias                        | 0004 |                              | 1004 |                                |
| 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 titulación                                | 0021 |                              | 1021 |                                |
| 1.19 Cédulas internacionalización                       | 0022 |                              | 1022 |                                |
| 1.20 Otros                                              | 0023 |                              | 1023 |                                |
| 1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos          | 0024 |                              | 1024 |                                |
| 1.22 Activos dudosos -principal-                        | 0025 |                              | 1025 |                                |
| 1.23 Activos dudosos -intereses y otros-                | 0026 |                              | 1026 |                                |
| 1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-) | 0027 |                              | 1027 |                                |
| 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 |                                |
| <b>II. Activos por impuesto diferido</b>                | 0039 |                              | 1039 |                                |
| <b>III. Otros activos no corrientes</b>                 | 0040 |                              | 1040 |                                |

S.01

Denominación Fondo: HT Working Capital, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

| BALANCE (miles de euros)                                   |      | Periodo actual<br>31/03/2021 |      | Periodo anterior<br>31/12/2020 |
|------------------------------------------------------------|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>                                 | 0041 | 8.042                        | 1041 | 8.158                          |
| <b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>  | 0042 |                              | 1042 |                                |
| <b>V. Activos financieros a corto plazo</b>                | 0043 | 7.585                        | 1043 | 7.794                          |
| 1. Activos titulizados                                     | 0044 | 7.585                        | 1044 | 7.794                          |
| 1.1 Participaciones hipotecarias                           | 0045 |                              | 1045 |                                |
| 1.2 Certificados de transmisión hipotecaria                | 0046 |                              | 1046 |                                |
| 1.3 Préstamos hipotecarios                                 | 0047 |                              | 1047 |                                |
| 1.4 Cédulas hipotecarias                                   | 0048 |                              | 1048 |                                |
| 1.5 Préstamos a promotores                                 | 0049 |                              | 1049 |                                |
| 1.6 Préstamos a PYMES                                      | 0050 |                              | 1050 |                                |
| 1.7 Préstamos a empresas                                   | 0051 |                              | 1051 |                                |
| 1.8 Préstamos corporativos                                 | 0052 |                              | 1052 |                                |
| 1.9 Cédulas territoriales                                  | 0053 |                              | 1053 |                                |
| 1.10 Bonos de tesorería                                    | 0054 |                              | 1054 |                                |
| 1.11 Deuda subordinada                                     | 0055 |                              | 1055 |                                |
| 1.12 Créditos AAPP                                         | 0056 |                              | 1056 |                                |
| 1.13 Préstamos consumo                                     | 0057 |                              | 1057 |                                |
| 1.14 Préstamos automoción                                  | 0058 |                              | 1058 |                                |
| 1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)          | 0059 |                              | 1059 |                                |
| 1.16 Cuentas a cobrar                                      | 0060 |                              | 1060 |                                |
| 1.17 Derechos de crédito futuros                           | 0061 |                              | 1061 |                                |
| 1.18 Bonos de titulación                                   | 0062 |                              | 1062 |                                |
| 1.19 Cédulas internacionalización                          | 0063 |                              | 1063 |                                |
| 1.20 Otros                                                 | 0064 | 7.585                        | 1064 | 7.794                          |
| 1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos             | 0065 |                              | 1065 |                                |
| 1.22 Intereses vencidos e impagados                        | 0066 |                              | 1066 |                                |
| 1.23 Activos dudosos -principal-                           | 0067 |                              | 1067 |                                |
| 1.24 Activos dudosos -intereses-                           | 0068 |                              | 1068 |                                |
| 1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)    | 0069 |                              | 1069 |                                |
| 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 |                              | 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 |                              | 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, pignorados o gravados en garantía    | 0081 |                              | 1081 |                                |
| <b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>                   | 0082 | 0                            | 1082 | 0                              |
| 1. Comisiones                                              | 0083 |                              | 1083 |                                |
| 2. Otros                                                   | 0084 | 0                            | 1084 | 0                              |
| <b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b> | 0085 | 458                          | 1085 | 363                            |
| 1. Tesorería                                               | 0086 | 458                          | 1086 | 363                            |
| 2. Otros activos líquidos equivalentes                     | 0087 |                              | 1087 |                                |
| <b>TOTAL ACTIVO</b>                                        | 0088 | 8.042                        | 1088 | 8.158                          |

Denominación Fondo: HT Working Capital, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

| BALANCE (miles de euros)                                  |      | Periodo actual<br>31/03/2021 |      | Periodo anterior<br>31/12/2020 |
|-----------------------------------------------------------|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>PASIVO</b>                                             |      |                              |      |                                |
| <b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>                             | 0089 |                              | 1089 |                                |
| <b>I. Provisiones a largo plazo</b>                       | 0090 |                              | 1090 |                                |
| 1. Provisión garantías financieras                        | 0091 |                              | 1091 |                                |
| 2. Provisión por margen de intermediación                 | 0092 |                              | 1092 |                                |
| 3. Otras provisiones                                      | 0093 |                              | 1093 |                                |
| <b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>              | 0094 |                              | 1094 |                                |
| 1. Obligaciones y otros valores emitidos                  | 0095 |                              | 1095 |                                |
| 1.1 Series no subordinadas                                | 0096 |                              | 1096 |                                |
| 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 |                              | 1101 |                                |
| 2.1 Préstamo subordinado                                  | 0102 |                              | 1102 |                                |
| 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 |                                |
| <b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>                 | 0116 |                              | 1116 |                                |

|                                                                  |      |
|------------------------------------------------------------------|------|
|                                                                  | S.01 |
| <b>Denominación Fondo: HT Working Capital, FT</b>                |      |
| <b>Denominación del compartimento:</b>                           |      |
| <b>Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.</b> |      |
| <b>Estados agregados: SI</b>                                     |      |
| <b>Fecha: 31/03/2021</b>                                         |      |

| BALANCE (miles de euros)                                                         |      | Periodo actual<br>31/03/2021 |      | Periodo anterior<br>31/12/2020 |
|----------------------------------------------------------------------------------|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>B) PASIVO CORRIENTE</b>                                                       | 0117 | 8.042                        | 1117 | 8.158                          |
| <b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b> | 0118 |                              | 1118 |                                |
| <b>V. Provisiones a corto plazo</b>                                              | 0119 |                              | 1119 |                                |
| 1. Provisión garantías financieras                                               | 0120 |                              | 1120 |                                |
| 2. Provisión por margen de intermediación                                        | 0121 |                              | 1121 |                                |
| 3. Otras provisiones                                                             | 0122 |                              | 1122 |                                |
| <b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>                                     | 0123 | 7.883                        | 1123 | 7.932                          |
| 1. Obligaciones y otros valores emitidos                                         | 0124 | 7.109                        | 1124 | 7.195                          |
| 1.1 Series no subordinadas                                                       | 0125 | 7.360                        | 1125 | 7.560                          |
| 1.2 Series subordinadas                                                          | 0126 |                              | 1126 |                                |
| 1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0127 | -290                         | 1127 | -370                           |
| 1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos                                    | 0128 | 39                           | 1128 | 5                              |
| 1.5 Intereses vencidos e impagados                                               | 0129 |                              | 1129 |                                |
| 1.6 Ajustes por operaciones de cobertura                                         | 0130 |                              | 1130 |                                |
| 2. Deudas con entidades de crédito                                               | 0131 |                              | 1131 |                                |
| 2.1 Préstamo subordinado                                                         | 0132 |                              | 1132 |                                |
| 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 |                              | 1136 |                                |
| 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 | 774                          | 1143 | 737                            |
| 4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar                                           | 0144 | 300                          | 1144 | 302                            |
| 4.2 Garantías financieras                                                        | 0145 |                              | 1145 |                                |
| 4.3 Otros                                                                        | 0146 | 474                          | 1146 | 435                            |
| 4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0147 | 0                            | 1147 | 0                              |
| <b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>                                        | 0148 | 159                          | 1148 | 226                            |
| 1. Comisiones                                                                    | 0149 | 12                           | 1149 | 6                              |
| 1.1 Comisión sociedad gestora                                                    | 0150 | 6                            | 1150 | 3                              |
| 1.2 Comisión administrador                                                       | 0151 | 2                            | 1151 | 2                              |
| 1.3 Comisión agente financiero/pagos                                             | 0152 | 3                            | 1152 | 1                              |
| 1.4 Comisión variable                                                            | 0153 |                              | 1153 |                                |
| 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 | 148                          | 1157 | 219                            |
| <b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>       | 0158 |                              | 1158 |                                |
| <b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>                       | 0159 |                              | 1159 |                                |
| <b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>                                      | 0160 |                              | 1160 |                                |
| <b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>                 | 0161 |                              | 1161 |                                |
| <b>TOTAL PASIVO</b>                                                              | 0162 | 8.042                        | 1162 | 8.158                          |

Denominación Fondo: HT Working Capital, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

| CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)                              |      | P. corriente<br>actual<br>(1. trimestre) |      | P. corriente<br>anterior<br>(1. trimestre) |      | Acumulado<br>actual<br>31/03/2021 |      | Acumulado<br>anterior<br>31/03/2020 |
|------------------------------------------------------------------------------|------|------------------------------------------|------|--------------------------------------------|------|-----------------------------------|------|-------------------------------------|
| <b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>                                | 0201 | 53                                       | 1201 | 0                                          | 2201 | 53                                | 3201 | 0                                   |
| 1.1 Activos titulizados                                                      | 0202 | 53                                       | 1202 | 0                                          | 2202 | 53                                | 3202 | 0                                   |
| 1.2 Otros activos financieros                                                | 0203 |                                          | 1203 | 0                                          | 2203 |                                   | 3203 | 0                                   |
| <b>2. Intereses y cargas asimilados</b>                                      | 0204 | -34                                      | 1204 | 0                                          | 2204 | -34                               | 3204 | 0                                   |
| 2.1 Obligaciones y otros valores emitidos                                    | 0205 | -34                                      | 1205 | 0                                          | 2205 | -34                               | 3205 | 0                                   |
| 2.2 Deudas con entidades de crédito                                          | 0206 |                                          | 1206 | 0                                          | 2206 |                                   | 3206 | 0                                   |
| 2.3 Otros pasivos financieros                                                | 0207 | -1                                       | 1207 | 0                                          | 2207 | -1                                | 3207 | 0                                   |
| <b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b> | 0208 |                                          | 1208 |                                            | 2208 |                                   | 3208 | 0                                   |
| <b>A) MARGEN DE INTERESES</b>                                                | 0209 | 19                                       | 1209 | 0                                          | 2209 | 19                                | 3209 | 0                                   |
| <b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>                        | 0210 |                                          | 1210 |                                            | 2210 |                                   | 3210 | 0                                   |
| 4.1 Resultados de derivados de negociación                                   | 0211 |                                          | 1211 |                                            | 2211 |                                   | 3211 | 0                                   |
| 4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG          | 0212 |                                          | 1212 |                                            | 2212 |                                   | 3212 | 0                                   |
| 4.3 Activos financieros disponibles para la venta                            | 0213 |                                          | 1213 |                                            | 2213 |                                   | 3213 |                                     |
| 4.4 Otros                                                                    | 0214 |                                          | 1214 |                                            | 2214 |                                   | 3214 |                                     |
| <b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>                                       | 0215 |                                          | 1215 |                                            | 2215 |                                   | 3215 |                                     |
| <b>6. Otros ingresos de explotación</b>                                      | 0216 |                                          | 1216 |                                            | 2216 |                                   | 3216 |                                     |
| <b>7. Otros gastos de explotación</b>                                        | 0217 | -34                                      | 1217 |                                            | 2217 | -34                               | 3217 | 0                                   |
| 7.1 Servicios exteriores                                                     | 0218 | -8                                       | 1218 |                                            | 2218 | -8                                | 3218 | 0                                   |
| 7.1.1 Servicios de profesionales independientes                              | 0219 | -4                                       | 1219 |                                            | 2219 | -4                                | 3219 |                                     |
| 7.1.2 Servicios bancarios y similares                                        | 0220 |                                          | 1220 |                                            | 2220 |                                   | 3220 |                                     |
| 7.1.3 Publicidad y propaganda                                                | 0221 |                                          | 1221 |                                            | 2221 |                                   | 3221 |                                     |
| 7.1.4 Otros servicios                                                        | 0222 | -5                                       | 1222 |                                            | 2222 | -5                                | 3222 |                                     |
| 7.2 Tributos                                                                 | 0223 | 0                                        | 1223 |                                            | 2223 | 0                                 | 3223 |                                     |
| 7.3 Otros gastos de gestión corriente                                        | 0224 | -26                                      | 1224 |                                            | 2224 | -26                               | 3224 |                                     |
| 7.3.1 Comisión sociedad gestora                                              | 0225 | -15                                      | 1225 |                                            | 2225 | -15                               | 3225 |                                     |
| 7.3.2 Comisión administrador                                                 | 0226 | -7                                       | 1226 |                                            | 2226 | -7                                | 3226 |                                     |
| 7.3.3 Comisión agente financiero/pagos                                       | 0227 | -2                                       | 1227 |                                            | 2227 | -2                                | 3227 |                                     |
| 7.3.4 Comisión variable                                                      | 0228 | -1                                       | 1228 |                                            | 2228 | -1                                | 3228 |                                     |
| 7.3.5 Otras comisiones del cedente                                           | 0229 |                                          | 1229 |                                            | 2229 |                                   | 3229 |                                     |
| 7.3.6 Otros gastos                                                           | 0230 |                                          | 1230 |                                            | 2230 |                                   | 3230 |                                     |
| <b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>                            | 0231 |                                          | 1231 |                                            | 2231 |                                   | 3231 |                                     |
| 8.1 Deterioro neto de activos titulizados                                    | 0232 |                                          | 1232 |                                            | 2232 |                                   | 3232 |                                     |
| 8.2 Deterioro neto de otros activos financieros                              | 0233 |                                          | 1233 |                                            | 2233 |                                   | 3233 |                                     |
| <b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>                                    | 0234 |                                          | 1234 |                                            | 2234 |                                   | 3234 |                                     |
| 9.1 Dotación provisión por garantías financieras                             | 0235 |                                          | 1235 |                                            | 2235 |                                   | 3235 |                                     |
| 9.2 Dotación provisión por margen de intermediación                          | 0236 |                                          | 1236 |                                            | 2236 |                                   | 3236 |                                     |
| 9.3 Dotación otras provisiones                                               | 0237 |                                          | 1237 |                                            | 2237 |                                   | 3237 |                                     |
| <b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>            | 0238 |                                          | 1238 |                                            | 2238 |                                   | 3238 |                                     |
| <b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>                               | 0239 | 15                                       | 1239 |                                            | 2239 | 15                                | 3239 |                                     |
| <b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>                                       | 0240 | 0                                        | 1240 | 0                                          | 2240 | 0                                 | 3240 | 0                                   |
| <b>12. Impuesto sobre beneficios</b>                                         | 0241 |                                          | 1241 |                                            | 2241 |                                   | 3241 |                                     |
| <b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>                                              | 0242 | 0                                        | 1242 | 0                                          | 2242 | 0                                 | 3242 | 0                                   |

Denominación Fondo: HT Working Capital, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

| ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)                                    |      | P. corriente actual (1. trimestre) |      | P. corriente anterior (1. trimestre) |      | Acumulado actual 31/03/2021 |      | Acumulado anterior 31/03/2020 |
|----------------------------------------------------------------------------------|------|------------------------------------|------|--------------------------------------|------|-----------------------------|------|-------------------------------|
| <b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>                          | 0300 | -25                                | 1300 | 0                                    | 2300 | -25                         | 3300 |                               |
| <b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>                    | 0301 | -1                                 | 1301 | 0                                    | 2301 | -1                          | 3301 |                               |
| 1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados                                | 0302 | 0                                  | 1302 |                                      | 2302 | 0                           | 3302 |                               |
| 1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos              | 0303 | 0                                  | 1303 |                                      | 2303 | 0                           | 3303 |                               |
| 1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura                             | 0304 | 0                                  | 1304 |                                      | 2304 | 0                           | 3304 |                               |
| 1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura                              | 0305 | 0                                  | 1305 | 0                                    | 2305 | 0                           | 3305 |                               |
| 1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros                              | 0306 | 0                                  | 1306 | 0                                    | 2306 | 0                           | 3306 |                               |
| 1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito                        | 0307 | 0                                  | 1307 | 0                                    | 2307 | 0                           | 3307 |                               |
| 1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)                                      | 0308 | -1                                 | 1308 | 0                                    | 2308 | -1                          | 3308 |                               |
| <b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>                  | 0309 | -20                                | 1309 | 0                                    | 2309 | -20                         | 3309 |                               |
| 2.1 Comisión sociedad gestora                                                    | 0310 | -12                                | 1310 |                                      | 2310 | -12                         | 3310 |                               |
| 2.2 Comisión administrador                                                       | 0311 | -7                                 | 1311 | 0                                    | 2311 | -7                          | 3311 |                               |
| 2.3 Comisión agente financiero/pagos                                             | 0312 | 0                                  | 1312 |                                      | 2312 | 0                           | 3312 |                               |
| 2.4 Comisión variable                                                            | 0313 | -1                                 | 1313 |                                      | 2313 | -1                          | 3313 |                               |
| 2.5 Otras comisiones                                                             | 0314 | 0                                  | 1314 |                                      | 2314 | 0                           | 3314 |                               |
| <b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>        | 0315 | -5                                 | 1315 |                                      | 2315 | -5                          | 3315 |                               |
| 3.1 Pagos por garantías financieras                                              | 0316 | 0                                  | 1316 |                                      | 2316 | 0                           | 3316 |                               |
| 3.2 Cobros por garantías financieras                                             | 0317 | 0                                  | 1317 |                                      | 2317 | 0                           | 3317 |                               |
| 3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación                            | 0318 | 0                                  | 1318 |                                      | 2318 | 0                           | 3318 |                               |
| 3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación                           | 0319 | 0                                  | 1319 |                                      | 2319 | 0                           | 3319 |                               |
| 3.5 Otros pagos de explotación                                                   | 0320 | -5                                 | 1320 |                                      | 2320 | -5                          | 3320 |                               |
| 3.6 Otros cobros de explotación                                                  | 0321 | 0                                  | 1321 |                                      | 2321 | 0                           | 3321 |                               |
| <b>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>                 | 0322 | 120                                | 1322 |                                      | 2322 | 120                         | 3322 |                               |
| <b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>            | 0323 | 0                                  | 1323 |                                      | 2323 | 0                           | 3323 |                               |
| <b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>                  | 0324 | -3.465                             | 1324 |                                      | 2324 | -3.465                      | 3324 |                               |
| <b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b> | 0325 | 3.585                              | 1325 |                                      | 2325 | 3.585                       | 3325 |                               |
| 6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados                     | 0326 | 3.785                              | 1326 |                                      | 2326 | 3.785                       | 3326 |                               |
| 6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados                    | 0327 | 0                                  | 1327 |                                      | 2327 | 0                           | 3327 |                               |
| 6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados          | 0328 | 0                                  | 1328 |                                      | 2328 | 0                           | 3328 |                               |
| 6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos    | 0329 | 0                                  | 1329 |                                      | 2329 | 0                           | 3329 |                               |
| 6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías     | 0330 | 0                                  | 1330 |                                      | 2330 | 0                           | 3330 |                               |
| 6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos              | 0331 | -200                               | 1331 |                                      | 2331 | -200                        | 3331 |                               |
| <b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>                     | 0332 | 0                                  | 1332 |                                      | 2332 | 0                           | 3332 |                               |
| 7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito                      | 0333 | 0                                  | 1333 |                                      | 2333 | 0                           | 3333 |                               |
| 7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito                       | 0334 | 0                                  | 1334 |                                      | 2334 | 0                           | 3334 |                               |
| 7.3 Pagos a Administraciones públicas                                            | 0335 | 0                                  | 1335 |                                      | 2335 | 0                           | 3335 |                               |
| 7.4 Otros cobros y pagos                                                         | 0336 | 0                                  | 1336 |                                      | 2336 | 0                           | 3336 |                               |
| <b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>              | 0337 | 94                                 | 1337 | 0                                    | 2337 | 94                          | 3337 |                               |
| Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo                                  | 0338 | 363                                | 1338 |                                      | 2338 | 363                         | 3338 |                               |
| Efectivo o equivalentes al final del periodo                                     | 0339 | 458                                | 1339 |                                      | 2339 | 458                         | 3339 |                               |

Denominación Fondo: HT Working Capital, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

| INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)                                                                 |      | P. corriente<br>actual<br>(1. trimestre) |      | P. corriente<br>anterior<br>(1. trimestre) |      | Acumulado<br>actual<br>31/03/2021 |      | Acumulado<br>anterior<br>31/03/2020 |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|------------------------------------------|------|--------------------------------------------|------|-----------------------------------|------|-------------------------------------|
| <b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>                                                        |      |                                          |      |                                            |      |                                   |      |                                     |
| 1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración                                                                        | 0350 |                                          | 1350 |                                            | 2350 |                                   | 3350 |                                     |
| 1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración                                                 | 0351 |                                          | 1351 |                                            | 2351 |                                   | 3351 |                                     |
| 1.1.2 Efecto fiscal                                                                                            | 0352 |                                          | 1352 |                                            | 2352 |                                   | 3352 |                                     |
| 1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias                                                  | 0353 |                                          | 1353 |                                            | 2353 |                                   | 3353 |                                     |
| 1.3 Otras reclasificaciones                                                                                    | 0354 |                                          | 1354 |                                            | 2354 |                                   | 3354 |                                     |
| 1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo                                                  | 0355 |                                          | 1355 |                                            | 2355 |                                   | 3355 |                                     |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>                   | 0356 |                                          | 1356 |                                            | 2356 |                                   | 3356 |                                     |
| <b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>                                                                  |      |                                          |      |                                            |      |                                   |      |                                     |
| 2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración                                                                        | 0357 | 0                                        | 1357 |                                            | 2357 | 0                                 | 3357 |                                     |
| 2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración                                                 | 0358 | 0                                        | 1358 |                                            | 2358 | 0                                 | 3358 |                                     |
| 2.1.2 Efecto fiscal                                                                                            | 0359 |                                          | 1359 |                                            | 2359 |                                   | 3359 |                                     |
| 2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias                                                  | 0360 | 0                                        | 1360 |                                            | 2360 | 0                                 | 3360 |                                     |
| 2.3 Otras reclasificaciones                                                                                    | 0361 |                                          | 1361 |                                            | 2361 |                                   | 3361 |                                     |
| 2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo                                                  | 0362 | 0                                        | 1362 |                                            | 2362 | 0                                 | 3362 |                                     |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>                                            | 0363 | 0                                        | 1363 |                                            | 2363 | 0                                 | 3363 |                                     |
| <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 | 0364 |                                          | 1364 |                                            | 2364 |                                   | 3364 |                                     |
| 3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración                                                 | 0365 |                                          | 1365 |                                            | 2365 |                                   | 3365 |                                     |
| 3.1.2 Efecto fiscal                                                                                            | 0366 |                                          | 1366 |                                            | 2366 |                                   | 3366 |                                     |
| 3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias                                                  | 0367 |                                          | 1367 |                                            | 2367 |                                   | 3367 |                                     |
| 3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo                                                  | 0368 |                                          | 1368 |                                            | 2368 |                                   | 3368 |                                     |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>                                        | 0369 |                                          | 1369 |                                            | 2369 |                                   | 3369 |                                     |
| <b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>                                                          | 0370 | 0                                        | 1370 |                                            | 2370 | 0                                 | 3370 |                                     |

Denominación Fondo: HT Working Capital, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados:

## INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

### CUADRO A

| Ratios (%)                                   | Situación actual 31/03/2021 |  |                 |  |                               |  |                                 |  | Situación cierre anual anterior 31/12/2020 |  |                 |  |                               |  |                                 |  | 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                        |  | 0402            |  | 0422                          |  | 0442                            |  | 1382                                       |  | 1402            |  | 1422                          |  | 1442                            |  | 2382                                  |  | 2402            |  | 2422                          |  | 2442                            |  |
| Cédulas hipotecarias                         | 0383                        |  | 0403            |  | 0423                          |  | 0443                            |  | 1383                                       |  | 1403            |  | 1423                          |  | 1443                            |  | 2383                                  |  | 2403            |  | 2423                          |  | 2443                            |  |
| Préstamos a promotores                       | 0384                        |  | 0404            |  | 0424                          |  | 0444                            |  | 1384                                       |  | 1404            |  | 1424                          |  | 1444                            |  | 2384                                  |  | 2404            |  | 2424                          |  | 2444                            |  |
| Préstamos a PYMES                            | 0385                        |  | 0405            |  | 0425                          |  | 0445                            |  | 1385                                       |  | 1405            |  | 1425                          |  | 1445                            |  | 2385                                  |  | 2405            |  | 2425                          |  | 2445                            |  |
| Préstamos a empresas                         | 0386                        |  | 0406            |  | 0426                          |  | 0446                            |  | 1386                                       |  | 1406            |  | 1426                          |  | 1446                            |  | 2386                                  |  | 2406            |  | 2426                          |  | 2446                            |  |
| Préstamos corporativos                       | 0387                        |  | 0407            |  | 0427                          |  | 0447                            |  | 1387                                       |  | 1407            |  | 1427                          |  | 1447                            |  | 2387                                  |  | 2407            |  | 2427                          |  | 2447                            |  |
| Cédulas territoriales                        | 0388                        |  | 0408            |  | 0428                          |  | 0448                            |  | 1388                                       |  | 1408            |  | 1428                          |  | 1448                            |  | 2388                                  |  | 2408            |  | 2428                          |  | 2448                            |  |
| Bonos de tesorería                           | 0389                        |  | 0409            |  | 0429                          |  | 0449                            |  | 1389                                       |  | 1409            |  | 1429                          |  | 1449                            |  | 2389                                  |  | 2409            |  | 2429                          |  | 2449                            |  |
| Deuda subordinada                            | 0390                        |  | 0410            |  | 0430                          |  | 0450                            |  | 1390                                       |  | 1410            |  | 1430                          |  | 1450                            |  | 2390                                  |  | 2410            |  | 2430                          |  | 2450                            |  |
| Créditos AAPP                                | 0391                        |  | 0411            |  | 0431                          |  | 0451                            |  | 1391                                       |  | 1411            |  | 1431                          |  | 1451                            |  | 2391                                  |  | 2411            |  | 2431                          |  | 2451                            |  |
| Préstamos consumo                            | 0392                        |  | 0412            |  | 0432                          |  | 0452                            |  | 1392                                       |  | 1412            |  | 1432                          |  | 1452                            |  | 2392                                  |  | 2412            |  | 2432                          |  | 2452                            |  |
| Préstamos automoción                         | 0393                        |  | 0413            |  | 0433                          |  | 0453                            |  | 1393                                       |  | 1413            |  | 1433                          |  | 1453                            |  | 2393                                  |  | 2413            |  | 2433                          |  | 2453                            |  |
| Cuotas de arrendamiento financiero (leasing) | 0394                        |  | 0414            |  | 0434                          |  | 0454                            |  | 1394                                       |  | 1414            |  | 1434                          |  | 1454                            |  | 2394                                  |  | 2414            |  | 2434                          |  | 2454                            |  |
| Cuentas a cobrar                             | 0395                        |  | 0415            |  | 0435                          |  | 0455                            |  | 1395                                       |  | 1415            |  | 1435                          |  | 1455                            |  | 2395                                  |  | 2415            |  | 2435                          |  | 2455                            |  |
| Derechos de crédito futuros                  | 0396                        |  | 0416            |  | 0436                          |  | 0456                            |  | 1396                                       |  | 1416            |  | 1436                          |  | 1456                            |  | 2396                                  |  | 2416            |  | 2436                          |  | 2456                            |  |
| Bonos de titulización                        | 0397                        |  | 0417            |  | 0437                          |  | 0457                            |  | 1397                                       |  | 1417            |  | 1437                          |  | 1457                            |  | 2397                                  |  | 2417            |  | 2437                          |  | 2457                            |  |
| Cédulas internacionalización                 | 0398                        |  | 0418            |  | 0438                          |  | 0458                            |  | 1398                                       |  | 1418            |  | 1438                          |  | 1458                            |  | 2398                                  |  | 2418            |  | 2438                          |  | 2458                            |  |
| Otros                                        | 0399                        |  | 0419            |  | 0439                          |  | 0459                            |  | 1399                                       |  | 1419            |  | 1439                          |  | 1459                            |  | 2399                                  |  | 2419            |  | 2439                          |  | 2459                            |  |

|                                                           |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|-----------------------------------------------------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| S.05.1                                                    |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Denominación Fondo: HT Working Capital, FT                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Denominación del compartimento:                           |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Estados agregados: SI                                     |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Fecha: 31/03/2021                                         |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Entidades cedentes de los activos titulizados:            |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

## 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          | 0 | 0467                        | 0 | 0474                                 | 0 | 0481                                    | 0 | 0488  | 0 | 0495                           | 0 | 0502           | 0 | 0509        | 0 |
| De 1 a 3 meses                   | 0461          | 0 | 0468                        | 0 | 0475                                 | 0 | 0482                                    | 0 | 0489  | 0 | 0496                           | 0 | 0503           | 0 | 0510        | 0 |
| De 3 a 6 meses                   | 0462          | 0 | 0469                        | 0 | 0476                                 | 0 | 0483                                    | 0 | 0490  | 0 | 0497                           | 0 | 0504           | 0 | 0511        | 0 |
| De 6 a 9 meses                   | 0463          | 0 | 0470                        | 0 | 0477                                 | 0 | 0484                                    | 0 | 0491  | 0 | 0498                           | 0 | 0505           | 0 | 0512        | 0 |
| De 9 a 12 meses                  | 0464          | 0 | 0471                        | 0 | 0478                                 | 0 | 0485                                    | 0 | 0492  | 0 | 0499                           | 0 | 0506           | 0 | 0513        | 0 |
| Más de 12 meses                  | 0465          | 0 | 0472                        | 0 | 0479                                 | 0 | 0486                                    | 0 | 0493  | 0 | 0500                           | 0 | 0507           | 0 | 0514        | 0 |
| Total                            | 0466          | 0 | 0473                        | 0 | 0480                                 | 0 | 0487                                    | 0 | 0494  | 0 | 0501                           | 0 | 0508           | 0 | 1515        | 0 |

| Impagados con garantía real<br>(miles de euros) | Nº de activos |   | Importe impagado               |   |                                            |   |                                               |   |       |   | Principal pendiente<br>no vencido |   | Otros importes |   | Deuda Total |   | Valor garantía |   | Valor Garantía con<br>Tasación > 2 años |   | % Deuda / v.<br>Tasación |  |
|-------------------------------------------------|---------------|---|--------------------------------|---|--------------------------------------------|---|-----------------------------------------------|---|-------|---|-----------------------------------|---|----------------|---|-------------|---|----------------|---|-----------------------------------------|---|--------------------------|--|
|                                                 |               |   | Principal pendiente<br>vencido |   | Intereses<br>devengados en<br>contabilidad |   | Intereses<br>interrumpidos en<br>contabilidad |   | Total |   |                                   |   |                |   |             |   |                |   |                                         |   |                          |  |
| Hasta 1 mes                                     | 0515          | 0 | 0522                           | 0 | 0529                                       | 0 | 0536                                          | 0 | 0543  | 0 | 0550                              | 0 | 0557           | 0 | 0564        | 0 | 0571           | 0 | 0578                                    | 0 | 0584                     |  |
| De 1 a 3 meses                                  | 0516          | 0 | 0523                           | 0 | 0530                                       | 0 | 0537                                          | 0 | 0544  | 0 | 0551                              | 0 | 0558           | 0 | 0565        | 0 | 0572           | 0 | 0579                                    | 0 | 0585                     |  |
| De 3 a 6 meses                                  | 0517          | 0 | 0524                           | 0 | 0531                                       | 0 | 0538                                          | 0 | 0545  | 0 | 0552                              | 0 | 0559           | 0 | 0566        | 0 | 0573           | 0 | 0580                                    | 0 | 0586                     |  |
| De 6 a 9 meses                                  | 0518          | 0 | 0525                           | 0 | 0532                                       | 0 | 0539                                          | 0 | 0546  | 0 | 0553                              | 0 | 0560           | 0 | 0567        | 0 | 0574           | 0 | 0581                                    | 0 | 0587                     |  |
| De 9 a 12 meses                                 | 0519          | 0 | 0526                           | 0 | 0533                                       | 0 | 0540                                          | 0 | 0547  | 0 | 0554                              | 0 | 0561           | 0 | 0568        | 0 | 0575           | 0 | 0582                                    | 0 | 0588                     |  |
| Más de 12 meses                                 | 0520          | 0 | 0527                           | 0 | 0534                                       | 0 | 0541                                          | 0 | 0548  | 0 | 0555                              | 0 | 0562           | 0 | 0569        | 0 | 0576           | 0 | 0583                                    | 0 | 0589                     |  |
| Total                                           | 0521          | 0 | 0528                           | 0 | 0535                                       | 0 | 0542                                          | 0 | 0549  | 0 | 0556                              | 0 | 0563           | 0 | 0570        | 0 | 0577           | 0 |                                         |   | 0590                     |  |

|                                                                  |
|------------------------------------------------------------------|
| <b>S.05.1</b>                                                    |
| <b>Denominación Fondo:</b> HT Working Capital, FT                |
| <b>Denominación del compartimento:</b>                           |
| <b>Denominación de la gestora:</b> HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |
| <b>Estados agregados:</b> SI                                     |
| <b>Fecha:</b> 31/03/2021                                         |
| <b>Entidades cedentes de los activos titulizados:</b>            |

## INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

### CUADRO C

| Vida residual de los activos titulizados (miles de euros) | Principal pendiente         |              |                                            |              |                              |             |
|-----------------------------------------------------------|-----------------------------|--------------|--------------------------------------------|--------------|------------------------------|-------------|
|                                                           | Situación actual 31/03/2021 |              | Situación cierre anual anterior 31/12/2020 |              | Situación inicial 01/12/2020 |             |
| Inferior a 1 año                                          | 0600                        | 7.585        | 1600                                       | 7.794        | 2600                         | 177         |
| Entre 1 y 2 años                                          | 0601                        | 0            | 1601                                       | 0            | 2601                         |             |
| Entre 2 y 3 años                                          | 0602                        | 0            | 1602                                       | 0            | 2602                         |             |
| Entre 3 y 4 años                                          | 0603                        | 0            | 1603                                       | 0            | 2603                         |             |
| Entre 4 y 5 años                                          | 0604                        | 0            | 1604                                       | 0            | 2604                         |             |
| Entre 5 y 10 años                                         | 0605                        | 0            | 1605                                       | 0            | 2605                         |             |
| Superior a 10 años                                        | 0606                        | 0            | 1606                                       | 0            | 2606                         |             |
| <b>Total</b>                                              | 0607                        | <b>7.585</b> | 1607                                       | <b>7.794</b> | 2607                         | <b>177</b>  |
| <b>Vida residual media ponderada (años)</b>               | 0608                        | <b>0,13</b>  | 1608                                       | <b>0,26</b>  | 2608                         | <b>0,35</b> |

| Antigüedad                        | Situación actual 31/03/2021 |  | Situación cierre anual anterior 31/12/2020 |  | Situación inicial 01/12/2020 |  |
|-----------------------------------|-----------------------------|--|--------------------------------------------|--|------------------------------|--|
| Antigüedad media ponderada (años) | 0609                        |  | 1609                                       |  | 2609                         |  |

|                                                           |        |
|-----------------------------------------------------------|--------|
|                                                           | S.05.1 |
| Denominación Fondo: HT Working Capital, FT                |        |
| Denominación del compartimento:                           |        |
| Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |        |
| Estados agregados: SI                                     |        |
| Fecha: 31/03/2021                                         |        |
| Entidades cedentes de los activos titulizados:            |        |

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

| Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros) | Situación actual 31/03/2021 |          |                     |          | Situación cierre anual anterior 31/12/2020 |          |                     |          | Situación inicial 01/12/2020 |  |                     |  |
|-------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|----------|---------------------|----------|--------------------------------------------|----------|---------------------|----------|------------------------------|--|---------------------|--|
|                                                                         | Nº de activos vivos         |          | Principal pendiente |          | Nº de activos vivos                        |          | Principal pendiente |          | Nº de activos vivos          |  | Principal pendiente |  |
| 0% - 40%                                                                | 0620                        | 0        | 0630                | 0        | 1620                                       | 0        | 1630                | 0        | 2620                         |  | 2630                |  |
| 40% - 60%                                                               | 0621                        | 0        | 0631                | 0        | 1621                                       | 0        | 1631                | 0        | 2621                         |  | 2631                |  |
| 60% - 80%                                                               | 0622                        | 0        | 0632                | 0        | 1622                                       | 0        | 1632                | 0        | 2622                         |  | 2632                |  |
| 80% - 100%                                                              | 0623                        | 0        | 0633                | 0        | 1623                                       | 0        | 1633                | 0        | 2623                         |  | 2633                |  |
| 100% - 120%                                                             | 0624                        | 0        | 0634                | 0        | 1624                                       | 0        | 1634                | 0        | 2624                         |  | 2634                |  |
| 120% - 140%                                                             | 0625                        | 0        | 0635                | 0        | 1625                                       | 0        | 1635                | 0        | 2625                         |  | 2635                |  |
| 140% - 160%                                                             | 0626                        | 0        | 0636                | 0        | 1626                                       | 0        | 1636                | 0        | 2626                         |  | 2636                |  |
| superior al 160%                                                        | 0627                        | 0        | 0637                | 0        | 1627                                       | 0        | 1637                | 0        | 2627                         |  | 2637                |  |
| <b>Total</b>                                                            | 0628                        | <b>0</b> | 0638                | <b>0</b> | 1628                                       | <b>0</b> | 1638                | <b>0</b> | 2628                         |  | 2638                |  |
| <b>Media ponderada (%)</b>                                              | 0639                        |          | 0649                |          | 1639                                       |          | 1649                |          | 2639                         |  | 2649                |  |

|                                                           |        |
|-----------------------------------------------------------|--------|
|                                                           | S.05.1 |
| Denominación Fondo: HT Working Capital, FT                |        |
| Denominación del compartimento:                           |        |
| Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |        |
| Estados agregados: SI                                     |        |
| Fecha: 31/03/2021                                         |        |
| Entidades cedentes de los activos titulizados:            |        |

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

| Tipos de interés de los activos titulizados (%) | Situación actual<br>31/03/2021 |      | Situación cierre anual anterior<br>31/12/2020 |      | Situación inicial 01/12/2020 |  |
|-------------------------------------------------|--------------------------------|------|-----------------------------------------------|------|------------------------------|--|
| Tipo de interés medio ponderado                 | 0650                           | 5,78 | 1650                                          | 7,87 | 2650                         |  |
| Tipo de interés nominal máximo                  | 0651                           | 7,87 | 1651                                          | 7,87 | 2651                         |  |
| Tipo de interés nominal mínimo                  | 0652                           | 6,30 | 1652                                          | 0    | 2652                         |  |

|                                                           |        |
|-----------------------------------------------------------|--------|
|                                                           | S.05.1 |
| Denominación Fondo: HT Working Capital, FT                |        |
| Denominación del compartimento:                           |        |
| Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |        |
| Estados agregados: SI                                     |        |
| Fecha: 31/03/2021                                         |        |
| Entidades cedentes de los activos titulizados:            |        |

## INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

### CUADRO F

| Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros) | Situación actual 31/03/2021 |           |                     |              | Situación cierre anual anterior 31/12/2020 |           |                     |              | Situación inicial 01/12/2020 |          |                     |            |
|--------------------------------------------------------------|-----------------------------|-----------|---------------------|--------------|--------------------------------------------|-----------|---------------------|--------------|------------------------------|----------|---------------------|------------|
|                                                              | Nº de activos vivos         |           | Principal pendiente |              | Nº de activos vivos                        |           | Principal pendiente |              | Nº de activos vivos          |          | Principal pendiente |            |
| Andalucía                                                    | 0660                        | 3         | 0683                | 63           | 1660                                       | 0         | 1683                | 0            | 2660                         |          | 2683                |            |
| Aragón                                                       | 0661                        | 5         | 0684                | 47           | 1661                                       | 0         | 1684                | 0            | 2661                         |          | 2684                |            |
| Asturias                                                     | 0662                        | 2         | 0685                | 486          | 1662                                       | 2         | 1685                | 486          | 2662                         |          | 2685                |            |
| Baleares                                                     | 0663                        | 4         | 0686                | 15           | 1663                                       | 0         | 1686                | 0            | 2663                         |          | 2686                |            |
| Canarias                                                     | 0664                        | 0         | 0687                | 0            | 1664                                       | 0         | 1687                | 0            | 2664                         |          | 2687                |            |
| Cantabria                                                    | 0665                        | 0         | 0688                | 0            | 1665                                       | 0         | 1688                | 0            | 2665                         |          | 2688                |            |
| Castilla-León                                                | 0666                        | 12        | 0689                | 630          | 1666                                       | 5         | 1689                | 1.042        | 2666                         |          | 2689                |            |
| Castilla La Mancha                                           | 0667                        | 3         | 0690                | 82           | 1667                                       | 4         | 1690                | 78           | 2667                         |          | 2690                |            |
| Cataluña                                                     | 0668                        | 4         | 0691                | 907          | 1668                                       | 12        | 1691                | 2.431        | 2668                         | 1        | 2691                | 177        |
| Ceuta                                                        | 0669                        | 0         | 0692                | 0            | 1669                                       | 0         | 1692                | 0            | 2669                         |          | 2692                |            |
| Extremadura                                                  | 0670                        | 0         | 0693                | 0            | 1670                                       | 0         | 1693                | 0            | 2670                         |          | 2693                |            |
| Galicia                                                      | 0671                        | 0         | 0694                | 0            | 1671                                       | 0         | 1694                | 0            | 2671                         |          | 2694                |            |
| Madrid                                                       | 0672                        | 0         | 0695                | 0            | 1672                                       | 0         | 1695                | 0            | 2672                         |          | 2695                |            |
| Melilla                                                      | 0673                        | 0         | 0696                | 0            | 1673                                       | 0         | 1696                | 0            | 2673                         |          | 2696                |            |
| Murcia                                                       | 0674                        | 5         | 0697                | 31           | 1674                                       | 1         | 1697                | 24           | 2674                         |          | 2697                |            |
| Navarra                                                      | 0675                        | 0         | 0698                | 0            | 1675                                       | 0         | 1698                | 0            | 2675                         |          | 2698                |            |
| La Rioja                                                     | 0676                        | 0         | 0699                | 0            | 1676                                       | 0         | 1699                | 0            | 2676                         |          | 2699                |            |
| Comunidad Valenciana                                         | 0677                        | 6         | 0700                | 1.500        | 1677                                       | 6         | 1700                | 1.500        | 2677                         |          | 2700                |            |
| País Vasco                                                   | 0678                        | 17        | 0701                | 3.769        | 1678                                       | 10        | 1701                | 2.233        | 2678                         |          | 2701                |            |
| <b>Total España</b>                                          | 0679                        | <b>61</b> | 0702                | <b>7.530</b> | 1679                                       | <b>40</b> | 1702                | <b>7.794</b> | 2679                         | <b>1</b> | 2702                | <b>177</b> |
| Otros países Unión Europea                                   | 0680                        | 7         | 0703                | 55           | 1680                                       | 0         | 1703                | 0            | 2680                         |          | 2703                |            |
| Resto                                                        | 0681                        | 0         | 0704                | 0            | 1681                                       | 0         | 1704                | 0            | 2681                         |          | 2704                |            |
| <b>Total general</b>                                         | 0682                        | <b>68</b> | 0705                | <b>7.585</b> | 1682                                       | <b>40</b> | 1705                | <b>7.794</b> | 2682                         | <b>1</b> | 2705                | <b>177</b> |

HT Working Capital, FT

|                                                           |        |
|-----------------------------------------------------------|--------|
|                                                           | S.05.1 |
| Denominación Fondo: HT Working Capital, FT                |        |
| Denominación del compartimento:                           |        |
| Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |        |
| Estados agregados: SI                                     |        |
| Fecha: 31/03/2021                                         |        |
| Entidades cedentes de los activos titulizados:            |        |

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

| Concentración                                         | Situación actual 31/03/2021 |   |      |  | Situación cierre anual anterior 31/12/2020 |       |      |  | Situación inicial 01/12/2020 |  |      |  |
|-------------------------------------------------------|-----------------------------|---|------|--|--------------------------------------------|-------|------|--|------------------------------|--|------|--|
|                                                       | Porcentaje                  |   | CNAE |  | Porcentaje                                 |       | CNAE |  | Porcentaje                   |  | CNAE |  |
| Diez primeros deudores/emisores con más concentración | 0710                        | 0 |      |  | 1710                                       | 98,69 |      |  | 2710                         |  |      |  |
| Sector                                                | 0711                        |   | 0712 |  | 1711                                       |       | 1712 |  | 2711                         |  | 2712 |  |

HT Working Capital, FT

|                                                           |        |
|-----------------------------------------------------------|--------|
|                                                           | S.05.2 |
| Denominación Fondo: HT Working Capital, FT                |        |
| Denominación del compartimento:                           |        |
| Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |        |
| Estados agregados: SI                                     |        |
| Periodo de la declaración: 31/03/2021                     |        |
| Mercados de cotización de los valores emitidos: Otros     |        |

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

| (miles de euros) |                    | Situación actual 31/03/2021 |                           |                     | Situación cierre anual anterior 31/12/2020 |                           |                     | Situación Inicial 01/12/2020 |                           |                     |
|------------------|--------------------|-----------------------------|---------------------------|---------------------|--------------------------------------------|---------------------------|---------------------|------------------------------|---------------------------|---------------------|
| Serie            | Denominación serie | Nº de pasivos emitidos      |                           | Principal pendiente | Nº de pasivos emitidos                     |                           | Principal pendiente | Nº de pasivos emitidos       |                           | Principal pendiente |
|                  |                    | 0720                        | Nominal unitario (€) 0721 |                     | 1720                                       | Nominal unitario (€) 1721 |                     | 2720                         | Nominal unitario (€) 2721 |                     |
| ES0505526006     | Pagare1            | 0                           | 0                         | 0                   | 2                                          | 100.000                   | 200                 | 2                            | 100.000                   | 200                 |
| ES0505526014     | Pagare2            | 53                          | 100.000                   | 5.078               | 53                                         | 100.000                   | 5.078               | 0                            | 0                         | 0                   |
| ES0505526022     | Pagare3            | 23                          | 100.000                   | 2.282               | 23                                         | 100.000                   | 2.282               | 0                            | 0                         | 0                   |
| <b>Total</b>     |                    | 0723 76                     |                           | 0724 7.360          | 1723 78                                    |                           | 1724 7.560          | 2723 2                       |                           | 2724 200            |

HT Working Capital, FT

|                                                           |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|-----------------------------------------------------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| S.05.2                                                    |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Denominación Fondo: HT Working Capital, FT                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Denominación del compartimento:                           |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Estados agregados: SI                                     |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Periodo de la declaración: 31/03/2021                     |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Mercados de cotización de los valores emitidos: Otros     |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

## 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 |
| ES0505526006     | Pagare1            | NS                     | FIJO                 | 0      | 1             | 0                    |    | 0                   |   | NO                                    | 0                    |       | 0                  |                 | 0     |                                                   |      |      |
| ES0505526014     | Pagare2            | NS                     | FIJO                 | 0      | 2,18          | 32                   |    | 0                   |   | NO                                    | 5.078                |       | 0                  |                 | 5.110 |                                                   |      |      |
| ES0505526022     | Pagare3            | NS                     | FIJO                 | 0      | 1,08          | 7                    |    | 0                   |   | NO                                    | 2.282                |       | 0                  |                 | 2.289 |                                                   |      |      |
| Total            |                    |                        |                      |        |               | 0740                 | 39 | 0741                | 0 |                                       | 0743                 | 7.360 | 0744               | 0               | 0745  | 7.399                                             | 0746 | -290 |

|                                                                                  | Situación actual 31/03/2021 |      | Situación cierre anual anterior 31/12/2020 |      | Situación inicial 01/12/2020 |      |
|----------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|------|--------------------------------------------|------|------------------------------|------|
| Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%) | 0747                        | 1,83 | 0748                                       | 1,83 | 0749                         | 2,10 |

HT Working Capital, FT

|                                                           |        |
|-----------------------------------------------------------|--------|
|                                                           | S.05.2 |
| Denominación Fondo: HT Working Capital, FT                |        |
| Denominación del compartimento:                           |        |
| Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |        |
| Estados agregados: SI                                     |        |
| Periodo de la declaración: 31/03/2021                     |        |
| Mercados de cotización de los valores emitidos: Otros     |        |

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

| (miles de euros) |                    | Situación actual 31/03/2021 |     |                  |     |                   |   |                  |   | Situación periodo comparativo anterior 31/03/2020 |   |                  |   |                   |   |                  |   |
|------------------|--------------------|-----------------------------|-----|------------------|-----|-------------------|---|------------------|---|---------------------------------------------------|---|------------------|---|-------------------|---|------------------|---|
| 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             |   |
| ES0505526014     | Pagare2            |                             |     |                  |     |                   |   |                  |   |                                                   |   |                  |   |                   |   |                  |   |
| ES0505526022     | Pagare3            |                             |     |                  |     |                   |   |                  |   |                                                   |   |                  |   |                   |   |                  |   |
| ES0505526006     | Pagare1            |                             | 200 |                  | 200 |                   |   |                  |   |                                                   |   |                  |   |                   |   |                  |   |
| <b>Total</b>     |                    | 0754                        | 200 | 0755             | 200 | 0756              | 0 | 0757             | 0 | 1754                                              | 0 | 1755             | 0 | 1756              | 0 | 1757             | 0 |

HT Working Capital, FT

|                                                           |        |
|-----------------------------------------------------------|--------|
|                                                           | S.05.2 |
| Denominación Fondo: HT Working Capital, FT                |        |
| Denominación del compartimento:                           |        |
| Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |        |
| Estados agregados: SI                                     |        |
| Periodo de la declaración: 31/03/2021                     |        |
| Mercados de cotización de los valores emitidos: Otros     |        |

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                        |                                                    |                                      |
|--------------|--------------------|------------------------------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------------------------|--------------------------------------|
|              |                    | 0760                                           | 0761                                   | Situación actual 31/03/2021<br>0762 | Situación cierre anual anterior 31/12/2020<br>0763 | Situación inicial 01/12/2020<br>0764 |
| ES0505526014 | Pagare2            | 23/11/2020                                     | OTROS                                  | A+                                  | A+                                                 |                                      |
| ES0505526022 | Pagare3            | 23/11/2020                                     | OTROS                                  | A+                                  | A+                                                 |                                      |
| ES0505526006 | Pagare1            | 23/11/2020                                     | OTROS                                  | A+                                  | A+                                                 |                                      |

HT Working Capital, FT

|                                                           |        |
|-----------------------------------------------------------|--------|
|                                                           | S.05.2 |
| Denominación Fondo: HT Working Capital, FT                |        |
| Denominación del compartimento:                           |        |
| Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |        |
| Estados agregados: SI                                     |        |
| Periodo de la declaración: 31/03/2021                     |        |
| Mercados de cotización de los valores emitidos: Otros     |        |

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 31/03/2021 |              | Situación cierre anual anterior 31/12/2020 |              | Situación inicial 01/12/2020 |             |
| Inferior a 1 año                                                                         | 0765                        | 2.282        | 1765                                       | 2.482        | 2765                         | 200         |
| Entre 1 y 2 años                                                                         | 0766                        | 5.078        | 1766                                       | 5.078        | 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                        |              | 1770                                       |              | 2770                         |             |
| Superior a 10 años                                                                       | 0771                        |              | 1771                                       |              | 2771                         |             |
| <b>Total</b>                                                                             | 0772                        | <b>7.360</b> | 1772                                       | <b>7.560</b> | 2772                         | <b>200</b>  |
| <b>Vida residual media ponderada (años)</b>                                              | 0773                        | <b>1,31</b>  | 1773                                       | <b>1,56</b>  | 2773                         | <b>0,30</b> |

|                                                                  |        |
|------------------------------------------------------------------|--------|
|                                                                  | S.05.3 |
| <b>Denominación Fondo: HT Working Capital, FT</b>                |        |
| <b>Denominación del compartimento:</b>                           |        |
| <b>Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.</b> |        |
| <b>Estados agregados: SI</b>                                     |        |
| <b>Fecha: 31/03/2021</b>                                         |        |

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

| Información sobre las mejoras crediticias del Fondo |                                                                                                                | Situación actual 31/03/2021 |                    | Situación cierre anual anterior 31/12/2020 |                    | Situación inicial 01/12/2020 |                    |
|-----------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|--------------------|--------------------------------------------|--------------------|------------------------------|--------------------|
| 1                                                   | Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)                                                      | 0775                        | 0                  | 1775                                       |                    | 2775                         |                    |
| 1.1                                                 | Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)                                                           | 0776                        | 0                  | 1776                                       |                    | 2776                         |                    |
| 1.2                                                 | Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)               | 0777                        | 0                  | 1777                                       |                    | 2777                         |                    |
| 1.3                                                 | Denominación de la contrapartida                                                                               | 0778                        | Notas Explicativas | 1778                                       | Notas Explicativas | 2778                         | Notas Explicativas |
| 1.4                                                 | Rating de la contrapartida                                                                                     | 0779                        | Notas Explicativas | 1779                                       | Notas Explicativas | 2779                         | Notas Explicativas |
| 1.5                                                 | Rating requerido de la contrapartida                                                                           | 0780                        | Notas Explicativas | 1780                                       | Notas Explicativas | 2780                         | Notas Explicativas |
| 2                                                   | Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)                                                  | 0781                        | 0                  | 1781                                       |                    | 2781                         |                    |
| 2.1                                                 | Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%) | 0782                        | 0                  | 1782                                       |                    | 2782                         |                    |
| 2.2                                                 | Denominación de la contrapartida                                                                               | 0783                        | Notas Explicativas | 1783                                       | Notas Explicativas | 2783                         | Notas Explicativas |
| 2.3                                                 | Rating de la contrapartida                                                                                     | 0784                        | Notas Explicativas | 1784                                       | Notas Explicativas | 2784                         | Notas Explicativas |
| 2.4                                                 | Rating requerido de la contrapartida                                                                           | 0785                        |                    | 1785                                       | Notas Explicativas | 2785                         | Notas Explicativas |
| 3                                                   | Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)                                       | 0786                        | 0                  | 1786                                       |                    | 2786                         |                    |
| 3.1                                                 | Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)                               | 0787                        | 0                  | 1787                                       |                    | 2787                         |                    |
| 3.2                                                 | Denominación de la entidad avalista                                                                            | 0788                        | Notas Explicativas | 1788                                       | Notas Explicativas | 2788                         | Notas Explicativas |
| 3.3                                                 | Rating del avalista                                                                                            | 0789                        | Notas Explicativas | 1789                                       | Notas Explicativas | 2789                         | Notas Explicativas |
| 3.4                                                 | Rating requerido del avalista                                                                                  | 0790                        | Notas Explicativas | 1790                                       | Notas Explicativas | 2790                         | Notas Explicativas |
| 4                                                   | Subordinación de series (S/N)                                                                                  | 0791                        | N                  | 1791                                       | N                  | 2791                         | N                  |
| 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                         |                    |

HT Working Capital, FT

|                                                           |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|-----------------------------------------------------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| S.05.3                                                    |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Denominación Fondo: HT Working Capital, FT                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Denominación del compartimento:                           |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Estados agregados: SI                                     |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Fecha: 31/03/2021                                         |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

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 31/03/2021      |  | Situación cierre anual anterior 31/12/2020 |  | Situación inicial 01/12/2020 |  |                       |  |
|                      | 0800          | 0801                     | 0802                         | 0803     | 0804                                 | 0805     | 0806                             |  | 1806                                       |  | 2806                         |  |                       |  |
| Total                |               |                          |                              |          |                                      |          | 0808                             |  | 0809                                       |  | 0810                         |  |                       |  |

|                                                           |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|-----------------------------------------------------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| S.05.3                                                    |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Denominación Fondo: HT Working Capital, FT                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Denominación del compartimento:                           |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Estados agregados: SI                                     |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Fecha: 31/03/2021                                         |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

| GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS               | Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros) |  |                                            |  |                              |  | Valor en libros (miles de euros) |  |                                            |  |                              |  | Otras características |  |
|----------------------------------------------|-----------------------------------------------------|--|--------------------------------------------|--|------------------------------|--|----------------------------------|--|--------------------------------------------|--|------------------------------|--|-----------------------|--|
| Naturaleza riesgo cubierto                   | Situación actual 31/03/2021                         |  | Situación cierre anual anterior 31/12/2020 |  | Situación inicial 01/12/2020 |  | Situación actual 31/03/2021      |  | Situación cierre anual anterior 31/12/2020 |  | Situación inicial 01/12/2020 |  |                       |  |
| 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                  |  |

HT Working Capital, FT

|                                                           |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|-----------------------------------------------------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| S.05.4                                                    |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Denominación Fondo: HT Working Capital, FT                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Denominación del compartimento:                           |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Estados agregados: SI                                     |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Fecha: 31/03/2021                                         |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

**INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO**

**CUADRO A**

|                                                                   |              |   |             |   | Importe impagado acumulado  |   |                                            |   | Ratio                       |   |                                            |   |                   |   | Ref. Folleto |  |
|-------------------------------------------------------------------|--------------|---|-------------|---|-----------------------------|---|--------------------------------------------|---|-----------------------------|---|--------------------------------------------|---|-------------------|---|--------------|--|
| Concepto                                                          | Meses impago |   | Días impago |   | Situación actual 31/03/2021 |   | Situación cierre anual anterior 31/12/2020 |   | Situación actual 31/03/2021 |   | Situación cierre anual anterior 31/12/2020 |   | Última Fecha Pago |   |              |  |
| 1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a  | 7000         | 0 | 7002        | 0 | 7003                        | 0 | 7006                                       | 0 | 7009                        |   | 7012                                       |   | 7015              |   |              |  |
| 2. Activos Morosos por otras razones                              |              |   |             |   | 7004                        |   | 7007                                       |   | 7010                        |   | 7013                                       |   | 7016              |   |              |  |
| Total Morosos                                                     |              |   |             |   | 7005                        | 0 | 7008                                       | 0 | 7011                        |   | 7014                                       |   | 7017              | 0 | 7018         |  |
| 3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a | 7019         | 0 | 7020        | 0 | 7021                        | 0 | 7024                                       | 0 | 7027                        |   | 7030                                       |   | 7033              |   |              |  |
| 4. Activos Fallidos por otras razones                             |              |   |             |   | 7022                        | 0 | 7025                                       | 0 | 7028                        |   | 7031                                       |   | 7034              |   |              |  |
| Total Fallidos                                                    |              |   |             |   | 7023                        | 0 | 7026                                       | 0 | 7029                        | 0 | 7032                                       | 0 | 7035              | 0 | 7036         |  |

|                         | Ratio                       |  |                                            |  |                   |  | Ref. Folleto |  |
|-------------------------|-----------------------------|--|--------------------------------------------|--|-------------------|--|--------------|--|
| Otras ratios relevantes | Situación actual 31/03/2021 |  | Situación cierre anual anterior 31/12/2020 |  | Última Fecha Pago |  |              |  |
|                         | 0850                        |  | 1850                                       |  | 2850              |  | 3850         |  |
|                         | 0851                        |  | 1851                                       |  | 2851              |  | 3851         |  |
|                         | 0852                        |  | 1852                                       |  | 2852              |  | 3852         |  |
|                         | 0853                        |  | 1853                                       |  | 2853              |  | 3853         |  |

HT Working Capital, FT

|                                                           |        |
|-----------------------------------------------------------|--------|
|                                                           | S.05.4 |
| Denominación Fondo: HT Working Capital, FT                |        |
| Denominación del compartimento:                           |        |
| Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |        |
| Estados agregados: SI                                     |        |
| Fecha: 31/03/2021                                         |        |

## 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               |
| OTROS TRIGGERS                                | 0857   | 0861     | 1861              | 2861               |

Cuadro de texto libre

### CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional  
en fichero adjunto

HT Working Capital, FT

|                                                           |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|-----------------------------------------------------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| S.05.5                                                    |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Denominación Fondo: HT Working Capital, FT                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Denominación del compartimento:                           |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Estados agregados: SI                                     |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| Fecha: 31/03/2021                                         |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

**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          |  | 1862                          |  | 2862                                   |  | 3862    |  | 4862                    |  | 5862                    |  | 6862                                        |  | 7862                                              |  | 8862                  |  |
| Comisión administrador               | 0863          |  | 1863                          |  | 2863                                   |  | 3863    |  | 4863                    |  | 5863                    |  | 6863                                        |  | 7863                                              |  | 8863                  |  |
| Comisión del agente financiero/pagos | 0864          |  | 1864                          |  | 2864                                   |  | 3864    |  | 4864                    |  | 5864                    |  | 6864                                        |  | 7864                                              |  | 8864                  |  |
| Otras                                | 0865          |  | 1865                          |  | 2865                                   |  | 3865    |  | 4865                    |  | 5865                    |  | 6865                                        |  | 7865                                              |  | 8865                  |  |

HT Working Capital, FT

|                                                           |        |
|-----------------------------------------------------------|--------|
|                                                           | S.05.5 |
| Denominación Fondo: HT Working Capital, FT                |        |
| Denominación del compartimento:                           |        |
| Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |        |
| Estados agregados: SI                                     |        |
| Fecha: 31/03/2021                                         |        |

## INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

### CUADRO B

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

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

HT Working Capital, FT

|                                                           |        |
|-----------------------------------------------------------|--------|
|                                                           | S.05.5 |
| Denominación Fondo: HT Working Capital, FT                |        |
| Denominación del compartimento:                           |        |
| Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |        |
| Estados agregados: SI                                     |        |
| Fecha: 31/03/2021                                         |        |

|                                   |
|-----------------------------------|
| 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 Working Capital, FT                |      |
| Denominación del compartimento:                           |      |
| Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |      |
| Estados agregados: SI                                     |      |
| Fecha: 31/03/2021                                         |      |

|                                                                                                                                                                    |  |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|
| NOTAS EXPLICATIVAS                                                                                                                                                 |  |
| <div> <p>Contiene</p>  <p>Información adicional<br/>en fichero adjunto</p> </div> |  |

|                    |
|--------------------|
| INFORME DE AUDITOR |
|--------------------|

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