

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT COLATERALES GLOBAL EMPRESAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8950
NIF Fondo: V85306850
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: SI
Fecha: 30/06/2018

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: AyT Colaterales Global Empresas, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001		1001	
I. Activos financieros a largo plazo	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	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	30.560	1041	32.912
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	12.240	1043	14.136
1. Activos titulizados	0044	12.240	1044	14.136
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	11.797	1051	13.722
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	19	1065	24
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	10	1066	7
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	2.337	1067	2.283
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	26	1068	25
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-1.949	1069	-1.926
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	
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	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082		1082	
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084		1084	
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	18.320	1085	18.775
1. Tesorería	0086	18.320	1086	18.775
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	30.560	1088	32.912

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089		1089	
I. Provisiones a largo plazo	0090		1090	
1. Provisión garantías financieras	0091		1091	
2. Provisión por margen de intermediación	0092		1092	
3. Otras provisiones	0093		1093	
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094		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	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) PASIVO CORRIENTE	0117	30.694	1117	32.944
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	
V. Provisiones a corto plazo	0119		1119	
1. Provisión garantías financieras	0120		1120	
2. Provisión por margen de intermediación	0121		1121	
3. Otras provisiones	0122		1122	
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	30.671	1123	32.905
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	13.372	1124	15.464
1.1 Series no subordinadas	0125		1125	
1.2 Series subordinadas	0126	13.302	1126	15.387
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	70	1128	77
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	17.060	1131	17.170
2.1 Préstamo subordinado	0132	18.132	1132	18.132
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	-5.478	1135	-5.177
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	103	1136	103
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	4.303	1137	4.112
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	238	1139	271
3.1 Derivados de cobertura	0140	238	1140	271
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	1
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	1
4.2 Garantías financieras	0145		1145	0
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	23	1148	39
1. Comisiones	0149	2	1149	2
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	2	1150	2
1.2 Comisión administrador	0151	72	1151	71
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152		1152	
1.4 Comisión variable	0153	138	1153	138
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-210	1155	-209
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	21	1157	36
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-133	1158	-32
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-133	1160	-32
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	30.560	1162	32.912

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/06/2018

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2018		Acumulado anterior 30/06/2017
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	110	1201	187	2201	238	3201	355
1.1 Activos titulizados	0202	110	1202	187	2202	238	3202	355
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203		3203	
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-162	1204	-175	2204	-327	3204	-360
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-66	1205	-79	2205	-136	3205	-166
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-96	1206	-97	2206	-191	3206	-193
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-85	1208	-84	2208	-183	3208	-217
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-138	1209	-72	2209	-272	3209	-221
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216		3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-3	1217	-3	2217	-6	3217	-7
7.1 Servicios exteriores	0218	0	1218	0	2218	-1	3218	-1
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219	0	2219	-1	3219	-1
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	
7.2 Tributos	0223	0	1223	-1	2223		3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-2	1224	-3	2224	-5	3224	-6
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-2	1225	-2	2225	-4	3225	-5
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	-1	2226	-1	3226	-1
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227		3227	
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228		3228	
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230		3230	
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-6	1231	111	2231	-23	3231	111
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-6	1232	111	2232	-23	3232	111
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233		3233	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234	0	2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238		3238	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	147	1239	-36	2239	301	3239	117
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241		3241	
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/06/2018

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2018		Acumulado anterior 30/06/2017
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	68	1300	126	2300	-243	3300	-184
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	84	1301	197	2301	-221	3301	-179
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	111	1302	197	2302	239	3302	366
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-27	1303	0	2303	-142	3303	-176
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	54	3304	83
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	-371	3305	-452
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	0	1309	0	2309	-4	3309	-5
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	0	1310	0	2310	-4	3310	-5
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	0
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-16	1315	-71	2315	-17	3315	-1
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	-16	1320	-1	2320	-17	3320	-1
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	-70	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	843	1322	1.153	2322	-213	3322	-626
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	843	1325	1.153	2325	-213	3325	-626
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	0	1326	610	2326	355	3326	1.186
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	178	1327	313	2327	543	3327	1.429
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	665	1328	231	2328	974	3328	474
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	0	1331	0	2331	-2.085	3331	-3.714
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332	0	2332	0	3332	0
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336	0	2336	0	3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	911	1337	1.280	2337	-455	3337	-810
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	17.409	1338	16.944	2338	18.775	3338	19.034
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	18.320	1339	18.224	2339	18.320	3339	18.224

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/06/2018

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2018		Acumulado anterior 30/06/2017
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-53	1357	16	2357	-284	3357	-140
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-53	1358	16	2358	-284	3358	-140
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	85	1360	84	2360	183	3360	217
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-31	1362	-101	2362	101	3362	-76
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368		3368	
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369		3369	
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/06/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2018								Situación cierre anual anterior 31/12/2017								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	0	2400	0	2420	0	2440	0
Certificados de transmisión de hipoteca	0381		0401		0421		0441		1381		1401		1421		1441		2381	0	2401	0	2421	0	2441	0
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382	0	2402	0	2422	0	2442	0
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383	0	2403	0	2423	0	2443	0
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384	0	2404	0	2424	0	2444	0
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385	0	2405	0	2425	0	2445	0
Préstamos a empresas	0386	16,54	0406	0	0426	0	0446	12,45	1386	14,27	1406	0	1426	0	1446	15,32	2386	3	2406	0,37	2426	0	2446	0
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387	0	2407	0	2427	0	2447	0
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388	0	2408	0	2428	0	2448	0
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389	0	2409	0	2429	0	2449	0
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390	0	2410	0	2430	0	2450	0
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391	0	2411	0	2431	0	2451	0
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392	0	2412	0	2432	0	2452	0
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393	0	2413	0	2433	0	2453	0
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394	0	2414	0	2434	0	2454	0
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395	0	2415	0	2435	0	2455	0
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396	0	2416	0	2436	0	2456	0
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397	0	2417	0	2437	0	2457	0
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398	0	2418	0	2438	0	2458	0
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399	0	2419	0	2439	0	2459	0

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 30/06/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	40	0467	35	0474	7	0481	0	0488	42	0495	1.844	0502	1	0509	1.887
De 1 a 3 meses	0461	4	0468	9	0475	3	0482	0	0489	12	0496	207	0503	1	0510	220
De 3 a 6 meses	0462	3	0469	8	0476	4	0483	1	0490	13	0497	286	0504	0	0511	299
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	9	0477	0	0484	0	0491	9	0498	24	0505	0	0512	33
De 9 a 12 meses	0464	2	0471	28	0478	1	0485	3	0492	31	0499	54	0506	0	0513	85
Más de 12 meses	0465	29	0472	705	0479	21	0486	251	0493	977	0500	1.223	0507	0	0514	2.200
Total	0466	79	0473	794	0480	35	0487	255	0494	1.084	0501	3.639	0508	2	1515	4.725

Impagados con garantía real (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total		Valor garantía		Valor Garantía con Tasación > 2 años		% Deuda / v. Tasación	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total													
Hasta 1 mes	0515	39	0522	32	0529	6	0536	0	0543	38	0550	1.567	0557	1	0564	1.605	0571	10.944	0578	0	0584	14,67
De 1 a 3 meses	0516	3	0523	7	0530	3	0537	0	0544	10	0551	200	0558	1	0565	210	0572	614	0579	0	0585	34,26
De 3 a 6 meses	0517	3	0524	8	0531	4	0538	1	0545	13	0552	286	0559	0	0566	299	0573	932	0580	0	0586	32,12
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	9	0532	0	0539	0	0546	9	0553	24	0560	0	0567	33	0574	455	0581	0	0587	7,34
De 9 a 12 meses	0519	2	0526	28	0533	1	0540	3	0547	31	0554	54	0561	0	0568	85	0575	716	0582	0	0588	11,89
Más de 12 meses	0520	23	0527	667	0534	20	0541	250	0548	938	0555	1.223	0562	0	0569	2.161	0576	7.394	0583	0	0589	29,23
Total	0521	71	0528	750	0535	34	0542	254	0549	1.039	0556	3.354	0563	2	0570	4.395	0577	21.056			0590	20,87

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/06/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 21/12/2007	
Inferior a 1 año	0600	450	1600	321	2600	20.093
Entre 1 y 2 años	0601	871	1601	606	2601	44.618
Entre 2 y 3 años	0602	1.393	1602	1.916	2602	100.871
Entre 3 y 4 años	0603	2.279	1603	2.127	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	1.065	1604	1.781	2604	214.570
Entre 5 y 10 años	0605	4.302	1605	4.991	2605	504.634
Superior a 10 años	0606	3.774	1606	4.265	2606	690.214
Total	0607	14.134	1607	16.006	2607	1.575.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	7,19	1608	7,52	2608	10,75

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 21/12/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	13,23	1609	12,77	2609	3,88

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 30/06/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 21/12/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	217	0630	11.198	1620	229	1630	12.451	2620	947	2630	216.311
40% - 60%	0621	26	0631	2.253	1621	29	1631	2.760	2621	1.133	2631	277.782
60% - 80%	0622	3	0632	260	1622	4	1632	314	2622	994	2632	274.968
80% - 100%	0623	0	0633	0	1623	0	1633	0	2623	399	2633	125.220
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	4	2634	1.233
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	1	2636	94
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	2	2637	324
Total	0628	246	0638	13.712	1628	262	1638	15.526	2628	3.480	2638	895.932
Media ponderada (%)	0639	25,83	0649		1639	26,59	1649		2639	48,83	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/06/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 21/12/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,72	1650	3,75	2650	6,27
Tipo de interés nominal máximo	0651	7,25	1651	7,25	2651	9
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,57	1652	0,57	2652	3,68

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 30/06/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 21/12/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	247	0683	13.481	1660	263	1683	15.288	2660	1.464	2683	212.432
Aragón	0661	0	0684	0	1661	0	1684	0	2661	109	2684	22.388
Asturias	0662	0	0685	0	1662	0	1685	0	2662	69	2685	6.873
Baleares	0663	0	0686	0	1663	0	1686	0	2663	27	2686	15.408
Canarias	0664	0	0687	0	1664	0	1687	0	2664	25	2687	4.604
Cantabria	0665	0	0688	0	1665	0	1688	0	2665	14	2688	6.795
Castilla-León	0666	0	0689	0	1666	0	1689	0	2666	1.544	2689	137.732
Castilla La Mancha	0667	0	0690	0	1667	0	1690	0	2667	125	2690	25.577
Cataluña	0668	8	0691	608	1668	10	1691	673	2668	167	2691	53.297
Ceuta	0669	0	0692	0	1669	0	1692	0	2669	0	2692	0
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	0	1693	0	2670	18	2693	5.935
Galicia	0671	0	0694	0	1671	0	1694	0	2671	2.149	2694	262.583
Madrid	0672	0	0695	0	1672	0	1695	0	2672	487	2695	156.013
Melilla	0673	1	0696	45	1673	1	1696	45	2673	6	2696	1.156
Murcia	0674	0	0697	0	1674	0	1697	0	2674	1.280	2697	305.625
Navarra	0675	0	0698	0	1675	0	1698	0	2675	735	2698	208.094
La Rioja	0676	0	0699	0	1676	0	1699	0	2676	57	2699	8.118
Comunidad Valenciana	0677	0	0700	0	1677	0	1700	0	2677	555	2700	115.286
País Vasco	0678	0	0701	0	1678	0	1701	0	2678	123	2701	27.084
Total España	0679	256	0702	14.134	1679	274	1702	16.006	2679	8.954	2702	1.575.000
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	256	0705	14.134	1682	274	1705	16.006	2682	8.954	2705	1.575.000

AyT Colaterales Global Empresas, FTA

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 30/06/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 21/12/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	22,86			1710	21,61			2710	17		
Sector	0711	8,49	0712	47	1711	8,40	1712	47	2711	0	2712	

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 30/06/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2018			Situación cierre anual anterior 31/12/2017			Situación inicial 21/12/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0312214127	A	1.356	0	0	1.356	0	0	1.356	100.000	135.600			
ES0312214135	B	184	0	0	184	0	0	184	100.000	18.400			
ES0312214143	C	105	26.685	2.802	105	46.545	4.887	105	100.000	10.500			
ES0312214150	D	105	100.000	10.500	105	100.000	10.500	105	100.000	10.500			
ES0312214002	A							3.716	100.000	371.600			
ES0312214010	B							192	100.000	19.200			
ES0312214028	C							81	100.000	8.100			
ES0312214036	D							61	100.000	6.100			
ES0312214044	A							1.886	100.000	188.600			
ES0312214051	B							195	100.000	19.500			
ES0312214069	C							115	100.000	11.500			
ES0312214077	D							104	100.000	10.400			
ES0312214085	A							962	100.000	96.200			
ES0312214093	B							130	100.000	13.000			
ES0312214101	C							104	100.000	10.400			
ES0312214119	D							104	100.000	10.400			
ES0312214168	A							4.220	100.000	422.000			
ES0312214176	B							445	100.000	44.500			
ES0312214184	C							50	100.000	5.000			
ES0312214192	D							285	100.000	28.500			
ES0312214200	A							1.088	100.000	108.800			
ES0312214218	B							134	100.000	13.400			
ES0312214226	C							82	100.000	8.200			
ES0312214234	D							46	100.000	4.600			
Total		0723	1.750	0724	13.302	1723	1.750	1724	15.387	2723	15.750	2724	1.575.000

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Periodo de la declaración: 30/06/2018
Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas	
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados		Intereses impagados		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		0738	0739
						0730	0731	0732	0733		0734	0735	0742	0736		
ES0312214127	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,30	0	0	0	0	SI	0	0	0	0	0		
ES0312214135	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,60	0	0	0	0	SI	0	0	0	0	0		
ES0312214143	C	S	EURIBOR 6 MESES	1,25	0,98	7	0	0	SI	2.802	0	0	2.809			
ES0312214150	D	S	EURIBOR 6 MESES	2,50	2,23	63	0	0	SI	10.500	0	0	10.563			
Total						0740	70	0741		0743	13.302	0744		0745	13.372	0746

	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 21/12/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	1,97	0748	1,86	0749	2,57

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Periodo de la declaración: 30/06/2018
Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2018								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2017							
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								
ES0312214143	C		7.698	5	1.751		3.059		1.689								
ES0312214150	D		0	22	3.007		0		2.767								
ES0312214127	A		135.600		5.961		135.600		5.961								
ES0312214135	B		18.400		1.877		18.400		1.877								
Total		0754	0	0755	161.698	0756	27	0757	12.596	1754	0	1755	157.059	1756	0	1757	12.293

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 30/06/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/06/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 21/12/2007
				0762	0763	0764
ES0312214127	A	30/04/2014	FCH	AA+	AA+	AAA
ES0312214127	A	25/04/2018	MDY	Aa1		
ES0312214135	B	30/04/2014	FCH	AA+	AA+	A
ES0312214135	B	23/01/2015	MDY	Aa2	Aa2	B3
ES0312214143	C	02/04/2015	FCH	AA+	AA+	BBB-
ES0312214143	C	24/04/2018	MDY	Aa1	Aa2	Caa3
ES0312214150	D	14/02/2017	FCH	A-	A	BBB-
ES0312214150	D	24/04/2018	MDY	Aa1	Aa2	Ca

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Periodo de la declaración: 30/06/2018
Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 21/12/2007	
Inferior a 1 año	0765	13.302	1765	15.387	2765	0
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	0
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	96.200
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768	1.226.600
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769	33.400
Entre 5 y 10 años	0770		1770		2770	138.100
Superior a 10 años	0771		1771		2771	80.700
Total	0772	13.302	1772	15.387	2772	1.575.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	0,50	1773	0,23	2773	4,74

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/06/2018

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 21/12/2007	
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	17.114	1775	16.596	2775	17.850
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	17.850	1776	17.850	2776	17.850
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	128,66	1777	107,86	2777	1,13
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	0
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	0
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783	Notas Explicativas	2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	0
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	0
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	N	1791	S	2791	
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	0	1792	0	2792	77,49
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/06/2018

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características				
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/06/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 21/12/2007				
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806			
Permuta 1	CAIXABANK	Semestral	La suma de los intereses devengados, vencidos e ingresados al Fondo durante el Periodo de Liquidación que vence de los Activos de la Serie correspondiente, disminuida en el importe de los Intereses Corridos que, en su caso, hubiere pagado el Fondo durante el mismo Periodo de Liquidación entre (ii) el Importe Nominal, multiplicado por 360 y dividido por los días efectivos existentes en dicho Periodo de Liquidación	El Saldo Vivo de los Activos (una vez deducidos los Activos Fallidos) en la Fecha de Determinación anterior que no se encuentren con retrasos en el pago de los importes vencidos por más de noventa (90) días en la Fecha de Determinación en curso (incluidos los Activos totalmente amortizados durante el Periodo de Determinación)	Tipo de Interés de Referencia de los Bonos fijado para el correspondiente Periodo de Devengo de Intereses de los Bonos más un margen del 0,95 %	el Saldo Vivo de los Activos (una vez deducidos los Activos Fallidos) en la Fecha de Determinación anterior que no se encuentren con retrasos en el pago de los importes vencidos por más de noventa (90) días en la Fecha de Determinación en curso (incluidos los Activos totalmente amortizados durante el Periodo de Determinación)	-185	-271	-3.977				
Total							0808	-185	0809	-271	0810	-3.977	

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/06/2018

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 21/12/2007		Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 21/12/2007			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/06/2018

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	0	7003	1.030	7006	467	7009	16,54	7012	14,27	7015	13,57		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.030	7008	467	7011	16,54	7014	14,27	7017	1.029.853	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	0	7020	0	7021	977	7024	440	7027	13,64	7030	11,91	7033	12,62		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	977	7026	440	7029	13,64	7032	11,91	7035	12,62	7036	

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto		
	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017			Última Fecha Pago
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/06/2018

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

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/06/2018

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	

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 30/06/2018

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														

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Empresas, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 30/06/2018

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: AyT Colaterales Global Empresas, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/06/2018

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

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