

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8484
NIF Fondo: V84776335
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	112.378	1001	122.081
I. Activos financieros a largo plazo	0002	112.378	1002	122.081
1. Activos titulizados	0003	112.378	1003	122.081
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	105.208	1004	115.279
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	6.350	1005	6.374
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	3.905	1025	3.642
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-3.085	1027	-3.215
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 Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	25.352	1041	29.307
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	118	1042	186
V. Activos financieros a corto plazo	0043	17.564	1043	20.987
1. Activos titulizados	0044	17.537	1044	20.566
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	16.426	1045	18.968
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	866	1046	1.374
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	0	1059	0
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	43	1065	51
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	16	1066	20
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	1.428	1067	1.253
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	43	1068	43
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-1.285	1069	-1.144
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	27	1074	421
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	27	1077	421
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	7	1082	6
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	7	1084	6
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	7.663	1085	8.128
1. Tesorería	0086	7.663	1086	8.128
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	137.730	1088	151.388

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	117.488	1089	128.078
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	117.488	1094	128.078
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	108.548	1095	118.220
1.1 Series no subordinadas	0096	82.948	1096	92.620
1.2 Series subordinadas	0097	25.600	1097	25.600
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	4.698	1101	5.000
2.1 Préstamo subordinado	0102	5.000	1102	5.000
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-302	1105	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	2.711	1108	3.498
3.1 Derivados de cobertura	0109	2.711	1109	3.498
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	1.530	1112	1.360
4.1 Garantías financieras	0113	1.530	1113	1.360
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) PASIVO CORRIENTE	0117	22.954	1117	26.808
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	22.944	1123	26.700
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	22.556	1124	26.300
1.1 Series no subordinadas	0125	22.554	1125	26.298
1.2 Series subordinadas	0126		1126	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	2	1128	3
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	287	1131	287
2.1 Préstamo subordinado	0132	249	1132	249
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	0	1136	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	38	1137	37
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	101	1139	112
3.1 Derivados de cobertura	0140	101	1140	112
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	1	1143	1
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	1	1144	1
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	9	1148	108
1. Comisiones	0149	9	1149	87
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	9	1150	2
1.2 Comisión administrador	0151	78	1151	105
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	1	1152	1
1.4 Comisión variable	0153		1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-78	1155	-21
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	0	1157	21
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-2.711	1158	-3.498
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-2.711	1160	-3.498
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	137.730	1162	151.388

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2020		Acumulado anterior 30/09/2019
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	27	1201	455	2201	795	3201	1.542
1.1 Activos titulizados	0202	27	1202	455	2202	795	3202	1.542
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203		3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-12	1204	-15	2204	-31	3204	-49
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-11	1205	-14	2205	-30	3205	-45
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	0	1206	-1	2206	-1	3206	-3
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-283	1208	-356	2208	-935	3208	-1.205
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-267	1209	84	2209	-171	3209	288
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216		3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-28	1217	-78	2217	-146	3217	-905
7.1 Servicios exteriores	0218	-6	1218	-2	2218	-13	3218	-13
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	0	2219	-4	3219	-2
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	-6	1222	-2	2222	-9	3222	-11
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-21	1224	-75	2224	-132	3224	-890
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-15	1225	-10	2225	-33	3225	-31
7.3.2 Comisión administrador	0226	-4	1226	-4	2226	-11	3226	-13
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-3	1227	-3	2227	-7	3227	-7
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	-59	2228	-80	3228	-839
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	115	1231	-70	2231	-11	3231	944
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	115	1232	-70	2232	-11	3232	944
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	-31	3238	18
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	180	1239	64	2239	359	3239	-346
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 Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2020		Acumulado anterior 30/09/2019
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	90	1300	-535	2300	241	3300	-2.147
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	116	1301	-358	2301	222	3301	-441
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	385	1302	96	2302	1.201	3302	914
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-13	1303	-15	2303	-31	3303	-45
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	81	1304	109	2304	204	3304	352
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-337	1305	-547	2305	-1.151	3305	-1.641
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	-1	2307	0	3307	-21
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-11	1309	-162	2309	-1.583	3309	-882
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-9	1310	-10	2310	-27	3310	-31
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	-1	2311	-1.468	3311	-4
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-3	1312	-3	2312	-8	3312	-8
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	-148	2313	-80	3313	-839
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-15	1315	-16	2315	1.601	3315	-824
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	-25	1320	-16	2320	1.431	3320	-34
3.6 Otros cobros de explotación	0321	10	1321	0	2321	170	3321	-790
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	115	1322	-215	2322	-705	3322	-641
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulación	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	115	1325	11	2325	-705	3325	-373
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	1.337	1326	1.473	2326	3.698	3326	4.426
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.604	1327	1.764	2327	4.087	3327	6.753
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.600	1328	1.807	2328	4.924	3328	5.924
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	2	2330	0	3330	64
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-4.426	1331	-5.036	2331	-13.415	3331	-17.540
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332	-225	2332	0	3332	-268
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	-205	2334	0	3334	-333
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336	-20	2336	0	3336	65
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	205	1337	-750	2337	-465	3337	-2.788
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	7.458	1338	7.777	2338	8.128	3338	9.815
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	7.663	1339	7.027	2339	7.663	3339	7.027

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2020		Acumulado anterior 30/09/2019
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	31	1357	-147	2357	-149	3357	-1.154
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	31	1358	-147	2358	-149	3358	-1.154
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	283	1360	356	2360	935	3360	1.205
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-314	1362	-209	2362	-787	3362	-52
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

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A. | A48265169 BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2020								Situación cierre anual anterior 31/12/2019								Hipótesis iniciales folleto/escritura									
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada			
Participaciones hipotecarias	0380	4,11	0400	0,30	0420	0	0440	4,91	1380	3,52	1400	0,27	1420	0	1440	6,03	2380	0,59	2400	0,09	2420	0	2440	0		
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	1,62	0401	0	0421	0	0441	6,13	1381	0	1401	0	1421	0	1441	12,96	2381	0	2401	0	2421	0	2441	0	2441	0
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A. | A48265169 BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. | 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	183	0467	66	0474	15	0481	0	0488	81	0495	10.852	0502	1	0509	10.933
De 1 a 3 meses	0461	7	0468	6	0475	2	0482		0489	7	0496	710	0503	0	0510	718
De 3 a 6 meses	0462	4	0469	6	0476	1	0483	1	0490	8	0497	364	0504		0511	372
De 6 a 9 meses	0463	5	0470	10	0477	1	0484	2	0491	14	0498	419	0505		0512	432
De 9 a 12 meses	0464	2	0471	6	0478	0	0485	0	0492	6	0499	40	0506		0513	46
Más de 12 meses	0465	51	0472	1.407	0479	41	0486	787	0493	2.235	0500	3.076	0507		0514	5.310
Total	0466	252	0473	1.500	0480	60	0487	791	0494	2.350	0501	15.461	0508	1	1515	17.812

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	183	0522	66	0529	15	0536	0	0543	81	0550	10.852	0557	1	0564	10.933	0571	32.233	0578	32.233	0584	33,92
De 1 a 3 meses	0516	7	0523	6	0530	2	0537		0544	7	0551	710	0558	0	0565	718	0572	1.677	0579	1.677	0585	42,81
De 3 a 6 meses	0517	4	0524	6	0531	1	0538	1	0545	8	0552	364	0559		0566	372	0573	1.048	0580	1.048	0586	35,49
De 6 a 9 meses	0518	5	0525	10	0532	1	0539	2	0546	14	0553	419	0560		0567	432	0574	866	0581	866	0587	49,96
De 9 a 12 meses	0519	2	0526	6	0533	0	0540	0	0547	6	0554	40	0561		0568	46	0575	216	0582	216	0588	21,44
Más de 12 meses	0520	51	0527	1.407	0534	41	0541	787	0548	2.235	0555	3.076	0562		0569	5.310	0576	9.187	0583	9.187	0589	57,80
Total	0521	252	0528	1.500	0535	60	0542	791	0549	2.350	0556	15.461	0563	1	0570	17.812	0577	45.226			0590	39,38

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A. | A48265169 BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. | 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 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 13/07/2006	
Inferior a 1 año	0600	429	1600	472	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	663	1601	625	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.400	1602	1.046	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	2.755	1603	2.133	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	4.384	1604	4.213	2604	139
Entre 5 y 10 años	0605	30.313	1605	26.861	2605	4.432
Superior a 10 años	0606	94.239	1606	111.541	2606	670.429
Total	0607	134.182	1607	146.891	2607	675.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	12,59	1608	13,15	2608	25,63

Antigüedad	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 13/07/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	16,18	1609	15,44	2609	2,23

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A. | A48265169 BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. | 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 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 13/07/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.313	0630	50.369	1620	1.299	1630	49.443	2620	544	2630	50.806
40% - 60%	0621	815	0631	63.749	1621	880	1631	69.817	2621	851	2631	85.978
60% - 80%	0622	194	0632	19.505	1622	267	1632	26.737	2622	1.931	2632	225.662
80% - 100%	0623	4	0633	464	1623	7	1633	797	2623	2.238	2633	312.554
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624	0	2634	0
120% - 140%	0625	1	0635	95	1625	1	1635	96	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627	0	2637	0
Total	0628	2.327	0638	134.182	1628	2.454	1638	146.891	2628	5.564	2638	675.000
Media ponderada (%)	0639	43,80	0649		1639	45,56	1649		2639	75,16	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A. | A48265169 BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 13/07/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	1,01	1650	1,17	2650	3,46
Tipo de interés nominal máximo	0651	5,50	1651	5,50	2651	5,05
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,04	1652	0,04	2652	2,10

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A. | A48265169 BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 13/07/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	956	0683	41.824	1660	1.014	1683	46.019	2660	2.615	2683	248.238
Aragón	0661	3	0684	124	1661	4	1684	271	2661	9	2684	959
Asturias	0662		0685		1662		1685		2662	0	2685	0
Baleares	0663		0686		1663		1686		2663	0	2686	0
Canarias	0664		0687		1664		1687		2664	0	2687	0
Cantabria	0665		0688		1665		1688		2665	0	2688	0
Castilla-León	0666		0689		1666		1689		2666	2	2689	286
Castilla La Mancha	0667		0690		1667		1690		2667	6	2690	922
Cataluña	0668	385	0691	35.029	1668	396	1691	37.512	2668	927	2691	152.931
Ceuta	0669	1	0692	18	1669	1	1692	21	2669	1	2692	70
Extremadura	0670		0693		1670		1693		2670	0	2693	0
Galicia	0671		0694		1671		1694		2671	1	2694	187
Madrid	0672	34	0695	1.969	1672	37	1695	2.173	2672	162	2695	24.868
Melilla	0673	3	0696	127	1673	3	1696	139	2673	14	2696	1.435
Murcia	0674	3	0697	79	1674	3	1697	87	2674	4	2697	384
Navarra	0675	927	0698	54.067	1675	981	1698	59.650	2675	1.784	2698	238.126
La Rioja	0676	6	0699	496	1676	6	1699	529	2676	7	2699	1.190
Comunidad Valenciana	0677	1	0700	25	1677	1	1700	29	2677	14	2700	2.221
País Vasco	0678	8	0701	424	1678	8	1701	463	2678	18	2701	3.183
Total España	0679	2.327	0702	134.182	1679	2.454	1702	146.891	2679	5.564	2702	675.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	2.327	0705	134.182	1682	2.454	1705	146.891	2682	5.564	2705	675.000

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A. A48265169 BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A. A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 13/07/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,81			1710	1,71			2710	0,77		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2020			Situación cierre anual anterior 31/12/2019			Situación inicial 13/07/2006					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0312252002	A	6.494	16.246	105.503	6.494	18.312	118.917	6.494	100.000	649.400			
ES0312252010	B	122	100.000	12.200	122	100.000	12.200	122	100.000	12.200			
ES0312252028	C	134	100.000	13.400	134	100.000	13.400	134	100.000	13.400			
Total		0723	6.750	0724	131.103	1723	6.750	1724	144.517	2723	6.750	2724	675.000

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas	
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado	Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas				
			0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736			0737	0738	0739	
ES0312252002	A	NS	EURIBOR 3 MESES	0,15	0	0	0	SI	105.503	0	105.503					
ES0312252010	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,40	0,04	0	0	SI	12.200	0	12.200					
ES0312252028	C	S	EURIBOR 3 MESES	0,70	0,34	2	0	SI	13.400	0	13.402					
Total						0740	2	0741	0743	131.103	0744	0745	131.104	0746		

	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 13/07/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,04	0748	0,02	0749	3,37

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

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2020								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2019							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0754	0755	0756	0757	1750	1751	1752	1753	1754	1755	1756	1757
ES0312252002	A	4.426	543.897	0	85.088	5.036	524.452	0	85.088								
ES0312252010	B	0	0	1	2.409	0	0	2	2.407								
ES0312252028	C	0	0	11	3.218	0	0	13	3.180								
Total		0754	4.426	0755	543.897	0756	13	0757	90.715	1754	5.036	1755	524.452	1756	15	1757	90.675

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

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 13/07/2006
				0762	0763	0764
ES0312252002	A	29/06/2018	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0312252002	A	25/07/2018	SYP	AA	AA	AAA
ES0312252010	B	29/06/2018	MDY	Baa2	Baa2	A1
ES0312252010	B	25/07/2018	SYP	A-	A-	A
ES0312252028	C	11/12/2017	MDY	Caa1	Caa1	Baa3
ES0312252028	C	25/07/2018	SYP	BB	BB	BBB-

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente				
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 13/07/2006
Inferior a 1 año	0765	131.103	1765	144.517	2765
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769
Entre 5 y 10 años	0770		1770		2770
Superior a 10 años	0771		1771		2771
Total	0772	131.103	1772	144.517	2772
Vida residual media ponderada (años)	0773	0	1773	0	2773
					649.400
					25.600
					675.000
					8,59

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 13/07/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	4.974	1775	5.000	2775	5.738
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	5.000	1776	5.000	2776	5.738
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	3,67	1777	3,46	2777	0
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783	Notas Explicativas	2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	80,47	1792	82,29	2792	96,20
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 Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 13/07/2006	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Permuta 1	CECABANK S.A	TRIMESTRAL	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 0,60 % .	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)	-2.812	-3.610	-8.109	
Total							0808 -2.812	0809 -3.610	0810 -8.109	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 13/07/2006		Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 13/07/2006			
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 Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación actual 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Última Fecha Pago							
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	2.262	7006	2.022	7009	4,05	7012	3,33	7015	4,20		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	2.262	7008	2.022	7011	4,05	7014	3,33	7017	2.261.965	7018	FOLLETO INFORMA TIVO. GLOSARIO DE DEFINICIO NES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	2.206	7024	1.972	7027	3,23	7030	2,94	7033	3,28		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	2.206	7026	1.972	7029	3,23	7032	2,94	7035	3,28	7036	FOLLETO INFORMA TIVO. NOTA DE VALORES. APARTAD O 4.9.2.b (iv)

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

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos es superior al % establecido para cada ISIN	1,25	4,40	4,40	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)
el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos es superior a				
el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos es superior al % establecido para cada ISIN	1	4,40	4,40	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)
el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos es superior a				
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera superior al porcentaje recogido del Saldo Vivo de los Activos que no tengan la consideración de Activos Fallidos	1	4,56	4,56	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.1
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861
a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) en la fecha de Determinación correspondiente a la Fecha de Pago en curso sea inferior al porcentaje establecido del Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Constitución sin que se ha	10	19,42	19,42	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	1862	0	2862	Días del mes /Base 365	3862	0,030	4862	150	5862	30	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	1863	0	2863	Días del mes /Base 365	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Trimestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BANCO SANTANDER, S.A.	1864	10	2864	Días del mes /Días año	3864	0	4864	0	5864	0	6864	Trimestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	S
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	N
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Banco Mare Nostrum , BBVA , Caixabank
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo adicional 3.4.6.4

Determinada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo											Total		
		31/03/2020	30/06/2020	30/09/2020											
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872														
Margen de intereses	0873	-544	640	-267											-170
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	-33	-93	115											-11
Dotaciones a provisiones (neto)	0875														0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876	-31													-31
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-21	-17	-28											-67
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	-629	530	-180	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-279
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879														0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880														0
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881	-80													-80
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	709	-530	180	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	359
Comisión variable pagada	0883														0
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884														0

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto V, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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