

Informe de Auditoría Independiente

**AyT Colaterales Global Hipotecario,
Fondo de Titulización de Activos
Cuentas Anuales e Informe de Gestión
correspondientes al ejercicio anual terminado
el 31 de diciembre de 2016**



Building a better
working world

Ernst & Young, S.L.
C/ Raimundo Fernández Villaverde, 65
28003 Madrid

Tel.: 902 365 456
Fax.: 915 727 300
ey.com

INFORME DE AUDITORÍA INDEPENDIENTE DE CUENTAS ANUALES

A Haya Titulización, Sociedad Gestora de Fondos de Titulización, S.A.U., Sociedad Gestora de AyT Colaterales Global Hipotecario, Fondo de Titulización de Activos

Informe sobre las cuentas anuales

Hemos auditado las cuentas anuales adjuntas de AyT Colaterales Global Hipotecario, Fondo de Titulización de Activos, que comprenden el balance a 31 de diciembre de 2016, la cuenta de pérdidas y ganancias, el estado de flujos de efectivo, el estado de ingresos y gastos reconocidos y la memoria correspondientes al ejercicio terminado en dicha fecha.

Responsabilidad de los administradores de la Sociedad Gestora en relación con las cuentas anuales

Los administradores de la Sociedad Gestora del Fondo son responsables de formular las cuentas anuales adjuntas, de forma que expresen la imagen fiel del patrimonio, de la situación financiera y de los resultados de AyT Colaterales Global Hipotecario, Fondo de Titulización de Activos, de conformidad con el marco normativo de información financiera aplicable al Fondo en España, que se identifica en la nota 2.a de la memoria adjunta, y del control interno que consideren necesario para permitir la preparación de cuentas anuales libres de incorrección material, debida a fraude o error.

Responsabilidad del auditor

Nuestra responsabilidad es expresar una opinión sobre las cuentas anuales adjuntas, basada en nuestra auditoría. Hemos llevado a cabo nuestra auditoría de conformidad con la normativa reguladora de la auditoría de cuentas vigente en España. Dicha normativa exige que cumplamos los requerimientos de ética, así como que planifiquemos y ejecutemos la auditoría con el fin de obtener una seguridad razonable de que las cuentas anuales están libres de incorrecciones materiales.

Una auditoría requiere la aplicación de procedimientos para obtener evidencia de auditoría sobre los importes y la información revelada en las cuentas anuales. Los procedimientos seleccionados dependen del juicio del auditor, incluida la valoración de los riesgos de incorrección material en las cuentas anuales, debida a fraude o error. Al efectuar dichas valoraciones del riesgo, el auditor tiene en cuenta el control interno relevante para la formulación por parte de la Sociedad Gestora de las cuentas anuales del Fondo, con el fin de diseñar los procedimientos de auditoría que sean adecuados en función de las circunstancias, y no con la finalidad de expresar una opinión sobre la eficacia del control interno del Fondo. Una auditoría también incluye la evaluación de la adecuación de las políticas contables aplicadas y de la razonabilidad de las estimaciones contables realizadas por la dirección de la Sociedad Gestora, así como la evaluación de la presentación de las cuentas anuales tomadas en su conjunto.

Consideramos que la evidencia de auditoría que hemos obtenido proporciona una base suficiente y adecuada para nuestra opinión de auditoría.

Opinión

En nuestra opinión, las cuentas anuales adjuntas expresan, en todos los aspectos significativos, la imagen fiel del patrimonio y de la situación financiera de AyT Colaterales Global Hipotecario, Fondo de Titulización de Activos a 31 de diciembre de 2016, así como de sus resultados y flujos de efectivo correspondientes al ejercicio anual terminado en dicha fecha, de conformidad con el marco normativo de información financiera que resulta de aplicación y, en particular, con los principios y criterios contables contenidos en el mismo.

Párrafo de énfasis

Llamamos la atención respecto de lo señalado en la nota 7 de la memoria adjunta, en la que se menciona la situación al 31 de diciembre de 2016 del Fondo de Reserva que se dotó en la constitución del Fondo. Esta cuestión no modifica nuestra opinión de auditoría.

Informe sobre otros requerimientos legales y reglamentarios

El informe de gestión adjunto del ejercicio 2016 contiene las explicaciones que los administradores de la Sociedad Gestora consideran oportunas sobre la situación del Fondo, la evolución de sus negocios y sobre otros asuntos y no forma parte integrante de las cuentas anuales. Hemos verificado que la información contable que contiene el citado informe de gestión concuerda con la de las cuentas anuales del ejercicio 2016. Nuestro trabajo como auditores se limita a la verificación del informe de gestión con el alcance mencionado en este mismo párrafo y no incluye la revisión de información distinta de la obtenida a partir de los registros contables del Fondo.

AUDITORES
INSTITUTO DE CENSORES JURADOS
DE CUENTAS DE ESPAÑA

ERNST & YOUNG, S.L.

Año 2017 Nº 01/17/20805
SELLO CORPORATIVO: 96,00 EUR

.....
Informe de auditoría de cuentas sujeto
a la normativa de auditoría de cuentas
española o internacional
.....

19 de abril de 2017

ERNST & YOUNG, S.L.
(Inscrita en el Registro Oficial de Auditores
de Cuentas con el Nº S0530)



Roberto Diez Cerrato

AyT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A.

AyT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS

Ejercicio 2016

ÍNDICE

1. CUENTAS ANUALES
 - 1.1. Balance de situación, cuenta de pérdidas y ganancias, estado de flujos de efectivo y estado de ingresos y gastos reconocidos
 - 1.2. Memoria

Anexo I
2. INFORME DE GESTIÓN
3. FORMULACIÓN
4. ANEXO II

**1. CUENTAS ANUALES DEL EJERCICIO 2016 DE AyT COLATERALES
GLOBAL HIPOTECARIO, FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS**

**1.1. BALANCE DE SITUACIÓN, CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS,
ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO Y ESTADO DE INGRESOS Y GASTOS
RECONOCIDOS DEL EJERCICIO 2016**

AyT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS

Balance de situación al 31 de diciembre 2016 y 2015

		Miles de euros	
	Nota	2016	2015
ACTIVO			
A) ACTIVO NO CORRIENTE		2.681.984	2.929.501
I. Activos financieros a largo plazo	6	2.681.984	2.929.501
1. Activos titulizados		2.681.984	2.929.501
Certificados de transmisión hipotecaria		2.657.307	2.896.429
Activos dudosos principal		70.056	81.030
Correcciones de valor por deterioro de activos (-)		(45.379)	(47.958)
2. Derivados		-	-
3. Otros activos financieros		-	-
II. Activos por impuesto diferido		-	-
III. Otros activos no corrientes		-	-
B) ACTIVO CORRIENTE		539.544	576.675
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta		-	-
V. Activos financieros a corto plazo	6	277.480	318.093
1. Activos titulizados		277.480	318.093
Certificados de transmisión hipotecaria		264.416	302.158
Activos dudosos - principal		45.111	44.341
Activos dudosos - intereses		484	603
Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		(34.058)	(31.251)
Intereses y gastos devengados no vencidos		810	1.254
Intereses vencidos e impagados		717	988
2. Derivados		-	-
3. Otros activos financieros		-	-
VI. Ajustes por periodificaciones		35	29
1. Comisiones		35	29
2. Otros		-	-
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	7	262.029	258.553
1. Tesorería		262.029	258.553
2. Otros activos líquidos equivalentes		-	-
TOTAL ACTIVO		3.221.528	3.506.176

AyT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS

Balance de situación al 31 de diciembre 2016 y 2015

	Nota	Miles de euros	
		2016	2015
PASIVO			
A) PASIVO NO CORRIENTE		2.894.030	3.143.390
I. Provisiones a largo plazo		-	-
II. Pasivos financieros a largo plazo		2.894.030	3.143.390
1. Obligaciones y otros valores emitidos	8.1	2.692.874	2.942.540
Series no subordinadas		2.202.838	2.421.157
Series subordinadas		491.271	523.332
Correcciones de valor por repercusión de pérdidas(-)		(1.235)	(1.949)
2. Deudas con entidades de crédito	8.2	134.094	149.255
Préstamo subordinado		197.404	203.353
Correcciones de valor por repercusión de pérdidas(-)		(63.310)	(54.098)
3. Derivados	11	27.104	30.936
Derivados de cobertura		27.104	30.936
4. Otros pasivos financieros	7	39.958	20.659
Otros		39.958	20.659
III. Pasivos por impuesto diferido		-	-
B) PASIVO CORRIENTE		354.602	393.722
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta		-	-
V. Provisiones a corto plazo		-	-
VI. Pasivos financieros a corto plazo		354.384	393.574
1. Obligaciones y otros valores emitidos	8.1	328.868	370.607
Series no subordinadas		317.422	363.788
Series subordinadas		6.753	868
Correcciones de valor por repercusión de pérdidas(-)		-	-
Intereses y gastos devengados no vencidos		4.693	5.951
2. Deudas con entidades de crédito	8.2	23.192	19.938
Préstamo subordinado		1.968	2.014
Correcciones de valor por repercusión de pérdidas(-)		(558)	(432)
Intereses y gastos devengados no vencidos		802	930
Intereses vencidos e impagados		20.980	17.426
3. Derivados	11	2.323	2.826
Derivados de cobertura		2.323	2.826
4. Otros pasivos financieros	7	1	203
Acreedores y otras cuentas a pagar		1	203
VII. Ajustes por periodificaciones	10	218	148
1. Comisiones		108	124
Comisión sociedad gestora		97	108
Comisión administrador		2.199	1.910
Comisión agente financiero/pagos		10	16
Comisión variable		8.281	8.647
Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)		(10.479)	(10.557)
2. Otros		110	24
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS		(27.104)	(30.936)
VIII. Activos financieros disponibles para la venta		-	-
IX. Coberturas de flujos de efectivo	11	(27.104)	(30.936)
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos		-	-
TOTAL PASIVO		3.221.528	3.506.176

AyT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS

Cuenta de pérdidas y ganancias correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2016 y 2015

	Nota	Miles de euros	
		2016	2015
1. Intereses y rendimientos asimilados		34.853	50.742
Activos titulizados	6	34.853	50.735
Otros activos financieros		-	7
2. Intereses y cargas asimilados		(32.349)	(38.661)
Obligaciones y otros valores emitidos	8.1	(28.125)	(33.845)
Deudas con entidades de crédito	8.2	(4.224)	(4.816)
Otros pasivos financieros		-	-
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)		(9.967)	(13.285)
A) MARGEN DE INTERESES		(7.464)	(1.204)
4. Resultado de operaciones financieras (neto)		-	-
5. Diferencias de cambio (neto)		-	-
6. Otros ingresos de explotación		24	1
7. Otros gastos de explotación		(1.189)	(1.080)
Servicios exteriores		(17)	(17)
Servicios de profesionales independientes		(16)	(17)
Otros servicios		(1)	-
Tributos		(2)	-
Otros gastos de gestión corriente		(1.170)	(1.063)
Comisión de sociedad gestora		(518)	(596)
Comisión administrador		(323)	(360)
Comisión del agente financiero / pagos		(56)	(79)
Comisión variable	10	(37)	130
Otros gastos		(236)	(158)
8. Deterioro de activos financieros (neto)	6	(227)	(2.658)
Deterioro neto de Activos Titulizados (-)		(227)	(2.658)
9. Dotaciones a provisiones (neto)		-	-
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta		-	-
11. Repercusión de pérdidas / (ganancias)	10	8.855	4.941
RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS		-	-
12. Impuesto sobre beneficios		-	-
RESULTADO DEL EJERCICIO		-	-

AyT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS

Estado de flujos de efectivo correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2016 y 2015

	Nota	Miles de euros	
		2016	2015
A) FLUJOS DE EFECTIVO DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN		13.331	(4.629)
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones		(5.158)	404
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados		35.494	52.031
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos		(29.383)	(35.365)
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura		(10.470)	(14.791)
1.6 Pagos por operaciones de derivados de negociación		-	-
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros		-	31
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito		(798)	(1.502)
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)		-	-
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados		(701)	(1.141)
2.1 Comisión sociedad gestora		(519)	(598)
2.2 Comisión administrador		(9)	(13)
2.3 Comisión agente financiero/pagos		(62)	(86)
2.4 Comisión variable		(95)	(423)
2.5 Otras comisiones		(16)	(21)
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación		19.190	(3.892)
3.1 Pagos por garantías financieras		-	-
3.2 Cobros por garantías financieras		-	-
3.3 Pagos por operaciones de derivados de cobertura		-	-
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación		-	-
3.5 Otros pagos de explotación		19.190	(3.892)
3.6 Otros cobros de explotación		-	-
B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSIÓN/ FINANCIACIÓN		(9.856)	(33.259)
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización		-	-
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros		-	-
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos		(3.859)	(14.160)
6.1 Cobros por amortización de activos titulizados		136.588	301.251
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados		95.865	95.943
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados		54.548	56.840
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos		-	-
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías		-	-
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos		(290.861)	(468.194)
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo		(5.996)	(19.099)
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito		-	-
7.2 Pagos por amortización de deudas con entidades de crédito		(5.996)	(19.301)
7.3 Pagos a Administraciones Públicas		-	-
7.4 Otros cobros y pagos		-	202
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES		3.476	(37.887)
Efectivo o equivalentes al comienzo del ejercicio		258.553	296.441
Efectivo o equivalentes al final del ejercicio		262.029	258.553

AyT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS

Estado de ingresos y gastos reconocidos correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2016 y 2015

	Miles de euros	
	2016	2015
1. Activos financieros disponibles para la venta	-	-
1.1. Ganancias (pérdidas) por valoración	-	-
1.1.1. Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	-	-
1.1.2. Efecto fiscal	-	-
1.2. Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	-	-
1.3. Otras reclasificaciones	-	-
1.4. Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	-	-
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	-	-
2. Cobertura de los flujos de efectivo		
2.1. Ganancias (pérdidas) por valoración	(6.135)	(3.249)
2.1.1. Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	(6.135)	(3.249)
2.1.2. Efecto fiscal	-	-
2.2. Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	9.967	13.285
2.3. Otras reclasificaciones	-	-
2.4. Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	(3.832)	(10.036)
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	-	-
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	-	-
3.1. Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance del periodo	-	-
3.1.1. Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	-	-
3.1.2. Efecto fiscal	-	-
3.2. Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	-	-
3.3. Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	-	-
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	-	-
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	-	-

1.2. MEMORIA DEL EJERCICIO 2016

AyT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FONDO DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS

Memoria correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2016.

1. NATURALEZA Y ACTIVIDAD

AyT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, Fondo de Titulización de Activos (en adelante el Fondo), se constituyó mediante escritura pública el 24 de abril de 2007, agrupando inicialmente Certificados de transmisión de hipoteca por un valor nominal total de 1.500.000 miles de euros distribuidas en una serie (Serie C.G. Hipotecario BBK).

Durante los ejercicios 2007, 2008 y 2009 fueron emitidas nuevas series agrupando, a su vez, nuevos certificados de transmisión hipotecaria (Nota 6).

Con fecha 19 de abril de 2007 la Comisión Nacional del Mercado de Valores verificó y registró el folleto informativo de constitución del Fondo y de emisión de los Bonos. La fecha de desembolso, que marca el inicio del devengo de los intereses de los Bonos, fue el 25 de abril de 2007.

El Fondo constituye un patrimonio separado y abierto carente de personalidad jurídica, que está integrado en cuanto a su activo, principalmente, por los Certificados de transmisión de hipoteca de todas las series que agrupa y, en cuanto a su pasivo, principalmente, por los Bonos de las distintas series emitidos en cuantía y condiciones financieras tales que el valor patrimonial neto del Fondo sea nulo.

La Sociedad Gestora procederá a la liquidación de una o varias series, cuando tenga lugar alguna de las causas siguientes:

- (i) cuando todos los activos y/o cuando todos los Bonos de dichas series hayan sido íntegramente amortizados;
- (ii) cuando, a juicio de la Sociedad Gestora, concurren circunstancias excepcionales que hagan imposible, o de extrema dificultad, el mantenimiento del equilibrio financiero de dicha serie o series, pero que no afecten al equilibrio financiero global del Fondo;

- (iii) cuando, a opción de la Sociedad Gestora, el importe nominal de los activos de cada una de dichas Series sea inferior al 10% del importe nominal de los activos en la fecha de emisión correspondiente. Esta facultad deberá ejercitarse coincidiendo con una fecha de pago y estará condicionada a que no se perjudiquen los intereses de los bonistas, a cuyo efecto la suma procedente de la venta de los activos, junto con los restantes fondos disponibles de dicha serie en dicha fecha de pago, deberán ser suficientes para permitir pagar íntegramente los importes que, por cualquier concepto, sean adeudados por el Fondo a los bonistas.
- (iv) cuando, a juicio de la Sociedad Gestora se produzca un impago indicativo de un desequilibrio grave y permanente o se prevea que se va a producir en relación con dicha serie o series, pero que no afecte de forma global al Fondo;
- (v) en caso de que alguna de las entidades de calificación no confirmase como definitivas, antes de la fecha de desembolso de la serie correspondiente, las calificaciones asignadas con carácter provisional por ella a dicha serie, o de que alguna de las entidades de calificación no confirmase que la emisión de la serie correspondiente no supone una alteración de las calificaciones asignadas a los Bonos de las series emitidas con anterioridad que hayan sido objeto de calificación por ellas.

El Fondo se extinguirá por las causas previstas en el Real Decreto 926/1998 y la Ley 19/1992 y en particular:

- (i) cuando todos los activos y/o cuando todos los Bonos de todas las series hayan sido íntegramente amortizados (una vez finalizada la vida efectiva);
- (ii) en todo caso, en la fecha de vencimiento legal del Fondo, que no tendrá lugar más tarde de aquella en la que se cumplan 60 años desde la fecha de constitución del Fondo;
- (iii) una vez se haya liquidado el Fondo;

Se podrán realizar emisiones al amparo del Fondo hasta la fecha en la que se cumplan cinco años desde la fecha de constitución del Fondo o hasta aquella otra fecha anterior en que la Sociedad Gestora determine que no se pueden producir más emisiones al amparo del Fondo, siempre y cuando exista un folleto informativo vigente inscrito en los oficiales de la CNMV, y no se supere el saldo vivo máximo.

En caso de insolvencia del Fondo se aplicará el régimen general de prelación de pagos establecidos en su escritura de constitución.

De acuerdo con la Ley 19/1992, la gestión del Fondo está encomendada de forma exclusiva a sociedades gestoras de fondos de titulización, quienes a su vez tienen en este cometido su objeto social exclusivo.

Haya Titulización, Sociedad Gestora de Fondos de Titulización, S.A.U. es la gestora del Fondo, actividad por la que recibió una comisión inicial con ocasión de la emisión de cada serie y una comisión periódica por cada serie.

El Fondo está regulado por:

- (i) El folleto de emisión.
- (ii) La escritura de constitución del Fondo.
- (iii) Real Decreto 926/1998 y disposiciones que lo desarrollen y Ley 19/1992, de 7 de julio, sobre Régimen de Sociedades y Fondos de Inversión Inmobiliaria y sobre Fondos de Titulización Hipotecaria, en cuanto a lo no contemplado en el Real Decreto 926/1998 y en tanto resulte de aplicación.
- (iv) Ley 5/2015, de 27 de abril, de fomento de la financiación empresarial. En el Título III de esta ley se regula el régimen jurídico de las titulizaciones y, adicionalmente, deroga el Real Decreto 926/1998 y los artículos de la Ley 19/1992 que hacían referencia a fondos de titulización hipotecaria y sus sociedades gestoras.
- (v) Orden Ministerial de 28 de diciembre de 2001.
- (vi) Real Decreto Legislativo 4/2015, de 23 de octubre, por el que se aprueba el texto refundido de la Ley del Mercado de Valores, en lo referente a su supervisión, inspección y sanción.
- (vii) La Circular 2/2016, de 20 de abril, de la CNMV sobre normas contables, cuentas anuales, estados financieros públicos y estados reservados de información estadística de los Fondos de Titulización. Esta circular, que se publicó en el Boletín Oficial del Estado el 30 de abril de 2016 y entró en vigor el día siguiente a su publicación, derogó la Circular 2/2009, de 25 marzo, de la CNMV y sus sucesivas modificaciones, que regulaban los mismos aspectos.

- (viii) Demás disposiciones legales y reglamentarias en vigor en cada momento que resulten de aplicación.

El Fondo se encuentra sometido al tipo general del Impuesto de Sociedades, encontrándose exento del concepto de operaciones societarias del Impuesto de Transmisiones y Actos Jurídicos Documentados. La actividad del Fondo se encuentra sujeta, pero exenta, del Impuesto sobre el Valor Añadido.

2. BASES DE PRESENTACIÓN

a) Imagen fiel

Las cuentas anuales comprenden el balance de situación, la cuenta de pérdidas y ganancias, el estado de ingresos y gastos reconocidos, el estado de flujo de efectivo y la memoria. En el Anexo I de la memoria se incluyen los siguientes estados financieros públicos que establece la Circular 2/2016 de la C.N.M.V.: S.05.1 (información relativa a los activos cedidos al Fondo), S.05.2 (información relativa a los pasivos emitidos por el Fondo), S.05.3 (información sobre mejora crediticias) y S.05.5 (información relativa a comisiones).

Como consecuencia de la liquidación de la Serie Caja Laietana I no han sido confeccionados los estados S05 para dicha serie.

Adicionalmente en el Anexo I se incluyen los balances de situación al 31 de diciembre de 2016 y 2015, y las cuentas de pérdidas y ganancias de dichos ejercicios de cada una de las series emitidas.

Las cuentas anuales han sido obtenidas de los registros contables del Fondo presentándose de acuerdo con principios contables y normas de valoración contenidas en la Circular 2/2016, de 20 de abril, de la C.N.M.V., de forma que muestren la imagen fiel del patrimonio, de la situación financiera y de los resultados del Fondo.

Asimismo, dado que, por la propia actividad del Fondo, su duración está sujeta al comportamiento de cada préstamo hipotecario participado en cuanto a su amortización, constituyendo por ello tanto los Certificados de transmisión hipotecaria como los Bonos de Titulización Hipotecaria instrumentos con calendarios inciertos de amortización, la clasificación entre activo y pasivo corriente y no corriente y los cuadros de vencimientos se han efectuado bajo la hipótesis de inexistencia de amortizaciones anticipadas.

Las cuentas anuales del ejercicio 2016 son formuladas por el Consejo de Administración de la Sociedad Gestora y se someterán a la aprobación de la Junta General de Accionistas de la misma, estimándose que serán aprobadas sin cambios significativos.

Los registros contables del Fondo se expresan en euros, si bien las presentes cuentas anuales han sido formuladas en miles de euros, salvo que se indique lo contrario.

b) Utilización de juicios y estimaciones en la elaboración de los estados financieros

En la preparación de las cuentas anuales del Fondo, los Administradores de la Sociedad Gestora han tenido que realizar juicios, estimaciones y asunciones que afectan a la aplicación de las políticas contables y a los saldos de los activos, pasivos, ingresos, gastos y compromisos existentes en la fecha de emisión de las presentes cuentas anuales.

Las estimaciones y asunciones realizadas están basadas en la experiencia histórica y en otros factores diversos que son entendidos como razonables de acuerdo con las circunstancias y cuyos resultados constituyen la base para establecer los juicios sobre el valor contable de los activos y pasivos que no son fácilmente disponibles mediante otras fuentes. Las estimaciones y las asunciones son revisadas de forma continuada. Sin embargo, la incertidumbre inherente a las estimaciones y asunciones podría conducir a resultados que podrían requerir ajuste de valores de los activos y pasivos afectados. Si como consecuencia, de estas revisiones o de hechos futuros se produjese un cambio en dichas estimaciones, su efecto se registraría en la cuenta de pérdidas y ganancias de ese período y de periodos sucesivos.

Las estimaciones más significativas utilizadas en la preparación de estas cuentas anuales se refieren a:

- Las pérdidas por deterioro de activos financieros (Nota 3.e).
- El valor razonable de la permuta financiera de intereses o swap (Nota 3.c).
- Cancelación anticipada.

Para estas estimaciones se sigue y aplica lo establecido por la Circular 2/2016, de 20 de abril de la C.N.M.V. y, en su caso, en la escritura de constitución del Fondo.

c) Comparación de la información

Los Administradores de la Sociedad Gestora del Fondo presentan, a efectos comparativos, con cada una de las cifras que se desglosan en las presentes cuentas anuales, además de las cifras del ejercicio 2016, las correspondientes al ejercicio anterior. La información contenida en esta Memoria referida al ejercicio 2015 se presenta, exclusivamente, a efectos comparativos con la información relativa al ejercicio 2016 y, por consiguiente, no constituye las cuentas anuales del Fondo del ejercicio 2015.

Durante el ejercicio 2016 se ha publicado la Circular 2/2016, de 20 de abril, de la CNMV, sobre normas contables, cuentas anuales, estados financieros públicos y estados reservados de información estadística de los fondos de titulización, que desarrolla el contenido, forma y demás condiciones de elaboración y publicación de las obligaciones de información financiera y contable que establece la Ley 5/2015, de 27 de abril, y deroga la Circular 2/2009, de 25 de marzo, de la CNMV y sus sucesivas modificaciones.

En este sentido, la información correspondiente al ejercicio 2015, que fue formulada aplicando el marco normativo de información financiera existente en ese momento (Circular 2/2009, de 25 de marzo, de la CNMV), ha sido adaptada para su presentación, a efectos comparativos, de acuerdo con el nuevo marco normativo de información financiera aplicado en la formulación de las presentes cuentas anuales (Circular 2/2016, de 20 de abril, de la CNMV).

d) Agrupación de partidas

En la confección de estas cuentas anuales no se ha procedido a la agrupación de partidas relativas al balance, cuenta de pérdidas y ganancias, estado de flujos de efectivo y estados de ingresos y gastos.

e) Elementos recogidos en varias partidas

En la confección de estas cuentas anuales no se han registrado elementos patrimoniales en dos o más partidas del balance.

3. PRINCIPIOS CONTABLES Y NORMAS DE VALORACIÓN APLICADAS

En la elaboración de las cuentas anuales del Fondo, correspondientes al ejercicio 2016, se han aplicado los siguientes principios, políticas contables y criterios de valoración, de acuerdo con lo establecido en la Circular 2/2016, de 20 de abril.

a) Empresa en funcionamiento

El Consejo de Administración de Haya Titulización, S.G.F.T., S.A.U. ha considerado que la gestión del Fondo continuará en un futuro previsible, por lo que la aplicación de los principios y criterios contable no tiene como el propósito de determinar el valor del patrimonio neto a efectos de su transmisión global o parcial, ni el importe resultante en caso de su liquidación total.

b) Definición y clasificación de los instrumentos financieros a efectos de su presentación y valoración

i. Definición

Un “instrumento financiero” es un contrato que da lugar a un activo financiero en una entidad y, simultáneamente, a un pasivo financiero o instrumento de capital en otra entidad.

Un “derivado financiero” es un instrumento financiero cuyo valor cambia como respuesta a los cambios en una variable observable de mercado (tal como un tipo de interés, de cambio, el precio de un instrumento financiero o un índice de mercado, incluyendo las calificaciones crediticias), cuya inversión inicial es muy pequeña en relación a otros instrumentos financieros con respuesta similar a los cambios en las condiciones de mercado y que se liquida, generalmente, en una fecha futura.

ii. Clasificación de los activos financieros

Los activos financieros se desglosan, a efectos de su presentación y valoración, en los siguientes epígrafes del balance:

- Efectivo y otros activos líquidos equivalentes: Este epígrafe incluye las cuentas corrientes mantenidas por el Fondo en instituciones financieras, para poder desarrollar su actividad, que incluyen, en su caso, el fondo de reserva mantenido por el Fondo para hacer frente a sus obligaciones de pago.

- Activos titulizados: Incluye los activos cedidos al Fondo como consecuencia del proceso de titulización y se clasifican, a efectos de su valoración, como “Préstamos y partidas a cobrar”.
- Derivados de cobertura: Incluye, en su caso, el valor razonable, a favor del Fondo, de los derivados designados como instrumentos de cobertura en coberturas contables.
- Deudores y otras cuentas a cobrar: Recoge, en su caso, la totalidad de los activos titulizados y cuentas deudoras que por cualquier concepto, diferente de los anteriores, ostente el Fondo frente a terceros. La totalidad de los deudores se clasifican, a efectos de su valoración, como “Préstamos y partidas a cobrar”.

iii. Clasificación de los pasivos financieros

Los pasivos financieros se desglosan, a efectos de su presentación y valoración, en los siguientes epígrafes del balance:

- Obligaciones y otros valores emitidos: Incluye, en su caso, las obligaciones, bonos y pagarés emitidos por el Fondo, con el fin de financiar la adquisición de sus activos financieros. Se clasifican, a efectos de su valoración, como “Débitos y partidas a pagar”.
- Deudas con entidades de crédito: Incluye, en su caso, las deudas contraídas con entidades de crédito, con el fin de financiar su actividad y se clasifican, a efectos de valoración, como “Débitos y partidas a pagar”.
- Derivados de cobertura: Incluye, en su caso, el valor razonable, en contra del Fondo, de los derivados designados como instrumentos de cobertura en coberturas contables.
- Acreedores y otras cuentas a pagar: Recoge, en su caso, la totalidad de las cuentas a pagar y débitos, que no deban ser clasificados en otros epígrafes. Se clasifican, a efectos de su valoración, como “Débitos y partidas a pagar”.

c) Reconocimiento y valoración de los activos y pasivos financieros

i. Reconocimiento y valoración de los activos financieros

Los activos financieros clasificados, a efectos de su valoración, como “Préstamos y partidas a cobrar” se valoran, inicialmente, por su “valor razonable” (que salvo evidencia en contrario será el precio de la transacción), incluyendo los costes de transacción directamente atribuibles a la operación. Posteriormente, dichos activos se valoran por su coste amortizado, contabilizándose los intereses devengados en el epígrafe “Intereses y rendimientos asimilados” de la cuenta de pérdidas y ganancias mediante el método del tipo de interés efectivo. No obstante, aquellas partidas cuyo importe se espera recibir en un plazo no superior a tres meses se valoran a su valor nominal siempre y cuando el efecto de no actualizar los flujos de efectivo sea totalmente inmaterial.

ii. Reconocimiento y valoración de los pasivos financieros

Los pasivos financieros clasificados, a efectos de su valoración, como “Débitos y partidas a pagar”, se valoran, inicialmente, por su “valor razonable” (que salvo evidencia en contrario será el precio de la transacción) incluyendo los costes de transacción directamente atribuibles a la operación. Posteriormente, dichos pasivos se valoran por su coste amortizado, contabilizándose los intereses devengados en el epígrafe “Intereses y cargas asimilados” de la cuenta de pérdidas y ganancias mediante el método del tipo de interés efectivo. No obstante, aquellas partidas cuyo importe se espera pagar en un plazo inferior a tres meses se valoran a su valor nominal siempre y cuando el efecto de no actualizar los flujos de efectivo sea totalmente inmaterial.

Se considerarán, en su caso, costes directamente atribuibles a las emisiones los costes de dirección y aseguramiento de la emisión, la comisión inicial de la Sociedad Gestora si hubiere, las tasas del Órgano Regulador, los costes de registro de los folletos de emisión y los costes derivados de la admisión a negociación de los valores emitidos, entre otros.

iii. Operaciones de cobertura

Las permutas financieras (contratos swap) suscritas por el Fondo tienen carácter de cobertura del riesgo de tipo de interés de los activos titulizados. Los resultados obtenidos por estos contratos se registran en la cuenta de pérdidas y ganancias de manera simétrica a los resultados obtenidos por los elementos cubiertos.

El Fondo utiliza derivados financieros negociados de forma bilateral con la contraparte al margen de mercados organizados (“derivados OTC”).

En relación a la valoración de los derivados financieros de pasivo, se incluye entre otros, el riesgo de crédito o impago y el riesgo de liquidez. En el caso del Fondo, dichos riesgos se ven minorados, ya que éste actúa como un vehículo entre el tenedor de los bonos emitidos por el Fondo y el cedente de los activos titulizados, por lo que dichos riesgos asociados a los activos titulizados se transmiten implícitamente a los bonistas del Fondo.

Mediante esta operación de cobertura, uno o varios instrumentos financieros, denominados instrumentos de cobertura, son designados para cubrir un riesgo específicamente identificado que puede tener impacto en la cuenta de pérdidas y ganancias, como consecuencia de variaciones en el valor razonable o en los flujos de efectivo de una o varias partidas cubiertas.

Todos los derivados financieros (incluso los contratados inicialmente con la intención de que sirvieran de cobertura) que no reúnen las condiciones que permiten considerarlos como de cobertura se trata a efectos contable como “derivados de negociación”.

A los efectos de su registro y valoración, las operaciones de cobertura se clasifican en la siguiente categoría:

- Cobertura de los flujos de efectivo: cubre la exposición a la variación de los flujos de efectivo que se atribuya a un riesgo concreto asociado a activos o pasivos reconocidos o a una transacción prevista altamente probable, siempre que pueda afectar a la cuenta de pérdidas y ganancias. La parte de la ganancia o la pérdida del instrumento de cobertura que se haya determinado como cobertura eficaz, se reconocerá transitoriamente en la partida “Ajustes repercutidos en balance de ingresos y gastos reconocidos – Cobertura de flujos de efectivo” de activo (valor razonable a favor del Fondo) o de pasivo (valor razonable en contra del Fondo), imputándose a la cuenta de pérdidas y ganancias en el ejercicio o ejercicios en los que la operación cubierta prevista afecte al resultado.

La eficacia de la cobertura de los derivados definidos como de cobertura, queda debidamente documentada por medio de los test de efectividad que realiza el Fondo, para verificar que las diferencias producidas por la variaciones de precios de mercado entre el elemento cubierto y su cobertura se mantiene en parámetros razonables a lo largo de la vida de las operaciones, cumpliendo así las previsiones establecidas en el momento de la contratación.

Una cobertura se considera altamente eficaz si, al inicio y durante la vida, el Fondo puede esperar, prospectivamente, que los cambios en el valor razonable o en los flujos de efectivo de la partida cubierta que sea atribuibles al riesgo cubierto sean compensados casi completamente por los cambios en el valor razonable o en los flujos de efectivo del instrumento de cobertura, y que, retrospectivamente, los resultados de la cobertura hayan oscilado dentro de un rango de variación del ochenta al ciento veinticinco por ciento respecto del resultado de la partida cubierta.

Cada tipo de interés se modeliza con su curva (se utiliza una curva con la misma periodicidad).

Los préstamos tienen una tasa de amortización de nominal predefinida, pero los prestatarios amortizan anticipadamente proporciones del nominal. Para modelizar la amortización del nominal del fondo se utilizan: el vencimiento medio ponderado (WAM) de la cartera, el cupón medio ponderado (WAC), y la CPR publicada por la gestora para cada fondo.

Para la estimación de los márgenes medios de los bonos se promedia por nominal vivo los spreads de los tramos de los bonos (pasivo).

Los flujos del fondo se modelizan como la media de la media móvil de un número determinado de Euribor 12 meses, cada Euribor 12 meses es ponderado según el porcentaje de préstamos del pool que fijen en ese mes y se le suma un margen medio.

De esta manera se estiman los flujos del fondo en el futuro.

El valor final de cada rama del swap equivale a la suma de sus flujos, descontados con la curva correspondiente.

Cuando en algún momento deja de cumplirse esta relación, las operaciones de coberturas dejarían de ser tratadas como tales y reclasificadas como derivados de negociación.

La Metodología aplicada permite obtener una Valoración que equivale al Precio Teórico de sustitución de la contrapartida. La nueva contrapartida, estimaría el Precio Real en función al Valor de los pagos a percibir o realizar por el Fondo en virtud del contrato.

La Metodología aplicada tiene en consideración las Fechas de Pago futuras del Fondo asumiendo el ejercicio del clean-up call (opción amortización anticipada cuando el Saldo de la Cartera de Activos alcanza o es inferior al 10% del Saldo Titulizado), considerándose a todos los efectos los diferentes períodos de pagos del Fondo afecto.

El nominal vivo correspondiente a cada período de pago se calcula, para cada uno de los Activos, de acuerdo a su sistema de amortización.

Se estima el Valor Actual de los pagos a percibir por el Fondo a partir de los tipos LIBOR implícitos (futuros) cotizados a Fecha de Valoración, para los diferentes períodos (teniendo en consideración si la fijación es al inicio o al final de cada período) aplicando el número de días del período y descontando dichos pagos a la Fecha de Cálculo de la Valoración, en función del Valor de Descuento obtenido de una curva cupón cero construida con Overnight Indexed Swaps (OIS).

De forma similar, se calcula el Valor de los Pagos a realizar por el Fondo a partir de promedios de forwards, si bien, en el caso de contar con índices no cotizados (EURIBOR BOE, IRPH, VPO,...), se realizan estimaciones estadísticas de dichos índices.

Finalmente, el Valor del Swap será igual a la diferencia entre el Valor Actual de los Pagos a percibir por el Fondo, y el valor Actual de los Pagos a realizar por el Fondo.

iv. Registro de resultados

Como norma general, las variaciones en el valor razonable de los activos y pasivos financieros se registran con contrapartida en la cuenta de pérdidas y ganancias; diferenciando entre las que tienen su origen en el devengo de intereses y conceptos asimilados (que se registran en los capítulos “Intereses y rendimientos asimilados” o “Intereses y cargas asimiladas”, según proceda); y las que correspondan a otras causas, que se registran, por su importe neto, en el capítulo “Resultado de Operaciones Financieras” de dicha cuenta de pérdidas y ganancias.

El reconocimiento en la cuenta de pérdidas y ganancias del devengo de intereses se interrumpe para todos los instrumentos de deuda calificados individualmente como dudosos.

v. Valor razonable de los activos y pasivos financieros

Dada la naturaleza y composición de los activos y pasivos financieros del Fondo, excluidos los derivados financieros cuya descripción se detalla en el apartado iii. de esta Nota, los vencimientos residuales de aquellos activos y pasivos financieros remunerados, en su caso, a tipo fijo, así como la desviación porcentual existente con respecto a los tipos de interés actuales de mercado, el valor razonable de los activos y de los pasivos financieros del Fondo al 31 de diciembre de 2016 y 2015 no difiere significativamente de sus correspondientes valores en libros a dichas fechas.

d) Activos dudosos

El valor en libros de los epígrafes de “Activos dudosos” recogerá el importe total de los instrumentos de deuda y activos titulizados que cuenten con algún importe vencido por principal, intereses o gastos pactados contractualmente, con más de tres meses de antigüedad, así como de aquéllos que presentan dudas razonables sobre su reembolso total (principal e intereses) en los términos pactados contractualmente, salvo que proceda clasificarlos como fallidos.

Se consideran fallidos aquellos instrumentos de deuda y activos titulizados, vencidos o no, para los que después de un análisis individualizado se considere remota su recuperación y proceda darlos de baja del activo.

El criterio establecido por la Sociedad Gestora del Fondo es que los activos no se darán de baja del balance por su entrada en fallido salvo que existieran daciones o quitas.

e) Deterioro del valor de los activos financieros

i. Definición

Un activo financiero se considera deteriorado (y, consecuentemente, se corrige su valor en libros para reflejar el efecto de su deterioro) cuando existe una evidencia objetiva de que se ha producido un evento, o el efecto combinado de varios de ellos, que dan lugar a un impacto negativo en los flujos de efectivo futuros que se estimaron en el momento de formalizarse la transacción.

En la estimación de los flujos de efectivo futuros de instrumentos que cuenten con garantías reales, siempre que éstas se hayan considerado en la cesión del instrumento o figuren en la información facilitada a los titulares de los pasivos emitidos por el Fondo, se tendrán en cuenta los flujos que se obtendrían de su realización menos el importe de los costes necesarios para su obtención y posterior venta, con independencia de la probabilidad de la ejecución de la garantía.

Como criterio general, la corrección del valor en libros de los instrumentos financieros, por causa de su deterioro, se efectúa con cargo a la cuenta de pérdidas y ganancias del periodo en el que tal deterioro se manifiesta, utilizando una contrapartida compensadora para corregir el valor de los activos. Las recuperaciones de las pérdidas por deterioro previamente registradas, en caso de producirse, se reconocen en la cuenta de pérdidas y ganancias del periodo en el que el deterioro deja de existir o se reduce y tendrán como límite el valor en libros del instrumento financiero que estaría reconocido en la fecha de reversión si no se hubiese registrado el deterioro del valor.

Cuando se considera remota la recuperación de cualquier importe registrado, éste se da de baja del balance, sin perjuicio de las actuaciones que pueda llevar a cabo el Fondo para intentar conseguir su cobro hasta tanto no se hayan extinguido definitivamente sus derechos; sea por prescripción, condonación u otras causas.

De acuerdo con lo previsto en la Circular 2/2016, en el cálculo de las pérdidas por deterioro de un grupo de activos financieros se prevé la posibilidad de utilizar modelos basados en métodos estadísticos. En este sentido, la Sociedad Gestora del Fondo considera que la metodología más representativa para la estimación del deterioro de los activos financieros del Fondo teniendo en cuenta las características de dichos activos es la basada en la estimación de los porcentajes de deterioro, de acuerdo con la antigüedad de la deuda vencida e impagada y con el calendario previsto en la Norma 13ª de la Circular 2/2016 de la Comisión Nacional del Mercado de Valores y sus modificaciones posteriores.

f) Periodificaciones (activo y pasivo)

En el caso del pasivo, corresponden, en su caso, a las comisiones de gestión del Fondo y de administración de los activos titulizados o de los bonos emitidos, así como la remuneración variable correspondiente a la Entidad Cedente, devengadas en el periodo al que se refiere el balance y que se encuentran pendientes de pago a dicha fecha.

Asimismo, estos epígrafes del balance incluirán, en su caso, gastos e ingresos de diversa naturaleza devengados en el periodo y pendientes de pago o cobro, respectivamente.

g) Reconocimiento de ingresos y gastos

Seguidamente se resumen los criterios más significativos utilizados por el Fondo, para el reconocimiento de sus ingresos y gastos:

i. Ingresos y gastos por intereses

Con carácter general, los ingresos y gastos por intereses se reconocen contablemente en los capítulos “Intereses y rendimientos asimilados” e “Intereses y cargas asimilados” de la cuenta de pérdidas y ganancias, respectivamente, en función de su periodo de devengo, por aplicación del método del tipo de interés efectivo, a excepción de los intereses correspondientes a inversiones dudosas, morosas o en litigio, que se registran en el momento efectivo del cobro.

ii. Ingresos y gastos no financieros

Se reconocen contablemente de acuerdo con el criterio de devengo.

iii. Comisiones, honorarios y conceptos asimilados

Estos ingresos y gastos se reconocen en la cuenta de pérdidas y ganancias con criterios distintos, según sea su naturaleza. Los más significativos son:

- Las comisiones variables vinculadas al servicio de intermediación financiera por parte de la Entidad Cedente se describen en el apartado f. de esta Nota.
- Los que tienen su origen en transacciones o servicios, tales como los prestados por la Sociedad Gestora, que se prolongan en el tiempo, se difieren durante la vida de tales transacciones o servicios.
- Los que surgen en la prestación de un servicio que se ejecuta en un acto singular, se reconocen cuando se realiza el acto singular que los origina.

- Los vinculados a activos y pasivos financieros valorados a su valor razonable con cambios en pérdidas y ganancias, se reconocen en el momento de su cobro.

h) Remuneración variable

La remuneración variable como consecuencia de la intermediación financiera se determina como la diferencia positiva, si la hubiese, entre los ingresos y los gastos, incluidas las pérdidas de ejercicios anteriores, si las hubiese, devengados por el Fondo de acuerdo al cierre de su contabilidad entre los ingresos y los gastos devengados se incluirá, entre otros, las pérdidas por deterioro y sus reversiones, las pérdidas o ganancias de la cartera de negociación y las diferencias que se originen en el proceso de conversión de las partidas monetarias en moneda extranjera a la moneda funcional y cualquier otro rendimiento o retribución devengado en el período, distinto de esta comisión variable, a percibir por el cedente, u otro beneficiario, de acuerdo con la documentación constitutiva del Fondo. Se exceptúan de dicha diferencia la propia comisión variable y el gasto por impuesto sobre beneficios.

La diferencia positiva obtenida por diferencia entre los ingresos y gastos devengados se utilizará en primer lugar, para detraer, en su caso, las pérdidas de periodos anteriores que hubieran sido repercutidas a los pasivos del Fondo. Si tras la detracción, continúan existiendo pasivos corregidos por imputación de pérdidas, no se procederá a registrar remuneración variable alguna. En consecuencia, sólo se producirá el devengo y registro de la remuneración variable cuando no existan pasivos corregidos por imputación de pérdidas.

Cuando, de acuerdo con el folleto o la escritura de constitución, el cálculo de la retribución variable no se determine como la diferencia entre los ingresos y gastos devengados por el Fondo en el período, la retribución variable devengada de acuerdo con las condiciones contractuales se registrará como gasto en la cuenta de pérdidas y ganancias del Fondo. La diferencia entre la totalidad de ingresos y gastos del periodo, incluyendo la propia comisión variable:

- Cuando sea positiva se utilizará en primer lugar para detraer las pérdidas de periodos anteriores que hubieran sido repercutidas a los pasivos del Fondo. El importe positivo que resulte tras dicha detracción se registrará como un gasto en la cuenta de pérdidas y ganancias del Fondo en la partida de “Dotación provisión por margen de intermediación” con cargo a la partida de “Provisión por margen de intermediación”.
- Cuando resulte negativa se repercutirá, en primer lugar, contra la “Provisión por margen de intermediación” dotada en periodos anteriores, y el importe restante será repercutido a los pasivos emitidos por el Fondo, comenzando por la cuenta de periodificación de la comisión variable, y continuando por el pasivo más subordinado.

i) Repercusión de pérdidas

Cuando la diferencia obtenida entre los ingresos y gastos devengados, conforme al apartado g) anterior, sea negativa, se repercute a los pasivos emitidos por el Fondo, a través de la cuenta correctora de pasivo “Correcciones de valor por repercusión de pérdidas” del pasivo del balance, registrándose un ingreso en el epígrafe “Repercusión de pérdidas (ganancias)” de la cuenta de pérdidas y ganancias (Nota 10). Dicha repercusión se realiza comenzando por la cuenta de periodificación de la comisión variable, devengada y no liquidada en periodos anteriores, y continuando por el pasivo más subordinado, teniendo en cuenta el orden inverso de prelación de pagos establecido contractualmente para cada fecha de pago.

j) Impuesto sobre Beneficios

El Fondo tributa en el régimen general del Impuesto sobre Sociedades de acuerdo con lo dispuesto por el Real Decreto Legislativo 4/2004, de 5 de marzo, por el que se aprueba el Texto Refundido de la Ley sobre el Impuesto de Sociedades, modificado posteriormente por la Ley 35/2006, de 28 de noviembre, del Impuesto sobre la Renta de las Personas Físicas y de modificación parcial de las Leyes de los Impuestos sobre Sociedades, sobre la Renta de no Residentes y sobre el Patrimonio, que establece el tipo de gravamen general del Impuesto sobre Sociedades en el 30%.

El gasto o ingreso por impuesto sobre beneficios comprende la parte relativa al gasto o ingreso por el impuesto corriente y la parte correspondiente al gasto o ingreso por el impuesto diferido, en su caso.

Dado que en los ejercicios 2016 y 2015 se han equilibrado los ingresos y los gastos del Fondo, no procede liquidar cuota alguna por el Impuesto sobre Beneficios (Nota 12).

El gasto o ingreso por impuesto diferido, en caso de que exista, se corresponde con el reconocimiento y la cancelación de los activos y pasivos por impuesto diferido, que surgen de las diferencias temporarias originadas por la diferente valoración, contable y fiscal, de los activos y pasivos del Fondo. Las diferencias temporarias imponibles dan lugar a pasivos por impuesto diferido, mientras que las diferencias temporarias deducibles y los créditos por deducciones y ventajas fiscales que queden pendientes de aplicar fiscalmente, dan lugar a activos por impuesto diferido. Los activos y pasivos por impuestos diferidos, originados por operaciones con cargos o abonos directos en el capítulo “Ajustes repercutidos en el balance de ingresos y gastos reconocidos” del pasivo del balance, se contabilizan, en su caso, también con contrapartida en dicho capítulo.

La cuantificación y valoración de dichos activos y pasivos se realizará considerando los tipos de gravamen esperados en el momento de su reversión, según la normativa que esté vigente o aprobada y pendiente de publicación en la fecha de cierre del ejercicio, y de acuerdo con la forma en que racionalmente se prevea recuperar o pagar el activo o el pasivo.

Conforme a la normativa reguladora (artículo 5.1 de la Ley 19/1992) el valor patrimonial del Fondo ha de ser nulo, por lo que los Administradores de la Sociedad Gestora estiman que la liquidación de cualquier diferencia de naturaleza temporaria, tanto activa como pasiva, es remota, con lo que, en función de lo previsto en la normativa contable vigente, no se registran activos ni pasivos diferidos.

Según la normativa anterior, el Fondo amortiza los gastos de constitución linealmente en un periodo máximo de cinco años desde su constitución.

k) Activos no corrientes mantenidos para la venta

El saldo de este epígrafe del activo del balance incluye, en su caso, los activos recibidos por el Fondo para la satisfacción, total o parcial, de los activos financieros que representan derechos de cobro frente a terceros, con independencia del modo de adquirir la propiedad (en adelante, activos adjudicados).

Los activos no corrientes mantenidos para la venta se registran, en el momento de su reconocimiento inicial por su valor razonable menos los costes de venta, que serán, al menos, del 25% de su valor razonable.

Posteriormente, los activos no corrientes mantenidos para la venta se valoran por el menor importe entre su valor en libros, calculado en la fecha de su asignación a esta categoría, y su valor razonable, neto de los costes de venta estimados.

A efectos de determinar el valor razonable de activos inmobiliarios localizados en España, se tomarán en consideración los criterios establecidos para determinar el valor de mercado en la OM ECO/805/2003, de 27 de marzo, tomándose el valor de tasación definido en la citada orden.

Las pérdidas por deterioro de estos activos, debidas a reducciones de su valor en libros hasta su valor razonable (menos los costes de venta) se reconocen, en su caso, en el epígrafe “Ganancias (pérdidas) en la baja de activos no corrientes en venta” de la cuenta de pérdidas y ganancias. Las ganancias de un activo no corriente en venta, por incrementos posteriores del valor razonable (menos los costes de venta) aumentan su valor en libros, y se reconocen en la cuentas de pérdidas y ganancias hasta un importe igual al de las pérdidas por deterioro anteriormente reconocidas.

l) Compensación de saldos

Se compensan entre sí y, consecuentemente, se presentan en el balance por su importe neto los saldos deudores y acreedores con origen en transacciones que, contractualmente o por imperativo de una norma legal, contemplan la posibilidad de compensación; teniendo la intención de liquidarlos por su importe neto o de realizar el activo y proceder al pago del pasivo de forma simultánea y en los que una de las partes contratantes sea una entidad financiera.

m) Estados de flujos de efectivo

En los estados de flujos de efectivo se utilizan las siguientes expresiones:

- Flujos de efectivo: entradas y salidas de dinero en efectivo y de sus equivalentes; entendiéndose por éstos las inversiones a corto plazo de gran liquidez y bajo riesgo de alteraciones en su valor.
- Actividades de explotación: son aquellas que constituyen la principal fuente de los ingresos ordinarios del Fondo, así como otras actividades que no pueden ser calificadas como de inversión o de financiación.
- Actividades de inversión y financiación: las de adquisición, enajenación o disposición por otros medios de activos a largo plazo y otras inversiones no incluidas en el efectivo y sus equivalentes, así como aquellas actividades que producen cambios en el tamaño y composición de los activos y pasivos que no forman parte de las actividades de explotación.

A efectos de la elaboración de los estados de flujos de efectivo, se han considerado como “efectivo o equivalentes de efectivo” aquellas inversiones a corto plazo de gran liquidez y con bajo riesgo a cambios en su valor. De esta manera, el Fondo considera efectivo o equivalentes de efectivo al saldo mantenido en cuentas corrientes, que se encuentra registrado en el epígrafe “Efectivo y otros activos líquidos equivalentes – Tesorería” del activo del balance.

n) Estados de ingresos y gastos reconocidos

Estos estados recogen los ingresos y gastos generados por el Fondo que, de acuerdo con lo dispuesto en la normativa vigente, han sido registrados directamente en el capítulo “Ajustes repercutidos en balance de ingresos y gastos reconocidos” del pasivo del balance.

Por tanto, en este estado se presentan, en su caso:

- (i) Los ingresos y gastos que, según lo requerido por las normas de valoración, deban imputarse directamente al balance.
- (ii) Las transferencias realizadas, en su caso, a la cuenta de pérdidas y ganancias, según lo dispuesto en las normas de valoración adoptadas.
- (iii) El efecto impositivo correspondiente, en su caso, a los apartados a) y b) anteriores.
- (iv) El importe neto repercutido en el periodo a las cuentas correspondientes de pasivo, de forma que el total de ingresos y gastos reconocidos sea nulo.
- o) Clasificación de activos y pasivos – Corriente y no corriente

Son activos y pasivos corrientes aquellos elementos cuyo vencimiento total o parcial, o realización se estima que se produzca en el plazo máximo de un año desde la fecha de cierre de balance, clasificándose en caso contrario como no corriente.

4. ERRORES Y CAMBIOS EN LAS ESTIMACIONES CONTABLES

Tal y como se indica en el apartado 2 c) anterior, la aplicación del nuevo marco normativo de información financiera, no ha supuesto cambios de criterios contables significativos respecto a los aplicados en el ejercicio 2015.

Durante el ejercicio 2016 y hasta la fecha de formulación de las cuentas anuales no se ha producido ningún error, ni cambio en estimaciones contables, que por su importancia relativa fuera necesario incluir en las cuentas anuales del Fondo formuladas por el Consejo de Administración de la Sociedad Gestora.

5. RIESGO ASOCIADO CON ACTIVOS FINANCIEROS

El riesgo es inherente a las actividades del Fondo pero el mismo es gestionado por la Sociedad Gestora a través de un proceso de identificación, medición y seguimiento continuo.

El Fondo está expuesto al riesgo de mercado (el cual incluye los riesgos de tipo de interés y de tipo de cambio), riesgo de crédito y riesgo de liquidez derivados de los instrumentos financieros que mantiene en su cartera.

- Riesgo de mercado

Este riesgo comprende principalmente los riesgos resultantes de posibles variaciones adversas de los tipos de interés de los activos y pasivos, y de los tipos de cambio en los que están denominadas las masas patrimoniales.

- i.) Riesgo de tipo de interés

El riesgo de tipo de interés deriva de la posibilidad de que cambios en los tipos de interés afecten a los cash flows o al valor razonable de los instrumentos financieros.

En el caso del Fondo, este riesgo radica en el hecho de que parte de los activos titulizados adquiridos (Certificados de transmisión de hipoteca) se encuentran sujetos a tipos de interés y a periodos de revisión y liquidación diferentes al tipo de interés aplicable a los bonos (Nota 8.1). Con la finalidad de cubrir el riesgo mencionado, han sido suscritos distintos “contratos de swap” con distintas entidades (en función de cada serie) que cubre el riesgo de interés antes aludido en los siguientes términos:

- a) Cantidad a pagar por el Fondo: será el importe variable A (según se define este concepto a continuación).
- b) Cantidad a pagar por la entidad de contrapartida: será el importe variable B (según se define este concepto a continuación).

“Importe nominal”: significa para cada 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 período de determinación). El Fondo notificará el importe nominal aplicable al periodo de liquidación dos días hábiles anteriores a cada fecha de pago.

“Importe variable A”: en cada fecha de determinación el importe variable A se calculará aplicando el tipo variable A al importe nominal para periodo de liquidación anterior multiplicado por el número de días del período de liquidación correspondiente y dividida por 360.

“Tipo variable A”: significa, en cada periodo de liquidación, el tipo de interés anual que resulte de dividir (i) la suma de los intereses devengados, vencidos e ingresados al Fondo durante el periodo de liquidación que vence de los activos, disminuida en el importe de los intereses corridos que, en su caso, hubiere pagado el Fondo durante el mismo periodo de liquidación (salvo impago de los activos se percibirán en el primer periodo de liquidación, si bien puede haber cantidades que se perciban en otros periodos) entre (ii) el importe nominal, multiplicado por 360 y dividido por los días efectivos existentes en dicho período de liquidación. El Fondo notificará el tipo variable A dos (2) días hábiles anteriores a cada Fecha de pago.

“Importe variable B”: será equivalente al resultado de aplicar, en cada fecha de determinación, el tipo variable B al importe nominal multiplicado por el número de días transcurridos entre la última fecha de pago y la fecha de pago en curso, salvo para la primera fecha de pago, que será el número de días transcurridos desde la fecha de desembolso hasta la primera fecha de pago, y dividido por 360.

“Tipo variable B”: significa, en cada periodo de liquidación el tipo de interés de referencia de los Bonos fijado para el correspondiente periodo de devengo de intereses de los Bonos más un margen para cada uno de las series.

Al ser el contrato de swap un acuerdo de compensación contractual, las partes tendrán derecho a exigirse en cada fecha de pago el saldo neto de las operaciones vencidas al amparo de cada uno de ellos.

Las fechas de liquidación de los intereses que resulten de la aplicación del contrato de swap coincidirán con las fechas de pago.

ii.) Riesgo de tipo de cambio

El Fondo no presenta exposición significativa a riesgo de tipo de cambio a la fecha de referencia de las cuentas anuales.

- Riesgo de liquidez

Este riesgo refleja la posible dificultad del Fondo para disponer de fondos líquidos, o para poder acceder a ellos, en la cuantía suficiente y al coste adecuado, de forma que pueda hacer frente en todo momento a sus obligaciones de pago conforme al calendario de pago establecido en el folleto del Fondo.

El Fondo a fin de gestionar este riesgo dispone desde la constitución del Fondo de mecanismos minimizadores del mismo como son los préstamos para gastos iniciales, préstamos subordinados, créditos de línea de liquidez, etc. con objeto de atender la posible dificultad del Fondo de disponer los fondos líquidos como consecuencia del posible desfase entre los ingresos procedentes de los activos titulizados y los importes a satisfacer por compromisos asumidos.

En las Notas 6 y 8 de la Memoria se hace referencia a los vencimientos estimados de los activos y pasivos financieros del Fondo al 31 de diciembre de 2014 y 2013.

- Riesgo de crédito

El riesgo de crédito nace de la posible pérdida causada por el incumplimiento de las obligaciones contractuales de las contrapartes del Fondo así como impago del conjunto de activos titulizados de la cartera titulizada del Fondo. La política del Fondo es que las contrapartes sean entidades de reconocida solvencia; en relación con el posible riesgo de crédito de la cartera titulizada, el Fondo a fin de gestionar el mismo dispone de mecanismos minimizadores como son los Fondos de reserva y dotaciones conforme a experiencia de impago y calendarios.

El Fondo no espera incurrir en pérdidas significativas derivadas del incumplimiento de sus obligaciones por parte de la contraparte.

El siguiente cuadro muestra las principales exposiciones al riesgo de crédito al cierre de los ejercicios 2016 y 2015:

	Miles de euros	
	2016	2015
Activos titulizados	2.959.464	3.247.594
Tesorería y otros	262.029	258.582
Total riesgo	<u>3.221.493</u>	<u>3.506.176</u>

La distribución del epígrafe del conjunto de los activos titulizados, sin considerar intereses devengados ni correcciones de valor por deterioro por zonas geográficas, al 31 de diciembre de 2016 y 2015 (donde radica el emisor) presenta el siguiente detalle:

2016:

Miles de euros													
	C.G.H BBK I	C.G.H BBK II	C.G.H Cantabria	C.G.H. Caixa Laietana	C.G.H CCM	C.G.H Caja España	C.G.H. Galicia I	C.G.H Galicia II	C.G.H Burgos	C.G.H Caja Granada	C.G.H Sa Nostra	C.G.H Caja Vital I	TOTAL
Andalucía	1.477	1.819	445	-	9.100	-	29.988	48.468	-	83.763	-	150	175.210
Baleares	99	235	-	-	134	-	9.338	5.464	-	91	44.523	-	59.884
Cantabria	54.796	42.098	113.451	-	-	-	1.787	391	-	-	-	3.156	215.697
Castilla La Mancha	30.323	15.459	1.029	-	288.913	-	4.432	4.753	-	-	-	1.942	346.851
Castilla - León	5.961	3.517	2.927	-	2.971	-	11.440	20.828	-	-	-	22.360	70.004
Cataluña	7.620	4.952	4.577	-	3.828	-	71.310	73.006	-	15.792	-	174	181.259
Comunidad Valenciana	51.733	38.630	-	-	36.207	-	35.961	63.293	-	227	109	78	226.238
Galicia	200	297	13.547	-	-	-	196.620	145.347	-	-	-	-	356.011
La Rioja	15.776	6.758	287	-	-	-	1.421	1.577	-	-	-	4.378	30.197
Madrid	183.992	90.001	-	-	77.912	-	40.361	33.489	-	527	-	16.152	442.434
Navarra	189	340	4.082	-	-	-	2.311	1.584	-	-	-	282	8.788
País Vasco	455.384	277.913	-	-	112	-	15.748	10.806	-	-	-	67.803	827.766
Otras zonas	16.998	14.269	1.015	-	12.872	-	19.494	26.948	-	1.159	8	3.807	77.076
TOTAL	824.548	496.288	141.360	-	432.049	-	440.211	435.954	-	101.559	44.640	120.282	3.036.890

2015

Miles de euros													
	C.G.H BBK I	C.G.H BBK II	C.G.H Cantabria	C.G.H. Caixa Laietana	C.G.H CCM	C.G.H Caja España	C.G.H. Galicia I	C.G.H Galicia II	C.G.H Burgos	C.G.H Caja Granada	C.G.H Sa Nostra	C.G.H Caja Vital I	TOTAL
Andalucía	1.955	1.933	486	-	9.579	-	31.291	50.188	-	103.529	-	231	199.192
Baleares	105	250	-	-	139	-	9.679	5.802	-	95	49.128	-	65.198
Cantabria	58.461	46.115	121.264	-	-	-	1.880	4.889	-	-	-	3.340	235.949
Castilla La Mancha	32.314	16.784	1.080	-	308.728	-	4.856	21.605	-	-	-	2.025	387.392
Castilla - León	6.379	3.759	3.093	-	3.131	-	11.982	76.256	-	17.596	-	23.792	145.988
Cataluña	8.192	5.433	4.787	52.014	3.994	-	75.542	65.963	-	-	-	188	216.113
Comunidad Valenciana	55.553	41.964	-	-	39.422	-	37.707	153.156	-	235	115	84	328.236
Galicia	208	306	14.677	-	-	-	209.508	-	-	-	-	-	224.699
La Rioja	17.022	7.204	302	-	-	-	1.536	1.622	-	-	-	4.719	32.405
Madrid	196.834	98.598	-	5.156	84.115	-	42.832	34.894	-	556	-	17.139	480.124
Navarra	201	364	4.447	-	-	-	2.421	1.651	-	-	-	293	9.377
País Vasco	490.025	305.068	-	-	118	-	16.528	11.158	-	-	-	72.758	895.655
Otras zonas	18.227	15.457	1.086	-	14.221	-	20.724	28.891	-	1.448	10	4.166	103.360
TOTAL	885.476	543.235	151.222	57.170	463.447	-	466.486	455.475	-	123.459	49.253	128.735	3.323.958

6. ACTIVOS FINANCIEROS

La cartera de activos estaba compuesta inicialmente por Certificados de transmisión de hipoteca nominativos correspondientes a quince emisiones emitidas singularmente por distintos emisores.

A continuación se presenta el detalle de los emisores y características principales de las quince emisiones realizadas:

Participaciones hipotecarias emitidas por:	Emisión (en miles de euros)
AyT C.G.H. BBK I (KutxaBank)	1.500.000
AyT C.G.H. BBK II (KutxaBank)	1.000.000
AyT C.G.H. C. Cantabria (Liberbank)	230.000
AyT C.G.H. C. Círculo de Burgos(Banco Grupo Cajatres) (***)	150.000
AyT C.G.H. C. Laietana (Bankia) (*)	170.000
AyT C.G.H. CCM(Liberbank)	800.000
AyT C.G.H C. España (Banco Caja España de Inversiones, Salamanca y Soria) (**)	500.000
AyT C.G.H. C. Galicia I (NCG Banco)	900.000
AyT C.G.H. C. Galicia II (NCG Banco)	950.000
AyT C.G.H Granada (Banco Mare Nostrum)	399.900
AyT C.G.H. Sa Nostra(Banco Mare Nostrum)	109.000
AyT C.G.H. C. Vital (KutxaBank)	199.900
AyT C.G.H. C. Navarra (CaixaBank) (***)	100.000
AyT C.G.H. C. Manlleu (Grupo BBVA)(***)	125.000
AyT C.G.H. C. Caja Sur (KutxaBank)(****)	200.000
	<u>7.333.800</u>

(*) En el ejercicio 2016 se ha producido la liquidación de la Serie Caja Laietana con fecha 14 de julio de 2016.

(**) En el ejercicio 2015 se ha producido la liquidación de la Serie Caja España con fecha 29 de abril de 2015.

(***) En el ejercicio 2014 se produjo la liquidación de la Serie Caja Círculo de Burgos con fecha 26 de mayo de 2014.

(****) Durante el ejercicio 2012 se produjo la liquidación de las Series Caja Navarra I y Manlleu con fecha 19 de noviembre y 22 de noviembre de 2012, respectivamente.

(*****) Durante el ejercicio 2011 se produjo la liquidación de la Serie Caja Sur.

Con fecha 14 de julio de 2016 se ha producido la liquidación de la Serie de Caja Laietana I. El 29 de abril de 2015 se produjo la liquidación de la Serie de Caja España.

La composición al 31 de diciembre de 2016 y 2015 del importe pendiente de amortización y su movimiento durante el ejercicio 2016 y 2015 es el siguiente:

<u>Global</u>	Miles de euros			
	2016			
	Saldo inicial	Adiciones	Disminuciones	Saldo final
Activos titulizados				
Certificados de transmisión hipotecaria	3.198.587	-	(276.864)	2.921.723
Activos dudosos - principal	125.371	12.162	(22.366)	115.167
Activos dudosos - intereses (*)	603	10	(129)	484
Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	(79.209)	15.797	(16.025)	(79.437)
Intereses y gastos devengados no vencidos	1.254	3.721	(4.165)	810
Intereses vencidos e impagados	988	20	(291)	717
	<u>3.247.594</u>	<u>31.710</u>	<u>(319.840)</u>	<u>2.959.464</u>

(*) Corresponden a intereses devengados de los préstamos antes de su entrada en dudoso.

<u>Global</u>	Miles de euros			
	2015			
	Saldo inicial	Adiciones	Disminuciones	Saldo final
Activos dudosos				
Certificados de transmisión hipotecaria	3.645.831	-	(447.244)	3.198.587
Activos dudosos - principal	132.162	41.859	(48.650)	125.371
Activos dudosos - intereses (*)	693	155	(245)	603
Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	(76.553)	18.685	(21.341)	(79.209)
Intereses y gastos devengados no vencidos	1.970	6.037	(6.753)	1.254
Intereses vencidos e impagados	1.465	22	(499)	988
	<u>3.705.568</u>	<u>66.758</u>	<u>(524.732)</u>	<u>3.247.594</u>

(*) Corresponden a intereses devengados de los préstamos antes de su entrada en dudoso.

Al 31 de diciembre de 2016 existían activos titulizados clasificados como “Activos dudosos” por importe de 115.651 miles de euros (2015: 125.974 miles de euros), de los cuales 115.167 miles de euros corresponden a principal (2015: 125.371 miles de euros) y 484 miles de euros a intereses (2015: 603 miles de euros).

Durante el ejercicio 2016 y 2015 han vencido y se han dejado de cobrar los siguientes importes en concepto de principal e intereses:

	Miles de euros		
	2016		
	Principal	Intereses	Total
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK I	2.835	110	2.945
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK II	935	53	988
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Cantabria I	1.020	34	1.054
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Laietana I	92	68	160
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. CCM I	5.245	389	5.634
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Galicia I	1.629	330	1.959
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Galicia II	1.329	395	1.274
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Granada I	142	108	250
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Sa Nostra I	56	10	66
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Vital I	750	13	763
	<u>14.033</u>	<u>1.710</u>	<u>15.093</u>

	Miles de euros		
	2015		
	Principal	Intereses	Total
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK I	5.556	185	5.741
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK II	2.380	85	2.465
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Cantabria I	1.443	57	1.500
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Laietana I	158	149	307
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. CCM I	2.102	367	2.469
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Galicia I	1.613	446	2.059
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Galicia II	1.288	503	1.791
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Granada I	207	182	389
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Sa Nostra I	88	20	108
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Vital I	153	16	169
	<u>14.988</u>	<u>2.010</u>	<u>16.998</u>

Con posterioridad al cierre del ejercicio 2016 y 2015 hasta la fecha de formulación de las respectivas cuentas anuales, se han recuperado impagos de principal e intereses por importe de:

	Miles de euros		
	2016		
	Principal	Intereses	Total
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK I	2.564	206	2.770
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK II	565	45	610
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Cantabria I	118	56	174
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Laietana I	47	41	88
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. CCM I	6.369	407	6.776
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Galicia I	1.578	427	2.005
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Galicia II	1.221	458	1.679
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Granada I	232	186	418
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Sa Nostra I	108	41	149
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Vital I	33	4	37
	<u>12.835</u>	<u>1.871</u>	<u>14.707</u>

	Miles de euros		
	2015		
	Principal	Intereses	Total
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK I	146	25	171
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK II	88	12	100
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Cantabria I	31	4	35
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Laietana I	23	17	40
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. CCM I	528	78	606
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Galicia I	1.512	509	2.021
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Galicia II	1.123	418	1.541
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Granada I	75	54	129
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Sa Nostra I	40	9	49
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Vital I	9	2	11
	3.575	1.128	4.703

Los Certificados de Transmisión Hipotecaria tienen las siguientes características:

- El Fondo ostenta los derechos reconocidos en la normativa legal aplicable.
- Participan de la totalidad del principal de Préstamos Hipotecarios que han servido de base para la titulización.
- La totalidad de los Certificados emitidos por cada entidad cedente con motivo de la emisión de una serie estará representada en un título múltiple.
- El interés que devenga es el del tipo de interés nominal del préstamo hipotecario del que representa cada participación.
- La entidad emisora no asume responsabilidad alguna por impago de los deudores hipotecarios ni garantiza directa o indirectamente el buen fin de la operación, ni otorga garantías o avales ni se establecen pactos de recompra de tales participaciones.

En el supuesto de que algún emisor acordara la modificación del tipo de interés de algún préstamo hipotecario, seguirán correspondiendo al Fondo la totalidad de los intereses ordinarios devengados por éste.

Por su parte, cada uno de los emisores garantizó:

- (i) que es una entidad de crédito debidamente constituida de acuerdo con la legislación vigente y se halla inscrita en el Registro Mercantil y en el Registro de entidades de crédito del Banco de España;
- (ii) que en ningún momento desde su constitución, se ha encontrado en situación de insolvencia, suspensión de pagos, quiebra o concurso;
- (iii) que la entidad cedente dispone de cuentas auditadas individuales de los tres últimos ejercicios con opinión favorable en, al menos, el informe de auditoría de las cuentas anuales correspondientes al último ejercicio cerrado;
- (iv) que sus órganos sociales han adoptado válidamente todos los acuerdos necesarios para la cesión al Fondo de los activos y para otorgar válidamente la escritura de constitución del Fondo o la escritura complementaria, así como los contratos y los compromisos complementarios asumidos;
- (v) que no se ha adoptado ninguna medida encaminada a declarar o instar la declaración de concurso, cese de negocio, disolución, intervención o para el nombramiento de un síndico, interventor, depositario o funcionario análogo, para cualquiera de los bienes de la entidad cedente;
- (vi) que no se ha iniciado y, según su leal saber y entender, no existe riesgo de que se inicie ningún litigio u otro procedimiento, ni se ha adoptado por la autoridad competente ninguna medida administrativa o judicial cuyo resultado puede afectar sustancialmente de manera adversa (i) a la situación patrimonial de la entidad cedente, o (ii) a la capacidad de la entidad cedente para cumplir todas las obligaciones que tenga asumidas frente a terceros y que vaya a asumir frente al Fondo;
- (vii) que la cesión de los activos y las obligaciones que se derivan de los contratos que forman parte de la operación de titulización no contravienen ninguna norma estatutaria o societaria de la entidad cedente ni suponen, en ningún caso, la violación de ningún otro contrato celebrado por la entidad cedente con terceras personas ni de la legislación vigente.

En relación con los Préstamos hipotecarios y los Certificados:

- (i) que los Certificados de Transmisión Hipotecaria se emiten de acuerdo con la Ley 2/1981, la disposición adicional quinta de la Ley 3/1994 en su redacción dada por el artículo 18 de la Ley 44/2002, el Real Decreto 685/1982, el Real Decreto 1289/1991 y la demás normativa aplicable, y cumplen todos los requisitos establecidos en las mismas para la emisión de Certificados de Transmisión Hipotecaria. No obstante, los Préstamos hipotecarios no cumplen con todos los requisitos establecidos en la Sección II de la Ley 2/1981 del mercado hipotecario y en el capítulo II del Real Decreto 685/1982, de 17 de marzo, siendo cedidos al Fondo mediante la emisión de los Certificados de Transmisión Hipotecaria, de acuerdo con la Ley 44/2002;
- (ii) que los Certificados de Transmisión Hipotecaria se emiten por el mismo plazo que resta hasta el vencimiento y por el mismo tipo de interés de cada uno de los Préstamos hipotecarios a que correspondan.
- (iii) que los Préstamos Hipotecarios existen y son válidos y ejecutables de acuerdo con la legislación aplicable;
- (iv) que es titular pleno de la totalidad de los Préstamos Hipotecarios y de las subsiguientes hipotecas inmobiliarias, no existiendo impedimento alguno para su cesión al Fondo;
- (v) que los datos relativos a los Préstamos Hipotecarios que se incluyen en el presente folleto y en las condiciones finales correspondientes, así como en la escritura de constitución y en la escritura complementaria correspondiente son correctos y completos y reflejan fiel y exactamente la realidad de dichos préstamos hipotecarios, sin que incluyan informaciones u omisiones que puedan inducir a error a los inversores;
- (vi) que la emisión de los Certificados no infringirá la legislación española;
- (vii) que los Préstamos Hipotecarios han sido concedidos para financiar a particulares, para cualquier finalidad;
- (viii) que ninguno de los Préstamos Hipotecarios está destinado a la financiación de locales comerciales ni de terrenos ni tienen la consideración de préstamos a promotores;
- (ix) que la totalidad de los Préstamos Hipotecarios se encuentra totalmente dispuesta;
- (x) que la vivienda sobre la que se constituye la hipoteca será, en la fecha de cesión al Fondo, una vivienda terminada y que contará con la licencia de primera ocupación;

- (xi) que todos los Préstamos Hipotecarios están garantizados por hipoteca inmobiliaria sobre vivienda;
- (xii) que todos los Préstamos Hipotecarios están formalizados en escritura pública y todas las hipotecas se encuentran debidamente constituidas e inscritas en los correspondientes registros de la propiedad. La inscripción de las fincas hipotecadas está vigente y sin contradicción alguna;
- (xiii) que las Hipotecas están constituidas sobre fincas que pertenecen en pleno dominio y en su totalidad al respectivo deudor cedido, no teniendo conocimiento la entidad cedente de la existencia de litigios sobre la titularidad de dichas fincas que puedan perjudicar a las hipotecas;
- (xiv) que las viviendas Hipotecadas han sido tasadas por entidades debidamente facultadas al efecto, constando tales tasadores debidamente inscritos en el correspondiente registro oficial del Banco de España y estando acreditada la tasación mediante la correspondiente certificación. Las tasaciones efectuadas cumplen todos los requisitos establecidos en la legislación sobre el mercado Hipotecario;
- (xv) que no tiene conocimiento de que se haya producido el desmerecimiento de la tasación de ninguna finca hipotecada en más de un 20% del valor de tasación;
- (xvi) que los Préstamos Hipotecarios no están instrumentados en títulos valores, ya sean nominativos, a la orden o al portador;
- (xvii) que, en la fecha de emisión de los Certificados, ninguno de los Préstamos Hipotecarios tendrá débitos vencidos pendientes de cobro por un plazo superior a treinta (30) días;
- (xviii) que no tiene conocimiento de que ninguno de los deudores cedidos de los Préstamos Hipotecarios sea titular de ningún derecho de crédito frente a la entidad cedente por el que les confiera derecho a ejercitar la compensación;
- (xix) que tanto la concesión de los Préstamos Hipotecarios como la emisión de los certificados, así como todos los actos relacionados con ellos, se han realizado o se realizarán según los criterios de mercado;
- (xx) que se han seguido fielmente los criterios establecidos por la entidad cedente en su memorándum sobre criterios de concesión de préstamos, que se adjunta a la escritura complementaria, o a la escritura de constitución en relación con la primera serie, como anexo y que se detalla en las condiciones finales, en la concesión de todos los Préstamos Hipotecarios;

- (xxi) que todas las Escrituras de las Hipotecas constituidas sobre las viviendas a que se refieren los préstamos hipotecarios están debidamente depositadas en los archivos de la entidad cedente adecuados al efecto a disposición de la sociedad gestora y que todos los préstamos hipotecarios están claramente identificados, tanto en soporte informático como por sus escrituras;
- (xxii) que, en la fecha de emisión de los Certificados de Transmisión Hipotecaria, el saldo vivo total de cada préstamo hipotecario cuya cesión se instrumente mediante la emisión de tales certificados será equivalente al valor nominal inicial del correspondiente Certificado de transmisión de hipoteca a emitir;
- (xxiii) que desde el momento de su concesión, los Préstamos Hipotecarios han sido y están siendo administrados por la entidad cedente de acuerdo con los procedimientos habituales que tiene establecidos;
- (xxiv) que no tiene conocimiento de la existencia de litigios de cualquier tipo en relación con los Préstamos Hipotecarios que puedan perjudicar la validez de los mismos;
- (xxv) que no tiene conocimiento de que algún deudor cedido se encuentre en situación concursal alguna;
- (xxvi) que todos los Préstamos Hipotecarios tienen una fecha de vencimiento final inferior a la fecha de vencimiento final de la serie correspondiente, y en todo caso anterior a la fecha en que se cumplan cincuenta y siete (57) años desde la fecha de constitución del Fondo;
- (xxvii) que, a la fecha de cesión, la entidad cedente no ha recibido ninguna notificación de amortización anticipada total de ninguno de los Préstamos Hipotecarios;
- (xxviii) que no tiene conocimiento de que exista ninguna circunstancia que impida la ejecución de la garantía hipotecaria relativa a los Préstamos Hipotecarios;
- (xxix) que los Préstamos Hipotecarios no están afectos a emisión alguna de bonos hipotecarios o participaciones hipotecarias, distinta de la emisión de los certificados y a partir de la emisión de éstos, no estarán afectos a emisión alguna de bonos hipotecarios, participaciones hipotecarias u otros Certificados de Transmisión Hipotecaria;
- (xxx) que a la fecha de cesión, los Préstamos Hipotecarios presentan al menos dos (2) cuotas pagadas;

- (xxxi) que ninguno de los contratos que regulan los préstamos integrados en la cartera de activos titulizables, contiene cláusulas que permitan al deudor cedido solicitar en cualquier momento de la vida del préstamo el diferimiento en el pago de intereses y/o principal del préstamo (salvo las relativas al periodo de carencia inicial para el pago de principal);
- (xxxii) que las cuotas de intereses y principal de los Préstamos Hipotecarios se liquidarán con una frecuencia igual o superior a la frecuencia de pago de los Bonos;
- (xxxiii) que el pago de los Préstamos Hipotecarios objeto de emisión de Certificados de Transmisión Hipotecaria se instrumenta mediante domiciliación bancaria;
- (xxxiv) que todos los Préstamos Hipotecarios están denominados y son pagaderos exclusivamente en euros.

El tipo medio anual de la cartera de préstamos participados durante los ejercicios 2016 y 2015 por serie es el siguiente:

	2016	2015
AyT C.G.H. BBK	0,70%	1,12%
AyT C.G.H. BBK II	0,68%	1,11%
AyT C.G.H. C. Cantabria	0,70%	1,11%
AyT C.G.H. C. Laietana	-	3,30%
AyT C.G.H. CCM	1,16%	1,94%
AyT C.G.H. C. Galicia I	0,77%	1,20%
AyT C.G.H. C. Galicia II	0,82%	1,26%
AyT C.G.H. C. Granada	2,72%	3,62%
AyT C.G.H Sa Nostra	0,91%	1,32%
AyT C.G.H. C. Vital	0,56%	0,93%

Con los siguientes tipos máximos y mínimos:

	Máximo	Mínimo
AyT C.G.H. BBK I	4,01%	0,24%
AyT C.G.H. BBK II	4,18%	0,24%
AyT C.G.H. C. Cantabria	5,25%	0,29%
AyT C.G.H. CCM	6,50%	0,19%
AyT C.G.H. C. Galicia I	5,00%	0,19%
AyT C.G.H. C. Galicia II	6,25%	0,19%
AyT C.G.H. C. Granada	6,50%	0,24%
AyT C.G.H Sa Nostra	4,00%	0,22%
AyT C.G.H. C. Vital	2,60%	0,38%

La tasa de amortización anticipada de los activos cedidos del Fondo es del 34,27 % a 31 de diciembre de 2016 (2015: 8,28%).

En el estado S.05.1 (Cuadro A), incluido como Anexo en las presentes Cuentas Anuales se muestran la tasa de activos dudosos, tasa de fallidos y tasa de recuperación de fallidos al cierre del ejercicio actual y al cierre del ejercicio anterior (los conceptos de fallido y activo moroso que aparecen en el folleto de emisión del Fondo no coinciden con la definición contable de dichos conceptos, por lo que en el cuadro anteriormente mencionado las tasas correspondientes al escenario inicial se han informado con valor cero).

Durante el ejercicio 2016 se han devengado intereses de los activos titulizados por importe de 34.853 miles de euros (2015: 50.735 miles de euros) de los que, al cierre del ejercicio 2016, 810 miles de euros (2015: 1.254 miles de euros) se encuentran pendientes de vencimiento, estando registrados en el epígrafe “Activos titulizados – Intereses y gastos devengados no vencidos” en el activo corriente del balance de situación a dicha fecha. Asimismo, a 31 de diciembre de 2016, 717 miles de euros (2015: 988 miles de euros) se encuentran vencidos e impagados, estando registrados en el epígrafe “Activos titulizados – Intereses vencidos e impagados” en el activo corriente del balance adjunto. A 31 de diciembre de 2016, los intereses cobrados de activos titulizados que estaban clasificados como dudosos del epígrafe “Intereses y rendimientos asimilados – Activos titulizados” ascienden a 1.073 miles de euros (2015: 366 miles de euros).

La información relativa a intereses vencidos e impagados del cuadro anterior, recoge tanto las importes de pago con antigüedad inferior a 90 días, como los importes impagados con antigüedad superior a 90 días.

El desglose de los Activos titulizados en función del vencimiento final de las operaciones a 31 de diciembre de 2016 y 2015 se muestra a continuación:

	Miles de Euros					
	Hasta 1 año	Entre 1 y 2 años	Entre 2 y 3 años	Entre 3 y 5 años	Entre 5 y 10 años	Más de 10 años
2016:						
Activos titulizados	659	1.531	3.614	17.222	131.581	2.882.284
Intereses y gastos devengados no vencidos	810	-	-	-	-	-

	Miles de Euros					
	Hasta 1 año	Entre 1 y 2 años	Entre 2 y 3 años	Entre 3 y 5 años	Entre 5 y 10 años	Más de 10 años
2015:						
Activos titulizados	514	1.316	2.449	14.331	117.649	3.187.702
Intereses y gastos devengados no vencidos	1.254	-	-	-	-	-

Por otro lado, el desglose por vencimientos de los Activos titulizados, al 31 de diciembre de 2016 y 2015, teniendo en cuenta el calendario de amortización previsto de las operaciones, sin considerar, en su caso, las correcciones de valor por deterioro de activos, los intereses vencidos e impagados y los intereses devengados, se muestra a continuación:

	Miles de Euros					
	Hasta 1 año	Entre 1 y 2 años	Entre 2 y 3 años	Entre 3 y 5 años	Entre 5 y 10 años	Más de 10 años
2016:						
Activos titulizados	357.935	294.486	273.347	513.503	953.227	644.393
Intereses y gastos devengados no vencidos	810	-	-	-	-	-

	Miles de Euros					
	Hasta 1 año	Entre 1 y 2 años	Entre 2 y 3 años	Entre 3 y 5 años	Entre 5 y 10 años	Más de 10 años
2015:						
Activos titulizados	299.028	245.342	148.770	404.260	887.837	1.338.724
Intereses y gastos devengados no vencidos	1.251	-	-	-	-	-

7. EFECTIVO Y OTROS ACTIVOS LÍQUIDOS EQUIVALENTES

Con fecha 17 de julio de 2012, de conformidad con lo dispuesto en el folleto y en el contrato de servicios financieros, como consecuencia del descenso de la calificación crediticia otorgada a CecaBank, S.A., por Moody's el 20 de febrero de 2012, la Sociedad Gestora procedió a sustituir al agente financiero por Barclays Bank PLC, Sucursal en España, en su condición de agente de pagos del Fondo para las Series BBK I, BBK II, Caja Vital I, Sa Nostra I, Caja Granada I, Caixa Galicia I y Caixa Galicia II. Dado lo anterior, la Sociedad Gestora procedió a la suscripción de un nuevo contrato de servicios financieros con dicha entidad, transfiriendo el saldo de la cuenta de tesorería abierta en CecaBank, S.A., a una nueva cuenta de tesorería abierta por la Sociedad Gestora, en nombre y representación del Fondo, en Barclays Bank PLC, Sucursal en España. Posteriormente, durante 2016, se traspasaron todas las cuentas que se mantenían en Barclays Bank PLC a Banco Santander, S.A.

Las cuentas de tesorería tienen un rendimiento mínimo igual al resultado de añadir al Euribor a seis (6) meses, determinado dos (2) Días Hábiles antes del inicio de cada período de devengo de intereses de la Cuenta de Tesorería, un diferencial de cuatro (4) puntos básicos (0,04%). En caso de que el tipo aplicable resultase negativo se entenderá que es igual a cero (0).

Las Series CCM I y Cantabria se encuentran suscritas al contrato de servicios financieros entre Banco Santander, S.A. y la Sociedad Gestora. El Agente Financiero garantiza un tipo de interés igual a la media aritmética de los tipos medios interbancarios día a día correspondientes al período de devengo de intereses reducido en veinticinco (25) puntos básicos (0,25%).

Con fecha 18 de diciembre de 2014 la Sociedad Gestora acordó sustituir para la Serie Caixa Laietana al Banco Santander, S.A. como Agente Financiero por BBVA, S.A. A partir de dicha fecha BBVA, S.A. garantiza sobre el saldo de la cuenta tesorería un tipo de interés igual al Euribor a tres (3) meses.

Sin perjuicio de lo dispuesto anteriormente, la Sociedad Gestora, con objeto de cubrir los posibles desfases temporales entre el calendario de los flujos de principal e intereses de los activos y el de los bonos emitidos, podrá invertir temporalmente el saldo de la cuenta de tesorería (hasta la siguiente fecha de determinación) mediante la adquisición de activos de renta fija denominados en euros a un plazo inferior al que restase hasta la fecha de determinación inmediatamente siguiente a la fecha en que se efectúe la inversión temporal, denominados en euros.

Durante el ejercicio 2016 se han devengado intereses de las cuentas de tesorería y cobros por importe de 0 miles de euros (2015: 7 miles de euros) de los que, al cierre del ejercicio 2016, 0 miles de euros (2015: 0 miles de euros) se encuentran pendientes de vencimiento.

El detalle de este epígrafe al 31 de diciembre de 2016 y 2015, es el siguiente:

	Miles de euros	
	2016	2015
Tesorería	262.029	258.553
	<u>262.029</u>	<u>258.553</u>

El saldo de tesorería está compuesto por el siguiente detalle a nivel consolidado:

Ejercicio 2016

	Miles de Euros			
	Cuenta de tesorería	Fondo de Reserva	Depósito	Total
C.G.H. BBK I	22.981	46.573	-	69.554
C.G.H. BBK II	7.151	29.111	-	36.362
C.G.H Caja Cantabria	3.273	4.492	531	8.296
C.G.H CCM I	5.582	18.988	2.174	26.744
C.G.H Caixa Galicia	14.062	21.799	18.829	54.690
C.G.H Caixa Galicia II	5.977	30.751	17.792	54.520
C.G.H. Caja Granada	3.304	-	12	3.316
C.G.H. Sa Nostra	982	2.520	-	3.502
C.G.H. Caja Vital I	1.555	2.870	620	5.045
Total	64.867	157.104	39.958	262.029

Ejercicio 2015

	Miles de Euros			
	Cuenta de tesorería	Fondo de Reserva	Depósito	Total
C.G.H. BBK I	22.853	48.578	-	71.431
C.G.H. BBK II	8.274	32.737	-	41.011
C.G.H Caja Cantabria	4.150	3.657	872	8.679
C.G.H Caixa Laietana	3.296	3.104	-	6.400
C.G.H CCM I	5.151	17.723	2.375	25.249
C.G.H Caixa Galicia	14.558	22.050	8.880	45.488
C.G.H Caixa Galicia II	5.326	33.200	8.029	46.555
C.G.H. Caja Granada	5.626	-	107	5.733
C.G.H. Sa Nostra	895	2.448	-	3.343
C.G.H. Caja Vital I	1.449	2.819	396	4.664
Total	71.578	166.316	20.659	258.553

Depósitos

La contrapartida de estos depósitos es la cuenta “Otros pasivos financieros” del Pasivo no corriente del balance de situación y su movimiento se incorpora en el Estado de Flujos de Efectivo en el apartado “Otros flujos de caja proveniente de operaciones del Fondo – Otros”.

1. C.G.H Caja Cantabria: Debido a que la deuda no garantizada y/o subordinada de la Entidad de Contrapartida Swap ha sido rebajada a una calificación F3 (Fitch) para largo plazo, durante 2012 se suscribió un depósito por importe de 600 miles de euros.

A 31 de diciembre de 2016 y 2015 el importe depositado asciende a 440 y 620 miles de euros, respectivamente.

Asimismo, con fecha 15 de abril de 2013 se formalizó el suplemento al contrato de administración en el que se establece la constitución de un depósito a favor del Fondo en una entidad con una calificación crediticia suficiente para que la calificación de los Bonos del Tramo A no se vean afectados.

El importe del referido depósito será calculado en cada Fecha de Pago por la Sociedad Gestora, siendo éste el importe equivalente a la suma de:

- La cantidad estimada del próximo pago de intereses que generarían los Bonos del Tramo A durante la fecha de pago siguiente a la fecha de cálculo del depósito
- La cantidad aplicada para el primero de los conceptos del Orden de prelación de pagos en la fecha de cálculo del depósito

A 31 de diciembre de 2016 y 2015, el importe depositado asciende a 91 y 252 miles de euros, respectivamente.

2. C.G.H CCM

Con fecha 17 de enero de 2013 se ha formalizado el suplemento al contrato de administración en el que se establece la constitución de un depósito a favor del Fondo en una entidad con una calificación crediticia suficiente para que la calificación de los Bonos del Tramo A no se vean afectados.

El importe del referido depósito será calculado en cada Fecha de Pago por la Sociedad Gestora, siendo éste el importe equivalente a la estimación del próximo pago de intereses que generarían los Bonos del Tramo A durante el siguiente pago a la fecha de cálculo del depósito.

A 31 de diciembre de 2016 y 2015, el importe depositado asciende a 2.174 y 2.376 miles de euros, respectivamente.

Con fecha 8 de abril de 2013 se cancela el depósito de garantía Swap debido al cambio en la remuneración de los Bonos, de tipo variable a tipo fijo (Nota 11)

4. C.G.H Caixa Galicia, I:

Debido a que la deuda no garantizada y/o subordinada de la Entidad de Contrapartida Swap fue rebajada a una calificación F3 (Fitch) para largo plazo, con fecha 8 de agosto de 2011 se procedió a la apertura de una cuenta de depósito swap. A 31 de diciembre de 2016 y 2015, el importe depositado asciende a 10.440 y 0 miles de euros, respectivamente.

Asimismo, con fecha 8 de octubre de 2010 se formalizó el suplemento al contrato de administración en el que se establece la constitución de un depósito a favor del Fondo en una entidad con una calificación crediticia suficiente para que la calificación de los Bonos del Tramo A no se vean afectados.

El importe del referido depósito será calculado en cada Fecha de Pago por la Sociedad Gestora, siendo éste el importe equivalente a la suma entre:

- El 1,25% del saldo vivo de los Activos
- La suma del importe de la siguiente cuota a pagar correspondiente a cada Activo, multiplicado por 1,5

A 31 de diciembre de 2016 y 2015 el importe depositado asciende a 8.389 y 8.880 miles de euros, respectivamente.

5. C.G.H Caixa Galicia, II:

Debido a que la deuda no garantizada y/o subordinada de la Entidad de Contrapartida Swap fue rebajada a una calificación F3 (Fitch) para largo plazo, con fecha 8 de agosto de 2012 se procedió a la apertura de una cuenta de depósito swap. A 31 de diciembre de 2016 y 2015, el importe depositado asciende a 10.110 y 0 miles de euros, respectivamente.

Asimismo, con fecha 8 de octubre de 2010 se formalizó el suplemento al contrato de administración en el que se establece la constitución de un depósito a favor del Fondo en una entidad con una calificación crediticia suficiente para que la calificación de los Bonos del Tramo A no se vean afectados.

El importe del referido depósito será calculado en cada Fecha de Pago por la Sociedad Gestora, siendo éste el importe equivalente a la suma entre:

- El 1,25% del saldo vivo de los Activos
- La suma del importe de la siguiente cuota a pagar correspondiente a cada Activo, multiplicado por 1,5

A 31 de diciembre de 2016 y 2015 el importe depositado asciende a 7.682 y 8.029 miles de euros, respectivamente.

6. C.G.H. Caja Granada:

Debido al descenso de la calificación crediticia del administrador a una calificación F3 (Fitch), durante 2012, se suscribió un depósito "Commingling Risk in Structured Finance Transactions: servicer and Account Bank Criteria" por importe de 1.401 miles de euros. A 31 de diciembre de 2016 y 2015, el importe depositado asciende a 12 y 109 miles de euros, respectivamente.

7. C.G.H. Sa Nostra:

Debido a que la deuda no garantizada y/o subordinada de la Entidad de Contrapartida Swap ha sido rebajada a una calificación F3 (Fitch) para largo plazo, se ha suscrito un depósito por importe de 120 miles de euros. A 31 de diciembre de 2016 y 2015 el importe depositado asciende a 3.502 y 0 miles de euros, respectivamente.

9. C.G.H. Caja Vital I:

Debido a que la deuda no garantizada y/o subordinada de la Entidad de contrapartida Swap fue rebajada a una calificación por debajo de A/F1 (Fitch). Durante 2011, se suscribió un depósito por importe de 4.880 miles de euros. A 31 de diciembre de 2016 y 2015, el importe depositado asciende a 600 y a 290 miles de euros, respectivamente.

Asimismo, con fecha 31 de julio de 2013 se ha formalizado el suplemento al contrato de administración en el que se establece la constitución de un depósito a favor del Fondo en una entidad con una calificación crediticia suficiente para que la calificación de los Bonos del Tramo A no se vean afectados.

El importe del referido depósito será calculado en cada Fecha de Pago por la Sociedad Gestora, siendo éste el importe equivalente a la suma de:

- La cantidad estimada del próximo pago de intereses que generarían los Bonos del Tramo A durante la fecha de pago siguiente a la fecha de cálculo del depósito
- La cantidad aplicada para gastos ordinarios y extraordinarios en la fecha de cálculo del depósito.

A 31 de diciembre de 2016 y 2015, el importe depositado asciende a 20 y 106 miles de euros, respectivamente.

Fondo de Reserva

Como mecanismo de garantía ante posibles pérdidas debidas a activos y con la finalidad de permitir los pagos a realizar por el Fondo de acuerdo con el orden de prelación de pagos, la Sociedad Gestora, en nombre y representación del Fondo, constituirá en relación con cada Serie un depósito en la cuenta de tesorería de dicha Serie denominado Fondo de Reserva (en adelante, el “Fondo de Reserva”).

La dotación inicial del Fondo de Reserva se realizará con cargo al Préstamo Subordinado para dotación del Fondo de Reserva.

Posteriormente, en cada Fecha de Pago, el Fondo de Reserva deberá ser dotado, con cargo a los fondos disponibles, de acuerdo con el orden de prelación de pagos, hasta alcanzar la cantidad requerida del Fondo de Reserva (la “cantidad requerida del Fondo de Reserva”), que será la menor de las siguientes cantidades:

- (a) El importe inicial del Fondo de Reserva, que será determinado en las condiciones finales de la serie correspondiente y será igual a un porcentaje del saldo vivo inicial de los Bonos correspondiente.
- (b) La cantidad mayor entre:
 - (i) el importe equivalente al doble del porcentaje inicial del Fondo de Reserva sobre el importe nominal de los Bonos en la fecha de emisión, aplicado sobre el saldo de principal pendiente de pago de los Bonos en cada fecha de pago de la serie correspondiente.

- (ii) el importe mínimo del Fondo de Reserva, que será equivalente a un porcentaje sobre el saldo vivo de los activos en la fecha de cesión correspondiente que se incluirá en las condiciones finales de la serie correspondiente y que no será superior al importe inicial del Fondo de Reserva.

Por otro lado el importe del Fondo de Reserva no se reducirá, si concurren en una fecha de pago cualquiera de las siguientes circunstancias:

- (a) Que el importe a que ascienda la suma del saldo vivo de los activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos (los “Activos morosos”), deducidos los activos fallidos, fuera superior a un porcentaje que se determinará en las condiciones finales, del saldo vivo de los activos que no tengan la consideración de activos fallidos en cualquier momento (el “porcentaje de activos morosos”);
- (b) cuando el saldo vivo de los activos (una vez deducidos los activos fallidos) en la fecha de determinación correspondiente a la fecha de pago en curso sea inferior al diez por ciento (10%) del saldo vivo de los activos en la fecha de emisión de la serie correspondiente, sin que se haya ejercitado la opción de amortización anticipada;
- (c) si en la fecha de pago anterior, el Fondo de Reserva no se dotó en la cantidad requerida del Fondo de Reserva;
- (d) que en la fecha de determinación correspondiente, el saldo acumulado de los activos fallidos sea superior a un porcentaje del saldo vivo de los activos en la fecha de cesión, que se determinará en las correspondientes condiciones finales (el “porcentaje de activos fallidos”);
- (e) que no hubieran transcurrido tres (3) años desde la fecha de emisión de la serie correspondiente.

Al 31 de diciembre de 2016, el importe del Fondo de Reserva correspondiente a la Serie AyT Colateral Global Hipotecario BBK I es inferior al importe requerido de 54.600 miles de euros, debiendo alcanzar esa cantidad en la próxima fecha de pago (23 de marzo de 2017) de esta serie.

Al 31 de diciembre de 2016, el importe del Fondo de Reserva correspondiente a la Serie AyT Colateral Global Hipotecario BBK II es inferior al importe requerido de 39.700 miles de euros, debiendo alcanzar esa cantidad en la próxima fecha de pago (2 de junio de 2017) de esta serie.

Al 31 de diciembre de 2016, el importe del Fondo de Reserva correspondiente a la Serie AyT Colateral Global Hipotecario Cantabria I es inferior al importe requerido de 8.050 miles de euros, debiendo alcanzar esa cantidad en la próxima fecha de pago (20 de marzo de 2017) de esta serie.

Al 31 de diciembre de 2016, el importe del Fondo de Reserva correspondiente a la Serie AyT Colateral Global Hipotecario CCM I es inferior al importe requerido de 28.000 miles de euros, debiendo alcanzar esa cantidad en la próxima fecha de pago (28 de mayo de 2017) de esta serie.

Al 31 de diciembre de 2016, el importe del Fondo de Reserva correspondiente a la Serie AyT Colateral Global Hipotecario Galicia II es inferior al importe requerido de 33.250 miles de euros, debiendo alcanzar esa cantidad en la próxima fecha de pago (27 de abril de 2017) de esta serie.

A 31 de diciembre de 2016, el importe del Fondo de Reserva correspondiente a la Serie AyT Colateral Global Hipotecario Granada I es inferior al importe requerido de 5.999 miles de euros, debiendo alcanzar esa cantidad en la próxima fecha de pago (20 de mayo de 2017).

A 31 de diciembre de 2016, el importe del Fondo de Reserva correspondiente a la Serie AyT Colateral Global Hipotecario Sa Nostra I es inferior al importe requerido de 2.616 miles de euros, debiendo alcanzar esa cantidad en la próxima fecha de pago (18 de mayo de 2017).

Al 31 de diciembre de 2016, el importe del Fondo de Reserva correspondiente a la Serie AyT Colateral Global Hipotecario Galicia I es inferior al importe requerido de 22.050 miles de euros, debiendo alcanzar esa cantidad en la próxima fecha de pago (19 de enero de 2017) de esta serie.

Al 31 de diciembre de 2016, el importe del Fondo de Reserva correspondiente a la Serie AyT Colateral Global Hipotecario Vital I es inferior al importe requerido de 3.139 miles de euros, debiendo alcanzar esa cantidad en la próxima fecha de pago (18 de mayo de 2017) de esta serie.

A continuación se muestra el detalle del Fondo de Reserva por cada una de la series a 31 de diciembre de 2016:

	Fecha de pago	Miles de euros		
		Fondo requerido	Fondo dotado	Déficit Fondo de reserva
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK I	03/16	54.600	47.674	6.926
	09/16	54.600	46.573	8.027
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK II	06.16	39.700	30.947	8.753
	12/16	39.700	29.211	10.489
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Caja Cantabria I	03/16	8.050	4.023	4.027
	09/16	8.050	4.492	3.558
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Caja Laietana I	03/16	5.950	2.811	3.139
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. CCM I	05/16	28.000	18.943	9.057
	11/16	28.000	18.988	9.012
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Galicia I	01/16	22.050	22.050	-
	07/16	22.050	21.799	251
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Galicia II	04/16	33.250	33.003	247
	10/16	33.250	30.751	2.500
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Granada I	11/16	5.998	-	5.998
	05/16	5.998	-	5.998
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Sa Nostra I	05/16	2.616	2.616	-
	11/16	2.616	2.520	96
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Vital I	05/16	3.138	2.821	317
	11/16	3.138	2.870	268

A fecha de formulación de las cuentas anuales, el Fondo de Reserva para cada una de las series que presentaban déficit de Fondo de Reserva a cierre del ejercicio 2016 es el siguiente:

	Miles de euros		
	Fondo requerido	Fondo dotado	Déficit Fondo de reserva
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK I	54.600	46.573	8.027
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK II	39.700	29.211	10.489
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Cantabria I	8.050	3.946	4.104
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Laietana I	5.950	2.811	3.139
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. CCM I	28.000	18.988	9.012
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Galicia II	33.250	30.751	2.499
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Granada I	5.998	-	5.998
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Sa Nostra I	2.616	2.520	96
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Vital I	3.138	2.870	268

A continuación se muestra el detalle del Fondo de Reserva por cada una de la series a 31 de diciembre de 2015:

	Fecha de pago	Miles de euros		
		Fondo requerido	Fondo dotado	Déficit Fondo de reserva
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK I	03/15	54.600	49.578	5.022
	09/15	54.600	48.578	6.022
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK II	06/15	39.700	35.024	4.676
	12/15	39.700	32.737	6.963
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Caja Cantabria I	03/15	4.870	1.690	3.180
	09/15	3.657	(736)	4.393
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Caja Laietana I	03/15	5.950	2.648	3.302
	09/15	5.950	3.104	2.846
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. CCM I	05/15	-	-	-
	11/15	28.000	17.723	10.277
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Galicia I	01/15	22.050	22.050	-
	07/15	22.050	22.050	-
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Galicia II	04/15	33.250	33.250	-
	10/15	33.250	33.200	50
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Granada I	11/15	5.998	-	5.998
	05/15	5.998	-	5.998
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Sa Nostra I	05/15	2.616	2.616	-
	11/15	2.616	2.446	170
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Vital I	05/15	3.138	2.973	165
	11/15	3.138	2.819	319

A fecha de formulación de las cuentas anuales, el Fondo de Reserva para cada una de las series que presentaban déficit de Fondo de Reserva a cierre del ejercicio 2015 es el siguiente:

	Miles de euros		
	Fondo requerido	Fondo dotado	Déficit Fondo de reserva
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK I	54.600	48.578	6.022
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK II	39.700	32.737	6.963
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Cantabria I	3.657	(736)	4.393
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Laietana I	5.950	3.104	2.846
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. CCM I	28.000	17.723	10.277
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Galicia II	33.250	33.200	50
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Granada I	5.998	-	5.998
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Sa Nostra I	2.616	2.446	170

Según lo previsto en el contrato de prestación de servicios financieros, se ingresarán en la cuenta de tesorería:

- (i) el importe efectivo por el desembolso de la suscripción de los Bonos de la serie correspondiente;
- (ii) los pagos correspondientes a principal e intereses de los activos;
- (iii) cualesquiera otras cantidades ingresadas por el Fondo en virtud de los activos de dicha serie;
- (iv) las cantidades que en cada momento compongan el Fondo de Reserva;
- (v) en su caso, las cantidades que resulten pagaderas por la entidad de contrapartida al amparo del contrato de swap;
- (vi) las cantidades a que asciendan los rendimientos obtenidos por los saldos habidos en la propia cuenta de tesorería o las cantidades a que asciendan los rendimientos de activos de renta fija, de acuerdo con lo recogido en el presente apartado;
- (vii) las cantidades procedentes de la disposición del Préstamo Subordinado para gastos iniciales;
- (viii) las cantidades a que asciendan las retenciones a cuenta de los rendimientos de capital mobiliario que, en su caso, de acuerdo con la legislación vigente en cada momento durante la vida del Fondo, corresponda efectuar en cada fecha de pago por los intereses de los Bonos satisfechos por el Fondo, hasta que corresponda efectuar su ingreso a la administración Tributaria o se solicite su devolución por parte de los titulares de los Bonos.

De acuerdo con la Escritura de constitución, el Fondo de Reserva debe estar depositado en la cuenta de tesorería, sin perjuicio de lo dispuesto anteriormente, la sociedad gestora, podrá invertir temporalmente el saldo de la cuenta de tesorería mediante la adquisición de activos de renta fija.

8. PASIVOS FINANCIEROS

8.1. Obligaciones y Otros valores emitidos

La Sociedad Gestora, en nombre y representación del Fondo, y con cargo al mismo, procedió en la fecha de constitución del Fondo a la creación de un programa de emisión de Bonos de Titulización que se emitirán con cargo al activo del Fondo. Al amparo de dicho programa se realizarán sucesivas emisiones de Bonos, constitutivas cada una de ellas de una serie. Las sucesivas series emitidas al amparo del programa no podrán ser objeto de ampliación ni podrán incorporar nuevos activos con posterioridad a la fecha de emisión, salvo los supuestos de sustitución de activos.

Cada una de las series de Bonos que se emitan estará respaldada por nuevos activos correspondientes a dicha Serie que se incorporarán al Fondo con motivo de dicha Emisión, y estarán afectos al pago de los Bonos de dicha Serie exclusivamente. Los pagos a realizar para cada una de las Series se llevarán a cabo exclusivamente con los fondos disponibles de dicha serie, sin que exista en ningún caso subordinación ni solidaridad entre las distintas series de Bonos.

La Sociedad Gestora, en representación y por cuenta del Fondo, puede realizar emisiones de Bonos al amparo del Fondo durante la vida efectiva, con un vencimiento máximo que no podrá superar en todo caso cincuenta y siete (57) años desde la fecha de constitución del Fondo, siempre que se cumplan los requisitos subjetivos, objetivos y formales establecidos en el Real Decreto 926/1998.

Pueden realizarse hasta diez (10) Emisiones por cada año de vigencia del programa durante la vida efectiva, con un máximo de cincuenta (50) Series vivas en cada momento.

El saldo vivo máximo de los Bonos de las distintas series emitidas al amparo del programa es de hasta 16.000.000 miles de euros.

Las características de los Bonos emitidos inicialmente, son las siguientes:

Serie	Fecha de emisión de los bonos	Importe nominal de la emisión	Número de tramos	Número de bonos	Importe nominal unitario	Precio de emisión	Interés variable	Periodicidad de pago de intereses	Fechas de pagos de intereses	Fecha de inicio del devengo de intereses	Amortización
C.G.H BBK I	24 de abril de 2007	1.500.000.000 euros	4	15.000 Bonos	100.000 euros	A la par, libre de impuestos y gastos de suscripción para el suscriptor en todo caso.	-Euribor a 6 meses + 0,17% para el Tramo A. -Euribor a 6 meses + 0,30% para el Tramo B. -Euribor a 6 meses + 0,65% para el Tramo C. -Euribor a 6 meses + 2,00% para el Tramo D.	Semestral	22 de marzo y septiembre	25 de abril de 2007	La Fecha de Vencimiento Final de los Bonos de la Serie AyT Colaterales Global Hipotecario BBK I será el 22 de marzo del 2047, o si no fuera Día Hábil, el siguiente Día Hábil.
C.G.H BBK II	10 de abril de 2008	1.000.000.000 euros	4	10.000 Bonos	100.000 euros	A la par, libre de impuestos y gastos de suscripción para el suscriptor en todo caso.	-Euribor a 6 meses + 0,30% para el Tramo A. -Euribor a 6 meses + 0,60% para el Tramo B. -Euribor a 6 meses + 1,00% para el Tramo C. -Euribor a 6 meses + 2,00% para el Tramo D.	Semestral	2 de junio y diciembre	11 de abril de 2008	La Fecha de Vencimiento Final de los Bonos de la Serie AyT Colaterales Global Hipotecario BBK II será el 2 de junio de 2043, o si no fuera Día Hábil, el siguiente Día Hábil.
C.G.H C. Cantabria	9 de julio de 2008	230.000.000 euros	4	2.300 Bonos	100.000 euros	A la par, libre de impuestos y gastos de suscripción para el suscriptor en todo caso.	-Euribor a 6 meses + 0,30% para el Tramo A. -Euribor a 6 meses + 0,60% para el Tramo B. -Euribor a 6 meses + 1,00% para el Tramo C. -Euribor a 6 meses + 2,00% para el Tramo D.	Semestral	20 de marzo y septiembre	10 de julio de 2008	La Fecha de Vencimiento Final de los Bonos de la Serie AyT Colaterales Global Hipotecario Caja Cantabria será el 20 de marzo de 2048, o si no fuera Día Hábil, el siguiente Día Hábil.
C.G.H C. Circulo de Burgos	25 de marzo de 2008	150.000.000 euros	4	1.500 Bonos	100.000 euros	A la par, libre de impuestos y gastos de suscripción para el suscriptor en todo caso.	-Euribor a 6 meses + 0,30% para el Tramo A. -Euribor a 6 meses + 0,60% para el Tramo B. -Euribor a 6 meses + 1,00% para el Tramo C. -Euribor a 6 meses + 2,00% para el Tramo D.	Semestral	26 de mayo y noviembre	26 de marzo de 2008	La Fecha de Vencimiento Final de los Bonos de la Serie AyT Colaterales Global Hipotecario Caja Circulo de Burgos será el 26 de noviembre de 2047, o si no fuera Día Hábil, el siguiente Día Hábil.
C.G.H C. Laietana	23 de julio de 2008	170.000.000 euros	4	1.700 Bonos	100.000 euros	A la par, libre de impuestos y gastos de suscripción para el suscriptor en todo caso.	-Euribor a 6 meses + 0,30% para el Tramo A. -Euribor a 6 meses + 0,60% para el Tramo B. -Euribor a 6 meses + 1,00% para el Tramo C. -Euribor a 6 meses + 2,00% para el Tramo D.	Semestral	25 de marzo y septiembre	24 de julio de 2008	La Fecha de Vencimiento Final de los Bonos de la Serie AyT Colaterales Global Hipotecario Caja Laietana será el 25 de marzo de 2048, o si no fuera Día Hábil, el siguiente Día Hábil.
C.G.H CCM	28 de diciembre de 2007	800.000.000 euros	4	8.000 Bonos	100.000 euros	A la par, libre de impuestos y gastos de suscripción para el suscriptor en todo caso.	-Euribor a 6 meses + 0,30% para el Tramo A. -Euribor a 6 meses + 0,60% para el Tramo B. -Euribor a 6 meses + 1,50% para el Tramo C. -Euribor a 6 meses + 2,50% para el Tramo D.	Semestral	28 de mayo y noviembre	31 de diciembre de 2007	La Fecha de Vencimiento Final de los Bonos de la Serie AyT Colaterales Global Hipotecario CCM I será el 28 de noviembre de 2047, o si no fuera Día Hábil, el siguiente Día Hábil.
C.G.H C. España	19 de diciembre de 2007	500.000.000 euros	4	5.000 Bonos	100.000 euros	A la par, libre de impuestos y gastos de suscripción para el suscriptor en todo caso.	-Euribor a 6 meses + 0,30% para el Tramo A. -Euribor a 6 meses + 0,60% para el Tramo B. -Euribor a 6 meses + 1,50% para el Tramo C. -Euribor a 6 meses + 2,50% para el Tramo D.	Semestral	24 de mayo y noviembre	20 de diciembre de 2007	La Fecha de Vencimiento Final de los Bonos de la Serie AyT Colaterales Global Hipotecario Caja España I será el 24 de mayo de 2047, o si no fuera Día Hábil, el siguiente Día Hábil.
C.G.H C. Galicia I	7 de marzo de 2008	900.000.000 euros	4	9.000 Bonos	100.000 euros	A la par, libre de impuestos y gastos de suscripción para el suscriptor en todo caso.	-Euribor a 6 meses + 0,30% para el Tramo A. -Euribor a 6 meses + 0,60% para el Tramo B. -Euribor a 6 meses + 1,00% para el Tramo C. -Euribor a 6 meses + 2,00% para el Tramo D.	Semestral	17 de enero y julio	10 de marzo de 2008	La Fecha de Vencimiento Final de los Bonos de la Serie AyT Colaterales Global Hipotecario Caja Galicia I será el 17 de julio de 2047, o si no fuera Día Hábil, el siguiente Día Hábil.

Serie	Fecha de emisión de los bonos	Importe nominal de la emisión	Número de tramos	Número de bonos	Importe nominal unitario	Precio de emisión	Interés variable	Periodicidad de pago de intereses	Fechas de pagos de intereses	Fecha de inicio del devengo de intereses	Amortización
C.G.H.C. Galicia II	27 de junio de 2008	950.000.000 euros	4	9.500 Bonos	100.000 euros	A la par, libre de impuestos y gastos de suscripción para el suscriptor en todo caso.	-Euribor a 6 meses + 0,30% para el Tramo A. -Euribor a 6 meses + 0,60% para el Tramo B. -Euribor a 6 meses + 1,00% para el Tramo C. -Euribor a 6 meses + 2,00% para el Tramo D.	Semestral	27 de abril y octubre	30 de junio de 2008	La Fecha de Vencimiento Final de los Bonos de la Serie AyT Colaterales Global Hipotecario Caja Galicia II será el 27 de abril de 2058, o si no fuera Día Hábil, el siguiente Día Hábil.
C.G.H.C. Granada	11 de diciembre de 2007	399.900.000 euros	4	3.999 Bonos	100.000 euros	A la par, libre de impuestos y gastos de suscripción para el suscriptor en todo caso.	-Euribor a 6 meses + 0,25% para el Tramo A. -Euribor a 6 meses + 0,60% para el Tramo B. -Euribor a 6 meses + 1,50% para el Tramo C. -Euribor a 6 meses + 2,50% para el Tramo D.	Semestral	20 de mayo y noviembre	12 de diciembre de 2007	La Fecha de Vencimiento Final de los Bonos de la Serie AyT Colaterales Global Hipotecario Caja Granada I será el 20 de mayo de 2047, o si no fuera Día Hábil, el siguiente Día Hábil.
C.G.H Sa Nostra	27 de julio de 2007	109.000.000 euros	4	1.090 Bonos	100.000 euros	A la par, libre de impuestos y gastos de suscripción para el suscriptor en todo caso.	-Euribor a 6 meses + 0,17% para el Tramo A. -Euribor a 6 meses + 0,30% para el Tramo B. -Euribor a 6 meses + 0,65% para el Tramo C. -Euribor a 6 meses + 2,00% para el Tramo D.	Semestral	16 de mayo y noviembre	30 de julio de 2007	La Fecha de Vencimiento Final de los Bonos de la Serie AyT Colaterales Global Hipotecario Sa Nostra I será el 16 de mayo de 2047, o si no fuera Día Hábil, el siguiente Día Hábil.
C.G.H.C. Vital	26 de julio de 2007	199.900.000 euros	4	1.999 Bonos	100.000 euros	A la par, libre de impuestos y gastos de suscripción para el suscriptor en todo caso.	-Euribor a 6 meses + 0,17% para el Tramo A. -Euribor a 6 meses + 0,30% para el Tramo B. -Euribor a 6 meses + 0,65% para el Tramo C. -Euribor a 6 meses + 2,00% para el Tramo D.	Semestral	16 de mayo y noviembre	27 de julio de 2007	La Fecha de Vencimiento Final de los Bonos de la Serie AyT Colaterales Global Hipotecario Caja Vital I será el 16 de noviembre de 2047, o si no fuera Día Hábil, el siguiente Día Hábil.
C.G.H.C. Navarra	4 de julio de 2007	100.000.000 euros	4	1.000 Bonos	100.000 euros	A la par, libre de impuestos y gastos de suscripción para el suscriptor en todo caso.	-Euribor a 6 meses + 0,17% para el Tramo A. -Euribor a 6 meses + 0,30% para el Tramo B. -Euribor a 6 meses + 0,65% para el Tramo C. -Euribor a 6 meses + 2,00% para el Tramo D.	Semestral	18 de mayo y noviembre	5 de julio de 2007	La Fecha de Vencimiento Final de los Bonos de la Serie AyT Colaterales Global Hipotecario Caja Navarra I será el 18 de noviembre de 2046, o si no fuera Día Hábil, el siguiente Día Hábil.
C.G.H.C. Manlleu	27 de agosto de 2009	125.000.000 euros	4	1.250 Bonos	100.000 euros	A la par, libre de impuestos y gastos de suscripción para el suscriptor en todo caso.	-Euribor a 6 meses + 0,30% para el Tramo A. -Euribor a 6 meses + 0,60% para el Tramo B. -Euribor a 6 meses + 1,25% para el Tramo C. -Euribor a 6 meses + 2,50% para el Tramo D.	Semestral	22 de mayo y noviembre	31 de agosto de 2009	La Fecha de Vencimiento Final de los Bonos de la Serie AyT Colaterales Global Hipotecario Caja Galicia II será el 27 de noviembre de 2049, o si no fuera Día Hábil, el siguiente Día Hábil.

Con fecha 26 de mayo de 2014 se produjo la amortización anticipada de la totalidad de los Bonos de la serie Caja Círculo Burgos, no habiendo quedado importes pendientes de pago.

El movimiento de los Bonos de Titulización durante los ejercicios 2016 y 2015 ha sido el siguiente:

		Miles de euros					
Serie	Tramos	2016			2015		
		Saldo inicial	Amortizaciones	Saldo final	Saldo inicial	Amortizaciones	Saldo final
C.G.H BBK I	A	773.881	(59.711)	714.170	839.394	(65.513)	773.881
	B	81.000	-	81.000	81.000	-	81.000
	C	13.500	-	13.500	13.500	-	13.500
	D	14.300	-	14.300	14.300	-	14.300
			<u>882.681</u>	<u>(59.711)</u>	<u>822.970</u>	<u>948.194</u>	<u>(65.513)</u>
C.G.H BBK II	A	498.840	(48.597)	450.243	553.257	(54.417)	498.840
	B	30.500	-	30.500	30.500	-	30.500
	C	7.000	-	7.000	7.000	-	7.000
	D	7.000	-	7.000	7.000	-	7.000
			<u>543.340</u>	<u>(48.597)</u>	<u>494.743</u>	<u>597.757</u>	<u>(54.417)</u>
C.G.H Cantabria	A	123.421	(9.837)	113.584	135.317	(11.896)	123.421
	B	12.700	-	12.700	12.700	-	12.700
	C	10.300	-	10.300	10.300	-	10.300
	D	3.500	-	3.500	3.500	-	3.500
			<u>149.921</u>	<u>(9.837)</u>	<u>140.084</u>	<u>161.817</u>	<u>(11.896)</u>
C.G.H C. Laietana	A	31.971	(31.971)	-	42.130	(10.159)	31.971
	B	13.500	(13.500)	-	13.500	-	13.500
	C	5.100	(5.100)	-	5.100	-	5.100
	D	6.000	(6.000)	-	6.000	-	6.000
			<u>56.571</u>	<u>(56.571)</u>	<u>-</u>	<u>66.730</u>	<u>(10.159)</u>
C.G.H CCM	A	356.767	(31.164)	325.603	385.686	(28.919)	356.767
	B	45.600	-	45.600	45.600	-	45.600
	C	28.000	-	28.000	28.000	-	28.000
	D	10.400	-	10.400	10.400	-	10.400
			<u>440.767</u>	<u>(31.164)</u>	<u>409.603</u>	<u>469.686</u>	<u>(28.919)</u>
C.G.H C. España	A	-	-	-	102.548	(102.548)	-
	B	-	-	-	45.000	(45.000)	-
	C	-	-	-	11.000	(11.000)	-
	D	-	-	-	6.500	(6.500)	-
			<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>165.048</u>	<u>(165.048)</u>
C.G.H C. Galicia I	A	404.432	(26.589)	377.843	433.893	(29.461)	404.432
	B	36.900	-	36.900	36.900	-	36.900
	C	21.600	-	21.600	21.600	-	21.600
	D	15.300	-	15.300	15.300	-	15.300
			<u>478.232</u>	<u>(26.589)</u>	<u>451.643</u>	<u>507.693</u>	<u>(29.461)</u>
C.G.H Galicia II	A	364.491	(21.333)	343.158	390.654	(26.163)	364.491
	B	44.600	-	44.600	44.600	-	44.600
	C	38.000	-	38.000	38.000	-	38.000

		Miles de euros					
Serie	Tramos	2016			2015		
		Saldo inicial	Amortizaciones	Saldo final	Saldo inicial	Amortizaciones	Saldo final
	D	12.400	-	12.400	12.400	-	12.400
		459.491	(21.333)	438.158	485.654	(26.163)	459.491
C.G.H C. Granada	A	89.976	(23.976)	66.000	153.463	(63.487)	89.976
	B	18.000	-	18.000	18.000	-	18.000
	C	8.000	-	8.000	8.000	-	8.000
	D	4.800	-	4.800	4.800	-	4.800
		120.776	(23.976)	96.800	184.263	(63.487)	120.776
C.G.H Sa Nostra	A	37.280	(3.014)	34.266	42.407	(5.127)	37.280
	B	7.400	(1.112)	6.288	7.400	-	7.400
	C	3.100	(464)	2.636	3.100	-	3.100
	D	1.100	-	1.100	1.100	-	1.100
		48.880	(4.590)	44.290	54.007	(5.127)	48.880
C.G.H C. Vital	A	103.886	(8.494)	95.392	111.888	(8.002)	103.886
	B	12.600	-	12.600	12.600	-	12.600
	C	8.200	-	8.200	8.200	-	8.200
	D	3.800	-	3.800	3.800	-	3.800
		128.486	(8.494)	119.992	136.488	(8.002)	128.486
TOTAL		3.309.145	(290.862)	3.018.283	3.777.337	(468.192)	3.309.145

Los Bonos están representados por anotaciones en cuenta y están dados de alta en la Sociedad de Gestión de los Sistemas de Registro, Compensación y Liquidación de Valores, S.A. (Iberclear), antiguo Servicio de Compensación y Liquidación de Valores (S.C.L.V.)

Los Bonos se encuentran admitidos a cotización en el mercado de la AIAF.

Ejercicio 2016:

Serie	Miles de euros				
	2016				
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D	Total
<u>C.G.H. BBK I</u>					
Saldo inicial	773.881	81.000	13.500	14.300	882.681
Amortización 24/03/16	(31.560)	-	-	-	(31.560)
Amortización 22/09/16	(28.151)	-	-	-	(28.151)
Saldo final	<u>714.170</u>	<u>81.000</u>	<u>13.500</u>	<u>14.300</u>	<u>822.970</u>
<u>C.G.H. BBK II</u>					
Saldo inicial	498.840	30.500	7.000	7.000	543.340
Amortización 02/06/16	(26.767)	-	-	-	(26.767)
Amortización 02/12/16	(21.830)	-	-	-	(21.830)
Saldo final	<u>450.243</u>	<u>30.500</u>	<u>7.000</u>	<u>7.000</u>	<u>494.743</u>
<u>C.G.H. Cantabria</u>					
Saldo inicial	123.421	12.700	10.300	3.500	149.921
Amortización 20/03/16	(5.304)	-	-	-	(5.304)
Amortización 20/09/16	(4.533)	-	-	-	(4.533)
Saldo final	<u>113.584</u>	<u>12.700</u>	<u>10.300</u>	<u>3.500</u>	<u>140.084</u>
<u>C.G.H. Laietana</u>					
Saldo inicial	31.971	13.500	5.100	6.000	56.571
Amortización 25/03/16	(4.540)	-	-	-	(4.540)
Amortización 14/07/16	(27.431)	(13.500)	(5.100)	(6.000)	(52.031)
Saldo final	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>
<u>C.G.H. CCM</u>					
Saldo inicial	356.767	45.600	28.000	10.400	440.767
Amortización 28/05/16	(16.382)	-	-	-	(16.382)
Amortización 28/11/16	(14.782)	-	-	-	(14.782)
Saldo final	<u>325.603</u>	<u>45.600</u>	<u>28.000</u>	<u>10.400</u>	<u>409.603</u>

Serie	Miles de euros				
	2016				
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D	Total
<u>C.G.H. C. Galicia I</u>					
Saldo inicial	404.432	36.900	21.600	15.300	478.232
Amortización 17/01/16	(13.865)	-	-	-	(13.865)
Amortización 17/07/16	(12.724)	-	-	-	(12.724)
Saldo final	<u>377.843</u>	<u>36.900</u>	<u>21.600</u>	<u>15.300</u>	<u>451.643</u>
<u>C.G.H. C. Galicia II</u>					
Saldo inicial	364.491	44.600	38.000	12.400	459.491
Amortización 28/04/16	(10.849)	-	-	-	(10.849)
Amortización 27/10/16	(10.484)	-	-	-	(10.484)
Saldo final	<u>343.158</u>	<u>44.600</u>	<u>38.000</u>	<u>12.400</u>	<u>438.158</u>
<u>C.G.H. Caja Granada</u>					
Saldo inicial	89.976	18.000	8.000	4.800	120.776
Amortización 20/05/16	(13.861)	-	-	-	(13.861)
Amortización 20/11/16	(10.115)	-	-	-	(10.115)
Saldo final	<u>66.000</u>	<u>18.000</u>	<u>8.000</u>	<u>4.800</u>	<u>96.800</u>
<u>C.G.H. Sa Nostra</u>					
Saldo inicial	37.280	7.400	3.100	1.100	48.880
Amortización 16/05/16	(970)	(1.112)	(464)	-	(2.546)
Amortización 17/11/16	(2.044)	-	-	-	(2.044)
Saldo final	<u>34.266</u>	<u>6.288</u>	<u>2.636</u>	<u>1.100</u>	<u>44.290</u>
<u>C.G.H. Caja Vital</u>					
Saldo inicial	103.886	12.600	8.200	3.800	128.486
Amortización 16/05/16	(4.377)	-	-	-	(4.377)
Amortización 17/11/16	(4.117)	-	-	-	(4.117)
Saldo final	<u>95.392</u>	<u>12.600</u>	<u>8.200</u>	<u>3.800</u>	<u>119.992</u>
TOTAL	<u>2.520.259</u>	<u>288.188</u>	<u>137.236</u>	<u>72.600</u>	<u>3.018.283</u>

Ejercicio 2015:

Serie	Miles de euros				
	2015				
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D	Total
<u>C.G.H. BBK I</u>					
Saldo inicial	839.394	81.000	13.500	14.300	948.194
Amortización 24/03/15	(32.882)	-	-	-	(32.882)
Amortización 22/09/15	(32.631)	-	-	-	(32.631)
Saldo final	<u>773.881</u>	<u>81.000</u>	<u>13.500</u>	<u>14.300</u>	<u>882.681</u>
<u>C.G.H. BBK II</u>					
Saldo inicial	553.257	30.500	7.000	7.000	597.757
Amortización 02/06/15	(30.069)	-	-	-	(30.069)
Amortización 02/12/15	(24.348)	-	-	-	(24.348)
Saldo final	<u>498.840</u>	<u>30.500</u>	<u>7.000</u>	<u>7.000</u>	<u>543.340</u>
<u>C.G.H. Cantabria</u>					
Saldo inicial	135.317	12.700	10.300	3.500	161.817
Amortización 20/03/15	(6.041)	-	-	-	(6.041)
Amortización 20/09/15	(5.855)	-	-	-	(5.855)
Saldo final	<u>123.421</u>	<u>12.700</u>	<u>10.300</u>	<u>3.500</u>	<u>149.921</u>
<u>C.G.H. Laietana</u>					
Saldo inicial	42.130	13.500	5.100	6.000	66.730
Amortización 25/03/15	(6.164)	-	-	-	(6.164)
Amortización 25/09/15	(3.995)	-	-	-	(3.995)
Saldo final	<u>31.971</u>	<u>13.500</u>	<u>5.100</u>	<u>6.000</u>	<u>56.571</u>
<u>C.G.H. CCM</u>					
Saldo inicial	385.686	45.600	28.000	10.400	469.686
Amortización 28/05/15	(15.019)	-	-	-	(15.019)
Amortización 28/11/15	(13.900)	-	-	-	(13.900)
Saldo final	<u>356.767</u>	<u>45.600</u>	<u>28.000</u>	<u>10.400</u>	<u>440.767</u>
<u>C.G.H. Caja España</u>					
Saldo inicial	102.548	45.000	11.000	6.500	165.048
Amortización 29/04/15	(102.548)	(45.000)	(11.000)	(6.500)	(165.048)
Amortización	-	-	-	-	-
Saldo final	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>

Serie	Miles de euros				
	2015				
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D	Total
<u>C.G.H. C. Galicia I</u>					
Saldo inicial	433.893	36.900	21.600	15.300	507.693
Amortización 17/01/15	(15.253)	-	-	-	(15.253)
Amortización 17/07/15	(14.208)	-	-	-	(14.208)
Saldo final	<u>404.432</u>	<u>36.900</u>	<u>21.600</u>	<u>15.300</u>	<u>478.232</u>
<u>C.G.H. C. Galicia II</u>					
Saldo inicial	390.654	44.600	38.000	12.400	485.654
Amortización 28/04/15	(14.677)	-	-	-	(14.677)
Amortización 27/10/15	(11.486)	-	-	-	(11.486)
Saldo final	<u>364.491</u>	<u>44.600</u>	<u>38.000</u>	<u>12.400</u>	<u>459.491</u>
<u>C.G.H. Caja Granada</u>					
Saldo inicial	153.463	18.000	8.000	4.800	184.263
Amortización 20/05/15	(24.036)	-	-	-	(24.036)
Amortización 20/11/15	(39.451)	-	-	-	(39.451)
Saldo final	<u>89.976</u>	<u>18.000</u>	<u>8.000</u>	<u>4.800</u>	<u>120.776</u>
<u>C.G.H. Sa Nostra</u>					
Saldo inicial	42.407	7.400	3.100	1.100	54.007
Amortización 16/05/15	(2.653)	-	-	-	(2.653)
Amortización 17/11/15	(2.474)	-	-	-	(2.474)
Saldo final	<u>37.280</u>	<u>7.400</u>	<u>3.100</u>	<u>1.100</u>	<u>48.880</u>
<u>C.G.H. Caja Vital</u>					
Saldo inicial	111.888	12.600	8.200	3.800	136.488
Amortización 16/05/15	(3.964)	-	-	-	(3.964)
Amortización 17/11/15	(4.038)	-	-	-	(4.038)
Saldo final	<u>103.886</u>	<u>12.600</u>	<u>8.200</u>	<u>3.800</u>	<u>128.486</u>
TOTAL	<u>2.784.945</u>	<u>302.800</u>	<u>142.800</u>	<u>78.600</u>	<u>3.309.145</u>

Al 31 de diciembre de 2016 y 2015, el rating asignado por las agencias de calificación Moody's Inverstor Services, Standard & Poor's y Fitch, a las distintas series no amortizadas es el siguiente:

	2016			2015		
	MOODY'S	S&P	FITCH	MOODY'S	S&P	FITCH
<u>C.G.H. BBK I</u>						
Tramo A	Aa2	-	A-	Aa3	-	A-
Tramo B	Ba3	-	-	Ba3	-	-
Tramo C	B3	-	-	B3	-	-
Tramo D	Caa3	-	-	Caa3	-	-
<u>C.G.H. BBK II</u>						
Tramo A	Aa2	-	A-	Aa2	-	AA-
Tramo B	Ba2	-	B	Ba2	-	BBB
Tramo C	B1	-	-	B1	-	-
Tramo D	Caa1	-	-	Caa1	-	-
<u>C.G.H. Caja Cantabria</u>						
Tramo A	Aa2	-	AAA	Aa2	-	A+
Tramo B	B2	-	BBB+	Baa2	-	BBB+
Tramo C	Caa1	-	BBB-	Caa1	-	B
Tramo D	C	-	CCC	C	-	CCC
<u>C.G.H. Caixa Laietana</u>						
Tramo A	-	-	-	-	A-	A+
Tramo B	-	-	-	-	B-	BBB
Tramo C	-	-	-	-	-	BB
Tramo D	-	-	-	-	-	CCC
<u>C.G.H. CCM</u>						
Tramo A	-	AA-	AAA	-	A	A-
Tramo B	-	-	A	-	-	BB
Tramo C	-	-	CCC	-	-	CCC
Tramo D	-	-	CC	-	-	CC
<u>C.G.H. Caja Vital I</u>						
Tramo A	Aa2	-	AA	Aa2	-	AA
Tramo B	A3	-	BBB	A3	-	A
Tramo C	B2	-	B	B2	-	BB
Tramo D	C	-	CCC	C	-	B
<u>C.G.H. Caixa Galicia</u>						
Tramo A	Aa2	-	AA+	Aa2	-	AA+
Tramo B	A2	-	A	A3	-	A
Tramo C	Ba2	-	BB+	B1	-	BB+
Tramo D	Caa2	-	B+	Ca	-	B+
<u>C.G.H. Caixa Galicia II</u>						
Tramo A	Aa2	-	AA+	Aa2	-	AA-
Tramo B	Aa3	-	A	Aa3	-	A
Tramo C	Ba1	-	BB-	Ba1	-	BB-
Tramo D	Caa1	-	B	Caa1	-	B
<u>C.G.H. Caja Granada</u>						
Tramo A	A1	-	A-	A1	-	A-
Tramo B	B1	-	B	B1	-	B
Tramo C	Caa3	-	CCC	Caa3	-	CCC
Tramo D	C	-	CC	C	-	CC
<u>C.G.H. Sa Nostra</u>						
Tramo A	-	BBB	A	-	BBB	A
Tramo B	-	-	BBB	-	-	BBB
Tramo C	-	-	BB	-	-	BB
Tramo D	-	-	B	-	-	B

El vencimiento estimado de los Bonos a 31 de diciembre 2016 es el siguiente:

2016

BBK I

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2017	88.347	-	-	-
2018	57.935	-	-	-
2019	56.805	-	-	-
2020-2021	110.009	-	-	-
2022-2030	401.074	81.000	13.500	14.300
	714.170	81.000	13.500	14.300

BBK II

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2017	88.851	-	-	-
2018	69.284	-	-	-
2019	62.384	-	-	-
2020-2021	106.448	-	-	-
2022-2030	123.276	30.500	7.000	7.000
	450.243	30.500	7.000	7.000

CAJA CANTABRIA

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2017	15.206	-	-	-
2018	9.194	-	-	-
2019	9.030	-	-	-
2020-2021	17.588	-	-	-
2022-2030	62.566	12.700	10.300	3.500
	113.584	12.700	10.300	3.500

CAIXA LAIETANA

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2017	-	-	-	-
2018	-	-	-	-
2019	-	-	-	-
2020-2022	-	-	-	-
	-	-	-	-

CCMI

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2017	82.393	-	-	-
2018	47.689	-	-	-
2019	43.300	-	-	-
2020-2021	107.166	-	-	-
2022-2030	45.055	45.600	28.000	10.400
	325.603	45.600	28.000	10.400

CAIXA GALICIA I

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2017	57.387	5.468	3.201	2.267
2018	50.378	4.941	2.893	2.049
2019	45.504	4.463	2.613	1.851
2020-2021	77.662	7.618	4.459	3.159
2022-2030	146.912	14.410	8.434	5.974
	377.843	36.900	21.600	15.300

CAIXA GALICIA II

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2017	30.634	-	-	-
2018	25.051	-	-	-
2019	24.722	-	-	-
2020-2021	48.292	-	-	-
2022-2031	214.459	44.600	38.000	12.400
	343.158	44.600	38.000	12.400

CAJA GRANADA

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2017	27.944	-	-	-
2018	13.672	-	-	-
2019-2021	24.384	18.000	8.000	4.800
	66.000	18.000	8.000	4.800

SA NOSTRA I

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2017	8.154	-	-	-
2018	5.868	-	-	-
2019	5.275	-	-	-
2020-2021	4.710	-	-	-
2022-2031	10.259	6.288	2.636	1.100
	34.266	6.288	2.636	1.100

CAJA VITAL

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2017	8.132	-	-	-
2018	5.532	-	-	-
2019	5.554	-	-	-
2020-2021	11.149	-	-	-
2022-2033	65.025	12.600	8.200	3.800
	95.392	12.600	8.200	3.800

El vencimiento estimado de los Bonos a 31 de diciembre de 2015 era el siguiente:

2015**BBK I**

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2016	91.788	-	-	-
2017	60.128	-	-	-
2018	58.989	-	-	-
2019-2022	224.139	-	-	-
2023-2030	338.836	81.000	13.500	14.300
	773.881	81.000	13.500	14.300

BBK II

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2016	62.056	-	-	-
2017	48.304	-	-	-
2018	46.540	-	-	-
2019-2022	168.496	-	-	-
2023-2027	173.443	30.500	7.000	7.000
	498.839	30.500	7.000	7.000

CAJA CANTABRIA

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2016	15.228	-	-	-
2017	9.387	-	-	-
2018	9.241	-	-	-
2019-2022	31.219	-	-	-
2023-2031	58.345	12.700	10.300	3.500
	123.420	12.700	10.300	3.500

CAIXA LAIETANA

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2016	12.972	-	-	-
2017	6.072	-	-	-
2018	5.518	-	-	-
2019-2022	7.408	13.500	5.100	6.000
	31.971	13.500	5.100	6.000

CCMI

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2016	50.815	-	-	-
2017	23.189	-	-	-
2018	23.041	-	-	-
2019-2022	90.429	-	-	-
2023-2031	169.292	45.600	28.000	10.400
	356.767	45.600	28.000	10.400

CAIXA GALICIA I

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2016	34.039	547	320	-
2017	28.819	2.716	1.590	-
2018	28.278	2.665	1.560	-
2019-2022	106.187	10.008	5.859	-
2023-2030	207.108	20.963	12.271	15.300
	404.431	36.900	21.600	15.300

CAIXA GALICIA II

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2016	29.659	-	-	-
2017	29.529	-	-	-
2018	28.871	-	-	-
2019-2022	108.887	-	-	-
2023-2028	167.543	44.600	38.000	12.400
		44.600	38.000	12.400

CAJA GRANADA

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2016	49.454	-	-	-
2017	24.432	-	-	-
2018	16.090	18.000	8.000	4.800
	89.976	18.000	8.000	4.800

SA NOSTRA I

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2016	5.512	-	-	-
2017	3.848	-	-	-
2018	3.709	-	-	-
2019-2022	13.237	-	-	-
2013-2028	10.975	7.400	3.100	1.100
	37.280	7.400	3.100	1.100

CAJA VITAL

	En miles			
	Tramo A	Tramo B	Tramo C	Tramo D
2016	10.002	-	-	-
2017	7.327	-	-	-
2018	7.254	-	-	-
2019-2022	28.198	-	-	-
2023-2033	51.107	12.600	8.200	3.800
	103.889	12.600	8.200	3.800

En el siguiente cuadro se muestran los tipos de interés medios anuales aplicados durante los ejercicios 2016 y 2015 de cada uno de los bonos emitidos y vivos durante dichos ejercicios:

	2016			
	Tipos de interés medios			
	Serie A	Serie B	Serie C	Serie D
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK I	1,17%	1,30%	1,65%	3,00%
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK II	1,30%	1,60%	2,00%	3,00%
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Caja Cantabria I	0,25%	0,55%	0,95%	1,95%
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Caja Laietana I	0,25%	0,55%	0,95%	1,95%
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. CCM I	1,30%	1,60%	2,50%	3,50%
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Galicia I	0,30%	0,60%	1,00%	2,00%
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Galicia II	0,23%	0,53%	0,93%	1,93%
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Granada I	0,16%	0,51%	1,41%	2,41%
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Sa Nostra I	0,08%	0,21%	0,56%	1,91%
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Vital I	0,09%	0,22%	0,57%	1,92%

	2015			
	Tipos de interés medios			
	Serie A	Serie B	Serie C	Serie D
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK I	1,170%	1,300%	1,650%	3,000%
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. BBK II	1,300%	1,600%	2,000%	3,000%
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Caja Cantabria I	0,441%	0,741%	1,141%	2,141%
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Caja Laietana I	0,437%	0,737%	1,137%	2,137%
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. CCM I	1,300%	1,600%	2,500%	3,500%
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Galicia I	0,524%	0,824%	1,224%	2,224%
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Galicia II	0,428%	0,728%	1,128%	2,128%
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Granada I	0,369%	0,719%	1,619%	2,619%
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Sa Nostra I	0,289%	0,419%	0,769%	2,119%
AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. Vital I	0,289%	0,419%	0,769%	2,119%

Durante el ejercicio 2016 se han devengado intereses de los Bonos de Titulización Hipotecaria por importe de 28.125 miles de euros (2015: 33.845 miles de euros) de los que, al cierre del ejercicio 2016, 4.693 miles de euros (2015: 5.951 miles de euros) se encuentran pendientes de vencimiento, estando registrados en la cuenta “Obligaciones y otros valores negociables - Intereses y gastos devengados no vencidos” del pasivo corriente del balance de situación.

8.2. Deudas con entidades de crédito

La Sociedad Gestora celebra, en representación y por cuenta del Fondo, con la Entidad cedente correspondiente o con una tercera entidad de crédito, un contrato de préstamo subordinado (el “contrato de Préstamo Subordinado para dotación del Fondo de Reserva”) por un importe igual al importe inicial del Fondo de Reserva (el “Préstamo Subordinado para Dotación del Fondo de Reserva”).

La Sociedad Gestora celebra, en representación y por cuenta del Fondo, con la entidad cedente de cada serie, un contrato de préstamo subordinado (el “contrato de Préstamo Subordinado para gastos iniciales”), que es destinado a financiar los gastos de la emisión de los Bonos de la Serie correspondiente y a financiar los intereses a favor de la entidad cedente por aplazamiento de pago del precio de suscripción de los activos hasta la fecha de desembolso (el “Préstamo Subordinado para gastos iniciales”).

Los Préstamos Subordinados devengan intereses a un tipo equivalente al tipo de interés de referencia de los Bonos más 200 puntos básicos.

Los intereses derivados del Préstamo Subordinado resultan pagaderos en cada fecha de pago de los Bonos de la Serie correspondiente, con arreglo al orden de prelación de pagos.

La amortización parcial del Préstamo Subordinado para dotación del Fondo de Reserva se efectúa en cada una de las fechas de pago, en una cuantía igual a la diferencia existente entre la cantidad requerida del Fondo de Reserva en la fecha de pago anterior y la cantidad requerida del Fondo de Reserva en la fecha de pago en curso, sin perjuicio de la amortización final del mismo en la fecha de vencimiento final de la serie.

La parte del Préstamo Subordinado para gastos iniciales que efectivamente se hubiere utilizado para financiar los gastos de emisión de Bonos y a financiar los intereses por aplazamiento del pago del precio de suscripción de los activos hasta la fecha de desembolso, se amortizará en la medida en que se vayan amortizando los citados gastos de emisión, de acuerdo con la contabilidad oficial del fondo y en todo caso, durante el plazo máximo de cinco (5) años desde la fecha de emisión, siempre que el Fondo disponga de fondos disponibles suficientes de acuerdo con el orden de prelación de pagos. La parte del principal del Préstamo Subordinado para gastos iniciales que no hubiese sido utilizada se amortizará, en caso de que exista, en la primera fecha de pago, siempre que el Fondo disponga de fondos disponibles suficientes de acuerdo con el orden de prelación de pagos.

El Préstamo Subordinado para Dotación del Fondo de Reserva permanecerá vigente hasta la fecha de vencimiento legal, hasta la fecha anterior en que el Fondo haya devuelto a la entidad prestamista cualesquiera cantidades debidas al amparo del contrato de Préstamo Subordinado y se hayan extinguido completamente las obligaciones del Fondo bajo el mismo con cargo a los fondos disponibles de la serie correspondiente o hasta la fecha anterior en que la emisión de los Bonos de la Serie correspondiente haya sido amortizada en su totalidad.

El movimiento producido de los Préstamos Subordinados durante los ejercicios 2016 y 2015 ha sido el siguiente:

	Miles euros		
	Préstamo Subordinado gastos iniciales	Préstamo Subordinado dotación F. Reserva	Total
<u>Ejercicio 2016</u>			
Saldo inicial	2.014	203.353	205.367
Amortización	(46)	(5.950)	(5.996)
Saldo final	<u>1.968</u>	<u>197.403</u>	<u>199.371</u>

	Miles euros		
	Préstamo Subordinado gastos iniciales	Préstamo Subordinado dotación F. Reserva	Total
<u>Ejercicio 2015</u>			
Saldo inicial	2.066	222.603	224.669
Amortización	(52)	(19.250)	(19.302)
Saldo final	<u>2.014</u>	<u>203.353</u>	<u>205.367</u>

Durante el ejercicio 2016 se han devengado intereses del Préstamo Subordinado por importe de 4.224 miles de euros (2015: 4.816 miles de euros) de los que, al cierre del ejercicio 2016, 802 miles de euros (2015: 930 miles de euros) se encuentran pendientes de vencimiento, estando registrados en el epígrafe “Deudas con entidades de crédito – Intereses vencidos e impagados” del pasivo del balance de situación.

Adicionalmente, a 31 de diciembre de 2016 existe principal e intereses de los préstamos subordinados pendiente de pago por importe de 22.950 miles de euros (2015: 19.440 miles de euros), de los cuales 1.968 miles de euros corresponden a principal (2015: 2.014 miles de euros) y 20.982 miles de euros a intereses (2015: 17.426 miles de euros). Este importe de intereses está registrado en las cuentas “Deudas con entidades de crédito – Intereses vencidos e impagados” de intereses del pasivo corriente del balance de situación.

Al 31 de diciembre de 2016 han sido asignadas a las cuentas correspondientes a “Deudores con entidades de crédito – Correcciones de valor por repercusión de pérdidas un importe de 63.747 miles de euros (2015: 54.530 miles de euros), de acuerdo con el orden de prelación de pagos establecido en el folleto de emisión del Fondo.

El vencimiento de las deudas con entidades de crédito, al corresponder a “Préstamo Subordinado” puede ser considerado como indeterminado al estar condicionada su amortización a la existencia de liquidez del Fondo.

9. LIQUIDACIONES INTERMEDIAS

El detalle de las liquidaciones intermedias habidas a lo largo de los ejercicios 2016 y 2015 se presenta a continuación (miles de euros):

2016

Global

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	95.865	157.607	781.725	601.927
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	136.294	38.724	2.365.537	728.760
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	19.533	227.282	704.158	1.101.408
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	13.266	-	597.327	161.396
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	54.535	-	569.290	158.347
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	2.846	-	85.990	961

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	254.847	175.774	1.842.315	2.751.244
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	22.468	172.535	445.528	1.399.236
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	63.209	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	3.014	14.093	35.128	93.507
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	5.564	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	1.961	7.400	18.270	53.694
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	6.000	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	1.939	4.447	15.209	33.603
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	48.597	-	-	48.597
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	5.950	-	7.887	1.907
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	253	-	16.507	14.136
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

BBK I

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	36.591	42.369	283.511	341.310
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	18.260	-	336.391	-
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	6.291	49.692	281.748	529.695
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	748	-	26.578	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	6.078	-	55.551	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	600	-	40.792	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	59.710	42.369	634.833	341.310
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	8.893	46.077	221.479	495.429
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	1.056	3.556	16.508	33.390
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	223	640	3.202	6.010
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	430	872	5.224	8.185
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	474	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	4.163	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie BBK I durante el ejercicio 2016 han sido (miles de euros):

	22/03/2016	22/09/2016	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	31.560	28.151	59.710
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	4.515	4.378	8.893
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	525	531	1.056
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	111	112	223
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	214	216	430
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

BBK II

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	28.982	31.792	231.626	-
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	15.276	-	240.805	-
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	3.782	39.736	148.738	-
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	335	-	12.543	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	2.690	-	31.190	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	129	-	26.436	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	48.597	31.792	505.259	246.598
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	6.328	37.580	122.209	373.802
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	48.597	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	489	1.657	5.669	14.294
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	140	409	1.544	3.526
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	211	480	2.155	4.140
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	48.597	-	48.597	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	955	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	3.174	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie BBK II durante el ejercicio 2016 han sido:

	02/06/2016	02/12/2016	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	26.767	21.830	48.597
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	3.251	3.077	6.328
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	26.767	21.830	48.597
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	245	245	489
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	70	70	140
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	105	105	211
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

Cantabria

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	5.747	3.999	21.355	36.799
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	3.188	6.559	38.765	69.882
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	1.036	6.683	5.893	73.458
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	157	-	31.019	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	926	-	29.119	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	57	-	91	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	-	10.557	80079	106681
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	311	5.802	21105	67932
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	71	743	1810	6085
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	99	644	1809	5277
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	69	255	908	2085
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	36	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	1128	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie Cantabria I durante el ejercicio 2016 han sido:

	21/03/2016	20/09/2016	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	5.304	4.533	9.837
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	210	101	311
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	41	30	71
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	54	45	99
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	36	33	69
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

Laietana

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	-	2.852	8.157	29.459
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	55.781	4.739	149.865	51.294
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	70	5.289	19.126	58.807
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	1.094	-	16.279	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	1.389	-	11.978	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	21	-	533	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	31.971	7.591	145.401	80.754
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	69	3.880	13.362	47.197
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	13.500	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	63	788	1.883	6.431
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	5.100	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	40	318	876	2.598
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	6.000	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	96	435	1.518	3.554
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	5.996	-	6.151	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	536	-	1.054	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie Laietana durante el ejercicio 2016 han sido:

	29/03/2016	14/07/2016	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	4.540	27.431	31.971
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	55	14	69
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	13.500	13.500
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	44	19	63
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	5.100	5.100
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	27	13	40
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	6.000	6.000
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	63	33	96
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	5.996	5.996
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	536	536
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

CCM I

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	13.359	18.291	112.263	144.284
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	7.727	-	171.688	-
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	4.525	32.602	129.400	319.352
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	1.552	-	30.963	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	10.312	-	84.000	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	1.796	-	14.290	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	31.164	18.291	761.010	144.284
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	4.519	30.166	99.248	298.583
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	728	2.489	9.200	22.132
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	698	1.784	7.567	15.868
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	364	768	3.694	6.834
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	477	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	5.314	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie CCM I durante el ejercicio 2016 han sido:

	30/05/2016	28/11/2016	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	16.382	14.782	31.164
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	2.313	2.206	4.519
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	364	364	728
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	349	349	698
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	182	182	364
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

Galicia I

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	-	24.021	-	181.288
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	8.170	-	301.259	-
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	4	36.861	519	342.486
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	4.062	-	160.989	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	17.736	-	156.861	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	52	-	953	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	26.589	24.021	448.357	181.288
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	1.213	31.608	88.136	296.155
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	225	1.872	784	15.602
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	220	1.183	4.140	9.865
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	312	994	4229	8285
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	475	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	208	-	5648	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie Galicia I durante el ejercicio 2016 han sido:

	17/01/2016	18/07/2016	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	13.865	12.724	26.589
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	725	488	1.213
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	123	102	225
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	116	103	220
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	161	151	312
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	208	-	208
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

Galicia II

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	-	13.717	-	127.927
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	6.338	27.426	395.378	304.278
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	2	28.389	3.346	314.723
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	4.281	-	150.103	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	-	-	114.209	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	35	-	1.072	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	21.333	41.143	511.843	432.205
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	855	25.018	79.422	290.715
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	242	2.596	6.592	21.555
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	360	2.367	6.901	19.650
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	244	898	3.299	7.459
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	318	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	7.122	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie Galicia II durante el ejercicio 2016 han sido:

	27/04/2016	27/10/2016	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	10.849	10.484	21.333
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	574	280	855
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	138	103	242
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	195	165	360
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	127	117	244
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

Granada I

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	3.853	12.538	48.497	86.525
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	16.773	-	228.403	-
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	2.663	16.152	64.795	148.867
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	886	-	28.451	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	1.273	-	20.711	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	42	-	717	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	23.975	12.538	303.098	86.525
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	148	14.120	42.613	131.727
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	95	973	3.162	7.710
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	116	505	2.061	4.006
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	118	352	1.672	2.791
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	500	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	1.354	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie Granada I durante el ejercicio 2016 han sido:

	20/05/2016	21/11/2016	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	13.861	10.115	23.975
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	107	41	148
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	53	42	95
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	60	56	116
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	60	58	118
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

Sa Nostra

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	2.145	3.559	19.073	29.575
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	1.957	-	38.525	-
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	393	4.055	15.948	44.034
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	104	-	44.861	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	505	-	6.760	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	104	-	765	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	3.014	7.024	63.134	33.040
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	35	6.631	12.068	39.229
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	1.112	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	16	694	1.218	3.571
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	464	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	17	315	611	1.621
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	21	141	356	723
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	150	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	54	-	764	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie Sa Nostra durante el ejercicio 2016 han sido:

	17/05/2016	16/11/2016	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	970	2.044	3.014
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	30	5	35
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	1.112	-	1.112
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	11	5	16
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	464	-	464
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	10	7	17
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	11	10	21
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	54	-	54
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

Vital I

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	5.187	4.469	41.117	36.857
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	2.823	-	33.848	-
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	768	7.823	33.847	80.171
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	47	-	2.414	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	443	-	4.652	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	11	-	218	-
SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)				
	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	8494	4.469	79.906	36.857
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	97	3.261	23.871	64.611
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	29	597	2.083	5.543
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	48	418	1.627	3.879
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	74	246	1.238	2.282
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	258	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	922	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie Vital I durante el ejercicio 2016 han sido:

	16/05/2016	16/11/2016	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	4.377	4117	8494
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	84	13	97
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	19	10	29
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	27	21	48
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	38	36	74
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

2015

Global

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	95.855	168.956	685.860	1.189.259
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	301.736	41.892	2.229.243	386.730
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	29.367	253.837	684.625	2.226.949
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	20.694	-	584.061	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	57.946	-	514.755	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	12.396	-	83.094	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	776.302	210.848	3.715.572	1.575.991
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	27.232	225.315	749.189	2.033.543
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	45.000	-	45.000	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	3.384	15.797	51.601	122.713
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	11.000	-	11.000	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	1.900	8.907	30.935	67.722
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	6.500	-	6.500	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	1.951	5.706	24.350	43.687
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	4.216	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	35.455	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

BBK I

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	35.745	40.722	246.920	298.941
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	20.887	-	318.131	-
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	9.093	51.300	275.457	480.003
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	1.028	-	25.830	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	5.860	-	49.473	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	1.025	-	40.192	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	65.513	40.722	575.123	298.941
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	9.628	47.697	212.586	449.352
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	1.053	3.540	15.452	29.834
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	222	638	2.979	5.370
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	429	869	4.794	7.313
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	474	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	4.163	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie BBK I durante el ejercicio 2015 han sido (miles de euros):

	24/03/2015	22/09/2015	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	32.882	32.631	65.513
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	4.897	4.731	9.628
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	525	528	1.053
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	111	111	222
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	214	215	429
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

BBK II

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	28.896	31.737	202.644	214.806
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	20.624	-	225.529	-
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	5.670	41.263	144.956	353.432
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	519	-	12.208	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	2.780	-	28.500	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	127	-	26.307	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	54.417	31.737	456.662	214.806
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	6.726	39.100	115.881	336.222
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	488	1.653	5.180	12.637
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	140	408	1.404	3.117
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	210	479	1.944	3.660
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	955	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	3.174	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie BBK II durante el ejercicio 2015 han sido:

	02/06/2015	02/12/2015	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	30.069	24.348	54.417
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	3.586	3.410	6.726
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	243	245	488
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	70	70	140
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	105	105	210
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

Cantabria

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	6.052	4.118	15.608	32.800
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	3.298	7.113	35.577	63.323
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	1.473	7.231	4.857	66.775
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	242	-	30.862	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	1.771	-	28.193	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	32	-	34	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	11.896	11.231	80.079	96.124
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	590	6.399	20.794	62.130
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	95	741	1.739	5.342
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	119	643	1.710	4.633
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	76	254	839	1.830
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	36	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	1.128	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie Cantabria I durante el ejercicio 2015 han sido:

	20/03/2015	22/09/2015	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	6.041	5.855	11.896
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	328	262	590
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	50	45	95
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	61	58	119
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	38	38	76
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

Laietana

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	-	3.355	8.157	26.607
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	6.594	5.160	94.084	46.555
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	9	5.740	19.056	53.518
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	1.949	-	15.185	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	2.066	-	10.589	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	39	-	512	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	10.159	8.515	113.430	73.163
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	174	4.333	13.293	43.317
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	100	785	1.820	5.643
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	58	317	836	2.280
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	130	434	1.422	3.119
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	201	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	1.021	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie Laietana durante el ejercicio 2015 han sido:

	25/03/2015	25/09/2015	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	6.164	3.995	10.159
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	103	71	174
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	53	47	100
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	30	28	58
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	66	64	130
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

CCM I

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	13.134	17.840	98.904	125.993
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	8.987	-	163.961	-
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	7.389	33.391	124.876	286.750
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	1.724	-	29.411	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	9.911	-	73.688	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	10.948	-	12.494	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	399.532	17.840	729.846	125.993
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	4.941	31.000	94.729	268.417
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	734	2.482	8.472	19.643
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	357	1.779	6.869	14.084
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	185	766	3.330	6.066
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	477	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	5.314	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie CCM I durante el ejercicio 2015 han sido:

	28/05/2015	28/11/2015	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	385.632	13.900	399.532
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	2.486	2.455	4.941
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	362	372	734
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	-	357	357
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	-	185	185
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

Caja España

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	-	12.258	16.125	86.244
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	162.246	-	430.609	-
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	226	16.754	797	149.470
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	2.156	-	93.126	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	2.306	-	54.258	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	9	-	74	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	102.548	12.258	437.499	86.244
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	214	14.699	48.144	132.306
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	45.000	-	45.000	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	152	970	7.445	7.707
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	11.000	-	11.000	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	80	504	2.558	4.005
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	6.500	-	6.500	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	75	351	1.996	2.790
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	372	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	5.065	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie Caja España durante el ejercicio 2015 han sido:

	29/04/15	24/11/2015	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	102.548	-	102.548
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	214	-	214
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	45.000	-	45.000
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	152	-	152
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	11.000	-	11.000
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	80	-	80
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	6.500	-	6.500
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	75	-	75
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

Galicia I

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	-	24.106	-	157.267
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	10.862	-	293.089	-
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	5	37.972	516	305.625
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	5.692	-	156.927	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	17.631	-	139.125	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	53	-	901	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	29.461	24.106	421.768	157.267
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	2.318	32.667	86.923	264.547
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	313	1.866	559	13.730
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	271	1.180	3.920	8.682
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	346	991	3.917	7.291
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	475	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	5.454	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie Galicia I durante el ejercicio 2015 han sido:

	17/01/2015	17/07/2015	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	15.253	14.208	29.461
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	1.358	960	2.318
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	173	140	313
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	146	125	271
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	182	164	346
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

Galicia II

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	-	15.167	-	114.210
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	11.392	29.619	389.040	276.852
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	5	30.569	3.344	286.334
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	5.807	-	145.822	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	12.985	-	101.027	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	31	-	1.037	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	26.163	44.786	490.510	391.062
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	1.663	27.361	78.567	265.697
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	329	2.589	6.350	18.959
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	434	2.360	6.541	17.283
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	267	896	3.055	6.561
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	318	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	7.122	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie Galicia II durante el ejercicio 2015 han sido:

	29/04/2015	27/10/2015	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	14.677	11.486	26.163
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	964	699	1.663
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	178	151	329
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	228	206	434
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	137	130	267
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

Granada I

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	4.703	11.920	44.644	73.987
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	53.265	-	211.630	-
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	3.819	17.391	62.132	132.715
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	1.365	-	27.565	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	1.727	-	19.438	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	69	-	675	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	63.487	11.920	279.123	73.987
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	535	15.306	42.465	117.607
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	131	970	3.067	6.737
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	132	504	1.945	3.501
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	128	351	1.554	2.439
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	500	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	1.354	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie Granada I durante el ejercicio 2015 han sido:

	20/05/2015	20/11/2015	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	24.036	39.451	63.487
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	333	202	535
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	71	60	131
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	68	64	132
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	65	63	128
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

Sa Nostra

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	2.202	3.465	16.928	26.016
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	1.573	-	36.568	-
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	536	4.219	15.555	39.979
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	132	-	44.757	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	524	-	6.255	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	87	-	661	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	5.127	3.465	60.120	26.016
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	121	3.391	12.033	32.598
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	31	347	1.202	2.877
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	24	157	594	1.306
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	23	70	335	582
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	150	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	738	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie Sa Nostra durante el ejercicio 2015 han sido:

	16/05/2015	17/11/2015	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	2.653	2.474	5.127
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	75	46	121
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	18	13	31
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	13	11	24
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	12	11	23
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

Vital I

ACTIVOS TITULIZADOS CLASIFICADOS EN EL ACTIVO	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
COBROS POR AMORTIZACIONES ORDINARIAS	5.123	4.268	35.930	32.388
COBROS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS	2.008	-	31.025	-
COBROS POR INTERESES ORDINARIOS	1.142	8.007	33.079	72.348
COBRO POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS	80	-	2.368	-
COBROS POR AMORTIZACIONES PREVIAMENTE IMPAGADAS	385	-	4.209	-
OTROS COBROS EN ESPECIE	-	-	-	-
OTROS COBROS EN EFECTIVO	(24)	-	207	-

SERIES EMITIDAS CLASIFICADAS EN EL PASIVO (INFORMACIÓN SERIE A SERIE)

	PERÍODO		ACUMULADO	
	REAL	CONTRACTUAL	REAL	CONTRACTUAL
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	7.999	4.268	71.412	32.388
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	322	3.362	23.774	61.350
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	53	595	2.054	4.946
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	63	417	1.579	3.461
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	82	245	1.164	2.036
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	258	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	922	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-	-

Las liquidaciones intermedias practicadas a los pasivos financieros de la Serie Vital I durante el ejercicio 2015 han sido:

	16/05/2015	17/11/2015	TOTAL PERIODO (REAL)
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE A	3.961	4.038	7.994
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE A	197	125	322
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE A	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE A	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE B	30	23	53
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE B	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE B	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE C	34	29	63
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE C	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE C	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN ORDINARIA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES ORDINARIOS SERIE D	42	40	82
PAGOS POR AMORTIZACIONES ANTICIPADAS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN PREVIAMENTE IMPAGADA SERIE D	-	-	-
PAGOS POR INTERESES PREVIAMENTE IMPAGADOS SERIE D	-	-	-
PAGOS POR AMORTIZACIÓN DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
PAGOS POR INTERESES DE PRÉSTAMOS SUBORDINADOS	-	-	-
OTROS PAGOS DEL PERÍODO	-	-	-

Al 31 de diciembre de 2016 el Fondo ha dispuesto de mejoras crediticias para hacer frente al pago de las series BBK I, BBK II, Cantabria I, CCM I, Galicia I, Galicia II, Granada I, Vital y Sa Nostra I (2015: BBK I, BBK II, Cantabria I, Laietana I, CCM I, Galicia II, Granada I y Sa Nostra I).

Al 31 de diciembre de 2016 se han producido un impago por parte de la series Granada I por importe de 2.936 miles de euros.

10. AJUSTES POR PERIODIFICACIONES DE PASIVO

La composición de este epígrafe del balance de situación a 31 de diciembre de 2016 y 2015 es la siguiente:

	Miles de Euros	
	2016	2015
Comisión Sociedad Gestora	97	108
Comisión de administración	2.199	1.910
Comisión agente financiero	10	16
Comisión variable	8.281	8.647
Correcciones de valor por repercusión de pérdidas	(10.479)	(10.557)
Otros	109	24
	<u>217</u>	<u>148</u>

Las condiciones específicas en relación con los contratos establecidos por comisiones se detallan a continuación:

- Comisión variable de las Cajas de Ahorro emisoras.

Se calcula como la diferencia positiva, si la hubiese, entre los Fondos disponibles del Fondo y las cantidades que han de ser abonadas. La remuneración consiste en una cantidad variable y subordinada, liquidable trimestralmente en cada fecha de pago.

Cuando la diferencia obtenida conforme al párrafo anterior sea negativa, dicha diferencia se repercute a los pasivos del Fondo a través de la cuenta correctora de pasivo “Correcciones de valor por repercusión de pérdidas” del pasivo del balance de situación, registrándose un ingreso en la cuenta “Comisión variable” de la cuenta de pérdidas y ganancias. Dicha repercusión se realiza comenzando por la cuenta de periodificación de la comisión variable, devengada y no liquidada en periodos anteriores, y continuando por el pasivo más subordinado, teniendo en cuenta el orden inverso de prelación de pagos establecido contractualmente por cada fecha de pago.

El Fondo ha registrado en la cuenta de pérdidas y ganancias una “Comisión variable” que presenta, por serie, el siguiente detalle al 31 de diciembre de 2016 y 2015:

	Miles de euros					
	2016			2015		
Comisión variable – resultados realizados ingreso	Repercusión de otras pérdidas (Ingreso)	TOTAL	Comisión variable – resultados realizados (gasto)	Repercusión de otras pérdidas (Ingreso)	TOTAL	
C.G.H. BBK I	-	2.913	2.913	-	3.010	3.010
C.G.H. Caja Vital I	-	(112)	(112)	-	506	506
C.G.H. Sa Nostra	37	(207)	(170)	-	(25)	(25)
C.G.H. Caja Granada	-	(576)	(576)	-	800	800
C.G.H. Caja España	-	-	-	130	-	-
C.G.H. Caixa Laietana	-	(3.628)	(3.628)	-	203	203
C.G.H. CCM	-	138	138	-	(5.614)	(5.614)
C.G.H. Caixa Galicia	-	1.046	1.046	-	81	81
C.G.H. Caja Burgos	-	-	-	-	-	-
C.G.H. BBK II	-	4.609	4.609	-	4.089	4.089
C.G.H. Caixa Galicia II	-	4.240	4.240	-	1.054	1.054
C.G.H. Caja Cantabria	-	431	431	-	838	838
TOTAL	37	8.855	8.892	130	4.941	4.486

- Comisión de la Sociedad Gestora.

Se calcula aplicando en cada fecha de pago al resultado de adicionar:

- AyT C.G.H. BBK I: (i) 5.500 euros más (ii) el 0,01275% sobre el Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Pago de Cupón anterior.
- AyT C.G.H. BBK II: (i) 5.500 euros anuales más (ii) el 0,01175% sobre el Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Pago de Cupón anterior.
- AyT C.G.H.C. Cantabria: (i) 5.500 euros anuales más (ii) el 0,01775% sobre el Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Pago de Cupón anterior.
- AyT C.G.H.C. Círculo de Burgos: (i) 5.500 euros anuales más (ii) el 0,018375% sobre el Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Pago de Cupón anterior.
- AyT C.G.H.C. Laietana: (i) 5.500 euros anuales más (ii) el 0,018375% sobre el Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Pago de Cupón anterior.
- AyT C.G.H. CCM: (i) 2.900 euros más (ii) el 0,015% sobre el Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Pago de Cupón anterior.
- AyT C.G.H. C. España: (i) 5.500 euros más (ii) el 0,015875% sobre el Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Pago de Cupón anterior.

- AyT C.G.H.C. Galicia I: (i) 5.500 euros anuales más (ii) el 0,013375% sobre el Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Pago de Cupón anterior.
- AyT C.G.H.C. Galicia II: (i) 5.500 euros anuales más (ii) el 0,012350% sobre el Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Pago de Cupón anterior.
- AyT C.G.H C. Granada: (i) 5.500 euros más (ii) el 0,0171250% sobre el Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Pago de Cupón anterior.
- AyT C.G.H Sa Nostra: (i) 5.500 euros más (ii) el 0,018375% sobre el Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Pago de Cupón anterior.
- AyT C.G.H C. Vital: (i) 7.500 euros más (ii) el 0,018750% sobre el Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Pago de Cupón anterior.

Durante los ejercicios 2016 y 2015 el movimiento de las partidas por el margen de intermediación del Fondo entre la cuenta de pérdidas y ganancias, el balance de situación y el estado de flujos de efectivo es el siguiente:

	Miles de euros	
	2016	2015
Comisión variable registrada en balance al inicio del ejercicio	8.647	9.201
Repercusión de pérdidas en cuenta de pérdidas y ganancias	11.821	4.941
Variación de las correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	(11.821)	(4.941)
Comisión variable devengada	(37)	(130)
Comisión variable pagada en el ejercicio	(329)	(423)
Ajustes por redondeo		
Comisión variable registrada en balance al final del ejercicio	8.281	8.647

El Fondo ha abonado los siguientes importes en concepto de comisión variable a la entidad cedente durante el ejercicio 2016:

	Miles de euros
<u>Caja Laietana</u> 29/04/16	-
<u>Sa Nostra</u> 16/05/16	95
17/11/16	-
	95

El Fondo abonó los siguientes importes en concepto de comisión variable a la entidad cedente durante el ejercicio 2015:

	<u>Miles de euros</u>
<u>Caja España</u>	
29/04/15	214
<u>Sa Nostra</u>	
16/05/15	210
17/11/15	-
	<u>424</u>

- Comisión de administración de las Entidades Emisoras.

La Comisión de administración de los activos será equivalente a 0,001% sobre el saldo vivo de los activos en la anterior fecha de pago.

- Comisión Agente Financiero (Banco Santander, S.A.)

En contraprestación a los servicios a realizar por el agente financiero, para de las Series BBK I, BBK II, Galicia I, Galicia II, Vital, Granada y Sa Nostra, no satisfarán contraprestación al Banco Santander, S.A. por los servicios prestados.

- Comisión Agente Financiero (Banco Santander, S.A.)

En contraprestación a los servicios a realizar por el agente financiero, las Series Caja Cantabria I y CCM I satisfarán al mismo una comisión de 25 mil euros anuales. En caso de la Serie Caixa Laietana satisfará al mismo una comisión del 0,001% anual sobre el saldo de principal pendiente de pago de los Bonos de cada serie en la fecha de pago anterior, pagadera por semestres vencidos en cada fecha de pago de cada serie.

10.1 Movimiento de comisiones

El movimiento de este epígrafe del balance de situación a 31 de diciembre de 2016 y 2015 es la siguiente:

Ejercicio 2016

BBK I

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2016	32	221	2	1.322	(1.322)
Importes devengados durante el ejercicio 2016	113	87	2	-	-
Pagos realizados el 23.03.2016	(58)	-	(4)	-	-
Pagos realizados el 22.09.2016	(57)	-	-	-	-
Saldo al 31 de diciembre de 2016	30	308	-	1.322	(1.322)

BBK II

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2016	5	128	-	1.754	(1.754)
Importes devengados durante el ejercicio 2016	65	48	1	-	-
Pagos realizados el 02.06.2016	(34)	-	(1)	-	-
Pagos realizados el 02.12.2016	(32)	-	-	-	-
Saldo al 31 de diciembre de 2016	4	176	-	1.754	(1.754)

CANTABRIA

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2016	9	143	7	-	(158)
Importes devengados durante el ejercicio 2016	35	15	25	-	-
Pagos realizados el 22.03.2016	(17)	-	(12)	-	-
Pagos realizados el 22.09.2016	(16)	-	(13)	-	-
Saldo al 31 de diciembre de 2016	9	158	7	-	(158)

CCM

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2016	6	475	2	-	(521)
Importes devengados durante el ejercicio 2016	72	46	25	-	-
Pagos realizados el 28.05.2016	(37)	-	(13)	-	-
Pagos realizados el 30.11.2016	(35)	-	(12)	-	-
Saldo al 31 de diciembre de 2016	6	521	2	-	(521)

GALICIA I

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2016	31	394	2	1.693	(1.693)
Importes devengados durante el ejercicio 2016	65	46	1	-	-
Pagos realizados el 19.01.2016	(34)	-	(2)	-	-
Pagos realizados el 17.07.2016	(33)	-	(1)	-	-
Saldo al 31 de diciembre de 2016	29	440	-	1.693	(1.693)

GALICIA II

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2016	11	440	1	1.118	(1.118)
Importes devengados durante el ejercicio 2016	62	45	1	-	-
Pagos realizados el 27.04.2016	(32)	-	(2)	-	-
Pagos realizados el 27.10.2016	(30)	-	-	-	-
Saldo al 31 de diciembre de 2016	11	485	-	1.118	(1.118)

GRANADA

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2016	3	65	-	1.481	(1.481)
Importes devengados durante el ejercicio 2016	26	12	-	-	-
Pagos realizados el 20.05.2016	(24)	-	-	-	-
Pagos realizados el 20.11.2016	(23)	-	-	-	-
Saldo al 31 de diciembre de 2016	2	77	-	1.481	(1.481)

LAIETANA

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2016	5	26	-	308	-
Importes devengados durante el ejercicio 2016	32	3	-	-	-
Pagos realizados el 25.03.2016	(9)	-	-	-	-
Liquidación realizada el 14.07.2016	(28)	(29)	-	(308)	-
Saldo al 31 de diciembre de 2016	-	-	-	-	-

SA NOSTRA I

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2016	2	4	-	178	(118)
Importes devengados durante el ejercicio 2016	16	5	-	37	-
Pagos realizados el 18.05.2016	(8)	(6)	-	(97)	-
Pagos realizados el 16.11.2016	(8)	-	-	-	-
Saldo al 31 de diciembre de 2016	2	3	-	118	(118)

VITAL I

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2016	4	16	-	794	(794)
Importes devengados durante el ejercicio 2016	30	13	-	-	-
Pagos realizados el 18.05.2016	(15)	-	-	-	-
Pagos realizados el 16.11.2016	(15)	-	-	-	-
Saldo al 31 de diciembre de 2016	4	29	-	794	(794)

Ejercicio 2015

BBK I

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2015	34	127	3	1.322	1.322
Importes devengados durante el ejercicio 2015	121	94	9	-	-
Pagos realizados el 23.03.2015	(62)	-	(5)	-	-
Pagos realizados el 22.09.2015	(61)	-	(5)	-	-
Saldo al 31 de diciembre de 2015	32	221	2	1.322	1.322

BBK II

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2015	6	69	-	1.754	1.754
Importes devengados durante el ejercicio 2015	71	59	6	-	-
Pagos realizados el 02.06.2015	(36)	-	(3)	-	-
Pagos realizados el 02.12.2015	(36)	-	(3)	-	-
Saldo al 31 de diciembre de 2015	5	128	0	1.754	1.754

CANTABRIA

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2015	10	128	7	-	-
Importes devengados durante el ejercicio 2015	37	16	25	-	-
Pagos realizados el 22.03.2015	(19)	-	(12)	-	-
Pagos realizados el 22.09.2015	(19)	(1)	(13)	-	-
Saldo al 31 de diciembre de 2015	9	143	7	-	-

CCM

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2015	7	426	2	-	-
Importes devengados durante el ejercicio 2015	76	49	25	-	-
Pagos realizados el 28.05.2015	(38)	-	(12)	-	-
Pagos realizados el 30.11.2015	(39)	-	(13)	-	-
Saldo al 31 de diciembre de 2015	6	475	2	-	-

GALICIA I

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2015	32	345	2	1.693	1.693
Importes devengados durante el ejercicio 2015	70	49	5	-	-
Pagos realizados el 19.01.2015	(36)	-	(3)	-	-
Pagos realizados el 17.07.2015	(35)	-	(2)	-	-
Saldo al 31 de diciembre de 2015	31	394	2	1.693	1.693

GALICIA II

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2015	12	393	1	1.118	1.118
Importes devengados durante el ejercicio 2015	65	47	5	-	-
Pagos realizados el 27.04.2015	(33)	-	(3)	-	-
Pagos realizados el 27.10.2015	(33)	-	(2)	-	-
Saldo al 31 de diciembre de 2015	11	440	1	1.118	1.118

GRANADA

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2015	4	48	-	1.481	1.481
Importes devengados durante el ejercicio 2015	32	17	2	-	-
Pagos realizados el 20.05.2015	(17)	-	(1)	-	-
Pagos realizados el 20.11.2015	(16)	-	(1)	-	-
Saldo al 31 de diciembre de 2015	3	65	-	1.481	1.481

LAIETANA

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2015	5	19	-	308	308
Importes devengados durante el ejercicio 2015	18	7	1	-	-
Pagos realizados el 25.03.2015	(9)	-	(1)	-	-
Pagos realizados el 25.09.2015	(9)	-	-	-	-
Saldo al 31 de diciembre de 2015	5	26	-	308	308

SA NOSTRA I

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2015	2	4	-	386	386
Importes devengados durante el ejercicio 2015	17	5	1	-	-
Pagos realizados el 18.05.2015	(9)	(5)	(1)	(208)	-
Pagos realizados el 16.11.2015	(8)	-	-	-	-
Saldo al 31 de diciembre de 2015	2	4	-	178	386

VITAL I

	Miles de Euros				
	Comisión Sociedad Gestora	Comisión Administración	Comisión Agente Financiero	Comisión Variable	Repercusión de pérdidas
Saldo al 1 de enero de 2015	4	2	-	794	794
Importes devengados durante el ejercicio 2015	32	14	1	-	-
Pagos realizados el 18.05.2015	(16)	-	1	-	-
Pagos realizados el 16.11.2015	(16)	-	-	-	-
Saldo al 31 de diciembre de 2015	4	16	-	794	794

11. CONTRATOS DE SWAP

La Sociedad Gestora, por cuenta y en representación del Fondo, celebró en relación con cada Serie con una entidad (la “entidad de contrapartida”) un contrato de permuta financiera de intereses conforme al modelo de Contrato Marco de Operaciones Financieras (CMOF) de la Asociación de Banca Española (el “contrato de swap”) con la finalidad de cubrir el riesgo de tipo de interés de la Serie correspondiente.

Con fecha 21 de marzo de 2013 se produjo una reestructuración del Fondo, de forma que se canceló el contrato Swap en la Series BBK I, BBK II y CCM I debido al cambio en la remuneración de los Bonos de tipo variable a tipo fijo.

El principal objetivo del contrato de swap es cubrir el riesgo que para el Fondo podría suponer el hecho de que ciertos Activos se encuentran sujetos a tipos de interés y a periodos de revisión y liquidación diferentes al tipo de interés aplicable a los Bonos. Mediante el contrato swap el Fondo paga, en cada fecha de pago, 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 Fondo notificará el tipo variable A dos (2) días hábiles anteriores a cada fecha de pago.

A su vez, cobra el resultante de adicionar al importe nominal el tipo de interés de referencia de los Bonos más un margen, siendo éste para las distintas series el siguiente:

- AyT C. Cantabria: 0,50%
- AyT C. Círculo de Burgos: 0,60% (cancelado en 2014)
- AyT C. Laietana: 0,80%
- AyT C.G.H C. España: 1,20%
- AyT C. Galicia I: 0,50%
- AyT C. Galicia II: 0,50%
- AyT C.G.H C. Granada: 0,60%
- AyT C.G.H Sa Nostra: 0,80%
- AyT C.G.H C. Vital: 0,50%

El movimiento global del valor razonable (ex - cupón) de los diferentes contratos de swap existentes en cada serie durante los ejercicios 2016 y 2015 es el siguiente:

	Miles de euros
Valor razonable al 31/12/14	<u>(40.972)</u>
Trasposos a pérdidas y ganancias	13.285
Importe bruto de las ganancias / (pérdidas) por valoración	<u>(3.249)</u>
Valor razonable al 31/12/15	<u>(30.936)</u>
Trasposos a pérdidas y ganancias	9.967
Importe bruto de las ganancias / (pérdidas) por valoración	<u>(6.136)</u>
Valor razonable al 31/12/16	<u>(27.104)</u>

Al 31 de diciembre de 2016 el Fondo ha registrado en la partida “Ajustes repercutidos en balance de Ingresos y Gastos reconocidos - Cobertura de Flujos de efectivo” del balance de situación un importe de 27.226 miles de euros (2015: 30.936 miles de euros).

El Fondo no ha registrado ningún saldo en la cuenta de pérdidas y ganancias como consecuencia de ineficacias de las coberturas contables.

Durante el ejercicio 2016 se han devengado gastos financieros netos por estos contratos por importe de 9.846 miles de euros (2015: 13.285 miles de euros).

Al 31 de diciembre de 2016 existían gastos netos devengados no vencidos por estos contratos por importe de 2.323 miles de euros (2015: 2.826 miles de euros), estando registrados en la cuenta “Derivados – Derivados de cobertura” del pasivo corriente del balance de situación.

A 31 de diciembre de 2016 y 2015 las hipótesis de valoración del swap son las que se indican en el cuadro siguiente:

	AyT CGH Vital I	
	Miles de euros	
	2016	2015
Precio	(1.884)	(1.967)
Nominal swap	118.457	126.948
WAC	0,56%	0,77%
WAM	255,67	266,41
CPR	2,23%	2,00%
Spread flujos préstamos	0,60%	0,61%
Spread medio bonos	0,00%	0,00%
Impagados	0,00%	0,00%

<u>AyT CGH Caja Cantabria</u>		
Miles de euros		
	<u>2016</u>	<u>2015</u>
Precio	(3.286)	(3.716)
Nominal swap	136.743	146.663
WAC	0,69%	0,91%
WAM	240,72	251,45
CPR	2,22%	2,20%
Spread flujos préstamos	0,66%	0,66%
Spread medio bonos	0,00%	0,00%
Impagados	0,00%	0,00%

<u>AyT CGH Caixa Laietana</u>		
Miles de euros		
	<u>2016</u>	<u>2015</u>
Precio	-	(2.663)
Nominal swap	-	53.447
WAC	-	3,31%
WAM	-	261,75
CPR	-	12,04%
Spread flujos préstamos	-	0,31%
Spread medio bonos	-	0,00%
Impagados	-	0,00%

<u>AyT CGH Caixa Galicia II</u>		
Miles de euros		
	<u>2016</u>	<u>2015</u>
Precio	(11.075)	(10.505)
Nominal swap	431.932	455.113
WAC	0,89%	1,06%
WAM	281,90	291,05
CPR	1,31%	2,88%
Spread flujos préstamos	0,76%	0,76%
Spread medio bonos	0,00%	0,00%
Impagados	0,00%	0,00%

AyT CGH Caixa Galicia I		
Miles de euros		
	2016	2015
Precio	(8.384)	(7.832)
Nominal swap	438.617	465.882
WAC	0,80%	1,01%
WAM	247,06	255,8
CPR	3,09%	3,95%
Spread flujos préstamos	0,69%	0,68%
Spread medio bonos	0,00%	0,00%
Impagados	0,00%	0,00%

AyT CGH Sa Nostra I		
Miles de euros		
	2016	2015
Precio	(637)	(747)
Nominal swap	43.468	48.094
WAC	0,90%	1,12%
WAM	260,38	266,65
CPR	2,29%	4,67%
Spread flujos préstamos	0,83%	0,84%
Spread medio bonos	0,00%	0,00%
Impagados	0,00%	0,00%

AyT CGH Caja Granada I		
Miles de euros		
	2016	2015
Precio	(4.162)	(834)
Nominal swap	92.709	28.201
WAC	3,13%	3,67%
WAM	205,45	102,74
CPR	15,17%	14,09%
Spread flujos préstamos	0,81%	1,05%
Spread medio bonos	0,00%	0,00%
Impagados	0,00%	0,00%

12. SITUACIÓN FISCAL

El Fondo tiene sujetos a inspección fiscal todos los impuestos que le son de aplicación correspondientes a los cuatro últimos ejercicios. En opinión de los Administradores de su Sociedad Gestora, la posibilidad de que se materialicen pasivos fiscales correspondientes a los ejercicios sujetos a inspección es remota y, en cualquier caso, la deuda tributaria que de ellos pudiera derivarse no afectaría significativamente a las cuentas anuales.

Según se indica en la Nota 3.j, en los ejercicios 2016 y 2015 se han equilibrado los ingresos y los gastos del Fondo, por lo que no ha procedido liquidar cuota alguna por el Impuesto sobre Beneficios.

13. OTRA INFORMACIÓN

El Fondo no tiene activos ni ha incurrido en gastos destinados a la minimización del impacto medioambiental y a la protección y mejora del medio ambiente. Asimismo, no existen provisiones para riesgos y gastos ni contingencias relacionadas con la protección y mejora del medio ambiente. Asimismo, durante los ejercicios 2016 y 2015 el Fondo no ha tenido derechos de emisión de gases de efecto invernadero.

Los honorarios correspondientes a la auditoría de las cuentas anuales del ejercicio 2016 han sido de 12 miles de euros (2015: 12 miles de euros), no habiéndose prestado por parte del auditor del Fondo, servicios distintos a la auditoría de cuentas.

En la Nota 9 se incluyen las fechas de pago de las liquidaciones intermedias de los ejercicios 2016 y 2015, así como un resumen de las liquidaciones de cobros y pagos habidas a lo largo de los ejercicios 2016 y 2015. Adicionalmente, el periodo medio de pago a proveedores, durante los ejercicios 2016 y 2015, no acumula un aplazamiento superior a la periodicidad del pago (60 días).

Los instrumentos financieros han sido valorados a 31 de diciembre de 2016 y 2015, en base a los criterios recogidos en la Nota 3 de estas cuentas anuales, los cuales no difieren de forma significativa del valor razonable de dichos instrumentos.

14. HECHOS POSTERIORES

Con posterioridad al cierre del ejercicio 2016 y hasta la fecha de formulación de estas cuentas anuales no ha ocurrido ningún otro hecho que afecte o modifique significativamente la información contenida en las cuentas anuales.

ANEXO I

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2016								Situación cierre anual anterior 31/12/2015								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	3,89	0400	0	0420	0	0440	2,61	1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	38,10	0401	0	0421	0	0441	33,23	1381	45,25	1401	0	1421	0	1441	34,27	2381	12,23	2401	2,14	2421	0	2441	0
Préstamos hipotecarios	0382	0	0402	0	0422	0	0442	0	1382	0	1402	0	1422	0	1442	0	2382	0	2402	0	2422	0	2442	0
Cédulas hipotecarias	0383	0	0403	0	0423	0	0443	0	1383	0	1403	0	1423	0	1443	0	2383	0	2403	0	2423	0	2443	0
Préstamos a promotores	0384	0	0404	0	0424	0	0444	0	1384	0	1404	0	1424	0	1444	0	2384	0	2404	0	2424	0	2444	0
Préstamos a PYMES	0385	0	0405	0	0425	0	0445	0	1385	0	1405	0	1425	0	1445	0	2385	0	2405	0	2425	0	2445	0
Préstamos a empresas	0386	0	0406	0	0426	0	0446	0	1386	0	1406	0	1426	0	1446	0	2386	0	2406	0	2426	0	2446	0
Préstamos corporativos	0387	0	0407	0	0427	0	0447	0	1387	0	1407	0	1427	0	1447	0	2387	0	2407	0	2427	0	2447	0
Cédulas territoriales	0388	0	0408	0	0428	0	0448	0	1388	0	1408	0	1428	0	1448	0	2388	0	2408	0	2428	0	2448	0
Bonos de tesorería	0389	0	0409	0	0429	0	0449	0	1389	0	1409	0	1429	0	1449	0	2389	0	2409	0	2429	0	2449	0
Deuda subordinada	0390	0	0410	0	0430	0	0450	0	1390	0	1410	0	1430	0	1450	0	2390	0	2410	0	2430	0	2450	0
Créditos AAPP	0391	0	0411	0	0431	0	0451	0	1391	0	1411	0	1431	0	1451	0	2391	0	2411	0	2431	0	2451	0
Préstamos consumo	0392	0	0412	0	0432	0	0452	0	1392	0	1412	0	1432	0	1452	0	2392	0	2412	0	2432	0	2452	0
Préstamos automoción	0393	0	0413	0	0433	0	0453	0	1393	0	1413	0	1433	0	1453	0	2393	0	2413	0	2433	0	2453	0
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394	0	0414	0	0434	0	0454	0	1394	0	1414	0	1434	0	1454	0	2394	0	2414	0	2434	0	2454	0
Cuentas a cobrar	0395	0	0415	0	0435	0	0455	0	1395	0	1415	0	1435	0	1455	0	2395	0	2415	0	2435	0	2455	0
Derechos de crédito futuros	0396	0	0416	0	0436	0	0456	0	1396	0	1416	0	1436	0	1456	0	2396	0	2416	0	2436	0	2456	0
Bonos de titulización	0397	0	0417	0	0437	0	0457	0	1397	0	1417	0	1437	0	1457	0	2397	0	2417	0	2437	0	2457	0
Cédulas internacionalización	0398	0	0418	0	0438	0	0458	0	1398	0	1418	0	1438	0	1458	0	2398	0	2418	0	2438	0	2458	0
Otros	0399	0	0419	0	0439	0	0459	0	1399	0	1419	0	1439	0	1459	0	2399	0	2419	0	2439	0	2459	0

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	9.670	0467	2.771	0474	622	0481	1	0488	3.394	0495	918.024	0502	58	0509	921.477
De 1 a 3 meses	0461	422	0468	340	0475	101	0482	0	0489	441	0496	48.174	0503	19	0510	48.634
De 3 a 6 meses	0462	100	0469	144	0476	28	0483	21	0490	193	0497	11.840	0504	0	0511	12.033
De 6 a 9 meses	0463	51	0470	140	0477	21	0484	40	0491	201	0498	6.243	0505	0	0512	6.444
De 9 a 12 meses	0464	59	0471	515	0478	21	0485	57	0492	592	0499	6.637	0506	0	0513	7.229
Más de 12 meses	0465	736	0472	44.663	0479	455	0486	2.998	0493	48.116	0500	50.564	0507	0	0514	98.681
Total	0466	11.038	0473	48.572	0480	1.249	0487	3.116	0494	52.937	0501	1.041.482	0508	78	1515	1.094.497

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	9.670	0522	2.771	0529	622	0536	1	0543	3.394	0550	918.024	0557	58	0564	921.477	0571	1.822.088	0578	1.239.526	0584	50,57
De 1 a 3 meses	0516	422	0523	340	0530	101	0537	0	0544	441	0551	48.174	0558	19	0565	48.634	0572	83.820	0579	30.227	0585	58,02
De 3 a 6 meses	0517	100	0524	144	0531	28	0538	21	0545	193	0552	11.840	0559	0	0566	12.033	0573	19.086	0580	5.528	0586	63,05
De 6 a 9 meses	0518	51	0525	140	0532	21	0539	40	0546	201	0553	6.243	0560	0	0567	6.444	0574	9.842	0581	4.989	0587	65,48
De 9 a 12 meses	0519	59	0526	515	0533	21	0540	57	0547	592	0554	6.637	0561	0	0568	7.229	0575	11.227	0582	4.869	0588	64,39
Más de 12 meses	0520	736	0527	44.663	0534	455	0541	2.998	0548	48.116	0555	50.564	0562	0	0569	98.681	0576	142.822	0583	72.546	0589	69,09
Total	0521	11.038	0528	48.572	0535	1.249	0542	3.116	0549	52.937	0556	1.041.482	0563	78	0570	1.094.497	0577	2.088.885			0590	52,40

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 19/04/2007	
Inferior a 1 año	0600	659	1600	514	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	1.531	1601	1.316	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	3.614	1602	2.449	2602	31
Entre 3 y 4 años	0603	6.858	1603	0	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	10.364	1604	14.331	2604	670
Entre 5 y 10 años	0605	131.581	1605	117.648	2605	11.672
Superior a 10 años	0606	2.882.284	1606	3.187.700	2606	7.321.426
Total	0607	3.036.891	1607	3.323.958	2607	7.333.799
Vida residual media ponderada (años)	0608	20,04	1608	20,86	2608	

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 19/04/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	11,70	1609	10,75	2609	

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 31/12/2016
Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 19/04/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	7.007	0630	313.218	1620	6.349	1630	299.547	2620	3.720	2630	359.538
40% - 60%	0621	10.560	0631	962.479	1621	10.082	1631	925.368	2621	3.443	2631	373.552
60% - 80%	0622	11.278	0632	1.407.025	1622	12.840	1632	1.586.237	2622	19.547	2632	2.634.917
80% - 100%	0623	2.202	0633	346.659	1623	3.226	1633	512.807	2623	25.490	2633	3.965.792
100% - 120%	0624	20	0634	3.041	1624	0	1634	0	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625	9	0635	1.424	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	6	0636	813	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	18	0637	2.232	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	31.100	0638	3.036.891	1628	32.497	1638	3.323.959	2628	52.200	2638	7.333.799
Media ponderada (%)			0639	61,64			1639	0			2639	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 19/04/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,90	1650	1,40	2650	4,98
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,50	1651	6,75	2651	8,37
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,19	1652	0,39	2652	2,25

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 19/04/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	1.980	0683	175.209	1660	2.178	1683	199.192	2660	5.902	2683	748.521
Aragón	0661	413	0684	42.237	1661	422	1684	45.292	2661	779	2684	110.741
Asturias	0662	118	0685	10.120	1662	120	1685	10.501	2662	478	2685	57.694
Baleares	0663	853	0686	59.883	1663	910	1686	65.198	2663	1.528	2686	143.445
Canarias	0664	114	0687	12.085	1664	116	1687	12.634	2664	388	2687	50.490
Cantabria	0665	2.300	0688	215.679	1665	2.348	1688	231.461	2665	2.771	2688	373.605
Castilla-León	0666	725	0689	70.004	1666	733	1689	73.741	2666	2.063	2689	254.764
Castilla La Mancha	0667	3.328	0690	346.852	1667	3.410	1690	370.676	2667	4.412	2690	624.352
Cataluña	0668	1.418	0691	181.259	1668	1.856	1691	244.002	2668	3.745	2691	681.862
Ceuta	0669	1	0692	200	1669	1	1692	210	2669	1	2692	235
Extremadura	0670	141	0693	10.436	1670	143	1693	10.927	2670	348	2693	40.333
Galicia	0671	4.586	0694	356.012	1671	4.691	1694	377.854	2671	5.673	2694	601.415
Madrid	0672	3.661	0695	442.434	1672	3.804	1695	480.124	2672	5.635	2695	962.504
Melilla	0673	13	0696	1.084	1673	15	1696	1.370	2673	25	2696	2.736
Murcia	0674	192	0697	19.978	1674	202	1697	21.828	2674	393	2697	53.582
Navarra	0675	78	0698	8.788	1675	79	1698	9.377	2675	673	2698	107.854
La Rioja	0676	301	0699	30.197	1676	309	1699	32.405	2676	1.996	2699	267.238
Comunidad Valenciana	0677	2.178	0700	226.237	1677	2.236	1700	241.043	2677	3.587	2700	500.959
País Vasco	0678	8.700	0701	827.766	1678	8.921	1701	895.676	2678	11.799	2701	1.750.756
Total España	0679	31.100	0702	3.036.462	1679	32.494	1702	3.323.511	2679	52.196	2702	7.333.086
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	3	0704	429	1681	3	1704	447	2681	4	2704	713
Total general	0682	31.103	0705	3.036.891	1682	32.497	1705	3.323.958	2682	52.200	2705	7.333.799

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 31/12/2016
Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 19/04/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	24,20			1710	23			2710	16,29		
Sector	0711	0	0712		1711	0	1712		2711	0	2712	

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2016			Situación cierre anual anterior 31/12/2015			Situación inicial 19/04/2007		
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
ES0312273479	D	35	100.000	3.500	35	100.000	3.500	35	100.000	3.500
ES0312273446	A	2.035	55.815	113.583	2.035	61.000	123.420	2.035	100.000	203.500
ES0312273461	C	103	100.000	10.300	103	100.000	10.300	103	100.000	10.300
ES0312273453	B	127	100.000	12.700	127	100.000	12.700	127	100.000	12.700
ES0312273156	D	11	100.000	1.100	11	100.000	1.100	11	100.000	1.100
ES0312273149	C	31	85.046	2.636	31	100.000	3.100	31	100.000	3.100
ES0312273131	B	74	84.967	6.288	74	100.000	7.400	74	100.000	7.400
ES0312273123	A	974	35.181	34.266	974	38.000	37.281	974	100.000	97.400
ES0312273008	A	13.912	51.335	714.171	13.912	56.000	773.881	13.912	100.000	1.391.200
ES0312273032	D	143	100.000	14.300	143	100.000	14.300	143	100.000	14.300
ES0312273024	C	135	100.000	13.500	135	100.000	13.500	135	100.000	13.500
ES0312273016	B	810	100.000	81.000	810	100.000	81.000	810	100.000	81.000
ES0312273396	D	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000
ES0312273388	C	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000
ES0312273370	B	305	100.000	30.500	305	100.000	30.500	305	100.000	30.500
ES0312273362	A	9.555	47.121	450.242	9.555	52.000	498.839	9.555	100.000	955.500
ES0312273115	D	38	100.000	3.800	38	100.000	3.800	38	100.000	3.800
ES0312273107	C	82	100.000	8.200	82	100.000	8.200	82	100.000	8.200
ES0312273099	B	126	100.000	12.600	126	100.000	12.600	126	100.000	12.600
ES0312273081	A	1.753	54.418	95.395	1.753	59.000	103.889	1.753	100.000	175.300
ES0312273164	A	3.691	17.881	66.001	3.691	24.000	89.976	3.691	100.000	369.100
ES0312273198	D	48	100.000	4.800	48	100.000	4.800	48	100.000	4.800
ES0312273180	C	80	100.000	8.000	80	100.000	8.000	80	100.000	8.000
ES0312273172	B	180	100.000	18.000	180	100.000	18.000	180	100.000	18.000
ES0312273271	D	104	100.000	10.400	104	100.000	10.400	104	100.000	10.400
ES0312273263	C	280	100.000	28.000	280	100.000	28.000	280	100.000	28.000

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

ES0312273255	B		456	100.000	45.600	456	100.000	45.600	456	100.000	45.600			
ES0312273248	A		7.160	45.475	325.603	7.160	50.000	356.767	7.160	100.000	716.000			
ES0312273313	D		153	100.000	15.300	153	100.000	15.300	153	100.000	15.300			
ES0312273305	C		216	100.000	21.600	216	100.000	21.600	216	100.000	21.600			
ES0312273297	B		369	100.000	36.900	369	100.000	36.900	369	100.000	36.900			
ES0312273289	A		8.262	45.733	377.842	8.262	49.000	404.432	8.262	100.000	826.200			
ES0312273438	D		124	100.000	12.400	124	100.000	12.400	124	100.000	12.400			
ES0312273420	C		380	100.000	38.000	380	100.000	38.000	380	100.000	38.000			
ES0312273412	B		446	100.000	44.600	446	100.000	44.600	446	100.000	44.600			
ES0312273404	A		8.550	40.135	343.157	8.550	43.000	364.490	8.550	100.000	855.000			
ES0312273511	D		60	100.000	6.000	60	100.000	6.000	60	100.000	6.000			
ES0312273503	C		51	100.000	5.100	51	100.000	5.100	51	100.000	5.100			
ES0312273495	B		135	100.000	13.500	135	100.000	13.500	135	100.000	13.500			
ES0312273487	A		1.454	18.866	27.431	1.454	22.000	31.971	1.454	100.000	145.400			
ES0312273040	A								898	100.000	89.800			
ES0312273057	B								56	100.000	5.600			
ES0312273065	C								41	100.000	4.100			
ES0312273073	D								5	100.000	500			
ES0312273206	A								4.375	100.000	437.500			
ES0312273214	B								450	100.000	45.000			
ES0312273222	C								110	100.000	11.000			
ES0312273230	D								65	100.000	6.500			
ES0312273321	A								1.350	100.000	135.000			
ES0312273339	B								63	100.000	6.300			
ES0312273347	C								51	100.000	5.100			
ES0312273354	D								36	100.000	3.600			
ES0312273529	A								1.622	100.000	162.200			
ES0312273537	B								170	100.000	17.000			
ES0312273545	C								160	100.000	16.000			
ES0312273552	D								48	100.000	4.800			
ES0312273560	A								1.112	100.000	111.200			
ES0312273578	B								63	100.000	6.300			
ES0312273586	C								50	100.000	5.000			
ES0312273594	D								25	100.000	2.500			
Total		0723	62.588		0724	3.070.315	1723	62.588	1724	3.309.146	2723	73.338	2724	7.333.800

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/12/2016

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
			0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737		
ES0312273487	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,30	0,33	0	0	SI	27.431	0	27.431	
ES0312273495	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,60	0,63	0	0	SI	13.500	0	13.500	
ES0312273503	C	S	EURIBOR 6 MESES	1	1,03	0	0	SI	5.100	0	5.100	
ES0312273511	D	S	EURIBOR 6 MESES	2	2,03	0	0	SI	6.000	0	6.000	
ES0312273008	A	NS	FIJO	0	1,17	2.312	0	SI	714.171	0	716.483	
ES0312273016	B	S	FIJO	0	1,30	291	0	SI	81.000	0	81.291	
ES0312273024	C	S	FIJO	0	1,65	62	0	SI	13.500	0	13.562	
ES0312273032	D	S	FIJO	0	3	119	0	SI	14.300	0	14.419	
ES0312273446	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,30	0,17	32	0	SI	113.583	0	113.615	
ES0312273453	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,60	0,47	14	0	SI	12.700	0	12.714	
ES0312273461	C	S	EURIBOR 6 MESES	1	0,87	24	0	SI	10.300	0	10.324	
ES0312273479	D	S	EURIBOR 6 MESES	2	1,87	18	0	SI	3.500	0	3.518	
ES0312273289	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,30	0,25	193	0	SI	377.842	0	378.035	
ES0312273297	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,60	0,55	70	0	SI	36.900	0	36.970	
ES0312273305	C	S	EURIBOR 6 MESES	1	0,95	81	0	SI	21.600	0	21.681	
ES0312273313	D	S	EURIBOR 6 MESES	2	1,95	128	0	SI	15.300	0	15.428	
ES0312273412	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,60	0,46	32	0	SI	44.600	0	44.632	
ES0312273420	C	S	EURIBOR 6 MESES	1	0,86	55	0	SI	38.000	0	38.055	
ES0312273438	D	S	EURIBOR 6 MESES	2	1,86	41	0	SI	12.400	0	12.441	
ES0312273404	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,30	0,16	55	0	SI	343.157	0	343.213	
ES0312273131	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,30	0,16	1	0	SI	6.288	0	6.288	
ES0312273149	C	S	EURIBOR 6 MESES	0,65	0,51	1	0	SI	2.636	0	2.638	
ES0312273156	D	S	EURIBOR 6 MESES	2	1,86	3	0	SI	1.100	0	1.103	
ES0312273164	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,25	0,11	3	0	SI	66.001	0	66.003	0
ES0312273123	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,17	0,03	0	0	SI	34.266	0	34.266	

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

ES0312273172	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,60	0,46	8	0	SI	18.000	0	18.008	0					
ES0312273180	C	S	EURIBOR 6 MESES	1,50	1,36	12	0	SI	8.000	0	8.012						
ES0312273198	D	S	EURIBOR 6 MESES	2,50	2,36	12	0	SI	4.800	0	4.812	-1.235					
ES0312273362	A	NS	FIJO	0	1,30	481	0	SI	450.242	0	450.723						
ES0312273370	B	S	FIJO	0	1,60	40	0	SI	30.500	0	30.540						
ES0312273388	C	S	FIJO	0	2	12	0	SI	7.000	0	7.012						
ES0312273396	D	S	FIJO	0	3	17	0	SI	7.000	0	7.017						
ES0312273081	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,17	0,03	0	0	SI	95.395	0	95.395						
ES0312273099	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,30	0,16	1	0	SI	12.600	0	12.601						
ES0312273107	C	S	EURIBOR 6 MESES	0,65	0,51	5	0	SI	8.200	0	8.205						
ES0312273115	D	S	EURIBOR 6 MESES	2	1,86	9	0	SI	3.800	0	3.809						
ES0312273248	A	NS	FIJO	0	1,30	394	0	SI	325.603	0	325.997						
ES0312273255	B	S	FIJO	0	1,60	68	0	SI	45.600	0	45.668						
ES0312273263	C	S	FIJO	0	2,50	65	0	SI	28.000	0	28.065						
ES0312273271	D	S	FIJO	0	3,50	34	0	SI	10.400	0	10.434						
Total						0740	4.693	0741	0	0743	3.070.315	0744	0	0745	3.075.008	0746	-1.235

	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 19/04/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,89	0748	0,75	0749	4,77

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2016				Situación periodo comparativo anterior 31/12/2015			
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
ES0312273487	A		145.400		13.362	10.160	113.431	174	13.293
ES0312273370	B	0	0	245	5.913	0	0	488	5.180
ES0312273388	C	0	0	70	1.615	0	0	140	1.404
ES0312273495	B		13.500		1.885	0	0	101	1.821
ES0312273503	C		5.100		877	0	0	59	836
ES0312273511	D		6.000		1.517	0	0	130	1.422
ES0312273123	A	2.044	63.134	5	12.067	5.127	60.120	121	12.033
ES0312273131	B	0	1.112	5	1.219	0	0	31	1.203
ES0312273149	C	0	464	7	612	0	0	24	594
ES0312273156	D	0	0	10	358	0	0	24	336
ES0312273164	A	10.115	303.100	41	42.615	63.487	279.123	535	42.466
ES0312273172	B	0	0	42	3.163	0	0	131	3.068
ES0312273180	C	0	0	56	2.059	0	0	131	1.943
ES0312273198	D	0	0	58	1.671	0	0	127	1.552
ES0312273412	B	0	0	103	6.592	0	0	329	6.350
ES0312273420	C	0	0	165	6.901	0	0	434	6.541
ES0312273404	A	10.484	511.843	280	79.422	26.164	490.511	1.663	78.567
ES0312273438	D	0	0	117	3.299	0	0	267	3.056
ES0312273396	D	0	0	105	2.261	0	0	210	1.944
ES0312273362	A	21.830	528.279	3.077	126.545	54.418	456.662	6.996	116.151
ES0312273081	A	4.117	79.905	13	23.871	7.999	71.412	322	23.774
ES0312273099	B	0	0	10	2.082	0	0	53	2.054
ES0312273107	C	0	0	21	1.626	0	0	64	1.579
ES0312273115	D	0	0	36	1.238	0	0	81	1.163
ES0312273255	B	0	0	364	9.198	0	0	734	8.470

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

ES0312273263	C	0	0	349	7.914	0	0	704	7.216								
ES0312273271	D	0	0	182	3.875	0	0	366	3.511								
ES0312273248	A	14.782	390.397	2.206	99.248	28.919	359.233	4.942	94.730								
ES0312273016	B		0		16.508	0	0	1.053	15.453								
ES0312273024	C		0		3.200	0	0	223	2.977								
ES0312273032	D		0		5.008	0	0	429	4.795								
ES0312273008	A		606.681		217.101	65.513	575.123	9.628	212.586								
ES0312273446	A		89.917		21.106	11.897	80.080	590	20.795								
ES0312273453	B		0		1.810	0	0	95	1.739								
ES0312273461	C		0		1.811	0	0	119	1.711								
ES0312273479	D		0		906	0	0	76	838								
ES0312273289	A		448.358		88.135	29.462	421.769	2.318	86.923								
ES0312273297	B		0		5.819	0	0	312	5.594								
ES0312273305	C		0		4.138	0	0	270	3.919								
ES0312273313	D		0		4.229	0	0	347	3.918								
Total		0754	63.372	0755	3.193.190	0756	7.569	0757	832.778	1754	303.146	1755	2.907.464	1756	34.841	1757	803.505

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Calificación				
		Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 19/04/2007
		0760	0761	0762	0763	0764
ES0312273487	A	17/01/2013	FCH	A+	A+	AAA
ES0312273487	A	13/11/2012	SYP	A-	A-	AA
ES0312273495	B	04/04/2014	FCH	BBB	BBB	A
ES0312273495	B	27/02/2015	SYP	B-	B-	BB
ES0312273503	C	02/03/2010	FCH	BB	BB	BBB-
ES0312273511	D	04/04/2014	FCH	CCC	CCC	BB-
ES0312273008	A	07/03/2016	FCH	A-	A-	A-
ES0312273008	A	14/05/2016	MDY	Aa2	Aa3	Aaa
ES0312273016	B	29/04/2013	MDY	Ba3	Ba3	Baa2
ES0312273024	C	29/04/2013	MDY	B3	B3	Ba2
ES0312273032	D	29/04/2013	MDY	Caa3	Caa3	B3
ES0312273446	A	10/07/2008	FCH	AAA	A+	AAA
ES0312273446	A	10/07/2015	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0312273453	B	17/05/2013	FCH	BBB+	BBB+	A
ES0312273453	B	01/03/2011	MDY	B2	Baa2	B2
ES0312273461	C	10/07/2008	FCH	BBB-	B	BBB-
ES0312273461	C	01/03/2011	MDY	Caa1	Caa1	Caa1
ES0312273479	D	13/04/2015	FCH	CCC	CCC	BB-
ES0312273479	D	01/03/2011	MDY	C	C	C
ES0312273289	A	30/06/2015	FCH	AA+	AA+	AAA
ES0312273289	A	23/01/2015	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0312273297	B	10/03/2008	FCH	A	A	A
ES0312273297	B	14/05/2016	MDY	A2	A3	Baa2
ES0312273305	C	17/05/2013	FCH	BB+	BB+	BBB-
ES0312273305	C	14/05/2016	MDY	Ba2	B1	Ba3
ES0312273313	D	17/05/2013	FCH	B+	B+	BB-

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

ES0312273313	D	14/05/2016	MDY	Caa2	Ca	Ca
ES0312273164	A	23/01/2015	MDY	A1	A1	Aa2
ES0312273172	B	26/03/2015	FCH	B	B	A
ES0312273172	B	10/07/2015	MDY	B1	B1	Ba1
ES0312273180	C	26/03/2015	FCH	CCC	CCC	BBB-
ES0312273180	C	13/12/2010	MDY	Caa3	Caa3	Caa3
ES0312273198	D	26/03/2015	FCH	CC	CC	BB-
ES0312273198	D	13/12/2010	MDY	C	C	C
ES0312273123	A	17/05/2013	FCH	A	A	AAA
ES0312273123	A	08/01/2015	SYP	BBB	BBB	A
ES0312273131	B	17/05/2013	FCH	BBB	BBB	A
ES0312273149	C	17/05/2013	FCH	BB	BB	BBB-
ES0312273156	D	18/04/2011	FCH	B	B	BB-
ES0312273164	A	26/03/2015	FCH	A-	A-	AAA
ES0312273404	A	07/03/2016	FCH	AA+	AA-	AAA
ES0312273404	A	23/01/2015	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0312273412	B	14/07/2008	FCH	A	A	A
ES0312273412	B	10/07/2015	MDY	Aa3	Aa3	Baa3
ES0312273420	C	17/05/2013	FCH	BB-	BB-	BBB-
ES0312273420	C	23/01/2015	MDY	Ba1	Ba1	B1
ES0312273438	D	06/09/2012	FCH	B	B	BB-
ES0312273438	D	10/07/2015	MDY	Caa1	Caa1	Caa3
ES0312273362	A	23/12/2016	FCH	A-	AA-	AA-
ES0312273362	A	14/05/2016	MDY	Aa2	Aa2	Aa2
ES0312273370	B	23/12/2016	FCH	B	BBB	BB
ES0312273370	B	25/09/2014	MDY	Ba2	Ba2	A2
ES0312273388	C	23/01/2015	MDY	B1	B1	Baa3
ES0312273396	D	10/07/2015	MDY	Caa1	Caa1	Ba2
ES0312273081	A	30/06/2015	FCH	AA	AA	AAA
ES0312273081	A	23/01/2015	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0312273099	B	12/12/2016	FCH	BBB	A	A
ES0312273099	B	10/07/2015	MDY	A3	A3	Ba3
ES0312273107	C	12/12/2016	FCH	B	BB	BBB-
ES0312273107	C	10/07/2015	MDY	B2	B2	B3
ES0312273115	D	12/12/2016	FCH	CCC	B	BB-
ES0312273115	D	08/10/2010	MDY	C	C	C
ES0312273248	A	28/12/2007	FCH	AAA	A-	AAA
ES0312273248	A	29/04/2016	SYP	AA-	A	AA
ES0312273255	B	28/12/2007	FCH	A	BB	A
ES0312273263	C	17/04/2012	FCH	CCC	CCC	BBB-
ES0312273271	D	17/04/2012	FCH	CC	CC	BB

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Periodo de la declaración: 31/12/2016
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 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 19/04/2007	
Inferior a 1 año	0765	52.031	1765	0	2765	0
Entre 1 y 2 años	0766	0	1766	89.976	2766	0
Entre 2 y 3 años	0767	66.001	1767	31.971	2767	31
Entre 3 y 4 años	0768	0	1768	30.800	2768	670
Entre 4 y 5 años	0769	30.800	1769	0	2769	11.672
Entre 5 y 10 años	0770	2.528.059	1770	2.746.099	2770	571.471
Superior a 10 años	0771	393.424	1771	410.300	2771	6.749.956
Total	0772	3.070.315	1772	3.309.146	2772	7.333.800
Vida residual media ponderada (años)	0773	8,38	1773	7,38	2773	29,52

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2016

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 19/04/2007	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	197.403	1775	203.353	2775	165.253
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	157.204	1776	166.315	2776	165.253
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	6	1777	6	2777	2
1.3 Denominación de la contrapartida	0778		1778		2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		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		1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784		1784		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		1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791		1791		2791	
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	82,96	1792	79,98	2792	90,14
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793	0	1793	0	2793	0
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 Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2016

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características		
Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 19/04/2007			
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806		
Total						0808		0809		0810	

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2016

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 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 19/04/2007	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 19/04/2007		
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.05.5

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2016

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 Hipotecario, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 31/12/2016

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 Hipotecario, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 31/12/2016

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 Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2016

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

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

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto



AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A.

ESTADO S.06 – NOTAS EXPLICATIVAS -

ESTADO S.05.3

El [ESTADO S.05.3](#) no está cumplimentado al no existir [MEJORAS CREDITICIAS](#) ni [CONTRAPARTIDAS](#) a nivel de Programa. Este Programa es un Fondo Compartimentado, compuesto por Series que son compartimentos estancos. Las Mejoras Crediticias y Contrapartidas existen a nivel de cada una de las Series (Compartimentos), ya que no son solidarias, al responder únicamente, para cada Serie (Compartimento) concreta.

Para conocer las distintas [MEJORAS CREDITICIAS](#) y [CONTRAPARTIDAS](#) que aplican a las Series (Compartimentos) que componen el Programa, [VER ESTADO S.05.4 DE CADA UNA DE LAS SERIES \(COMPARTIMENTOS\)](#)

ESTADO S.05.4

El Apartado de “[TRIGGERS](#)” del [ESTADO S.05.4](#) no está cumplimentado al no existir Triggers a nivel de Programa. Este Programa es un Fondo Compartimentado, compuesto por Series que son compartimentos estancos. Los Triggers existen a nivel de cada una de las Series (Compartimentos), ya que no son solidarias, y únicamente son aplicables a cada Serie (Compartimento) concreta.

Para conocer los distintos [TRIGGERS](#) que afectan a las Series (Compartimentos) que componen el Programa, [VER ESTADO S.05.4 DE CADA UNA DE LAS SERIES \(COMPARTIMENTOS\)](#)

ESTADO S.05.5

El [ESTADO S.05.5](#) no está cumplimentado al no existir [COMISIONES](#) ni [FECHAS DE PAGO](#) a nivel de Programa. Este Programa es un Fondo Compartimentado, compuesto por Series que son compartimentos estancos. Las Mejoras Crediticias y Contrapartidas existen a nivel de cada una de las Series (Compartimentos), ya que no son solidarias, al responder únicamente, para cada Serie (Compartimento) concreta.

Para conocer las distintas [COMISIONES](#) y la información de la [COMISIÓN VARIABLE](#) que aplican a las Series (Compartimentos) que componen el Programa, [VER ESTADO S.05.5 DE CADA UNA DE LAS SERIES \(COMPARTIMENTOS\)](#)



HECHOS RELEVANTES

FONDO	FECHA DE CONSTITUCIÓN	RATING	DESCRIPCIÓN	HECHO RELEVANTE - CNMV
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA BBK II	10/04/2008		Modificación calificación crediticia por Fitch Ratings para los tramos A y B de AyT Colaterales Global Hipotecario FTA, Serie BBK II	4047028 27 de diciembre de 2016
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA BBK II	10/04/2008		Modificación a la baja del tramo A de AA-(sf) a A-(sf) y del tramo B de BB (sf) a B (sf), por parte de Fitch Ratings	4046687 23 de diciembre de 2016
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA Caja Vital I	26/07/2007		Modificación a la baja del tramo B de A (sf) a BBB (sf), del tramo C de BB (sf) a B (sf) y del tramo D de B (sf) a CCC (sf), por parte de Fitch Ratings	4044700 15 de diciembre de 2016
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA Caja Vital I	26/07/2007		Fijación tipo de lo bonos	4038492 14 de noviembre de 2016
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA Sa Nostra I	27/07/2007		Fijación tipo de los bonos	4038490 14 de noviembre de 2016
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA BBK I	24/04/2007		Modificación al alza del tramo A de Aa3 (sf) a Aa2 (sf) por parte de Moodys	3751799 18 de mayo de 2016
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA CCM I	28/12/2007		Modificación al alza del tramo A de A(sf) a AA- (sf), por parte de Fitch Ratings.	3747322 3 de mayo de 2016
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA BBK I	24/04/2007		Modificación de las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación y sustitución de Agente Financiero.	3728653 23 de marzo de 2016
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA BBK II	10/04/2008		Modificación de las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación y sustitución de Agente Financiero.	3728654 23 de marzo de 2016
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA Caixa Galicia I	07/03/2008		Modificación de las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación y sustitución de Agente Financiero.	3728655 23 de marzo de 2016
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA Caixa Galicia II	27/06/2008		Modificación de las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación y sustitución de Agente Financiero.	3728658 23 de marzo de 2016
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA Caja Granada I	11/12/2007		Modificación de las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación y sustitución de Agente Financiero.	3728659 23 de marzo de 2016
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA Caja Vital I	26/07/2007		Modificación de las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación y sustitución de Agente Financiero.	3728660 23 de marzo de 2016
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA Sa Nostra I	27/07/2007		Modificación de las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación y sustitución de Agente Financiero.	3728662 23 de marzo de 2016
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Vital I	26/07/2007		Modificación al alza del tramo B de Baa2 (sf) a A3 (sf) y del tramo C de B3 (sf) a B2 (sf) por parte de Moodys	3660954 14 de julio de 2015
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Cantabria I	09/07/2008		Modificación al alza del tramo A de A1 (sf) a Aa2 (sf) y del tramo B de Baa3 (sf) a Baa2 (sf), por parte de Moodys	3660952 14 de julio de 2015
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - BBK II	10/04/2008		Modificación al alza del tramo D de Caa2 (sf) a Caa1 (sf), por parte de Moodys	3660951 14 de julio de 2015
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia I	07/03/2008		Modificación al alza del tramo B de Baa3 (sf) a A3 (sf) y del tramo C de B3 (sf) a B1 (sf), por parte de Moodys	3660949 14 de julio de 2015
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia II	27/06/2008		Modificación al alza del tramo B de A1 (sf) a Aa3 (sf) y del tramo D de Caa2 (sf) a Caa1 (sf), por parte de Moodys	3660694 13 de julio de 2015
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Granada I	11/12/2007		Modificación al alza del tramo B de B3 (sf) a B1 (sf), por parte de Moodys	3660699 13 de julio de 2015
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Vital I	26/07/2007		Modificación a la alza de tramo A de AA- (sf) a AA(sf) por parte de Fitch Ratings	Nº 3658059 30 de junio de 2015
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia I	07/03/2008		Modificación al alza del tramo A de AA(sf) a AA+ (sf), por parte de Fitch Ratings	Nº 3658068 30 de junio de 2015
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Cantabria I	09/07/2008		Modificación a la baja de la calificación del tramo C de BB (sf) a B (sf) y del tramo D de B(sf) a CCC(sf), por parte de Fitch Ratings.	Nº 3657808 14 de abril de 2015

AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Granada I	11/12/2007		Modificación a la baja de la calificación de las serie A de A(sf) a A-(sf), la serie B de BB(sf) a B(sf), la serie C de B(sf) a CCC(sf) y la serie D de CCC(sf) a CC(sf), por parte de Fitch Ratings	Nº 3497011 2 de marzo de 2015
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Laietana I	23/07/2008		Modificación a la baja de la calificación del Tramo B de BB+(sf) a B-(sf) por parte de Standard & Pooors	Nº 3432504 26 de enero de 2015
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - BBK II	10/04/2008		Modificación al alza de la calificación del Tramo A de A2(sf) a Aa2(sf) y del Tramo C de B3(sf) a B1(sf), por parte de Moody's Investor Service	Nº 3432479 26 de enero de 2015
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia I	07/03/2008		Modificación al alza de la calificación del Tramo A de A1(sf) a Aa2(sf), por parte de Moody's Investors Service	Nº 3432475 26 de enero de 2015
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Vital I	26/07/2007		Modificación al alza de la calificación del Tramo A de A1(sf) a Aa2(sf), del Tramo B de Baa3(sf) a Baa2(sf) y del Tramo C de Caa1(sf) a B3(sf), por parte de Moody's Investor Service	Nº 3432454 26 de enero de 2015
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Cantabria I	09/07/2008		Modificación al alza de la calificación del Tramo B de Ba1(sf) a Baa3(sf), por parte de Moody's Investor Service	Nº 3432765 26 de enero de 2015
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja España I	19/12/2007		Modificación al alza de la calificación de la Serie A de A1(sf) a Aa2(sf), de la Serie B de Baa1(sf) a Aa2(sf), de la Serie C de Baa2(sf) a Baa2(sf) y de la Serie D de B3(sf) a B1(sf), por parte de Moody's Investor Service	Nº 3432695 26 de enero de 2015
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia II	27/06/2008		Modificación al alza de la calificación de la Serie A de A1(sf) a Aa2(sf), de la Serie B de Baa1(sf) a A1(sf) y de la Serie C de Baa3(sf) a Ba1(sf), por parte de Moody's Investor Service	3432689 26 de enero de 2015
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Granada I	11/12/2007		Modificación al alza de la calificación de la Serie A de A2(sf) a A1(sf), por parte de Moody's Investor Service	3432684 26 de enero de 2015
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - BBK I	24/04/2007		Modificación al alza de la calificación del Tramo A de A2(sf) a Aa3(sf), por parte de Moody's Investor Service	3421821 20 de enero de 2015
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Sa Nostra I	27/07/2007		Incorporación del suplemento del contrato de Administración	Nº 3407949 12 de enero de 2015
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Sa Nostra I	27/07/2007		Modificación a la baja de la calificación del Tramo A de A-(sf) a BBB(sf) por parte de Standard & Pooors	Nº 3376381 19 de diciembre de 2014
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Laietana I	23/07/2008		Sustitución del Agente Financiero	Nº 3329105 18 de noviembre de 2014
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja España I	19/12/2007		Recompra de certificados de transmisión hipotecaria y amortización anticipada de títulos	Nº 3294055 28 de octubre de 2014
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia I	07/03/2008		Modificación al alza de la calificación del Tramo A de A3(sf) a A1(sf) y del Tramo B de Ba1(sf) a Baa3(sf) por parte de Moody's Investors Service	Nº 3291670 27 de octubre de 2014
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja España I	19/12/2007		Modificación al alza de la calificación de la Serie B de Ba1(sf) a Baa1(sf), de la Serie C de B2(sf) a Ba2(sf) y de la Serie D de Caa1(sf) a B3(sf) por parte de Moody's Investors Service	Nº 3291680 27 de octubre de 2014
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Granada I	11/12/2007		Modificación al alza de la Serie A de Baa1(sf) a A2(sf) por parte de Moody's Investor Service	Nº 3264147 10 de octubre de 2014
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Granada I	11/12/2007		Suplemento al Contrato de Administración, siguiendo la Orientación del Banco Central Europeo (BCE/2014/31)	Nº 3262431 9 de octubre de 2014
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja España I	19/12/2007		Siguiendo la Orientación del Banco Central Europeo (BCE/2014/31), se realiza un Suplemento al Contrato de Administración.	Nº 3258426 7 de octubre de 2014
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Cantabria I	09/07/2008		Modificación al alza del Tramo A de A3(sf) a A1(sf), del Tramo B de B2(sf) a Ba1(sf) y del Tramo D de Caa1(sf) a Caa2(sf), por parte de Moody's Investor Service	Nº 3250323 1 de octubre de 2014
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia II	27/06/2008		Modificación al alza de la calificación de la Serie A de A3(sf) a A1(sf), de la Serie B de Ba1(sf) a Baa1(sf), de la Serie C de B2(sf) a Ba3(sf) y de la Serie D de Caa3(sf) a Caa2(sf) por parte de Moody's Investors Service	Nº 3247729 30 de septiembre de 2014
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Vital I	26/07/2007		Modificación al alza de la calificación del Tramo A de A3(sf) a A1(sf), Tramo B de Baa3(sf) a Baa3(sf) y del Tramo C de Caa2(sf) a Caa1(sf) por parte de Moody's Investors Service	3136544 21 de julio de 2014
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia I	07/03/2008		Modificación al alza de la calificación del Tramo A de AA-(sf) a AA(sf) por parte de Fitch Rating	Nº 2926817 20 de marzo de 2014
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja España I	19/12/2007		Modificación al alza de la calificación de los bonos del Tramo A, por parte de Moody's, como consecuencia de la modificación de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 2600661 26 de agosto de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja España I	19/12/2007		* Modificación al alza del Tramo A, de BBB-(sf) a BBB(sf) y rebaja de la calificación del Tramo D, de BB(sf) a BB-(sf) por parte de Standard & Poor's.	Nº 2514702 4 de julio de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Laietana I	23/07/2008		* Modificación al alza del Tramo B, de BB(sf) a BB+(sf) por parte de Standard & Poor's.	Nº 2444528 21 de mayo de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Granada I	11/12/2007		* Rebaja de la calificación de los Tramos A, de A3(sf) a Baa1(sf), y B, de Ba1(sf) a B3(sf) por parte de Moody's.	Nº 2444515 21 de mayo de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia I	07/03/2008		* Rebaja de la calificación de los Tramos B, de Baa2(sf) a Ba1(sf), y C, de Baa3(sf) a B3(sf) por parte de Moody's.	Nº 2444503 21 de mayo de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Sa Nostra I	27/07/2007		* Rebaja de la calificación de los Tramos A, de AA-(sf) a A(sf), B, de A(sf) a BBB(sf), y C, de BBB-(sf) a BB(sf) por parte de Fitch Ratings.	Nº 2444496 21 de mayo de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Vital I	26/07/2007		* Rebaja de la calificación del Tramo C, de BBB-(sf) a BB(sf) por parte de Fitch Ratings.	Nº 2444484 21 de mayo de 2013

AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Circulo I	25/03/2008		• Rebaja de la calificación del Tramo D , de BB-(sf) a B(sf) por parte de Fitch Ratings.	Nº 2444475 21 de mayo de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Cantabria I	09/07/2008		• Rebaja de la calificación de los Tramos B , de A(sf) a BBB+(sf), C , de BBB-(sf) a BB(sf), y D , de BB-(sf) a B(sf) por parte de Fitch Ratings.	Nº 2444463 21 de mayo de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia II	27/06/2008		• Rebaja de la calificación del Tramo C , de BBB-(sf) a BB-(sf) por parte de Fitch Ratings.	Nº 2444449 21 de mayo de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia I	07/03/2008		• Rebaja de la calificación de los Tramos C , de BBB-(sf) a BB+(sf), y D , de BB-(sf) a B+(sf) por parte de Fitch Ratings.	Nº 2444291 21 de mayo de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I	28/12/2007		• Rebaja de la calificación de los Tramos A , de A+(sf) a A-(sf), y B , de BBB-(sf) a BB(sf) por parte de Fitch Ratings.	Nº 2444276 21 de mayo de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Granada I	11/12/2007		• Rebaja de la calificación de los Tramos B , de A(sf) a BBB-(sf), C , de BB(sf) a BB-(sf) y D , de B(sf) a B-(sf) por parte de Fitch Ratings.	Nº 2432898 14 de mayo de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Vital I	26/07/2007		• Rebaja de la calificación del Tramo C , de B3(sf) a Caa2(sf) por parte de Moody's.	Nº 2432893 14 de mayo de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia II	27/06/2008		• Rebaja de la calificación de los Tramos B , de Baa3(sf) a Ba1(sf), y C , de B1(sf) a B2(sf) por parte de Moody's.	Nº 2404448 30 de abril de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - BBK II	10/04/2008		• Rebaja de la calificación por parte de Moody's del Tramo B de Baa2(sf) a B1(sf), y Tramo C de B1(sf) a B3(sf) y modificación al alza del Tramo D de Ca(sf) a Caa3(sf).	Nº 2404435 30 de abril de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - BBK I	24/04/2007		• Rebaja de la calificación por parte de Moody's del Tramo B de Baa3(sf) a Ba3(sf), Tramo C de B1(sf) a B3(sf) y Tramo D de Caa1(sf) a Caa3(sf).	Nº 2388040 25 de abril de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Cantabria I	09/07/2008		• Modificación del Contrato de Administración y constitución depósito	Nº 2388010 25 de abril de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I	28/12/2007		• Modificación de la Escritura Complementaria y cancelación contrato swap	Nº 2388030 25 de abril de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - BBK II	10/04/2008		• Modificación de la Escritura Complementaria y cancelación Contrato Swap	Nº 2388023 25 de abril de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - BBK I	24/04/2007		• Modificación de la segunda parte de la Escritura de Constitución y cancelación Contrato Swap	Nº 2386807 25 de abril de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - BBK I	24/04/2007		• Modificación de la Escritura de Constitución	Nº 2371698 18 de abril de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja España I	19/12/2007		• Rebaja de la calificación por parte de Moody's del Tramo B de Baa2(sf) a Ba1(sf), Tramo C de Ba3(sf) a B2(sf) y Tramo D , de B3(sf) a Caa1(sf).	Nº 2371352 18 de abril de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I	28/12/2007		• Rebaja de la calificación del Tramo A por parte de Standard & Poor's de BBB-(sf) a A(sf).	Nº 2226669 22 de enero de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Laietana I	23/07/2008		• Rebaja de la calificación del Tramo A por parte de Fitch Ratings, de AA-(sf) a A+(sf).	Nº 2226681 22 de enero de 2013
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Circulo I	25/03/2008		• Rebaja de la calificación por parte de Fitch Ratings del Tramo A de AA-(sf) a A+(sf).	Nº 2180783 21 de diciembre de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Laietana I	23/07/2008		• Acciones remediales	Nº 2166149 12 de diciembre de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja España I	19/12/2007		• Modificación de escritura de constitución y contratos. Sustitución de Agente Financiero	Nº 2145039 28 de noviembre de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - BBK I	24/04/2007		• Rebaja de la calificación por parte de Moody's del Tramo A de A3(sf) a Baa1(sf), Tramo B de Baa2(sf) a Baa3(sf), Tramo C de Ba2(sf) a B1(sf) y Tramo D de B3(sf) a Caa1(sf).	Nº 2145029 28 de noviembre de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - BBK II	10/04/2008		• Rebaja de la calificación por parte de Moody's del Tramo A de A3(sf) a Baa1(sf).	Nº 2124128 14 de noviembre de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Laietana I	23/07/2008		• Rebaja de la calificación por parte de Standard & Poor's del Tramo A de AA-sf a A-sf.	Nº 2114562 8 de noviembre de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja España I	19/12/2007		• Rebaja de la calificación por parte de Standard & Poor's del Tramo A de AA-sf a BBB-sf, y Tramo B de BBB-sf a BBB-sf.	Nº 2070539 16 de octubre de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I	28/12/2007		• Rebaja de la calificación del Tramo A por parte de Standard & Poor's de A-sf a BBB-sf, y del mismo Tramo por parte de Fitch Ratings de AA-sf a A+s.	Nº 2070522 16 de octubre de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Cantabria I	09/07/2008		• Rebaja de la calificación por parte de Fitch Ratings del Tramo A de AA-(sf) a A+(sf).	Nº 2070507 16 de octubre de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Navarra I	04/07/2007		• Rebaja de la calificación por parte de Fitch Ratings del Tramo A de AA-(sf) a BBB(sf), del Tramo B de A+sf a Bsf, del Tramo C de BBsf a CCCsf y del Tramo D de Bsf a CCsf.	Nº 2070237 16 de octubre de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Laietana I	23/07/2008		• Rebaja de la calificación por parte de Standard & Poor's del Tramo A de AA(sf) a AA-(sf) como consecuencia de la rebaja de calificación del Reino de España.	Nº 2070194 16 de octubre de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja España I	19/12/2007		• Rebaja de la calificación por parte de Standard & Poor's del Tramo A de AA(sf) a AA-(sf) como consecuencia de la rebaja de calificación del Reino de España.	Nº 2052792 4 de octubre de 2012

AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Circulo I	25/03/2008		• Acción correctiva como consecuencia de la bajada de rating de CECA.	Nº 2047788 1 de octubre de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I	28/12/2007		• Acción correctiva como consecuencia de la bajada de rating de CECA.	Nº 2047766 1 de octubre de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Manlleu I	27/08/2009		• Acción correctiva como consecuencia de la bajada de rating de CECA.	Nº 2047595 1 de octubre de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Manlleu I	27/08/2009		• Rebaja de la calificación por parte de Standard & Poor's del Tramo A de A-sf a BBBsf y del Tramo B de BBBsf a BBB-sf .	Nº 1970728 10 de agosto de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Cantabria I	09/07/2008		• Acción remedial y adecuación a la nueva criteria de las Agencias de Calificación	Nº 1970388 10 de agosto de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Sa Nostra I	27/07/2007		• Acción remedial y adecuación a la nueva criteria de las Agencias de Calificación	Nº 1970383 10 de agosto de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Granada I	11/12/2007		• Acción remedial y adecuación a la nueva criteria de las Agencias de Calificación	Nº 1967738 8 de agosto de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia I	07/03/2008		• Acción remedial y adecuación a la nueva criteria de las Agencias de Calificación	Nº 1967738 8 de agosto de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia II	27/06/2008		• Acción remedial y adecuación a la nueva criteria de las Agencias de Calificación	Nº 1925740 18 de julio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - BBK I	24/04/2007		• Acciones remediales efectuadas para la sustitución de CECA como Agente Financiero, siendo el nuevo Agente Financiero Barclays Bank PLC	Nº 1925740 18 de julio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - BBK II	10/04/2008		• Acciones remediales efectuadas para la sustitución de CECA como Agente Financiero, siendo el nuevo Agente Financiero Barclays Bank PLC	Nº 1925740 18 de julio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia I	07/03/2008		• Acciones remediales efectuadas para la sustitución de CECA como Agente Financiero, siendo el nuevo Agente Financiero Barclays Bank PLC	Nº 1925740 18 de julio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia II	27/06/2008		• Acciones remediales efectuadas para la sustitución de CECA como Agente Financiero, siendo el nuevo Agente Financiero Barclays Bank PLC	Nº 1925740 18 de julio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Granada I	11/12/2007		• Acciones remediales efectuadas para la sustitución de CECA como Agente Financiero, siendo el nuevo Agente Financiero Barclays Bank PLC	Nº 1925740 18 de julio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Vital I	26/07/2007		• Acciones remediales efectuadas para la sustitución de CECA como Agente Financiero, siendo el nuevo Agente Financiero Barclays Bank PLC	Nº 1925740 18 de julio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Sa Nostra I	27/07/2007		• Acciones remediales efectuadas para la sustitución de CECA como Agente Financiero, siendo el nuevo Agente Financiero Barclays Bank PLC	Nº 1909731 9 de julio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Granada I	11/12/2007		• Acciones remediales efectuadas para la sustitución de la CECA como Entidad de Contrapartida de SWAP, siendo la posible entidad sustituta BNP Paribas.	Nº 1904473 5 de julio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - BBK I	24/04/2007		• Rebaja de la calificación del Tramo A de Aa2(sf) a A3(sf) por parte de Moody's, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1904473 5 de julio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - BBK II	10/04/2008		• Rebaja de la calificación del Tramo A de Aa2(sf) a A3(sf) por parte de Moody's, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1904473 5 de julio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia I	07/03/2008		• Rebaja de la calificación del Tramo A de Aa2(sf) a A3(sf) por parte de Moody's, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1904473 5 de julio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia II	27/06/2008		• Rebaja de la calificación del Tramo A de Aa2(sf) a A3(sf) por parte de Moody's, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1904473 5 de julio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Cantabria I	09/07/2008		• Rebaja de la calificación del Tramo A de Aa2(sf) a A3(sf) por parte de Moody's, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1904473 5 de julio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja España I	19/12/2007		• Rebaja de la calificación del Tramo A de Aa2(sf) a A3(sf) por parte de Moody's, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1904473 5 de julio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Granada I	11/12/2007		• Rebaja de la calificación del Tramo A de Aa2(sf) a A3(sf) por parte de Moody's, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1904473 5 de julio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Vital I	26/07/2007		• Rebaja de la calificación del Tramo A de Aa2(sf) a A3(sf) por parte de Moody's, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1904473 5 de julio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Cantabria I	09/07/2008	Tramo A – Aa2(sf)/AA-sf Tramo B – B2(sf)/Asf Tramo C – Caa1(sf)/BBB-sf Tramo D – C(sf)/BB-sf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [AAAsf] por parte de Fitch Ratings, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1872082 15 de junio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia II	27/06/2008	Tramo A – Aa2(sf)/AAAsf Tramo B – Baa3(sf)/Asf Tramo C – B1(sf)/BBB-sf Tramo D – Caa3(sf)/BB-sf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [AAAsf] por parte de Fitch Ratings, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1872082 15 de junio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia I	07/03/2008	Tramo A – Aa2(sf)/AA-sf Tramo B – Baa2(sf)/Asf Tramo C – Ba3(sf)/BBB-sf Tramo D – Ca(sf)/BB-sf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [AAAsf] por parte de Fitch Ratings, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1872082 15 de junio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Laietana I	23/07/2008	Tramo A – AA-sf/Asf Tramo B – Asf/BBsf Tramo C – BBSf Tramo D – Bsf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [AAAsf] por parte de Fitch Ratings, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1872082 15 de junio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Circulo I	25/03/2008	Tramo A – AA-sf/A-sf Tramo B – Asf/BBsf Tramo C – BBB-sf/CCC+sf Tramo D – BB-sf/CCCsf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [AAAsf] por parte de Fitch Ratings, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1872082 15 de junio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Sa Nostra I	27/07/2007	Tramo A – A-sf/AA-sf Tramo B – Asf Tramo C – BBBsf- Tramo D – Bsf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [AAAsf] por parte de Fitch Ratings, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1872082 15 de junio de 2012

AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Vital I	26/07/2007	Tramo A – Aa2(sf)/AA-sf Tramo B – Ba3(sf)/Asf Tramo C – B3(sf)/BBB-sf Tramo D – C(sf)/Bsf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [AAAsf] por parte de Fitch Ratings, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1872082 15 de junio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I	28/12/2007	Tramo A – A-sf/AA-sf Tramo B – BBB-sf Tramo C – CCCsf Tramo D – Ccsf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [AAAsf] por parte de Fitch Ratings, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1872082 15 de junio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Granada I	11/12/2007	Tramo A – Aa2(sf)/AA-sf Tramo B – Ba1(sf)/Asf Tramo C – Caa3(sf)/BBsf Tramo D – C(sf)/Bsf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [AAAsf] por parte de Fitch Ratings, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1872082 15 de junio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Navarra I	04/07/2007	Tramo A – AA-sf Tramo B – Asf Tramo C – Bsf Tramo D – Bsf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [AAAsf] por parte de Fitch Ratings, como consecuencia de la bajada de calificación de la deuda a largo plazo de España.	Nº 1872082 15 de junio de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Circulo I	25/03/2008		• Acciones remediales efectuadas como consecuencia de la bajada de rating de CECA.	Nº 1813734 9 de mayo de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I	28/12/2007	Tramo A – A-sf/AAAsf Tramo B – BBB-sf Tramo C – CCCsf Tramo D – Ccsf	• Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos B [A-sf], C [Bsf] y D [CCCs] por parte de Fitch.	Nº 1767500 18 de abril de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Manlleu I	27/08/2009		• Acciones remediales efectuadas con motivo de la bajada de calificación de CECA.	Nº 1759039 13 de abril de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Cantabria I	09/07/2008		• Acciones remediales efectuadas con motivo de la bajada de calificación de CECA.	Nº 1759023 13 de abril de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I	28/12/2007		• Acciones remediales efectuadas como consecuencia de la bajada de rating de CECA.	Nº 1759005 13 de abril de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Sa Nostra I	27/07/2007		• Acciones remediales efectuadas como consecuencia de la bajada de rating de CECA.	Nº 1758983 13 de abril de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Circulo I	25/03/2008	Tramo A – AAAsf/A-sf Tramo B – Asf/BBsf Tramo C – BBB-sf/CCC+sf Tramo D – BB-sf/CCCsf	• Rebaja en la calificación de los bonos del Tramo A [AAAsf] por parte de Standard & Poor's.	Nº 1740050 30 de marzo de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Laietana I	23/07/2008		• Acciones remediales - Traspaso Cuenta Tesorería	Nº 1711518 12 de marzo de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja España I	19/12/2007	Tramo A – Aa2(sf)/AAAsf Tramo B- Baa2(sf)/BBBsf Tramo C – Ba3(sf)/BBB-sf Tramo D – B3(sf)/BBsf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [Aa1(sf)], como consecuencia de la rebaja de calificación máxima otorgable a Aa2(sf) por parte de Moody's a la titulación española.	Nº 1689831 28 de febrero de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - BBK I	24/04/2007	Tramo A – Aa2(sf)/A-sf Tramo B – Baa2(sf) Tramo C – Ba2(sf) Tramo D – B3(sf)	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [Aa1(sf)], como consecuencia de la rebaja de calificación máxima otorgable a Aa2(sf) por parte de Moody's a la titulación española.	Nº 1689819 28 de febrero de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia II	27/06/2008	Tramo A – Aa2(sf)/AAAsf Tramo B – Baa3(sf)/Asf Tramo C – B1(sf)/BBB-sf Tramo D – Caa3(sf)/BB-sf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [Aa1(sf)], como consecuencia de la rebaja de calificación máxima otorgable a Aa2(sf) por parte de Moody's a la titulación española.	Nº 1689057 28 de febrero de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Galicia I	07/03/2008	Tramo A – Aa2(sf)/AAAsf Tramo B – Baa2(sf)/Asf Tramo C – Ba3(sf)/BBB-sf Tramo D – Ca(sf)/BB-sf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [Aa1(sf)], como consecuencia de la rebaja de calificación máxima otorgable a Aa2(sf) por parte de Moody's a la titulación española.	Nº 1689048 28 de febrero de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Vital I	26/07/2007	Tramo A – Aa2(sf)/AAAsf Tramo B – Ba3(sf)/Asf Tramo C – B3(sf)/BBB-sf Tramo D – C(sf)/Bsf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [Aa1(sf)], como consecuencia de la rebaja de calificación máxima otorgable a Aa2(sf) por parte de Moody's a la titulación española.	Nº 1689031 28 de febrero de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Cantabria I	09/07/2008	Tramo A – Aa2(sf)/AAAsf Tramo B – B2(sf)/Asf Tramo C – Caa1(sf)/BBB-sf Tramo D – C(sf)/BB-sf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [Aa1(sf)], como consecuencia de la rebaja de calificación máxima otorgable a Aa2(sf) por parte de Moody's a la titulación española.	Nº 1689023 28 de febrero de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja España I	19/12/2007	Tramo A – Aa1(sf)/AAAsf Tramo B- Baa2(sf)/BBBsf Tramo C – Ba3(sf)/BBB-sf Tramo D – B3(sf)/BBsf	• Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos B y C por parte de Moody's.	Nº 1653382 7 de febrero de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Manlleu I	27/08/2009	Tramo A – A-sf/AAAsf Tramo B – A-sf/Asf Tramo C – BBBsf Tramo D – Bsf	• Modificación de la Escritura Complementaria de Constitución y otros Contratos con motivo de la inclusión de una segunda Agencia de Calificación y de los nuevos criterios de Standard & Poor's.	Nº 1670433 17 de febrero de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Laietana I	23/07/2008	Tramo A – AAAsf/AAAsf Tramo B – Asf/BBsf Tramo C – Bsf Tramo D – Bsf	• Acciones remediales efectuadas como consecuencia de la bajada de rating de CECA.	Nº 1623455 25 de enero de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Circulo I	25/03/2008	Tramo A – AAAsf/AAAsf Tramo B – Asf/BBsf Tramo C – BBB-sf/CCC+sf Tramo D – BB-sf/CCCsf	• Acciones remediales efectuadas como consecuencia de la bajada de rating de CECA.	Nº 1623435 25 de enero de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Sa Nostra I	27/07/2007	Tramo A – A-sf/AAAsf Tramo B – Asf Tramo C – BBBsf- Tramo D – Bsf	• Acciones remediales efectuadas como consecuencia de la bajada de rating de CECA.	Nº 1623568 25 de enero de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I	28/12/2007	Tramo A – A-sf/AAAsf Tramo B – A-sf Tramo C – Bsf Tramo D – CCCsf	• Acciones remediales efectuadas como consecuencia de la bajada de rating de CECA.	Nº 1623525 25 de enero de 2012
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja España I	19/12/2007	Tramo A – Aa1/AA Tramo B- A3/BBB Tramo C – Ba2/BBB- Tramo D – B3/BB	• Incorporación de Standard & Poor's como segunda agencia de calificación y suscripción de una Escritura Complementaria a la Escritura de Constitución, así como modificación del Contrato de Servicios Financieros y Contrato de Swap.	Nº 1584133 30 de diciembre de 2011

AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Manlleu I	27/08/2009	Tramo A - A-sf Tramo B - A-sf Tramo C - BBsf Tramo D - Bsf	• Rebaja en la calificación de los bonos de los Tramos A [AAsf] y B [Asf]	Nº 1568337 20 de diciembre de 2011
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Sa Nostra I	27/07/2007	Tramo A - A-sf/AAAsf Tramo B - Asf Tramo C - BBsf- Tramo D - Bsf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [Asf] por parte de Standard & Poor's.	Nº 1568364 20 de diciembre de 2011
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I	28/12/2007	Tramo A - A-sf/AAAsf Tramo B - A-sf Tramo C - Bsf Tramo D - CCCsf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo A [AAsf] por parte de Standard & Poor's.	Nº 1568349 20 de diciembre de 2011
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Vital I	26/07/2007	Tramo A - Aaa(sf)/AAAsf Tramo B - Ba3(sf)/Asf Tramo C - B3(sf)/BBB-sf Tramo D - C(sf)/Bsf	• Bajada de calificación de Bankinter por debajo de A/F1, y en consecuencia, traslado del depósito de swap abierto en esta Entidad a BBVA.	Nº 1321743 28 de septiembre de 2011
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Manlleu I	27/08/2009	Tramo A - AAAsf Tramo B - Asf Tramo C - BBsf Tramo D - Bsf	• Modificación del Contrato de Servicios Financieros y Anexos I y III del CMOF, con objeto de adecuarlos a la nueva criteria establecida por Standard & Poor's. Depósito de garantía en ICO por parte del Agente Financiero.	Nº 1322989 28 de septiembre de 2011
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Circulo I	25/03/2008	Tramo A - AAAsf/AAAsf Tramo B - Asf/BBsf Tramo C - BBB-sf/CCC+sf Tramo D - BB-sf/CCCsf	• Bajada de calificación de Bankinter por debajo de A/F1, y en consecuencia, traslado del depósito de commingling abierto en esta Entidad a BBVA.	Nº 91322702 28 de septiembre de 2011
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Circulo I	25/03/2008	Tramo A - AAAsf/AAAsf Tramo B - Asf/BBsf Tramo C - BBsf/CCC+sf Tramo D - BB-sf/CCCsf	• Apertura de Cuenta de Depósito en Bankinter como consecuencia de bajada de rating del Administrador y firma del Suplemento del Contrato de Administración y Contrato de Regulación de movimientos de la cuenta.	Nº 911239 10 de junio de 2011
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Cajasar I	30/01/2009	Tramo A - AAA Tramo B - A Tramo C - BBB- Tramo D - BB-	• Liquidación anticipada de la Serie.	Nº 911239 12 de mayo de 2011
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Sa Nostra I	27/07/2007	Tramo A - A(sf)/AAAsf Tramo B - Asf Tramo C - BBsf- Tramo D - Bsf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo D [BB-] por parte de Fitch Ratings.	Nº 815566 25 de abril de 2011
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Vital I	26/07/2007	Tramo A - Aaa(sf)/AAAsf Tramo B - Ba3(sf)/Asf Tramo C - B3(sf)/BBB-sf Tramo D - C(sf)/Bsf	• Rebaja de la calificación de los bonos del Tramo D [BB-] por parte de Fitch Ratings.	Nº 815553 25 de abril de 2011
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I	28/12/2007	Tramo A - AA(sf)/AAAsf Tramo B - A-sf Tramo C - Bsf Tramo D - CCCsf	• Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos C [BB] y D [B] por parte de Fitch Ratings.	Nº 815541 25 de abril de 2011
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Granada I	11/12/2007	Tramo A - Aa2(sf)/AAAsf Tramo B - Ba1(sf)/Asf Tramo C - Caa3(sf)/BBsf Tramo D - C(sf)/Bsf	• Rebaja de la calificación de los bonos de los Tramos C [BBB-] y D [BB-] por parte de Fitch Ratings.	Nº 815525 25 de abril de 2011
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - BBK II	10/04/2008	Tramo A - Aa2 (sf)/AA-sf Tramo B - Baa2 (sf)/BBsf Tramo C - B1 (sf) Tramo D - Ca (sf)	• Rebaja de la calificación de los Tramos A [Aaa (sf)], B [A2 (sf)], C [Baa3 (sf)] y D [Ba2 (sf)] por parte de Moody's.	Nº 751519 24 de marzo de 2011
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - BBK I	24/04/2007	Tramo A - Aa1 (sf)/A-sf Tramo B - Baa2 (sf) Tramo C - Ba2 (sf) Tramo D - B3 (sf)	• Rebaja de la calificación de los Tramos A [Aaa (sf)], B [A2 (sf)], C [Baa3 (sf)] y D [Ba2 (sf)] por parte de Moody's.	Nº 751499 24 de marzo de 2011
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - BBK II	10/04/2008	Tramo A - Aa2(sf)/AA-sf Tramo B - Baa2(sf)/BBsf Tramo C - B1 (sf) Tramo D - Ca(sf)	• Incorporación a la Escritura Complementaria de los nuevos criterios de Moody's y modificación del Contrato de Swap y Contrato de Administración, todo ello motivado por la bajada de calificación de la Entidad Cedente por parte de Moody's.	Nº 727155 3 de marzo de 2011
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - BBK I	24/04/2007	Tramo A - Aa1(sf)/A-sf Tramo B - Baa2(sf) Tramo C - Baa2(sf) Tramo D - B3(sf)	• Incorporación a la Segunda parte de la Escritura de Constitución de los nuevos criterios de Moody's y modificación del Contrato de Swap y Contrato de Administración, todo ello motivado por la bajada de calificación de la Entidad Cedente por parte de Moody's.	Nº 727146 3 de marzo de 2011
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja Vital I	26/07/2007	Tramo Único - Aaa/AA-	• Modificación de la Escritura de Constitución y ciertos contratos con motivo de la incorporación de una segunda calificación del Fondo.	Nº 631556 14 de octubre de 2010
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I	28/12/2007	Tramo A - AAA Tramo B - A- Tramo C - BB Tramo D - B	• Cambio de Contrapartes en la Serie.	Nº 630913 13 de octubre de 2010
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Laietana I	23/07/2008	Tramo A - AAA Tramo B - A Tramo C - BB Tramo D - B	• Rebaja de la calificación de los Tramos C [BBB-] y D [BB-] por parte de Fitch Ratings.	Nº 494409 4 de marzo de 2010
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caixa Laietana I	23/07/2008	Tramo A - AAA Tramo B - A Tramo C - BB Tramo D - B	• Rebaja de la calificación de los Tramos C y D por parte de Fitch Ratings.	Nº 494409 4 de marzo de 2010
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I	28/12/2007	Tramo A - AAA Tramo B - A- Tramo C - BB Tramo D - B	• Rebaja de la Calificación de los Bonos de los Tramos B , C y D .	Nº 480563 17 de febrero de 2010
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja España I	19/12/2007	Tramo A - Aa1 Tramo B - A3 Tramo C - Ba2 Tramo D - B3	• Rebaja de las calificaciones otorgadas inicialmente por MOODY'S INVESTORS SERVICE ESPAÑA, S.A.	Nº 167647 11 de febrero de 2009
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - Caja España I	19/12/2007	Tramo A - Aa1 Tramo B - A3 Tramo C - Ba2 Tramo D - B3	• Rebaja de la calificación de la Entidad de Contrapartida (Caja España). • Sustitución de la Entidad de contrapartida por CECA.	Nº 148137 12 de diciembre de 2008
AyT Colaterales Global Hipotecario FTA - CCM I	28/12/2007	Tramo A - AAA Tramo B - A Tramo C - BB- Tramo D - BB	• Rebaja de la calificación de la Entidad de contrapartida (CCM). • Sustitución de la Entidad de contrapartida por CECA.	Nº 115211 CD 12 de agosto de 2008

MODIFICACIONES ESCRITURA

	Fecha Modificación	Estipulaciones modificadas
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO FTA	6 de junio de 2008	ESTIPULACIONES 7, 15.1, 16.3, 18, 21.2, 9.2.b)
	3 de agosto de 2009	ESTIPULACIONES 15.2, 15.4, 16.1, 18
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO BBK I	23 de diciembre de 2010	INCORPORACION AGENCIA RATING FITCH, MODIFICACIÓN DE LAS ESTIPULACIONES 32.4, 32.5 Y 32.6, MODIFICACIÓN CONTRATO PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS, CONTRATO DE ADMINISTRACIÓN Y SWAP.
	8 de febrero de 2011	ESCRITURA DE ACLARACIÓN DE LA ESCRITURA DE MODIFICACIÓN DE LA ESCRITURA COMPLEMENTARIA
	25 de febrero de 2011	REDUCCIÓN DEL RATING MINIMO REQUERIDO A BBK COMO CONTRAPARTIDA DEL SWAP, MODIFICACIÓN DE LAS ESTIPULACIONES 32.5 Y 32.6, MODIFICACIÓN CONTRATO DE ADMINISTRACIÓN Y SWAP
	21 de marzo de 2013	CANCELACIÓN CONTRATO SWAP, MODIFICACIÓN TIPO INTERÉS BONOS, INCREMENTO IMPORTE PRÉSTAMO
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO BBK II	23 de diciembre de 2010	INCORPORACION AGENCIA RATING FITCH, MODIFICACIÓN DE LAS ESTIPULACIONES 5, 7.4, 7.5 Y 7.6, MODIFICACIÓN CONTRATO PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS, CONTRATO DE ADMINISTRACIÓN Y SWAP.
	8 de febrero de 2011	ESCRITURA DE ACLARACIÓN DE LA ESCRITURA DE MODIFICACIÓN DE LA ESCRITURA COMPLEMENTARIA
	25 de febrero de 2011	REDUCCIÓN DEL RATING MINIMO REQUERIDO A BBK COMO CONTRAPARTIDA DEL SWAP, MODIFICACIÓN DE LAS ESTIPULACIONES 7.2.5 Y 7.2.6, MODIFICACIÓN CONTRATO DE ADMINISTRACIÓN Y SWAP
	21 de marzo de 2013	CANCELACIÓN CONTRATO SWAP, MODIFICACIÓN TIPO INTERÉS BONOS, INCREMENTO IMPORTE PRÉSTAMO
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CAJA VITAL I	8 de octubre de 2010	INCORPORACION AGENCIA RATING, MODIFICACIÓN CONTRATO PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS Y SWAP.
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CAJA CIRCULO I	22 de diciembre de 2010	INCORPORACION AGENCIA RATING, ESTIPULACION 7.4, 7.5, modificación Contrato Prestación Servicios Financieros y Swap
	1 de octubre de 2012	SUSTITUCIÓN AGENTE FINANCIERO Y ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE, ESTIPULACIÓN 7.4, 7.5 Y 7.6, MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS, SWAP Y ADMINISTRADOR.
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CAJA GRANADA I	13 de diciembre de 2010	INCORPORACION AGENCIA RATING, ESTIPULACION 7.6, modificación Contrato Prestación Servicios Financieros, Swap y de Administración
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CAIXA GALICIA I	20 de diciembre de 2010	INCORPORACION AGENCIA RATING, ESTIPULACION 7.6, modificación Contrato Prestación Servicios Financieros, Swap y de Administración
	27 de julio de 2012	ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE, ESTIPULACIÓN 7.4, 7.5 Y 7.6, MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS, SWAP Y ADMINISTRADOR
	19 de diciembre de 2013	ESTIPULACIÓN 7.6. MODIFICACIÓN CONTRATO DE ADMINISTRACIÓN
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CAIXA GALICIA II	20 de diciembre de 2010	INCORPORACION AGENCIA RATING, ESTIPULACION 7.6, modificación Contrato Prestación Servicios Financieros, Swap y de Administración
	27 de julio de 2012	ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE, ESTIPULACIÓN 7.4, 7.5 Y 7.6, MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS, SWAP Y ADMINISTRADOR
	19 de diciembre de 2013	ESTIPULACIÓN 7.6. MODIFICACIÓN CONTRATO DE ADMINISTRACIÓN
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO SA NOSTRA I	18 de febrero de 2011	INCORPORACION AGENCIA RATING S&P, ESTIPULACIÓN 7.4 Y 7.5, MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS Y SWAP
	8 de agosto de 2012	ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE, ESTIPULACIÓN 7.4 Y 7.5, MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS Y SWAP

AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CCM I	24 de febrero de 2011	INCORPORACION AGENCIA RATING S&P, ESTIPULACIÓN 7.4 Y 7.5, MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS Y SWAP
	18 de septiembre de 2012	SUSTITUCIÓN AGENTE FINANCIERO Y CONTRAPARTIDA SWAP Y ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE. ESTIPULACIÓN 7,4 , 7,5 Y 7.6, MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS, SWAP Y ADMINISTRADOR.
	8 de abril de 2013	CANCELACIÓN CONTRATO SWAP, MODIFICACIÓN TIPO INTERÉS BONOS, ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE ADMINISTRADOR. ESTIPULACIONES 3.5, 7.2, 7.3, 7.5 Y 7.6. MODIFICACIÓN CONTRATO DE SWAP, ADMINISTRACIÓN, AGENTE FINANCIERO, PRÉSTAMO SUBORDINADO PARA GASTOS INICIALES Y PRÉSTAMO SUBORDINADO PARA FONDO DE RESERVA
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CAIXA LAIETANA I	25 de febrero de 2011	INCORPORACION AGENCIA RATING S&P, ESTIPULACIÓN 7.4 Y 7.5, MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS Y SWAP
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CAJA CANTABRIA	1 de marzo de 2011	INCORPORACION AGENCIA RATING MOODY'S, ESTIPULACIÓN 7.4, 7.5 Y 7.6, MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS, DE ADMINISTRACION Y SWAP
	9 de agosto de 2012	SUSTITUCIÓN AGENTE FINANCIERO Y ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE, ESTIPULACIÓN 7,4 , 7,5 Y 7.6, MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS, SWAP Y ADMINISTRADOR.
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CAJA SUR I	11 de mayo de 2011	ESCRITURA DE LIQUIDACIÓN DE LA SERIE
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CAJA ESPAÑA I	20 de diciembre de 2011	INCORPORACION AGENCIA RATING S&P, ESTIPULACIÓN 7.4 Y 7.5, MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS Y SWAP
	28 de noviembre de 2012	SUSTITUCIÓN AGENTE FINANCIERO Y ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE, ESTIPULACIÓN 7,4 Y 7,5,
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CAIXA MANLLEU I	10 de febrero de 2012	INCORPORACION AGENCIA RATING DBRS, ESTIPULACIÓN 7.4, 7.5 Y 7.6, MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS, DE ADMINISTRACIÓN Y SWAP
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CAIXA GALICIA I	27 de julio de 2012	ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE, ESTIPULACIÓN 7,4 , 7,5 Y 7.6, MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS, SWAP Y ADMINISTRADOR
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CAIXA GALICIA II	27 de julio de 2012	ADECUACIÓN DOWNGRADE LANGUAGE, ESTIPULACIÓN 7,4 , 7,5 Y 7.6, MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS, SWAP Y ADMINISTRADOR
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CAJA NAVARRA I	13 de noviembre de 2012	ESCRITURA DE LIQUIDACIÓN DE LA SERIE
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CAIXA MANLLEU I	10 de febrero de 2012	INCORPORACION AGENCIA RATING DBRS, ESTIPULACIÓN 7.4, 7.5 Y 7.6, MODIFICACIÓN CONTRATO DE PRESTACIÓN SERVICIOS FINANCIEROS, DE ADMINISTRACIÓN Y SWAP
	15 de noviembre de 2012	ESCRITURA DE LIQUIDACIÓN DE LA SERIE
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CCM I	8 de abril de 2013	CANCELACIÓN CONTRATO SWAP, MODIFICACIÓN TIPO INTERÉS BONOS, ADECUACIÓN DOWNGRADE
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CAIXA GALICIA I	19 de diciembre de 2013	ESTIPULACIÓN 7,6. MODIFICACIÓN CONTRATO DE ADMINISTRACIÓN
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO CIRCULO I	20 de mayo de 2014	ESCRITURA DE LIQUIDACIÓN DE LA SERIE

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK I

Denominación del compartimento: 8715

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	731.217	1001	787.052
I. Activos financieros a largo plazo	0002	731.217	1002	787.052
1. Activos titulizados	0003	731.217	1003	787.052
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	727.701	1005	782.666
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	0
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	15.092	1025	17.386
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-11.576	1027	-13.000
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	0
2. Derivados	0029		1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	0
3. Otros activos financieros	0032		1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	0
3.4 Otros	0036		1036	0
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	0
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK I

Denominación del compartimento: 8715

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	141.525	1041	147.309
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	71.970	1043	75.878
1. Activos titulizados	0044	71.970	1044	75.878
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	68.607	1046	72.086
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	0
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	275	1065	390
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	10	1066	18
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	13.148	1067	13.339
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	64	1068	76
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-10.134	1069	-10.031
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	0
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	0
3.5 Otros	0079		1079	0
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	0	1082	0
1. Comisiones	0083		1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	69.554	1085	71.431
1. Tesorería	0086	69.554	1086	71.431
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	872.742	1088	934.361

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK I

Denominación del compartimento: 8715

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	777.600	1089	836.694
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	777.600	1094	836.694
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	734.624	1095	790.893
1.1 Series no subordinadas	0096	625.824	1096	682.093
1.2 Series subordinadas	0097	108.800	1097	108.800
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	42.976	1101	45.801
2.1 Préstamo subordinado	0102	54.600	1102	54.600
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-11.624	1105	-8.799
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	0
3. Derivados	0108		1108	0
3.1 Derivados de cobertura	0109		1109	0
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	0
4.1 Garantías financieras	0113		1113	
4.1 Otros	0114		1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK I

Denominación del compartimento: 8715

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) PASIVO CORRIENTE	0117	95.142	1117	97.667
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	0
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	95.104	1123	97.631
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	91.131	1124	94.765
1.1 Series no subordinadas	0125	88.347	1125	91.788
1.2 Series subordinadas	0126		1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	2.784	1128	2.977
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	3.973	1131	2.866
2.1 Préstamo subordinado	0132		1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	294	1136	326
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	3.679	1137	2.540
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	0
3. Derivados	0139	0	1139	0
3.1 Derivados de cobertura	0140	0	1140	0
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	39	1148	36
1. Comisiones	0149	29	1149	34
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	29	1150	32
1.2 Comisión administrador	0151	308	1151	221
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	2
1.4 Comisión variable	0153	1.322	1153	1.322
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-1.631	1155	-1.543
1.7 Otras comisiones	0156		1156	0
2. Otros	0157	9	1157	2
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158		1158	0
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160		1160	0
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	0
TOTAL PASIVO	0162	872.742	1162	934.361

S.02

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK I

Denominación del compartimento: 8715

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	1.769	1201		2201	7.502	3201	10.942
1.1 Activos titulizados	0202	1.769	1202		2202	7.502	3202	10.941
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203		2203		3203	1
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-2.804	1204		2204	-11.515	3204	-12.324
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-2.536	1205		2205	-10.409	3205	-11.121
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-268	1206		2206	-1.106	3206	-1.203
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207		2207		3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	0	1208		2208		3208	0
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-1.035	1209		2209	-4.013	3209	-1.382
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210		2210		3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211		2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212		2212		3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213		2213		3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214		2214		3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215		2215		3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216		2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-56	1217		2217	-221	3217	-232
7.1 Servicios exteriores	0218	0	1218		2218	0	3218	0
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219		2219	0	3219	0
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220		2220		3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221		2221		3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222		2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223		2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-55	1224		2224	-220	3224	-232
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-27	1225		2225	-113	3225	-121
7.3.2 Comisión administrador	0226	-22	1226		2226	-88	3226	-93
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227		2227	-2	3227	-9
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228		2228		3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229		2229		3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-7	1230		2230	-18	3230	-9
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	917	1231		2231	1.321	3231	-1.396
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	917	1232		2232	1.321	3232	-1.396
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233		2233		3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235		2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236		2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237		2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238		2238		3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	174	1239		2239	2.913	3239	3.010
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240		2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241		2241		3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242		2242	0	3242	0

S.01
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	436.925	1001	479.681
I. Activos financieros a largo plazo	0002	436.925	1002	479.681
1. Activos titulizados	0003	436.925	1003	479.681
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	435.422	1005	476.709
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	0
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	6.365	1025	7.960
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-4.862	1027	-4.988
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	0
2. Derivados	0029		1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	0
3. Otros activos financieros	0032		1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	0
3.4 Otros	0036		1036	0
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	0
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	87.652	1041	97.300
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	51.291	1043	56.288
1. Activos titulizados	0044	51.291	1044	56.288
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	50.086	1046	54.547
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	0
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	150	1065	220
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	7	1066	10
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	4.416	1067	4.020
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	23	1068	26
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-3.391	1069	-2.535
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	0
2. Derivados	0071		1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	0
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	0
3.5 Otros	0079		1079	0
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	0
1. Comisiones	0083		1083	0
2. Otros	0084		1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	36.362	1085	41.012
1. Tesorería	0086	36.362	1086	41.012
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	524.577	1088	576.981

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	464.634	1089	512.413
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	464.634	1094	512.413
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	438.064	1095	481.284
1.1 Series no subordinadas	0096	393.564	1096	436.784
1.2 Series subordinadas	0097	44.500	1097	44.500
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	26.569	1101	31.129
2.1 Préstamo subordinado	0102	39.700	1102	39.700
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-13.131	1105	-8.571
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	0
3. Derivados	0108		1108	0
3.1 Derivados de cobertura	0109		1109	0
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	0
4.1 Garantías financieras	0113		1113	
4.1 Otros	0114		1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) PASIVO CORRIENTE	0117	59.943	1117	64.568
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	0
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	59.929	1123	64.562
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	57.227	1124	62.658
1.1 Series no subordinadas	0125	56.677	1125	62.056
1.2 Series subordinadas	0126		1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	550	1128	602
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	2.702	1131	1.904
2.1 Préstamo subordinado	0132		1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	63	1136	71
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	2.639	1137	1.833
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	0
3. Derivados	0139		1139	0
3.1 Derivados de cobertura	0140		1140	0
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145		1145	0
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	14	1148	6
1. Comisiones	0149	5	1149	6
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	5	1150	5
1.2 Comisión administrador	0151	177	1151	128
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	1.754	1153	1.754
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-1.930	1155	-1.881
1.7 Otras comisiones	0156		1156	0
2. Otros	0157	9	1157	0
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158		1158	0
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160		1160	0
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	0
TOTAL PASIVO	0162	524.577	1162	576.981

S.02

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	952	1201		2201	4.171	3201	6.199
1.1 Activos titulizados	0202	952	1202		2202	4.171	3202	6.198
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203		2203		3203	1
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-1.930	1204		2204	-7.915	3204	-8.649
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.734	1205		2205	-7.117	3205	-7.776
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-196	1206		2206	-798	3206	-873
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207		2207	0	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	0	1208		2208		3208	0
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-978	1209		2209	-3.744	3209	-2.450
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210		2210		3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211		2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212		2212		3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213		2213		3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214		2214		3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215		2215		3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216		2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-36	1217		2217	-134	3217	-144
7.1 Servicios exteriores	0218	0	1218		2218	0	3218	0
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219		2219	0	3219	0
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220		2220		3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221		2221		3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222		2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223		2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-36	1224		2224	-134	3224	-144
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-16	1225		2225	-65	3225	-71
7.3.2 Comisión administrador	0226	-9	1226		2226	-49	3226	-58
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227		2227	-1	3227	-6
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228		2228		3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229		2229		3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-10	1230		2230	-18	3230	-9
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	492	1231		2231	-730	3231	-1.495
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	492	1232		2232	-730	3232	-1.495
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233		2233		3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235		2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236		2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237		2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238		2238		3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	523	1239		2239	4.609	3239	4.089
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240		2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241		2241		3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242		2242	0	3242	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	124.074	1001	134.197
I. Activos financieros a largo plazo	0002	124.074	1002	134.197
1. Activos titulizados	0003	124.074	1003	134.197
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	122.979	1005	133.058
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	0
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	3.790	1025	4.366
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-2.695	1027	-3.227
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	0
2. Derivados	0029		1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	0
3. Otros activos financieros	0032		1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	0
3.4 Otros	0036		1036	0
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	0
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	21.089	1041	21.280
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	12.785	1043	12.594
1. Activos titulizados	0044	12.785	1044	12.594
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	11.976	1046	12.076
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	0
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	41	1065	59
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	4	1066	3
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	2.615	1067	1.722
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	25	1068	27
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-1.878	1069	-1.293
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	0
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	0
3.5 Otros	0079		1079	0
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	8	1082	7
1. Comisiones	0083	8	1083	7
2. Otros	0084		1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	8.296	1085	8.679
1. Tesorería	0086	8.296	1086	8.679
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	145.163	1088	155.477

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	130.792	1089	141.983
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	130.792	1094	141.983
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	124.876	1095	134.692
1.1 Series no subordinadas	0096	98.376	1096	108.192
1.2 Series subordinadas	0097	26.500	1097	26.500
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	2.287	1101	2.704
2.1 Préstamo subordinado	0102	8.050	1102	8.050
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-5.763	1105	-5.346
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	0
3. Derivados	0108	3.098	1108	3.715
3.1 Derivados de cobertura	0109	3.098	1109	3.715
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	531	1112	872
4.1 Garantías financieras	0113	531	1113	
4.1 Otros	0114		1114	872
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) PASIVO CORRIENTE	0117	17.469	1117	17.209
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	0
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	17.439	1123	17.190
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	15.295	1124	15.419
1.1 Series no subordinadas	0125	15.206	1125	15.228
1.2 Series subordinadas	0126		1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	88	1128	191
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	1.957	1131	1.770
2.1 Préstamo subordinado	0132	288	1132	288
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	50	1136	55
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	1.619	1137	1.427
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	0
3. Derivados	0139	187	1139	1
3.1 Derivados de cobertura	0140	187	1140	1
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145		1145	0
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	30	1148	19
1. Comisiones	0149	16	1149	15
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	9	1150	9
1.2 Comisión administrador	0151	159	1151	143
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	7	1152	7
1.4 Comisión variable	0153		1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-159	1155	-144
1.7 Otras comisiones	0156		1156	0
2. Otros	0157	15	1157	4
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-3.098	1158	-3.715
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-3.098	1160	-3.715
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	0
TOTAL PASIVO	0162	145.163	1162	155.477

S.02

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caja Cantabria I

Denominación del compartimento: 9122

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	256	1201		2201	1.231	3201	1.699
1.1 Activos titulizados	0202	256	1202		2202	1.231	3202	1.699
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203		2203		3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-123	1204		2204	-635	3204	-1.006
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-78	1205		2205	-448	3205	-802
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-45	1206		2206	-187	3206	-204
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207		2207		3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-147	1208		2208	-877	3208	-538
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-14	1209		2209	-281	3209	155
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210		2210		3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211		2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212		2212		3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213		2213		3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214		2214		3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215		2215		3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216		2216		3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-36	1217		2217	-99	3217	-100
7.1 Servicios exteriores	0218	0	1218		2218	0	3218	0
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219		2219	0	3219	0
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220		2220		3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221		2221		3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222		2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223		2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-35	1224		2224	-98	3224	-100
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-8	1225		2225	-35	3225	-37
7.3.2 Comisión administrador	0226	-4	1226		2226	-15	3226	-16
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-6	1227		2227	-25	3227	-25
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228		2228		3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229		2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-17	1230		2230	-23	3230	-22
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-298	1231		2231	-52	3231	-893
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-298	1232		2232	-52	3232	-893
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233		2233		3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235		2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236		2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237		2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238		2238		3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	348	1239		2239	432	3239	838
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240		2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241		2241		3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242		2242	0	3242	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie CCM I

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	351.882	1001	382.238
I. Activos financieros a largo plazo	0002	351.882	1002	382.238
1. Activos titulizados	0003	351.882	1003	382.238
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	348.437	1005	377.188
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	0
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	13.752	1025	15.674
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-10.306	1027	-10.624
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	0
2. Derivados	0029		1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	0
3. Otros activos financieros	0032		1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	0
3.4 Otros	0036		1036	0
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	0
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie CCM I

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	80.068	1041	80.468
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	53.315	1043	55.212
1. Activos titulizados	0044	53.315	1044	55.212
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	47.323	1046	47.197
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	0
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	227	1065	339
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	65	1066	59
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	22.538	1067	23.388
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	216	1068	256
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-17.053	1069	-16.027
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	0
2. Derivados	0071		1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	0
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	0
3.5 Otros	0079		1079	0
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	9	1082	7
1. Comisiones	0083	9	1083	7
2. Otros	0084		1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	26.744	1085	25.249
1. Tesorería	0086	26.744	1086	25.249
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	431.951	1088	462.706

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie CCM I

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	370.141	1089	402.674
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	370.141	1094	402.674
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	357.713	1095	389.952
1.1 Series no subordinadas	0096	273.713	1096	305.952
1.2 Series subordinadas	0097	84.000	1097	84.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	10.254	1101	10.347
2.1 Préstamo subordinado	0102	28.000	1102	28.000
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-17.746	1105	-17.653
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	0
3. Derivados	0108		1108	0
3.1 Derivados de cobertura	0109		1109	0
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	2.174	1112	2.375
4.1 Garantías financieras	0113	2.174	1113	
4.1 Otros	0114		1114	2.375
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	0

S.01
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie CCM I
Denominación del compartimento: 8953
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) PASIVO CORRIENTE	0117	61.810	1117	60.032
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	0
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	61.786	1123	60.023
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	52.451	1124	51.380
1.1 Series no subordinadas	0125	51.890	1125	50.816
1.2 Series subordinadas	0126		1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	561	1128	564
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	9.335	1131	8.643
2.1 Préstamo subordinado	0132	559	1132	559
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	61	1136	62
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	8.715	1137	8.022
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	0
3. Derivados	0139		1139	0
3.1 Derivados de cobertura	0140		1140	0
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145		1145	0
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	23	1148	9
1. Comisiones	0149	8	1149	8
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	6	1150	6
1.2 Comisión administrador	0151	521	1151	475
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	1152	2
1.4 Comisión variable	0153		1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-521	1155	-475
1.7 Otras comisiones	0156		1156	0
2. Otros	0157	15	1157	1
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158		1158	0
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160		1160	0
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	0
TOTAL PASIVO	0162	431.951	1162	462.706

S.02

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie CCM I

Denominación del compartimento: 8953

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	1.723	1201		2201	7.748	3201	10.011
1.1 Activos titulizados	0202	1.723	1202		2202	7.748	3202	10.011
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203		2203		3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-1.719	1204		2204	-6.996	3204	-7.426
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.550	1205		2205	-6.305	3205	-6.675
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-169	1206		2206	-691	3206	-751
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207		2207	0	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	0	1208		2208		3208	0
A) MARGEN DE INTERESES	0209	4	1209		2209	752	3209	2.585
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210		2210		3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211		2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212		2212		3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213		2213		3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214		2214		3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215		2215		3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216		2216		3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-60	1217		2217	-182	3217	-174
7.1 Servicios exteriores	0218	0	1218		2218	0	3218	0
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219		2219	0	3219	0
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220		2220		3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221		2221		3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222		2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223		2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-59	1224		2224	-181	3224	-174
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-18	1225		2225	-71	3225	-76
7.3.2 Comisión administrador	0226	-11	1226		2226	-46	3226	-49
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-6	1227		2227	-25	3227	-25
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228		2228		3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229		2229		3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-24	1230		2230	-39	3230	-24
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-189	1231		2231	-709	3231	3.203
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-189	1232		2232	-709	3232	3.203
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233		2233		3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235		2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236		2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237		2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238		2238		3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	244	1239		2239	138	3239	-5.614
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240		2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241		2241		3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242		2242	0	3242	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia I

Denominación del compartimento: 8997

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	415.844	1001	441.695
I. Activos financieros a largo plazo	0002	415.844	1002	441.695
1. Activos titulizados	0003	415.844	1003	441.695
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	410.974	1005	437.356
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	0
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	6.314	1025	4.930
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-1.443	1027	-591
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	0
3. Otros activos financieros	0032		1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	0
3.4 Otros	0036		1036	0
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	0
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia I

Denominación del compartimento: 8997

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	77.886	1041	70.119
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	23.196	1043	24.631
1. Activos titulizados	0044	23.196	1044	24.631
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	22.730	1046	24.070
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	0
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	19	1065	26
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	286	1066	407
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	193	1067	130
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	16	1068	16
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-48	1069	-18
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	0
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	0
3.5 Otros	0079		1079	0
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	0
1. Comisiones	0083		1083	0
2. Otros	0084		1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	54.690	1085	45.488
1. Tesorería	0086	54.690	1086	45.488
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	493.730	1088	511.814

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia I

Denominación del compartimento: 8997

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	464.213	1089	480.374
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	464.213	1094	480.374
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	417.546	1095	443.325
1.1 Series no subordinadas	0096	349.068	1096	370.392
1.2 Series subordinadas	0097	68.477	1097	72.933
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	20.652	1101	21.652
2.1 Préstamo subordinado	0102	22.050	1102	22.050
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-1.398	1105	-398
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	0
3. Derivados	0108	7.185	1108	6.517
3.1 Derivados de cobertura	0109	7.185	1109	6.517
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	18.829	1112	8.880
4.1 Garantías financieras	0113	18.829	1113	
4.1 Otros	0114		1114	8.880
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia I

Denominación del compartimento: 8997

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) PASIVO CORRIENTE	0117	36.703	1117	37.957
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	0
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	36.662	1123	37.917
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	34.569	1124	35.929
1.1 Series no subordinadas	0125	28.774	1125	34.039
1.2 Series subordinadas	0126	5.323	1126	867
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	473	1128	1.023
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	894	1131	673
2.1 Préstamo subordinado	0132	449	1132	449
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	185	1136	215
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	260	1137	9
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	0
3. Derivados	0139	1.199	1139	1.315
3.1 Derivados de cobertura	0140	1.199	1140	1.315
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145		1145	0
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	41	1148	40
1. Comisiones	0149	29	1149	33
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	29	1150	31
1.2 Comisión administrador	0151	440	1151	394
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	2
1.4 Comisión variable	0153	1.693	1153	1.693
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-2.134	1155	-2.087
1.7 Otras comisiones	0156		1156	0
2. Otros	0157	12	1157	7
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-7.185	1158	-6.517
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-7.185	1160	-6.517
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	0
TOTAL PASIVO	0162	493.730	1162	511.814

S.02

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia I

Denominación del compartimento: 8997

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	908	1201		2201	4.016	3201	5.585
1.1 Activos titulizados	0202	908	1202		2202	4.016	3202	5.584
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203		2203		3203	1
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-362	1204		2204	-1.849	3204	-3.074
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-260	1205		2205	-1.420	3205	-2.591
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-102	1206		2206	-429	3206	-483
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207		2207		3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-1.147	1208		2208	-2.193	3208	-2.538
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-601	1209		2209	-26	3209	-27
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210		2210		3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211		2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212		2212		3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213		2213		3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214		2214		3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215		2215		3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216		2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-40	1217		2217	-137	3217	-136
7.1 Servicios exteriores	0218	0	1218		2218	0	3218	0
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219		2219	0	3219	0
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220		2220		3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221		2221		3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222		2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223		2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-40	1224		2224	-137	3224	-136
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-16	1225		2225	-65	3225	-70
7.3.2 Comisión administrador	0226	-11	1226		2226	-46	3226	-49
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227		2227	-1	3227	-5
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228		2228		3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229		2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-12	1230		2230	-24	3230	-12
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-360	1231		2231	-883	3231	82
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-360	1232		2232	-883	3232	82
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233		2233		3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235		2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236		2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237		2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238		2238		3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	1.001	1239		2239	1.046	3239	81
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240		2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241		2241		3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242		2242	0	3242	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	406.152	1001	428.424
I. Activos financieros a largo plazo	0002	406.152	1002	428.424
1. Activos titulizados	0003	406.152	1003	428.424
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	397.796	1005	417.374
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	0
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	12.336	1025	11.509
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-3.979	1027	-459
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	0
3. Otros activos financieros	0032		1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	0
3.4 Otros	0036		1036	0
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	0
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	80.592	1041	73.612
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	26.072	1043	27.057
1. Activos titulizados	0044	26.072	1044	27.057
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	25.524	1046	26.412
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	0
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	20	1065	26
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	305	1066	414
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	298	1067	179
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	31	1068	34
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-106	1069	-8
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	0
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	0
3.5 Otros	0079		1079	0
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	0
1. Comisiones	0083		1083	0
2. Otros	0084		1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	54.520	1085	46.555
1. Tesorería	0086	54.520	1086	46.555
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	486.744	1088	502.036

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	462.051	1089	478.165
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	462.051	1094	478.165
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	407.523	1095	429.831
1.1 Series no subordinadas	0096	312.523	1096	334.831
1.2 Series subordinadas	0097	95.000	1097	95.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	26.049	1101	30.244
2.1 Préstamo subordinado	0102	33.250	1102	33.250
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-7.201	1105	-3.006
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	0
3. Derivados	0108	10.686	1108	10.061
3.1 Derivados de cobertura	0109	10.686	1109	10.061
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	17.792	1112	8.029
4.1 Garantías financieras	0113	17.792	1113	
4.1 Otros	0114		1114	8.029
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) PASIVO CORRIENTE	0117	35.380	1117	33.932
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	0
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	35.357	1123	33.919
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	30.817	1124	30.032
1.1 Series no subordinadas	0125	30.634	1125	29.659
1.2 Series subordinadas	0126		1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	183	1128	373
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	4.151	1131	3.443
2.1 Préstamo subordinado	0132	667	1132	667
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	122	1136	135
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	3.362	1137	2.641
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	0
3. Derivados	0139	389	1139	444
3.1 Derivados de cobertura	0140	389	1140	444
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145		1145	0
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	23	1148	13
1. Comisiones	0149	11	1149	12
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	11	1150	11
1.2 Comisión administrador	0151	485	1151	440
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	1
1.4 Comisión variable	0153	1.118	1153	1.118
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-1.603	1155	-1.558
1.7 Otras comisiones	0156		1156	0
2. Otros	0157	12	1157	1
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-10.686	1158	-10.061
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-10.686	1160	-10.061
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	0
TOTAL PASIVO	0162	486.744	1162	502.036

S.02

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	976	1201		2201	4.200	3201	5.686
1.1 Activos titulizados	0202	976	1202		2202	4.200	3202	5.685
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203		2203		3203	1
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-449	1204		2204	-2.219	3204	-3.291
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-277	1205		2205	-1.510	3205	-2.520
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-172	1206		2206	-709	3206	-771
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207		2207		3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-1.216	1208		2208	-2.471	3208	-3.003
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-688	1209		2209	-489	3209	-608
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210		2210		3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211		2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212		2212		3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213		2213		3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214		2214		3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215		2215		3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216		2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-42	1217		2217	-133	3217	-130
7.1 Servicios exteriores	0218	0	1218		2218	0	3218	0
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219		2219	0	3219	0
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220		2220		3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221		2221		3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222		2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223		2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-41	1224		2224	-132	3224	-130
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-15	1225		2225	-62	3225	-65
7.3.2 Comisión administrador	0226	-11	1226		2226	-45	3226	-47
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227		2227	-1	3227	-5
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228		2228		3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229		2229		3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-15	1230		2230	-24	3230	-13
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-1.022	1231		2231	-3.618	3231	-316
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-1.022	1232		2232	-3.618	3232	-316
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233		2233		3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235		2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236		2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237		2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238		2238		3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	1.752	1239		2239	4.240	3239	1.054
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240		2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241		2241		3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242		2242	0	3242	0

S.01
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Granada I
Denominación del compartimento: 8929
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	68.702	1001	71.127
I. Activos financieros a largo plazo	0002	68.702	1002	71.127
1. Activos titulizados	0003	68.702	1003	71.127
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	67.620	1005	69.089
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	0
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	9.425	1025	11.067
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-8.343	1027	-9.029
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	0
2. Derivados	0029		1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	0
3. Otros activos financieros	0032		1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	0
3.4 Otros	0036		1036	0
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	0
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Granada I

Denominación del compartimento: 8929

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	27.402	1041	48.666
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	24.077	1043	42.927
1. Activos titulizados	0044	24.077	1044	42.927
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	23.919	1046	42.668
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	0
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	44	1065	69
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	35	1066	53
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	596	1067	635
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	94	1068	110
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-610	1069	-608
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	0
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	0
3.5 Otros	0079		1079	0
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	9	1082	7
1. Comisiones	0083	9	1083	7
2. Otros	0084		1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	3.316	1085	5.732
1. Tesorería	0086	3.316	1086	5.732
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	96.104	1088	119.793

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Granada I

Denominación del compartimento: 8929

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	69.951	1089	72.974
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	69.951	1094	72.974
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	66.242	1095	67.110
1.1 Series no subordinadas	0096	36.677	1096	38.259
1.2 Series subordinadas	0097	30.800	1097	30.800
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	-1.235	1098	-1.949
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	0	1101	0
2.1 Préstamo subordinado	0102	5.999	1102	5.999
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-5.999	1105	-5.999
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	0
3. Derivados	0108	3.698	1108	5.757
3.1 Derivados de cobertura	0109	3.698	1109	5.757
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	12	1112	107
4.1 Garantías financieras	0113	12	1113	
4.1 Otros	0114		1114	107
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Granada I

Denominación del compartimento: 8929

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) PASIVO CORRIENTE	0117	29.850	1117	52.576
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	0
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	29.836	1123	52.574
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	29.358	1124	51.782
1.1 Series no subordinadas	0125	29.324	1125	51.717
1.2 Series subordinadas	0126		1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	35	1128	65
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	13	1131	15
2.1 Préstamo subordinado	0132	6	1132	6
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	-558	1135	-432
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	13	1136	15
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	553	1137	426
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	0
3. Derivados	0139	464	1139	575
3.1 Derivados de cobertura	0140	464	1140	575
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	202
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	202
4.2 Garantías financieras	0145		1145	0
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	15	1148	2
1. Comisiones	0149	2	1149	3
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	2	1150	3
1.2 Comisión administrador	0151	77	1151	65
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	1.481	1153	1.481
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-1.558	1155	-1.546
1.7 Otras comisiones	0156		1156	0
2. Otros	0157	12	1157	-1
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-3.698	1158	-5.757
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-3.698	1160	-5.757
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	0
TOTAL PASIVO	0162	96.104	1162	119.793

S.02

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Granada I

Denominación del compartimento: 8929

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	823	1201		2201	3.531	3201	5.172
1.1 Activos titulizados	0202	823	1202		2202	3.531	3202	5.172
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203		2203		3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-120	1204		2204	-573	3204	-1.000
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-89	1205		2205	-448	3205	-865
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-31	1206		2206	-125	3206	-135
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207		2207	0	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-759	1208		2208	-2.998	3208	-4.051
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-56	1209		2209	-40	3209	121
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210		2210		3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211		2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212		2212		3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213		2213		3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214		2214		3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215		2215		3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216		2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-24	1217		2217	-68	3217	-70
7.1 Servicios exteriores	0218	0	1218		2218	0	3218	0
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219		2219	0	3219	0
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220		2220		3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221		2221		3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222		2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223		2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-24	1224		2224	-68	3224	-70
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-7	1225		2225	-27	3225	-32
7.3.2 Comisión administrador	0226	-3	1226		2226	-12	3226	-17
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227		2227	0	3227	-2
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228		2228		3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229		2229		3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-14	1230		2230	-29	3230	-19
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	321	1231		2231	684	3231	-851
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	321	1232		2232	684	3232	-851
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233		2233		3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235		2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236		2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237		2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238		2238		3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-241	1239		2239	-576	3239	800
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240		2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241		2241		3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242		2242	0	3242	0

S.01
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Sa Nostra I
Denominación del compartimento: 8828
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	38.463	1001	43.272
I. Activos financieros a largo plazo	0002	38.463	1002	43.272
1. Activos titulizados	0003	38.463	1003	43.272
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	38.392	1005	42.831
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	0
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	1.129	1025	1.499
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-1.058	1027	-1.058
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	0
2. Derivados	0029		1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	0
3. Otros activos financieros	0032		1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	0
3.4 Otros	0036		1036	0
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	0
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Sa Nostra I

Denominación del compartimento: 8828

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	8.521	1041	8.168
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	5.011	1043	4.820
1. Activos titulizados	0044	5.011	1044	4.820
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	4.997	1046	4.762
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	0
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	1	1065	1
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	4	1066	7
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	122	1067	161
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	5	1068	8
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-119	1069	-119
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	0
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	0
3.5 Otros	0079		1079	0
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	9	1082	7
1. Comisiones	0083	9	1083	7
2. Otros	0084		1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	3.502	1085	3.341
1. Tesorería	0086	3.502	1086	3.341
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	46.985	1088	51.440

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Sa Nostra I

Denominación del compartimento: 8828

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	40.275	1089	46.526
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	40.275	1094	46.526
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	37.072	1095	43.369
1.1 Series no subordinadas	0096	28.479	1096	31.769
1.2 Series subordinadas	0097	8.594	1097	11.600
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	2.604	1101	2.455
2.1 Préstamo subordinado	0102	2.616	1102	2.616
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-12	1105	-161
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	0
3. Derivados	0108	599	1108	702
3.1 Derivados de cobertura	0109	599	1109	702
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	
4.1 Otros	0114		1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Sa Nostra I

Denominación del compartimento: 8828

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) PASIVO CORRIENTE	0117	7.308	1117	5.616
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	0
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	7.291	1123	5.613
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	7.223	1124	5.529
1.1 Series no subordinadas	0125	5.788	1125	5.512
1.2 Series subordinadas	0126	1.430	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	5	1128	17
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	31	1131	34
2.1 Préstamo subordinado	0132		1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	6	1136	7
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	25	1137	27
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	0
3. Derivados	0139	38	1139	45
3.1 Derivados de cobertura	0140	38	1140	45
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	5
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	5
4.2 Garantías financieras	0145		1145	0
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	17	1148	3
1. Comisiones	0149	2	1149	3
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	2	1150	2
1.2 Comisión administrador	0151	3	1151	4
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	118	1153	176
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-121	1155	-179
1.7 Otras comisiones	0156		1156	0
2. Otros	0157	15	1157	0
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-599	1158	-702
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-599	1160	-702
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	0
TOTAL PASIVO	0162	46.985	1162	51.440

S.02

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Sa Nostra I

Denominación del compartimento: 8828

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	142	1201		2201	596	3201	741
1.1 Activos titulizados	0202	142	1202		2202	596	3202	741
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203		2203		3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-24	1204		2204	-129	3204	-243
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-11	1205		2205	-78	3205	-187
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-13	1206		2206	-51	3206	-56
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207		2207		3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-37	1208		2208	-164	3208	-199
A) MARGEN DE INTERESES	0209	82	1209		2209	304	3209	299
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210		2210		3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211		2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212		2212		3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213		2213		3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214		2214		3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215		2215		3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216		2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-27	1217		2217	-97	3217	-46
7.1 Servicios exteriores	0218	0	1218		2218	-1	3218	0
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219		2219	-1	3219	0
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220		2220		3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221		2221		3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222		2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223		2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-27	1224		2224	-96	3224	-46
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-3	1225		2225	-16	3225	-17
7.3.2 Comisión administrador	0226	-1	1226		2226	-5	3226	-5
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227		2227	0	3227	-1
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228		2228	-37	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229		2229		3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-23	1230		2230	-38	3230	-23
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-60	1231		2231	1	3231	-228
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-60	1232		2232	1	3232	-228
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233		2233		3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235		2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236		2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237		2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238		2238		3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	6	1239		2239	-207	3239	-25
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240		2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241		2241		3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242		2242	0	3242	0

S.01
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Vital I
Denominación del compartimento: 8823
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	108.724	1001	118.337
I. Activos financieros a largo plazo	0002	108.724	1002	118.337
1. Activos titulizados	0003	108.724	1003	118.337
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	107.984	1005	117.857
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	0
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	1.856	1025	1.935
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-1.116	1027	-1.455
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	0
2. Derivados	0029		1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	0
3. Otros activos financieros	0032		1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	0
3.4 Otros	0036		1036	0
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	0
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Vital I

Denominación del compartimento: 8823

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	14.809	1041	13.313
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	9.764	1043	8.649
1. Activos titulizados	0044	9.764	1044	8.643
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	9.254	1046	8.474
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	0
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	33	1065	49
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	1	1066	2
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	1.188	1067	468
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	9	1068	8
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-720	1069	-358
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	0
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	6
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	6
3.4 Garantías financieras	0078		1078	0
3.5 Otros	0079		1079	0
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	0	1082	0
1. Comisiones	0083		1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	5.044	1085	4.664
1. Tesorería	0086	5.044	1086	4.664
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	123.532	1088	131.650

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Vital I

Denominación del compartimento: 8823

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	114.495	1089	123.361
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	114.495	1094	123.361
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	109.213	1095	118.487
1.1 Series no subordinadas	0096	84.613	1096	93.887
1.2 Series subordinadas	0097	24.600	1097	24.600
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	2.703	1101	2.576
2.1 Préstamo subordinado	0102	3.138	1102	3.138
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-436	1105	-562
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	0
3. Derivados	0108	1.959	1108	1.902
3.1 Derivados de cobertura	0109	1.959	1109	1.902
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	620	1112	396
4.1 Garantías financieras	0113	620	1113	
4.1 Otros	0114		1114	396
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Vital I

Denominación del compartimento: 8823

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) PASIVO CORRIENTE	0117	10.996	1117	10.191
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	0
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	10.980	1123	10.185
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	10.796	1124	10.044
1.1 Series no subordinadas	0125	10.781	1125	10.002
1.2 Series subordinadas	0126		1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	15	1128	42
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	138	1131	76
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	7	1136	8
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	131	1137	68
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	0
3. Derivados	0139	46	1139	65
3.1 Derivados de cobertura	0140	46	1140	65
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145		1145	0
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	16	1148	6
1. Comisiones	0149	4	1149	5
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	4	1150	4
1.2 Comisión administrador	0151	29	1151	16
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	794	1153	794
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-824	1155	-809
1.7 Otras comisiones	0156		1156	0
2. Otros	0157	12	1157	1
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-1.959	1158	-1.902
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-1.959	1160	-1.902
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	0
TOTAL PASIVO	0162	123.532	1162	131.650

S.02

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Vital I

Denominación del compartimento: 8823

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	177	1201		2201	806	3201	1.173
1.1 Activos titulizados	0202	177	1202		2202	806	3202	1.173
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203		2203		3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-50	1204		2204	-283	3204	-557
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-34	1205		2205	-220	3205	-489
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-15	1206		2206	-62	3206	-68
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207		2207		3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-123	1208		2208	-321	3208	-403
A) MARGEN DE INTERESES	0209	4	1209		2209	202	3209	213
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210		2210		3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211		2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212		2212		3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213		2213		3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214		2214		3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215		2215		3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216		2216		3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-24	1217		2217	-67	3217	-59
7.1 Servicios exteriores	0218	0	1218		2218	0	3218	0
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219		2219	0	3219	0
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220		2220		3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221		2221		3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222		2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223		2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-24	1224		2224	-67	3224	-59
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-7	1225		2225	-30	3225	-32
7.3.2 Comisión administrador	0226	-4	1226		2226	-14	3226	-14
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227		2227	0	3227	-1
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228		2228		3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229		2229		3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-11	1230		2230	-21	3230	-12
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-82	1231		2231	-23	3231	-660
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-82	1232		2232	-23	3232	-660
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233		2233		3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235		2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236		2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237		2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238		2238		3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	102	1239		2239	-112	3239	506
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240		2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241		2241		3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242		2242	0	3242	0

**2. INFORME DE GESTIÓN DEL EJERCICIO 2016 DE
AyT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, FONDO DE TITULIZACIÓN
DE ACTIVOS**

(El estado S.05.4 se adjunta como anexo de este informe de gestión)

AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A.

Informe de gestión correspondiente al ejercicio anual terminado el 31 de diciembre de 2016.

1. Descripción de los principales riesgos e incertidumbres a los que se enfrenta el fondo

RIESGOS ESPECÍFICOS DEL EMISOR Y DE SU SECTOR DE ACTIVIDAD

a) Naturaleza jurídica del Fondo

De conformidad con el Real Decreto 926/1998, el Fondo constituye un patrimonio separado, carente de personalidad jurídica, administrado y representado por una sociedad gestora. El Fondo sólo responderá frente a sus acreedores con su patrimonio.

El Fondo se establece como un vehículo abierto por el activo y por el pasivo de manera que puede incorporar sucesivos conjuntos de activos, en todo caso Préstamos Hipotecarios, y realizar sucesivas Emisiones de Series de Bonos al amparo del Programa, vinculadas a cada conjunto de Activos. Las distintas Series son independientes, de forma que cada Serie está respaldada, exclusivamente, por el conjunto de Activos incorporados al Fondo con motivo de dicha Emisión. Los importes recibidos correspondientes a un determinado Activo, el retraso en el pago o impago definitivo de importes debidos en virtud de dicho Activo, los importes correspondientes a su amortización regular o anticipada o cualquier otra circunstancia correspondiente a dicho Activo sólo afectan a la Serie de Bonos vinculada a dicho Activo.

La Sociedad Gestora tiene encomendada, en calidad de gestora de negocios ajenos, la representación y defensa de los intereses de los bonistas y de los restantes acreedores ordinarios del Fondo en los términos establecidos en la legislación vigente. Por consiguiente, la defensa de los intereses de los titulares de los Bonos depende de los medios de la Sociedad Gestora.

b) Sustitución forzosa de la Sociedad Gestora

Conforme al artículo 19 del Real Decreto 926/1998, cuando la Sociedad Gestora hubiera sido declarada en concurso deberá proceder a encontrar una sociedad gestora que la sustituya, de acuerdo con lo previsto en el artículo 18 del Real Decreto 926/1998. Siempre que en este caso hubieran transcurrido cuatro meses desde que tuvo lugar el evento determinante de la sustitución y no se hubiera encontrado una nueva sociedad gestora dispuesta a encargarse de la gestión, se procederá a la liquidación anticipada del Fondo, a la amortización de los valores emitidos con cargo al mismo y a la liquidación de los activos, de acuerdo con lo previsto en la Escritura de Constitución y el Folleto Informativo.

c) Acciones de los bonistas

Los titulares de los Bonos y los restantes acreedores del Fondo no disponen de acción alguna contra los Deudores Cedidos de los Activos que hayan incumplido sus obligaciones de pago de los mismos, siendo la Sociedad Gestora, como representante del Fondo titular de los Activos, quien ostenta dicha acción.

Los titulares de los Bonos y los restantes acreedores del Fondo no dispondrán de acción alguna frente al Fondo ni frente a la Sociedad Gestora en caso de impago de cantidades adeudadas por el Fondo que sea consecuencia de: (i) la existencia de morosidad o de la amortización anticipada de los Activos, (ii) del incumplimiento de las contrapartes de las operaciones contratadas en nombre y por cuenta del Fondo o (iii) por insuficiencia de las operaciones financieras de protección para atender el servicio financiero de los Bonos.

Los titulares de los Bonos y los restantes acreedores del Fondo no disponen de más acciones contra la Entidad Cedente o contra la Sociedad Gestora, respectivamente, que las derivadas de los incumplimientos de sus respectivas funciones y, por tanto, nunca como consecuencia de la existencia de morosidad o de amortización anticipada de los Activos.

Dichas acciones deben resolverse en el juicio declarativo ordinario que corresponda según la cuantía de la reclamación.

d) Situación concursal

Tanto las Entidades Cedentes como la Sociedad Gestora y cualquiera de los restantes participantes en la operación, pueden ser declarados en concurso. El concurso de cualquiera de los sujetos intervinientes puede afectar a las relaciones contractuales con el Fondo, de conformidad con lo dispuesto en la Ley 22/2003 de 9 de julio, Concursal.

De conformidad con la Disposición Adicional Quinta de la Ley 3/1994, de 14 de abril, por la que se adapta la legislación española en materia de entidades de crédito a la Segunda Directiva de Coordinación Bancaria y se introducen otras modificaciones relativas al sistema financiero, en caso de concurso de alguna Entidad Cedente, el negocio de cesión de los Activos en favor del Fondo sólo podrá ser impugnado en caso de que exista fraude, gozando el Fondo de un derecho absoluto de separación. La Disposición Adicional Quinta de la Ley 3/1994 sigue siendo aplicable tras la entrada en vigor de la Ley 22/2003, de 9 de julio, Concursal, en virtud de lo dispuesto en la Disposición Adicional Segunda de la misma, modificada por la Disposición Adicional Tercera de la Ley 36/2003, de 11 de noviembre, de medidas de reforma económica, y por el Real Decreto-ley 5/2005, de 11 de marzo, de reformas urgentes para el impulso a la productividad y para la mejora de la contratación pública.

En caso de concurso de alguna Entidad Cedente, los bienes pertenecientes al Fondo, excepción hecha del dinero, por su carácter de bien fungible, que existieran en el patrimonio concursal de la misma serían de dominio del Fondo, y deberían pasar a su disposición, en los términos de los artículos 80 y 81 de la Ley 22/2003, de 9 de julio, Concursal.

No obstante lo anterior, tanto el Folleto Informativo como la Escritura de Constitución prevén determinados mecanismos al objeto de paliar los efectos antedichos con relación al dinero por su naturaleza de bien fungible.

No existe certeza sobre las repercusiones prácticas que, en caso de concurso de los Deudores Cedidos o de la Entidad Cedente, pueden tener algunos preceptos de la Ley 22/2003, de 9 de julio, Concursal en relación con determinados aspectos de la operación, pues ello dependerá en gran medida de la interpretación que de dichos preceptos lleven a cabo los jueces y tribunales competentes que son, además, juzgados de nueva creación.

Tales aspectos son, entre otros, los siguientes:

- (a) Conforme a lo dispuesto en el artículo 61.2 de la Ley Concursal, la declaración de concurso no afecta a la vigencia de los contratos con obligaciones recíprocas pendientes de cumplimiento a cargo de ambas partes.
- (b) En relación con lo anterior, según el artículo 61.3 de la Ley Concursal, se tendrán por no puestas las cláusulas que establezcan la facultad de resolución o la extinción de los contratos por la sola causa de la declaración de concurso de cualquiera de las partes.

- (c) El artículo 56 de la Ley Concursal establece que los acreedores con garantía real sobre bienes afectos a la actividad profesional o empresarial o a una unidad productiva del concursado están sujetos a una suspensión de ejecución (hasta que se apruebe un convenio cuyo contenido no afecte a tales acreedores o transcurra un año desde la declaración de concurso sin haberse producido la apertura de la liquidación).

Los bonistas correrán con el riesgo de que un Deudor Cedido sea declarado en concurso y se vea menoscabada su capacidad de devolver puntualmente los importes adeudados en virtud del Activo, y sin que ello implique necesariamente la resolución anticipada del mismo.

En caso de concurso de la Sociedad Gestora, ésta deberá ser sustituida por otra sociedad gestora conforme a lo descrito en el apartado b) anterior.

RIESGOS DERIVADOS DE LOS VALORES

- a) Protección limitada

Aunque existen mecanismos de mejora del crédito en relación con los Bonos de cada Serie, la mejora de crédito es limitada y los bonistas son los que soportan en última instancia el riesgo de crédito y otros riesgos asociados con su inversión en cada una de las Series emitidas por el Fondo.

- b) Riesgo de liquidez

No existe ninguna garantía de que llegue a producirse en el mercado una negociación de los Bonos con una frecuencia o volumen mínimo. No existe el compromiso de que alguna entidad vaya a intervenir en la contratación secundaria, dando liquidez a los Bonos mediante ofrecimiento de contrapartida. Además, en ningún caso el Fondo podrá recomprar los Bonos a los titulares de éstos, aunque sí podrán ser amortizados anticipadamente en su totalidad en el caso de liquidación anticipada del Fondo o de alguna de las Series, en los términos establecidos en el apartado 4.4.3 del Documento de Registro.

- c) Intereses de demora

En ningún caso la existencia de retrasos en el pago de los intereses o en el reembolso del principal a los titulares de los Bonos da lugar al devengo de intereses de demora a su favor, si bien los importes de intereses pendientes de pago seguirán devengando intereses al tipo de interés ordinario de los Bonos.

d) Riesgo de precio

La Emisión se realiza con la intención de ser suscrita íntegramente por la Entidad Cedente, con el objeto de disponer de activos líquidos que puedan ser utilizados como garantía en operaciones con el Eurosistema. Las condiciones de Emisión no constituyen una estimación de los precios a los que estos instrumentos podrían venderse en el mercado secundario ni de las valoraciones que, eventualmente, pueda realizar el Eurosistema a efectos de su utilización como instrumentos de garantía en sus operaciones de préstamo al sistema bancario.

e) Rentabilidad

Los cálculos incluidos en las Condiciones Finales de cada una de las Series respecto de la tasa interna de rentabilidad, de la vida media y de la duración de los Bonos están sujetos, entre otras cosas, a hipótesis de tasas de amortización anticipada y de morosidad de los Activos que pueden no cumplirse.

f) Responsabilidad limitada

Los Bonos emitidos por el Fondo no representan una obligación de la Sociedad Gestora ni de la Entidad Cedente. El flujo de recursos utilizado para atender a las obligaciones a las que den lugar los Bonos está asegurado o garantizado únicamente en las circunstancias específicas y hasta los límites citados en el Folleto Informativo. Con la excepción de estas garantías, no existen otras concedidas por entidad pública o privada alguna, incluyendo la Entidad Cedente, la Sociedad Gestora y cualquier empresa afiliada o participada por cualquiera de las anteriores.

g) Compartimentación

Los Activos de cada Serie, junto con la mejora crediticia de dicha Serie para su utilización en los supuestos descritos en el Folleto Informativo, constituyen la única fuente de ingresos de la Serie correspondiente, y por tanto, de pagos a los titulares de los Bonos de dicha Serie. En consecuencia, los Bonos de una Serie no están respaldados en ninguna medida por los Activos correspondientes a las restantes Series. Cada una de las Series constituye un compartimento independiente, por lo que los supuestos de liquidación anticipada, las mejoras de crédito y los posibles remanentes se refieren a cada una de dichas Series de forma independiente.

h) Duración

El cálculo de la vida media y de la duración de los Bonos que se incluirá en las Condiciones Finales correspondientes a cada una de las Series está sujeto al cumplimiento de la amortización de los Activos y a hipótesis del TACP que pueden no cumplirse.

RIESGOS DERIVADOS DE LOS ACTIVOS SUBYACENTES

a) Riesgo de amortización anticipada

El riesgo de amortización anticipada de los Activos es por cuenta de los titulares de los Bonos.

b) Riesgo de impago

Los titulares de los Bonos emitidos con cargo al Fondo corren con el riesgo de impago de los Activos agrupados en el mismo.

En consecuencia, las Entidades Cedentes no asumen responsabilidad alguna por el impago de los Deudores Cedidos, ya sea del principal, de los intereses o de cualquier otra cantidad que los mismos puedan adeudar en virtud de los Activos. Las Entidades Cedentes tampoco asumen responsabilidad alguna de garantizar directa o indirectamente el buen fin de la operación, ni otorgan garantías o avales, ni incurren en pactos de recompra de los Activos.

c) Riesgo de garantía hipotecaria

En la fecha de Constitución, la totalidad de los Préstamos Hipotecarios que respaldan la Cartera de Activos Titulizables contaban con garantía hipotecaria sobre vivienda. En alguno de los casos, la vivienda sobre la que se constituyó la hipoteca no constituye el 100% de la garantía hipotecaria del correspondiente Préstamo Hipotecario, puesto que dichos Préstamos Hipotecarios están garantizados asimismo por hipotecas adicionales sobre garajes o trasteros. Asimismo, la vivienda hipotecada no respalda necesariamente la totalidad de la deuda de cada Préstamo Hipotecario.

FACTORES DE RIESGO ESPECÍFICOS PARA CADA SERIE

- **BBK I:**

a) Riesgo de Concentración geográfica

En la fecha de Constitución de la Serie, el 58,41% de los Préstamos Hipotecarios integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 19 de marzo de 2007 habían sido concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la provincia de Vizcaya y suponían un saldo de principal pendiente de pago de 1.012.871.266,26 euros (el 55,14% del saldo vivo). Dado este nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre la provincia de Vizcaya, puede afectar a los pagos de los Certificados que respaldan la emisión de los Bonos.

b) Riesgo de Tipos de interés

En la fecha de Constitución de la Serie, el tipo medio de los préstamos de la Cartera de Activos Titulizables a 19 de marzo de 2007 era del 4,20%, de conformidad con lo recogido en el apartado VIII.3.e) del Folleto Informativo, mientras que el tipo medio ponderado a pagar por los Bonos era del 4,24% (resultado de adicionar al Tipo de Interés de Referencia asumido en el apartado V.7 del Folleto Informativo para el primer Periodo de Devengo de Intereses el margen medio de los Bonos, 0,199%, teniendo en cuenta los Márgenes señalados en el apartado V.5 del Folleto Informativo, ponderado por el importe nominal de cada uno de los Tramos). Esta contingencia se encuentra cubierta por el Contrato de Swap, en virtud del cual el Fondo recibirá un tipo esperado del 4,741% (resultado de adicionar al Tipo de Interés de Referencia asumido en el apartado V.7 del Folleto Informativo para el primer Periodo de Devengo de Intereses el Margen del Tipo Variable B señalado en el apartado IX.5 del Folleto Informativo, 0,70%). No obstante, la estimación del margen medio de la cartera se espera que sea superior al margen de los Bonos, una vez los préstamos de la cartera realicen sus revisiones del tipo de interés.

• **BBK II:**

a) Riesgo de concentración geográfica

En la fecha de Constitución de la Serie, el 55,50% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 4 de marzo de 2008 habían sido concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la provincia de Vizcaya y suponían un saldo de principal pendiente de pago de 741.047.461,62 euros. El 17,81% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 4 de marzo de 2008 fueron concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la provincia de Madrid y supusieron un saldo de principal pendiente de pago de 237.759.569,69 euros. Dado este nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre Vizcaya o Madrid, podría afectar a los pagos de los Certificados que respaldan la Emisión.

- **Caja Navarra I:**

- a) Riesgo de concentración geográfica

En la fecha de Constitución de la Serie, el 93,84% de los Préstamos Hipotecarios integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 4 de Junio de 2007 habían sido concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la provincia de Navarra y suponían un saldo de principal pendiente de pago de 110.439.775,63 euros (el 92,90% del saldo vivo). Dado este nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre la provincia de Navarra, podría afectar a los pagos de los Certificados que respaldan la Emisión de los Bonos.

- **Caja Vital Kutxa I:**

- a) Riesgo de Concentración geográfica

En la fecha de Constitución de la Serie, el 52,48% de los Préstamos Hipotecarios integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 18 de julio de 2007 habían sido concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la provincia de Álava y supusieron un saldo de principal pendiente de pago de 117.380.737,30 euros (el 54,67% del saldo vivo). Dado este nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre la provincia de Álava, podría afectar a los pagos de los Certificados que respaldan la emisión de los Bonos.

- **Sa Nostra I:**

- a) Riesgo de Concentración geográfica

En la fecha de Constitución de la Serie, el 99,65% de los Préstamos Hipotecarios integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 21 de junio de 2007 habían sido concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la provincia de Baleares y supusieron un saldo de principal pendiente de pago de 116.303.300,34 euros (el 99,51% del saldo vivo). Dado este nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre la provincia de Baleares, podría afectar a los pagos de los Certificados que respaldan la emisión de los Bonos.

- **Caja España I:**

- a) Riesgo de concentración geográfica

En la fecha de Constitución de la Serie, el 35,19% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 5 de diciembre de 2007 habían sido concedidos a Deudores domiciliados en la provincia de Madrid y supusieron un saldo de principal pendiente de pago de 188.864.316 euros. El 13,81% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 5 de diciembre de 2007 habían sido concedidos a Deudores domiciliados en la provincia de Valladolid y supusieron un saldo de principal pendiente de pago de 74.132.526 euros. El 12,72% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 5 de diciembre de 2007 habían sido concedidos a Deudores domiciliados en la provincia de León y supusieron un saldo de principal pendiente de pago de 68.257.492 euros. Dado este nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre Madrid, Valladolid o León, podría afectar a los pagos de los Certificados que respaldan la Emisión.

- b) Riesgo de antigüedad y LTV

En la fecha de Constitución de la Serie, la cartera de préstamos a titularizar tenía una antigüedad media de 1,89 años y un LTV medio ponderado del 92,54%. Dado estos niveles de LTV y antigüedad cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial podría afectar a los pagos de los Certificados que respaldan la Emisión.

- c) Riesgo de tipo de interés

En la fecha de Constitución de la Serie, el tipo medio de los activos era 5,07%, mientras que el tipo medio a pagar por los Bonos era de 5,228% (asumiendo las hipótesis de las Condiciones Finales). El tipo medio de los activos varía a lo largo del tiempo en función de los nuevos tipos actualizados de los Préstamos Hipotecarios y de la tasa de amortización de los mismos. La mayoría de los Préstamos Hipotecarios pagan un EURIBOR 12 meses más un diferencial medio del 1,46% (debido a la reciente evolución de los tipos de interés publicados produciendo una subida pronunciada de tipos de interés, existen préstamos cuya fijación EURIBOR 12 meses es inferior al EURIBOR 6 meses de la actualidad, en las próximas revisiones deberá corregirse) y los Bonos pagan un EURIBOR 6 meses más un diferencial medio de 0,382%. Por lo tanto, es de esperar que la situación descrita (tipo de los activos inferior al tipo de los Bonos) perdure durante un cierto número de meses, aunque esta circunstancia se corregirá según se vayan revisando los tipos de la totalidad de los Préstamos Hipotecarios de la cartera.

No obstante lo anterior, la situación descrita se verá compensada en las distintas Fechas de Pago en virtud del Contrato de Swap contratado por el Fondo. En particular, el Fondo cobrará por este contrato el EURIBOR 6 meses más un margen de 1,20% (siendo 6,106% en la primera Fecha de Pago) asumiendo las hipótesis de las Condiciones Finales. En posteriores Fechas de Pago tendrá lugar una compensación similar, variable según sean los tipos de los activos y de los Bonos, pero que se mantendrá constante el margen del Fondo.

- **Caja Granada I:**

- a) Riesgo de concentración geográfica

En la fecha de Constitución de la Serie, el 34,58% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 8 de noviembre de 2007 habían sido concedidos a Deudores domiciliados en la provincia de Granada y suponían un saldo de principal pendiente de pago de 168.033.210,10 euros. El 82,80% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 8 de noviembre de 2007 habían sido concedidos a Deudores domiciliados en la Comunidad Autónoma de Andalucía y supusieron un saldo de principal pendiente de pago de 402.398.331,86 euros. Dado este nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre Andalucía, podría afectar a los pagos de los Certificados que respaldan la Emisión.

- **CCM I:**

- a) Riesgo de concentración geográfica

En la fecha de Constitución de la Serie, el 31,63% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 29 de noviembre de 2007 habían sido concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la provincia de Albacete y suponían un saldo de principal pendiente de pago de 284.089.521,26 euros. El 29,55% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 29 de noviembre de 2007 habían sido concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la provincia de Toledo y suponían un saldo de principal pendiente de pago de 265.452.036,73 euros. El 13,49% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 29 de noviembre de 2007 habían sido concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la provincia de Guadalajara y suponían un saldo de principal pendiente de pago de 121.189.692,34 euros. Dado este nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre Albacete, Toledo o Guadalajara, podría afectar a los pagos de los Certificados que respaldan la Emisión.

b) Riesgo de antigüedad y LTV

En la fecha de Constitución de la Serie, la cartera de préstamos a titularizar tenía una antigüedad media de 1,43 años y un LTV medio ponderado del 83,38%. Dado estos niveles de LTV y antigüedad cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial podría afectar a los pagos de los Certificados que respaldan la Emisión.

c) Riesgo de tipo de interés

En la fecha de Constitución de la Serie, el tipo medio de los activos fue 4,89%, mientras que el tipo medio a pagar por los Bonos fue de 5,156% (asumiendo las hipótesis de las Condiciones Finales). El tipo medio de los activos variará a lo largo del tiempo en función de los nuevos tipos actualizados de los Préstamos Hipotecarios y de la tasa de amortización de los mismos. La mayoría de los Préstamos Hipotecarios pagan un Euribor a doce (12) meses más un diferencial medio del 0,78% y los Bonos pagan un Euribor a seis (6) meses más un diferencial medio de 0,388%. Por lo tanto, es de esperar que la situación descrita (tipo de los activos inferior al tipo de los Bonos) perdure durante un cierto número de meses, aunque esta circunstancia se corregirá según se vayan revisando los tipos de la totalidad de los Préstamos Hipotecarios de la cartera.

No obstante lo anterior, la situación descrita se verá compensada en las distintas Fechas de Pago en virtud del Contrato de Swap contratado por el Fondo. En particular, el Fondo cobrará por este contrato el Euribor a seis (6) meses más un margen de 0,60% (siendo 5,368% en la primera Fecha de Pago) asumiendo las hipótesis de las Condiciones Finales. En posteriores Fechas de Pago tendrá lugar una compensación similar, variable según sean los tipos de los activos y de los Bonos, pero que se mantendrá constante el margen del Fondo.

- **Caixa Galicia I:**

- a) Riesgo de concentración geográfica

En la fecha de Constitución de la Serie, el 25,41% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 11 de febrero de 2008 habían sido concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la provincia de A Coruña y suponían un saldo de principal pendiente de pago de 244.209.319,43 euros. El 12,78% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 11 de febrero de 2008 fueron concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la provincia de Barcelona y supusieron un saldo de principal pendiente de pago de 122.797.674,55 euros. El 11,99% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 11 de febrero de 2008 habían sido concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la provincia de Madrid y supusieron un saldo de principal pendiente de pago de 115.199.626,97 euros. A nivel regional, el 41,16% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 11 de febrero de 2008 habían sido concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la Comunidad Autónoma de Galicia y supusieron un saldo de principal pendiente de pago de 395.634.165,51 euros.

Dado este nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre las Comunidad Autónoma de Galicia o de las provincias de Madrid o Barcelona, podría afectar a los pagos de los Certificados que respaldan la Emisión.

- b) Riesgo de antigüedad y LTV

En la fecha de Constitución de la Serie, la cartera de préstamos a titularizar tenía una antigüedad media de 2,33 años y el 40,74% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 11 de febrero de 2008 tienen un LTV superior al 80%. Dado estos niveles de LTV y antigüedad cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial podría afectar a los pagos de los Certificados que respaldan la Emisión.

- **Caja Círculo I:**

- a) Riesgo de concentración geográfica

En la fecha de Constitución de la Serie, el 53,42% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 2 de marzo de 2008 habían sido concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la provincia de Burgos y supusieron un saldo de principal pendiente de pago de 92.611.800,38 euros. El 18,15% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 2 de marzo de 2008 habían sido concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la provincia de Madrid y supusieron un saldo de principal pendiente de pago de 31.459.030,97 euros.

El 17,64% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 2 de marzo de 2008 habían sido concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la provincia de Valladolid y supusieron un saldo de principal pendiente de pago de 30.588.680,04 euros. Dado este nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre Burgos, Madrid o Valladolid podría afectar a los pagos de los Certificados que respaldan la Emisión.

- b) Riesgo de antigüedad y LTV

En la fecha de Constitución de la Serie, la cartera de préstamos a titularizar tenía una antigüedad media de 2,81 años y un LTV medio ponderado del 82,10%. El 66,71% del Saldo Vivo de los Activos tenía un LTV superior al 80%. Dado estos niveles de LTV y antigüedad cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial podría afectar a los pagos de los Certificados que respaldan la Emisión.

- c) Riesgo de concentración por Deudor Cedido

En la fecha de Constitución de la Serie, el conjunto formado por los diez (10) mayores Deudores Cedidos supuso el 2,83% de la totalidad de la Cartera de Activos Titulizables, y el Fondo de Reserva es del 3,00%. Dado este nivel de concentración una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre estos diez (10) Deudores Cedidos podría afectar a los pagos de los Activos que respaldan la emisión de Bonos.

- **Caixa Galicia II:**

- a) Riesgo de concentración geográfica

En la fecha de Constitución, había 788 préstamos, que suponían un 16,40% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 30 de mayo de 2008 que habían sido concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la provincia de Barcelona y supusieron un saldo de principal pendiente de pago de 163.921.314,61 euros. Había 1.295 préstamos, que suponían un 13,48% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 30 de mayo de 2008 que fueron concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la provincia de A Coruña y suponían un saldo de principal pendiente de pago de 134.769.344,76 euros. Dado este nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre Barcelona y A Coruña, podría afectar a los pagos de los Certificados que respaldan la Emisión.

- b) Riesgo de antigüedad y LTV

En la fecha de Constitución de la Serie, la cartera de préstamos a titular tenía una antigüedad media de 1,68 años y un LTV medio ponderado del 77,12%. Dentro de la Cartera de Activos Titulizables, un total de 4.923 préstamos hipotecarios tenían una antigüedad de entre cero (0) y dos (2) años. Dichos préstamos hipotecarios tenían un saldo nominal no vencido de 701.127.290,60 euros, lo que representaba un 70,13% del saldo vivo de la Cartera de Activos Titulizables.

Había 2.593 préstamos, que suponían un 48,84% del Saldo Vivo de los Activos que tenían un LTV superior al 80% sobre el total de la(s) garantía(s). Dado estos niveles de LTV y antigüedad cualquier circunstancia de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre el precio de los bienes hipotecados podría afectar al valor de la garantía hipotecaria de los Activos que respaldan la Emisión.

- c) Riesgo de tipo de interés

En la fecha de Constitución, el tipo medio de los préstamos de la Cartera de Activos Titulizables era 5,264%, mientras que el tipo medio a pagar por los Bonos en la primera fecha de pago fue de 5,373% (asumiendo las hipótesis de las Condiciones Finales). El tipo medio de los préstamos varía a lo largo del tiempo en función de los nuevos tipos actualizados de los Préstamos Hipotecarios y de la tasa de amortización de los mismos.

Por lo tanto, es de esperar que la situación descrita (tipo de los activos inferior al tipo de los Bonos) perdure durante un cierto número de meses, aunque esta circunstancia se corrige según se vayan revisando los tipos de la totalidad de los Préstamos Hipotecarios de la cartera.

No obstante lo anterior, la situación descrita se ve compensada en las distintas Fechas de Pago en virtud del Contrato de Swap contratado por el Fondo. En particular, el Fondo cobra por este contrato el Euribor a seis (6) meses más un margen de 0,50% (siendo 5,509% en la primera Fecha de Pago asumiendo las hipótesis de las Condiciones Finales). En posteriores Fechas de Pago tendrá lugar una compensación similar, variable según sean los tipos de los activos y de los Bonos, pero que se mantendrá constante el margen del Fondo.

- **Caixa Laietana I:**

- a) Riesgo de concentración geográfica

En la fecha de Constitución de la Serie, el 86,03% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 9 de julio de 2008 fueron concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la Comunidad Autónoma de Cataluña y supusieron un saldo de principal pendiente de pago de 165.175.784,34 euros y en particular un 75,30% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables fueron concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la Provincia de Barcelona y suponían un saldo de principal pendiente de pago de 144.559.748,12. Dado este nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre la Comunidad Autónoma de Cataluña podría afectar a los pagos de los Certificados que respaldan la Emisión.

- b) Riesgo de antigüedad y LTV

En la fecha de Constitución de la Serie, la cartera de préstamos a titular tenía una antigüedad media de 2,87 años y un LTV medio ponderado del 85,88%. Dentro de la Cartera de Activos Titulizables, un total de 622 préstamos hipotecarios tenían una antigüedad de entre cero (0) y tres (3) años. Dichos préstamos hipotecarios tenían un saldo nominal no vencido de 130.655.955,94 euros, lo que representaba un 68,05% del saldo vivo de la Cartera de Activos Titulizables.

Había 1.008 préstamos, que suponían un 96,01% del Saldo Vivo de los Activos que tenían un LTV superior al 80% sobre el total de la(s) garantía(s).

Dado estos niveles de LTV y antigüedad, cualquier circunstancia de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre el precio de los bienes hipotecados podría afectar al valor de la garantía hipotecaria de los Activos que respaldan la emisión.

c) Riesgo de Vida Residual

En la fecha de Constitución de la Serie, la cartera de préstamos a titularizar tenía una vida residual media ponderada de 29,80 años. Dado este nivel de vida residual, cualquier circunstancia de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre el precio de los bienes hipotecados podría afectar al valor de la garantía hipotecaria de los Activos que respaldan la emisión.

d) Riesgo de concentración por deudor respecto al Fondo de Reserva

En la fecha de Constitución de la Serie, el Deudor por mayor importe del conjunto de Deudores suponía un 0,293% de la Cartera de Activos Titulizables.

El conjunto formado por los diez Deudores por mayores importes suponía el 2,376% de la totalidad de la Cartera de Activos Titulizables, es decir, un importe de 4.562.524,70 euros, lo que a su vez suponía un 76,68% del Importe Inicial del Fondo de Reserva. Dado este nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre estos diez Deudores pudiera afectar a los pagos de los Activos que respaldan la emisión de Bonos.

e) Riesgo de tipo de interés

En la fecha de Constitución de la Serie, el tipo medio ponderado por el Saldo Vivo de los préstamos de la Cartera de Activos Titulizables era a 9 de julio, 5,685%, mientras que el tipo medio a pagar por los Bonos en la primera fecha de pago fue de 5,620% (asumiendo las hipótesis de las Condiciones Finales). El tipo medio ponderado de los préstamos variará a lo largo del tiempo en función de los nuevos tipos actualizados de los Préstamos Hipotecarios y de la tasa de amortización de los mismos.

No obstante lo anterior, la situación descrita se verá compensada en las distintas Fechas de Pago en virtud del Contrato de Swap contratado por el Fondo. En particular, el Fondo cobrará por este contrato el tipo de referencia de los Bonos más un margen de 0,80% (siendo 6,015% en la primera Fecha de Pago asumiendo las hipótesis de las Condiciones Finales).

f) Riesgo de morosidad histórica de la Entidad Cedente

A continuación se Recogen los datos correspondientes a la evolución de la morosidad de la Entidad Cedente (que se recogen asimismo en el Folleto), en los que se aprecia un incremento sustancial de la morosidad, así como una reducción del porcentaje de cobertura de la misma.

	30/06/2008	31/03/2008	31/12/2007	31/12/2006
% DE MOROSIDAD HIPOTECARIA	2,91%	2,81%	2,44%	1,07%
% COBERTURA/MOROSIDAD	52,19%	57,16%	70,28%	138,31%

Dada la morosidad de la cartera hipotecaria de la Entidad Cedente y las hipótesis de morosidad asumidas para la elaboración de los cuadros del servicio financiero de la deuda, el sistema de amortización de los Bonos sería secuencial hasta el 25 de marzo de 2016.

• **Caja Cantabria I:**

a) Riesgo de concentración geográfica

En la fecha de Constitución de la Serie, el 81,43% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 5 de junio de 2008 fueron concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la Comunidad Autónoma de Cantabria y supusieron un saldo de principal pendiente de pago de 208.795.022,88 euros.

Dado este nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre la Comunidad Autónoma de Cantabria podría afectar a los pagos de los Certificados que respaldan la Emisión.

b) Riesgo de antigüedad y LTV

En la fecha de Constitución de la Serie, la cartera de préstamos a titular tenía una antigüedad media de 2,77 años y un LTV medio ponderado del 85,672%. Dentro de la Cartera de Activos Titulizables, un total de 1.087 préstamos hipotecarios tenían una antigüedad de entre cero (0) y tres (3) años. Dichos préstamos hipotecarios tenían un saldo nominal no vencido de 164.735.963,58 euros, lo que representaba un 64,25% del saldo vivo de la Cartera de Activos Titulizables.

Había 1.547 préstamos, que suponían un 87,62% del Saldo Vivo de los Activos que tienen un LTV superior al 80% sobre el total de la(s) garantía(s).

Dado estos niveles de LTV y antigüedad, cualquier circunstancia de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre el precio de los bienes hipotecados podría afectar al valor de la garantía hipotecaria de los Activos que respaldan la emisión.

c) Riesgo de tipo de interés

En la fecha de Constitución de la Serie, el tipo medio de los préstamos de la Cartera de Activos Titulizables era 5,186%, mientras que el tipo medio a pagar por los Bonos en la primera fecha de pago fue de 5,621 % (asumiendo las hipótesis de las Condiciones Finales). El tipo medio de los préstamos varía a lo largo del tiempo en función de los nuevos tipos actualizados de los Préstamos Hipotecarios y de la tasa de amortización de los mismos.

Por lo tanto, es de esperar que la situación descrita (tipo de los activos inferior al tipo de los Bonos) perdure durante un cierto número de meses, aunque esta circunstancia se corrige según se vayan revisando los tipos de la totalidad de los Préstamos Hipotecarios de la cartera.

No obstante lo anterior, la situación descrita se ve compensada en las distintas Fechas de Pago en virtud del Contrato de Swap contratado por el Fondo. En particular, el Fondo cobra por este contrato el Euribor a seis (6) meses más un margen de 0,50% (siendo 5,747% en la primera Fecha de Pago asumiendo las hipótesis de las Condiciones Finales). En posteriores Fechas de Pago tendrá lugar una compensación similar, variable según sean los tipos de los activos y de los Bonos, pero que se mantendrá constante el margen del Fondo.

• **Caja Sur I:**

a) Riesgo de concentración geográfica

En la fecha de Constitución de la Serie, el 84,80% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 31 de diciembre de 2008 fueron concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la Comunidad Autónoma de Andalucía y supusieron un saldo de principal pendiente de pago de 184.184.850,09 euros y en particular un 46,57% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables fueron concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la Provincia de Córdoba y suponían un saldo de principal pendiente de pago de 101.140.549,53 euros. Dado este nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre la Comunidad Autónoma de Andalucía o la Provincia de Córdoba podría afectar a los pagos de los Certificados que respaldan la Emisión.

b) Riesgo de antigüedad y LTV

En la fecha de Constitución de la Serie, la cartera de préstamos a titularizar tenía una antigüedad media de 4 años y un LTV medio ponderado del 88,43%. Dentro de la Cartera de Activos Titulizables, un total de 526 préstamos hipotecarios tenían una antigüedad de entre cero (0) y tres (3) años. Dichos préstamos hipotecarios tenían un saldo nominal no vencido de 82.520.374,21 euros, lo que representaba un 37,99% del saldo vivo de la Cartera de Activos Titulizables.

Había 1.575 préstamos, que suponían un 99,18% del Saldo Vivo de los Activos que tienen un LTV superior al 80% sobre el total de la(s) garantía(s).

Dado estos niveles de LTV y antigüedad, cualquier circunstancia de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre el precio de los bienes hipotecados podría afectar al valor de la garantía hipotecaria de los Activos que respaldan la emisión.

c) Riesgo de Vida Residual

En la fecha de Constitución de la Serie, la cartera de préstamos a titularizar tenía una vida residual media ponderada de 28,24 años. Dado este nivel de vida residual, una evolución negativa continuada del precio de los bienes hipotecados podría afectar al valor de la garantía hipotecaria de los Activos que respaldan la emisión.

d) Riesgo de concentración por deudor respecto al Fondo de Reserva

En la fecha de Constitución de la Serie, el Deudor por mayor importe del conjunto de Deudores suponía un 0,29% de la Cartera de Activos Titulizables.

El conjunto formado por los diez Deudores por mayores importes supuso el 2,14% de la totalidad de la Cartera de Activos Titulizables, es decir, un importe de 4.653.874,41 euros, lo que a su vez suponía un 55,40% del importe inicial del Fondo de Reserva. Dado este nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre estos diez Deudores pudiera afectar a los pagos de los Activos que respaldan la emisión de Bonos.

e) Riesgo de morosidad histórica de la Entidad Cedente

A continuación se Recogen los datos correspondientes a la evolución de la morosidad de la Entidad Cedente (que se recogen asimismo en el Folleto), hasta la fecha de constitución de la Serie en los que se aprecia un incremento sustancial de la morosidad, así como una reducción del porcentaje de cobertura de la misma.

	31/12/2008	31/12/2007	31/12/2006
% DE MOROSIDAD HIPOTECARIA	5,45%	2,30%	2,92%
% COBERTURA/MOROSIDAD	48,38%	173,39%	266,86%

Dada la morosidad de la cartera hipotecaria de la Entidad Cedente y las hipótesis de morosidad asumidas para la elaboración de los cuadros del servicio financiero de la deuda, el sistema de amortización de los Bonos sería secuencial.

De igual forma, dadas las hipótesis de morosidad asumidas en la elaboración de los cuadros del servicio financiero de la deuda, el Fondo de Reserva no se reducirá.

f) Riesgo de insuficiencia de la Cartera de Activos Titulizables

La Sociedad Gestora estimó en la Fecha de Constitución de la Serie, con la información que pudo facilitar la Entidad Cedente relativa a la tasa de amortización y a la mora de los Activos, que el saldo vivo de la cartera a la fecha de verificación de las Condiciones Finales era suficiente para emitir la Serie AYT Colaterales Global Hipotecario Cajasur I con el activo inicial previsto.

• **Caixa Manlleu I:**

a) Riesgo de concentración geográfica

En la fecha de Constitución de la Serie, el 95,84% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables seleccionada con fecha 29 de julio de 2009 fueron concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la Comunidad Autónoma de Cataluña y supusieron un saldo de principal pendiente de pago de 135.251.848,29 euros y en particular un 93,87% del Saldo Vivo de los Activos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables fueron concedidos a Deudores Cedidos domiciliados en la Provincia de Barcelona y suponían un saldo de principal pendiente de pago de 132.482.246,73 euros. Dado este nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre la Comunidad Autónoma de Cataluña o la Provincia de Barcelona podría afectar a los pagos de los Certificados y Participaciones que respaldan la Emisión.

b) Riesgo de antigüedad y LTV

En la fecha de Constitución de la Serie, la cartera de préstamos a titularizar tenía una antigüedad media de 2,82 años y un LTV medio ponderado del 78,87%. Dentro de la Cartera de Activos Titulizables, un total de 344 préstamos hipotecarios tenían una antigüedad de entre cero (0) y tres (3) años. Dichos préstamos hipotecarios tenían un saldo nominal no vencido de 76.020.610,76 euros, lo que representaba un 53,87% del saldo vivo de la Cartera de Activos Titulizables.

A esa fecha había 330 préstamos, que suponían un 44,18% del Saldo Vivo de los Activos que tienen un LTV superior al 80% sobre el total de la(s) garantía(s). De los mismos, 168 préstamos poseían un LTV entre un 80% y un 90% y 162 préstamos un LTV entre el 90% y el 100%, lo que representaba el 22,11% y el 22,07% del Saldo Vivo de los Activos, respectivamente. Existían 2 préstamos con un LTV superior al 100% y supusieron un 0,19% del Saldo Vivo de los Activos.

Dado estos niveles de LTV y antigüedad, cualquier circunstancia de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre el precio de los bienes hipotecados, como la actual situación de desaceleración del mercado hipotecario, podría afectar al valor de la garantía hipotecaria de los Activos que respaldan la emisión.

c) Riesgo de tipo de interés

Debido a la diferencia entre el Tipo de Interés de Referencia de los Bonos y los tipos de referencia de los Activos, así como a las posibles renegociaciones de los Activos, existe la posibilidad de que a lo largo de la vida del Fondo el tipo de interés medio de los Activos sea inferior al tipo de interés medio ponderado de los Bonos. No obstante dicho riesgo se encuentra mitigado por la existencia del Contrato de Swap.

El margen medio de los Activos era inferior al de los Bonos, siendo el margen medio ponderado de la Cartera de Activos Titulizables, en la fecha 29 de julio de 2009, del 0,31% sobre los tipos de referencia de los activos (Euribor a 1 año e IRPH), mientras que el margen medio ponderado de los Bonos del Tramo A, B, C, y D será de 0,377% sobre el Euribor 6 meses.

d) Riesgo de concentración por deudor respecto al Fondo de Reserva

En la fecha de Constitución de la Serie, el Deudor por mayor importe del conjunto de Deudores suponía un 0,51% de la Cartera de Activos Titulizables.

El conjunto formado por los diez y por veinte Deudores por mayores importes suponía el 3,57% y el 6,25%, respectivamente, de la totalidad de la Cartera de Activos Titulizables, es decir, un importe de 5.069.389,55 euros para los diez primeros deudores y de 8.819.615,18 euros para los veinte primeros deudores, lo que a su vez supuso un 47,60% y un 94,07% del importe inicial del Fondo de Reserva para cada uno de ambos casos. Dado este nivel de concentración, una situación de cualquier índole que tenga un efecto negativo sustancial sobre estos veinte Deudores pudiera afectar a los pagos de los Activos que respaldan la emisión de Bonos.

e) Riesgo de morosidad histórica de la Entidad Cedente

A continuación se recogen los datos correspondientes a la evolución de la morosidad de la Entidad Cedente, hasta la fecha de la constitución de la Serie, en los que se aprecia un incremento sustancial de la morosidad, así como una reducción del porcentaje de cobertura de la misma.

	30/06/2009	21/12/2008	31/12/2007
% DE MOROSIDAD HIPOTECARIA	5,52%	3,78%	1,10%
% COBERTURA/MOROSIDAD	40,00%	49,60%	116,63%

Dada la morosidad de la cartera hipotecaria de la Entidad Cedente y las hipótesis de morosidad asumidas para la elaboración de los cuadros del servicio financiero de la deuda, el sistema de amortización de los Bonos sería secuencial.

De igual forma, dadas las hipótesis de morosidad asumidas en la elaboración de los cuadros del servicio financiero de la deuda, el Fondo de Reserva no se reducirá.

f) Riesgo de préstamos para viviendas de protección oficial

Determinados préstamos integrantes de la Cartera de Activos Titulizables fueron concedidos para financiar la adquisición, construcción o rehabilitación de viviendas de protección oficial (VPO), si bien no es posible determinar el número de dichos préstamos ni su saldo vivo, puesto que la Entidad Cedente no los tiene individualizados, al no estar sujetos a ningún convenio de colaboración financiera con la Administración. En todo caso, el valor de tasación considerado en el informe de tasación en relación con dichos préstamos es el máximo legal.

2. Acontecimientos ocurridos posteriormente al cierre del ejercicio y probabilidad de ocurrencia de cualquiera de los supuestos de liquidación anticipada del Fondo

Con posterioridad al cierre del ejercicio y hasta la fecha de formulación de las cuentas anuales no ha ocurrido ningún hecho que afecte o modifique significativamente la información contenida en las cuentas anuales.

3. Instrumentos Financieros: objetivos y mecanismos de cobertura de cada tipo de riesgo significativo para el que se utilice la cobertura

Fondo de Reserva

Como mecanismo de garantía ante posibles pérdidas debidas a Activos y con la finalidad de permitir los pagos a realizar por el Fondo de acuerdo con el Orden de Prelación de Pagos, la Sociedad Gestora, en nombre y representación del Fondo, constituyó en relación con cada Serie un depósito en la Cuenta de Tesorería de dicha Serie denominado Fondo de Reserva.

El importe inicial del Fondo de Reserva se determinó en las Condiciones Finales de la Serie correspondiente y era igual a un porcentaje del saldo vivo inicial de los Bonos de la Serie correspondiente. La dotación inicial del Fondo de Reserva se realizó con cargo al Préstamo Subordinado para Dotación del Fondo de Reserva.

Posteriormente, en cada Fecha de Pago el Fondo de Reserva se ha ido dotando, con cargo a los Fondos Disponibles, de acuerdo con el Orden de Prelación de Pagos, hasta alcanzar la cantidad requerida del Fondo de Reserva, que es la menor de las siguientes cantidades:

- (a) el importe inicial del Fondo de Reserva
- (b) la cantidad mayor entre:
 - (i) el importe equivalente al doble del porcentaje inicial del Fondo de Reserva sobre el importe nominal de los Bonos en la Fecha de Emisión, aplicado sobre el Saldo de Principal Pendiente de Pago de los Bonos en cada Fecha de Pago de la Serie correspondiente.
 - (ii) el importe mínimo del Fondo de Reserva, que es equivalente a un porcentaje sobre el Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Cesión correspondiente que se incluyó en las Condiciones Finales de la Serie correspondiente y que no fue superior al importe inicial del Fondo de Reserva.

Por otro lado el importe del Fondo de Reserva no se reducirá, si concurren en una Fecha de Pago cualquiera de las siguientes circunstancias:

- (a) Que el importe a que asciende la suma del Saldo Vivo de los Activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, deducidos los Activos Fallidos, sea superior a un porcentaje que se determina en las Condiciones Finales, del Saldo Vivo de los Activos que no tengan la consideración de Activos Fallidos en cualquier momento;
- (b) cuando el Saldo Vivo de los Activos (una vez deducidos los Activos Fallidos) en la Fecha de Determinación correspondiente a la Fecha de Pago en curso sea inferior al diez por ciento (10%) del Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Emisión de la Serie correspondiente, sin que se haya ejercitado la opción de amortización anticipada;
- (c) si en la Fecha de Pago anterior, el Fondo de Reserva no se ha dotado en la Cantidad Requerida del Fondo de Reserva;
- (d) que en la Fecha de Determinación correspondiente, el saldo acumulado de los Activos Fallidos sea superior a un porcentaje del Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Cesión, que se determinará en las correspondientes Condiciones Finales;
- (e) que no hubieran transcurrido tres (3) años desde la Fecha de Emisión de la Serie correspondiente.

El importe del Fondo de Reserva permanece depositado en la Cuenta de Tesorería de la Serie correspondiente, de acuerdo con el apartado 3.4.4.1 del Módulo Adicional del Folleto Informativo, remunerada en los términos del Contrato de Prestación de Servicios Financieros.

Contrato de Préstamo Subordinado para Dotación del Fondo de Reserva

La Sociedad Gestora celebró, en representación y por cuenta del Fondo, con la Entidad Cedente correspondiente o con una tercera entidad de crédito, que se determinó en su caso en las Condiciones Finales correspondientes, (en tal concepto, la “Entidad Prestamista”), un contrato de préstamo subordinado (el “Contrato de Préstamo Subordinado para Dotación del Fondo de Reserva”) por un importe igual al importe inicial del Fondo de Reserva (el “Préstamo Subordinado para Dotación del Fondo de Reserva”) para cada una de las Series emitidas.

La entrega por la Entidad Prestamista del importe total del Préstamo Subordinado para Dotación del Fondo de Reserva se realizó en una única disposición en la Fecha de Emisión de la Serie correspondiente, valor mismo día, mediante ingreso en la Cuenta de Tesorería.

El Préstamo Subordinado para Dotación del Fondo de Reserva devenga, desde la Fecha de Disposición del Préstamo Subordinado para Dotación del Fondo de Reserva, intereses a un tipo de interés nominal anual variable fijado semestralmente, que se indica en las Condiciones Finales de la Serie correspondiente, en cada periodo de interés (que coinciden con los Periodos de Devengo de Intereses de los Bonos, a excepción del primer periodo de devengo, que comprende los días transcurridos desde la Fecha de Disposición del Préstamo Subordinado para Dotación del Fondo de Reserva, incluida, hasta la primera Fecha de Pago, excluida).

Los intereses derivados del Préstamo Subordinado para Dotación del Fondo de Reserva resultan pagaderos en cada Fecha de Pago de los Bonos de la Serie correspondiente, con arreglo al Orden de Prelación de Pagos.

Estos intereses se abonan únicamente si el Fondo dispone de Fondos Disponibles suficientes de acuerdo con el Orden de Prelación de Pagos. Los intereses devengados que deben abonarse en una Fecha de Pago determinada se calculan tomando como base: (i) los días efectivos existentes en cada periodo de devengo de intereses y (ii) un año compuesto de trescientos sesenta (360) días.

En ningún caso puede reputarse incumplimiento del Contrato de Préstamo Subordinado para Dotación del Fondo de Reserva (ni de la obligación de pago de intereses en el mismo prevista) la falta de pago de los intereses del préstamo cuando la falta de pago de los mismos se deba a la insuficiencia de Fondos Disponibles de acuerdo con el Orden de

Prelación de Pagos.

La amortización parcial del Préstamo Subordinado para Dotación del Fondo de Reserva se efectúa en cada una de las Fechas de Pago, en una cuantía igual a la diferencia existente entre la Cantidad Requerida del Fondo de Reserva en la Fecha de Pago anterior y la Cantidad Requerida del Fondo de Reserva en la Fecha de Pago en curso, sin perjuicio de la amortización final del mismo en la Fecha de Vencimiento Final de la Serie.

Los intereses devengados y no pagados en una Fecha de Pago se acumulan devengando un interés de demora al mismo tipo que el tipo ordinario del Préstamo Subordinado para Dotación del Fondo de Reserva aplicable durante el correspondiente periodo de interés y se abonan en la siguiente Fecha de Pago, siempre que el Fondo disponga de Fondos Disponibles suficientes de acuerdo con el Orden de Prelación de Pagos.

El Préstamo Subordinado para Dotación del Fondo de Reserva, por su carácter subordinado, está postergado en rango respecto a los pagos que el Fondo deba realizar a los titulares de los Bonos y a los restantes acreedores comunes del Fondo, de conformidad con el Orden de Prelación de Pagos.

El Préstamo Subordinado para Dotación del Fondo de Reserva permanecerá vigente hasta la Fecha de Vencimiento Legal, hasta la fecha anterior en que el Fondo haya devuelto a la Entidad Prestamista cualesquiera cantidades debidas al amparo del Contrato de Préstamo Subordinado para Dotación del Fondo de Reserva y se hayan extinguido completamente las obligaciones del Fondo bajo el mismo con cargo a los Fondos Disponibles de la Serie correspondiente o hasta la fecha anterior en que la Emisión de los Bonos de la Serie correspondiente haya sido amortizada en su totalidad.

Cuenta de Tesorería

La Sociedad Gestora abrió en el Agente Financiero, en nombre y representación del Fondo, una cuenta para cada Serie (en relación con dicha Serie, la “Cuenta de Tesorería”) que se regula en el Contrato de Servicios Financieros, con la finalidad de centralizar los cobros y pagos de cada Serie en los términos que se describen a continuación.

Según lo previsto en el Contrato de Prestación de Servicios Financieros, se ingresará en la Cuenta de Tesorería:

- (i) el importe efectivo por el desembolso de la suscripción de los Bonos de la Serie correspondiente;
- (ii) los pagos correspondientes a principal e intereses de los Activos;
- (iii) cualesquiera otras cantidades ingresadas por el Fondo en virtud de los Activos de dicha Serie;
- (iv) las cantidades que en cada momento compongan el Fondo de Reserva;
- (v) en su caso, las cantidades que resulten pagaderas por la Entidad de Contrapartida al amparo del Contrato de Swap;
- (vi) las cantidades a que asciendan los rendimientos obtenidos por los saldos habidos en la propia Cuenta de Tesorería o las cantidades a que asciendan los rendimientos de activos de renta fija, de acuerdo con lo recogido en el presente apartado;
- (vii) las cantidades procedentes de la disposición del Préstamo Subordinado para Gastos Iniciales;

- (viii) las cantidades a que asciendan las retenciones a cuenta de los rendimientos de capital mobiliario que, en su caso, de acuerdo con la legislación vigente en cada momento durante la vida del Fondo, corresponda efectuar en cada Fecha de Pago por los intereses de los Bonos satisfechos por el Fondo, hasta que corresponda efectuar su ingreso a la Administración Tributaria o se solicite su devolución por parte de los titulares de los Bonos.

De acuerdo con el Contrato de Prestación de Servicios Financieros, el Agente Financiero garantiza al saldo que en cada momento tenga la Cuenta de Tesorería, un rendimiento mínimo al tipo que se indique en las Condiciones Finales de la Serie correspondiente. Los intereses devengados se liquidan semestralmente el primer Día Hábil del mes correspondiente a cada Fecha de Pago y se calculan tomando como base (i) los días efectivos existentes en cada periodo de devengo de intereses (que coincidirán con los semestres naturales que finalizan el último día del mes anterior al correspondiente a cada Fecha de Pago (incluido), excepto para el primer periodo de devengo de intereses que tuvo una duración desde la Fecha de Emisión (excluida) hasta el último día del mes anterior al correspondiente a cada Fecha de Pago (incluido)) y (ii) un año compuesto por 360 días.

Sin perjuicio de lo dispuesto anteriormente, la Sociedad Gestora, con objeto de cubrir los posibles desfases temporales entre el calendario de los flujos de principal e intereses de los Activos y el de los Bonos emitidos, podrá invertir temporalmente el saldo de la Cuenta de Tesorería (hasta la siguiente Fecha de Determinación) mediante la adquisición de activos de renta fija denominados en euros a un plazo inferior al que restase hasta la Fecha de Determinación inmediatamente siguiente a la fecha en que se efectúe la inversión temporal, denominados en euros, emitidos por emisores que cuenten con una calificación crediticia mínima para deuda no subordinada y no garantizada a corto plazo de F1 (FITCH), P-1 (MOODY'S) y A-1 (S&P) (dependiendo de qué Entidades de Calificación califiquen los Bonos de la Serie correspondiente) para valores con plazos inferiores a treinta (30) días naturales, para plazos superiores a (30) días naturales la calificación mínima para deuda no subordinada y no garantizada a corto plazo será de F1+ (FITCH), P-1 (MOODY'S) y A-1+ (S&P) (dependiendo de qué Entidades de Calificación califiquen los Bonos de la Serie correspondiente) siempre y cuando la rentabilidad de la inversión temporal neta de comisiones y otros gastos sea, al menos, igual que la remuneración mínima garantizada del saldo de la Cuenta de Tesorería. En el caso de que los activos en los que se materialice la referida inversión temporal sean repos, la contrapartida de la operación de repo deberá contar con una calificación crediticia mínima de F1+ (FITCH), P-1 (MOODY'S) y A-1+ (S&P) (dependiendo de qué Entidades de Calificación califiquen los Bonos de la Serie correspondiente) para riesgos a corto plazo. En caso de que la Serie correspondiente sea objeto de calificación por S&P, en ningún caso, el saldo vivo total de las inversiones realizadas en activos de renta fija denominados en euros, emitidos por emisores que cuenten con una calificación crediticia mínima para deuda no subordinada a corto plazo de A-1 (STANDARD & POOR'S) podrá superar el 20% del principal pendiente de amortización de los Bonos.

En caso de que en cualquier momento de la Emisión de la Serie correspondiente, la calificación de la deuda no subordinada no garantizada a corto plazo del Agente Financiero descendiera por debajo de F1 (FITCH) o P-1 (MOODY'S) o fuese retirada o cuando S&P considere que la calidad crediticia del Agente Financiero pudiera afectar negativamente a la calificación crediticia de los Bonos (dependiendo de qué Entidades de Calificación califiquen los Bonos de la Serie correspondiente), la Sociedad Gestora, en el plazo de treinta (30) días naturales desde que ocurriera dicha circunstancia actuará de conformidad con lo dispuesto en el apartado 5.2 de la Nota de Valores del Folleto Informativo.

No obstante, la Sociedad Gestora podrá trasladar con posterioridad el saldo de la Cuenta de Tesorería al Agente Financiero sustituido, siempre que obtenga el aval a que se refiere el apartado 5.2 de la Nota de Valores del Folleto Informativo o que el Agente Financiero sustituido recupere la calificación para la deuda a corto plazo de F1 (FITCH), P-1 (MOODY'S) y S&P considere que la calidad crediticia del Agente Financiero no puede afectar negativamente a la calificación crediticia de los Bonos (dependiendo de qué Entidades de Calificación califiquen los Bonos de la Serie correspondiente), previa suscripción de los oportunos documentos.

El Agente Financiero podrá subcontratar o delegar en terceras personas la realización de las funciones señaladas en el presente apartado, siempre que sea legalmente posible y (i) medie el consentimiento previo por escrito de la Sociedad Gestora, en nombre del Fondo, (ii) no suponga una rebaja de las calificaciones otorgadas a los Bonos y siempre que (iii) dicho subcontratista o delegado haya renunciado a ejercitar cualquier acción en demanda de responsabilidad contra el Fondo. Las terceras entidades a las que el Agente Financiero subcontrate dichos servicios deberán comprometerse, en el correspondiente contrato de prestación de servicios, a aceptar y cumplir los términos y condiciones recogidos en el Contrato de Prestación de Servicios Financieros, siendo en todo caso la responsabilidad última del Agente Financiero.

Contrato de Swap

La Sociedad Gestora, por cuenta y en representación del Fondo, ha celebrado en relación con cada Serie con una entidad (la “**Entidad de Contrapartida**”) un contrato de permuta financiera de intereses conforme al modelo de Contrato Marco de Operaciones Financieras (CMOF) de la Asociación de Banca Española (el “**Contrato de Swap**”) con la finalidad de cubrir el riesgo de tipo de interés de la Serie correspondiente.

El principal objetivo del Contrato de Swap es cubrir el riesgo que para el Fondo podría suponer el hecho de que ciertos Activos se encuentran sujetos a tipos de interés y a periodos de revisión y liquidación diferentes al tipo de interés aplicable a los Bonos.

Mediante el Contrato de Swap, la Sociedad Gestora, por cuenta del Fondo, cubre el riesgo de tipo de interés antes aludido en los siguientes términos. Las cantidades a pagar en cada fecha de liquidación por cada una de las partes del Contrato de Swap son las siguientes:

- (a) Cantidad a pagar por el Fondo: es el Importe Variable A (según se define este concepto en el Folleto Informativo).
- (b) Cantidad a pagar por la Entidad de Contrapartida: es el Importe Variable B (según se define este concepto en el Folleto Informativo).

Al ser el Contrato de Swap un acuerdo de compensación contractual, las partes tienen derecho a exigirse en cada Fecha de Pago el saldo neto de las operaciones vencidas al amparo de cada uno de ellos.

Las fechas de liquidación de los intereses que resulten de la aplicación del Contrato de Swap coincidirán con las Fechas de Pago de la Serie correspondiente.

El Contrato de Swap está dividido en sucesivos “**Periodos de Liquidación**”, comprensivos de los días efectivos transcurridos entre cada Fecha de Determinación, incluyendo en cada Periodo de Liquidación la Fecha de Determinación inicial y excluyendo la Fecha de Determinación final. Por excepción, el primer Periodo de Liquidación fue el comprendido entre la Fecha de Emisión de la Serie correspondiente (incluida) y la primera Fecha de Determinación (excluida).

En caso de vencimiento anticipado del Contrato de Swap por causa imputable a la Entidad de Contrapartida, el pago liquidativo, en caso de ser favorable para esta última, se postergará tras la dotación del Fondo de Reserva hasta la Cantidad Requerida del Fondo de Reserva.

La fecha de vencimiento del Contrato de Swap será la primera de las siguientes fechas: (i) la Fecha de Vencimiento Legal o (ii) aquella fecha en que la Sociedad Gestora proceda a la liquidación de la Serie correspondiente o del Fondo de conformidad con lo dispuesto en el apartado 4.4.3 del Documento de Registro del Folleto Informativo.

4. Evolución del fondo

Las cifras contenidas en este apartado pueden verse afectadas por el redondeo al indicarse en miles de euros, según requerimiento de la Circular 2/2016, de 20 de abril de CNMV.

a) Tasas de amortización anticipada de los préstamos titulizados

La tasa de amortización anticipada del activo durante el ejercicio 2016, ha sido la siguiente según Serie:

	Tasa de Amortización Anticipada
BBK I	2,73%
BBK II	3,81%
Caja Vital Kutxa I	2,69%
Sa Nostra I	4,53%
Caja Granada I	20,96%
CCMI	2,20%
Caixa Galicia I	2,36%
Caixa Galicia II	1,69%
Caixa Laietana I	12,00%
Caja Cantabria I	2,62%

Adicionalmente la tasa de amortización histórica del fondo por cada una de las Series se muestra en el cuadro siguiente según Serie:

	Tasa de Amortización Histórica
BBK I	26,74%
BBK II	32,87%
Caja Vital Kutxa I	22,13%
Sa Nostra I	46,41%
Caja Granada I	76,79%
CCM I	29,55%
Caixa Galicia I	40,75%
Caixa Galicia II	47,85%
Caixa Laietana I	62,33%
Caja Cantabria I	21,84%

b) Información relevante en relación con garantías

La distribución según el valor de la razón entre el principal pendiente de amortizar de los Préstamos Hipotecarios y el valor de tasación de los inmuebles hipotecados expresados en tanto por cien, se muestra en el cuadro de la página siguiente:

Cifras en miles de euros

Intervalo	Datos al 31/12/2016				Datos al 31/12/2015			
	Núm.	%	Principal pendiente	%	Núm.	%	Principal pendiente	%
0,01- 40,00	7.010	22,54%	313.219	10,31%	6.349	19,54%	299.548	9,01%
40,01- 60,00	10.560	33,95%	962.477	31,69%	10.082	31,02%	925.369	27,84%
60,01- 80,00	11.278	36,26%	1.407.025	46,33%	12.840	39,51%	1.586.237	47,72%
80,01- 100,00	2.202	7,08%	346.658	11,41%	3.226	9,93%	512.805	15,43%
100,00- 120,00	20	0,06%	3.042	0,10%				
120,00- 140,00	9	0,03%	1.424	0,05%				
140,00- 160,00	6	0,02%	813	0,03%				
Superior al 160,00%	18	0,06%	2.232	0,07%				
Total	31.103	100%	3.036.891	100%	32.497	100%	3.323.959	100%
Media Ponderada		61,48%				0,00%		

c) Información sobre concentración de riesgos

Por deudor

La concentración de riesgos atendiendo al deudor se presenta en el siguiente cuadro:

• **SERIE BBK I**

Datos al 31/12/2016	Datos al 31/12/2015
0,48%	0,46%

• **SERIE BBK II**

Datos al 31/12/2016	Datos al 31/12/2015
0,75%	0,71%

• **SERIE CAIXA GALICIA I**

Datos al 31/12/2016	Datos al 31/12/2015
1,27%	1,23%

- **SERIE CAIXA GALICIA II**

Datos al 31/12/2016	Datos al 31/12/2015
1,03%	1,01%

- **SERIE CAJA CANTABRIA**

Datos al 31/12/2016	Datos al 31/12/2015
2,68%	2,60%

- **SERIE CAJA GRANADA**

Datos al 31/12/2016	Datos al 31/12/2015
2,64%	2,25%

- **SERIE CAJA VITAL KUTXA I**

Datos al 31/12/2016	Datos al 31/12/2015
2,85%	2,78%

- **SERIE CCM I**

Datos al 31/12/2016	Datos al 31/12/2015
1,14%	1,11%

- **SERIE SA NOSTRA**

Datos al 31/12/2016	Datos al 31/12/2015
5,97%	5,63%

Por distribución geográfica

Asimismo la distribución geográfica según la comunidad autónoma donde se ubica el inmueble objeto de la garantía hipotecaria se presenta en el cuadro de la página siguiente:

Cifras en miles de euros

Comunidad Autónoma	Datos al 31/12/2016				Datos al 31/12/2015			
	Núm.	%	Principal pendiente	%	Núm.	%	Principal pendiente	%
Andalucía	1.980	6,37%	175.210	5,77%	2.178	6,70%	199.192	5,99%
Aragón	413	1,33%	42.236	1,39%	422	1,30%	45.291	1,36%
Asturias	118	0,38%	10.119	0,33%	120	0,37%	10.501	0,32%
Baleares	853	2,74%	59.884	1,97%	910	2,80%	65.197	1,96%
Canarias	114	0,37%	12.085	0,40%	116	0,36%	12.634	0,38%
Cantabria	2.300	7,40%	215.679	7,10%	2.348	7,23%	231.461	6,96%
Castilla-León	725	2,33%	70.004	2,31%	733	2,26%	78.742	2,37%
Castilla La Mancha	3.328	10,70%	346.851	11,42%	3.410	10,49%	370.676	11,15%
Cataluña	1.418	4,56%	181.259	5,97%	1.856	5,71%	244.002	7,34%
Ceuta	1	0,00%	200	0,01%	1	0,00%	210	0,01%
Extremadura	141	0,45%	10.436	0,34%	143	0,44%	10.928	0,33%
Galicia	4.586	14,75%	356.011	11,72%	4.691	14,44%	377.855	11,37%
Madrid	3.661	11,77%	442.434	14,57%	3.804	11,71%	480.125	14,45%
Melilla	13	0,04%	1.084	0,04%	15	0,05%	1.370	0,04%
Murcia	192	0,62%	19.978	0,66%	202	0,62%	21.829	0,66%
Navarra	78	0,25%	8.788	0,29%	79	0,24%	9.377	0,28%
La Rioja	301	0,97%	30.197	0,99%	309	0,95%	32.405	0,98%
Comunidad Valenciana	2.178	7,00%	226.238	7,45%	2.236	6,88%	241.043	7,25%
País Vasco	8.700	27,97%	827.766	27,26%	8.921	27,45%	895.676	26,95%
Total España	31.100	99,99%	3.036.462	99,99%	32.494	99,99%	3.323.514	99,99%
Resto	3	0,01%	429	0,01%	3	0,01%	447	0,01%
Total General	31.103	100%	3.036.891	100%	32.497	100%	3.323.961	100%

Por morosidad

La distribución por la antigüedad de la primera cuota vencida y no cobrada de las participaciones hipotecarias en situación de impago, con información del principal pendiente de vencer al 31 de diciembre de 2016 es la siguiente:

Cifras en miles de euros

Antigüedad Deuda	Número Préstamos	Importe impagado				Deuda pendiente vencer	Deuda Total
		Principal	Intereses devengados en contabilidad	Intereses interrumpidos en contabilidad	Total		
Hasta 1 mes	9.648	2.763	619		3.384	915.418	918.858
De 1 a 3 meses	418	336	100		434	47.330	47.783
De 3 a 6 meses	97	139	25	18	184	11.412	11.596
De 6 a 9 meses	49	129	19	35	184	5.835	6.019
De 9 a 12 meses	57	498	19	48	562	6.189	6.749
Más de 12 meses	712	44.345	418	2.668	47.428	47.063	94.493
Totales	10.981	48.211	1.195	2.770	52.177	1.033.248	1.085.499

Por rentabilidad

El rendimiento de los Préstamos Hipotecarios durante el ejercicio 2016 es el siguiente:

Índice de referencia	31/12/2016	31/12/2015
Nº Activos vivos (Uds.)	31.103	32.059
Importe pendiente (euros)	3.036.891	3.266.788
Tipo de interés medio ponderado (%)	0,85	1,36
Tipo de interés nominal máximo (%)	6,5	6,75
Tipo de interés nominal mínimo (%)	0,19	0,39

d) Cantidades abonadas a los bonistas en cada una de las fechas de pago y tipos de interés de los bonos al cierre del ejercicio

Los Bonos de titulización se emitieron por el siguiente importe nominal repartidos en las series que se muestran en el cuadro de las páginas siguientes:

- **BBK I**

Cifras en miles de euros

	SERIE A			SERIE B		
	ES0312273008			ES0312273016		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
22/09/2016	4.378	28.151	714.171	531	0	81.000
22/03/2016	4.515	31.560	742.322	525	0	81.000
22/09/2015	4.731	32.631	773.881	528	0	81.000
23/03/2015	4.897	32.882	806.513	525	0	81.000
22/09/2014	5.058	27.550	839.394	525	0	81.000
24/03/2014	5.255	33.786	866.944	525	0	81.000
23/09/2013	5.519	29.976	900.730	534	0	81.000
22/03/2013	3.105	52.611	930.706	308	0	81.000
24/09/2012	6.809	25.815	983.317	601	0	81.000
22/03/2012	10.035	31.752	1.009.132	834	0	81.000
22/09/2011	9.069	35.108	1.040.884	737	0	81.000
22/03/2011	7.344	39.867	1.075.992	586	0	81.000
22/09/2010	6.643	1.422	1.158.056	518	0	81.000
22/03/2010	7.245	36.406	1.159.479	544	0	81.000
22/09/2009	12.032	35.673	1.195.885	845	0	81.000
23/03/2009	34.536	35.126	1.231.558	2.262	0	81.000
22/09/2008	31.651	39.400	1.266.684	2.016	0	81.000
25/03/2008	33.704	49.240	1.306.084	2.068	0	81.000
24/09/2007	24.953	35.876	1.355.324	1.497	0	81.000

	SERIE C			SERIE D		
	ES0312273024			ES0312273032		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
22/09/2016	112	0	13.500	216	0	14.300
22/03/2016	111	0	13.500	214	0	14.300
22/09/2015	112	0	13.500	215	0	14.300
23/03/2015	111	0	13.500	214	0	14.300
22/09/2014	111	0	13.500	214	0	14.300
24/03/2014	111	0	13.500	214	0	14.300
23/09/2013	113	0	13.500	217	0	14.300
22/03/2013	75	0	13.500	175	0	14.300
24/09/2012	125	0	13.500	232	0	14.300
22/03/2012	163	0	13.500	270	0	14.300
22/09/2011	147	0	13.500	254	0	14.300
22/03/2011	121	0	13.500	226	0	14.300
22/09/2010	110	0	13.500	216	0	14.300
22/03/2010	114	0	13.500	218	0	14.300
22/09/2009	165	0	13.500	273	0	14.300
23/03/2009	401	0	13.500	522	0	14.300
22/09/2008	360	0	13.500	478	0	14.300
25/03/2008	369	0	13.500	489	0	14.300
24/09/2007	269	0	13.500	367	0	14.300

- **BBK II**

Cifras en miles de euros

	SERIE A			SERIE B		
	ES0312273362			ES0312273370		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
02/12/2016	3.077	21.830	450.242	245	0	30.500
02/06/2016	3.251	26.767	472.072	245	0	30.500
02/12/2015	3.410	24.348	498.839	245	0	30.500
02/06/2015	3.586	30.069	523.187	243	0	30.500
02/12/2014	3.763	24.125	553.257	245	0	30.500
02/06/2014	3.917	26.866	577.382	243	0	30.500
03/12/2013	4.066	23.021	604.247	243	0	30.500
02/12/2013	4.066	23.021	604.247	243	0	30.500
03/06/2013	2.178	40.623	627.269	146	0	30.500
03/12/2012	4.355	23.473	667.892	238	0	30.500
04/06/2012	7.401	28.356	691.365	361	0	30.500
02/12/2011	7.644	27.701	719.721	358	0	30.500
02/06/2011	6.154	32.817	747.421	287	0	30.500
02/12/2010	5.323	32.164	780.238	246	0	30.500
02/06/2010	5.554	35.880	812.403	246	0	30.500
02/12/2009	7.894	31.509	848.282	320	0	30.500
02/06/2009	19.414	35.191	879.792	693	0	30.500
02/12/2008	31.492	40.518	914.982	1.065	0	30.500

	SERIE C			SERIE D		
	ES0312273388			ES0312273396		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
02/12/2016	70	0	7.000	105	0	7.000
02/06/2016	70	0	7.000	105	0	7.000
02/12/2015	70	0	7.000	105	0	7.000
02/06/2015	70	0	7.000	105	0	7.000
02/12/2014	70	0	7.000	105	0	7.000
02/06/2014	70	0	7.000	105	0	7.000
03/12/2013	70	0	7.000	105	0	7.000
02/12/2013	70	0	7.000	105	0	7.000
03/06/2013	48	0	7.000	83	0	7.000
03/12/2012	69	0	7.000	104	0	7.000
04/06/2012	97	0	7.000	133	0	7.000
02/12/2011	97	0	7.000	132	0	7.000
02/06/2011	80	0	7.000	115	0	7.000
02/12/2010	71	0	7.000	106	0	7.000
02/06/2010	71	0	7.000	106	0	7.000
02/12/2009	88	0	7.000	123	0	7.000
02/06/2009	173	0	7.000	209	0	7.000
02/12/2008	263	0	7.000	308	0	7.000

Caixa Galicia I

Cifras en miles de euros

	SERIE A			SERIE B		
	ES0312273289			ES0312273297		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
21/11/2016	0	0	0	0	0	0
18/07/2016	488	12.724	377.842	102	0	36.900
18/01/2016	725	13.865	390.566	123	0	36.900
17/07/2015	960	14.208	404.432	140	0	36.900
19/01/2015	1.359	15.253	418.640	173	0	36.900
17/07/2014	1.575	15.464	433.893	185	0	36.900
17/01/2014	1.611	49.506	449.357	176	0	36.900
17/07/2013	1.673	20.174	498.863	175	0	36.900
17/01/2013	2.941	20.242	519.038	258	0	36.900
17/07/2012	5.117	18.676	539.280	394	0	36.900
17/01/2012	6.205	18.637	557.955	453	0	36.900
18/07/2011	4.602	18.738	576.593	341	0	36.900
17/01/2011	4.386	23.889	595.331	317	0	36.900
19/07/2010	4.214	31.490	619.220	295	0	36.900
18/01/2010	5.316	29.819	650.710	345	0	36.900
17/07/2009	10.573	59.875	680.528	582	0	36.900
19/01/2009	22.382	55.929	740.403	1.094	0	36.900
17/07/2008	14.009	29.867	796.333	665	0	36.900

	SERIE C			SERIE D		
	ES0312273305			ES0312273313		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
21/11/2016	0	0	0	0	0	0
18/07/2016	103	0	21.600	151	0	15.300
18/01/2016	116	0	21.600	161	0	15.300
17/07/2015	125	0	21.600	164	0	15.300
19/01/2015	146	0	21.600	182	0	15.300
17/07/2014	152	0	21.600	184	0	15.300
17/01/2014	147	0	21.600	182	0	15.300
17/07/2013	146	0	21.600	180	0	15.300
17/01/2013	195	0	21.600	216	0	15.300
17/07/2012	275	0	21.600	272	0	15.300
17/01/2012	309	0	21.600	297	0	15.300
18/07/2011	243	0	21.600	250	0	15.300
17/01/2011	229	0	21.600	240	0	15.300
19/07/2010	216	0	21.600	231	0	15.300
18/01/2010	246	0	21.600	253	0	15.300
17/07/2009	384	0	21.600	348	0	15.300
19/01/2009	685	0	21.600	564	0	15.300
17/07/2008	420	0	21.600	353	0	15.300

- **Caixa Galicia II**

Cifras en miles de euros

	SERIE A			SERIE B		
	ES0312273404			ES0312273412		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
21/11/2016	0	0	0	0	0	0
27/10/2016	280	10.484	343.157	103	0	44.600
27/04/2016	574	10.849	353.641	138	0	44.600
27/10/2015	699	11.486	364.490	151	0	44.600
27/04/2015	964	14.678	375.976	178	0	44.600
27/10/2014	1.515	16.089	390.654	234	0	44.600
28/04/2014	1.404	25.268	406.742	213	0	44.600
28/10/2013	1.487	43.788	432.010	207	0	44.600
29/04/2013	1.762	23.448	475.799	225	0	44.600
29/10/2012	3.495	16.823	499.246	371	0	44.600
27/04/2012	5.668	17.964	516.070	541	0	44.600
27/10/2011	5.422	13.193	534.034	510	0	44.600
27/04/2011	4.485	23.957	547.227	418	0	44.600
27/10/2010	3.800	23.534	571.185	353	0	44.600
27/04/2010	4.243	41.558	594.718	365	0	44.600
27/10/2009	6.695	56.865	636.277	499	0	44.600
27/04/2009	21.949	127.272	693.142	1.261	0	44.600
27/10/2008	14.979	34.587	820.413	826	0	44.600

	SERIE C			SERIE D		
	ES0312273420			ES0312273438		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
21/11/2016	0	0	0	0	0	0
27/10/2016	165	0	38.000	117	0	12.400
27/04/2016	195	0	38.000	127	0	12.400
27/10/2015	206	0	38.000	130	0	12.400
27/04/2015	228	0	38.000	137	0	12.400
27/10/2014	276	0	38.000	153	0	12.400
28/04/2014	258	0	38.000	147	0	12.400
28/10/2013	253	0	38.000	145	0	12.400
29/04/2013	269	0	38.000	150	0	12.400
29/10/2012	394	0	38.000	192	0	12.400
27/04/2012	539	0	38.000	239	0	12.400
27/10/2011	512	0	38.000	230	0	12.400
27/04/2011	433	0	38.000	204	0	12.400
27/10/2010	378	0	38.000	186	0	12.400
27/04/2010	388	0	38.000	189	0	12.400
27/10/2009	502	0	38.000	227	0	12.400
27/04/2009	1.151	0	38.000	438	0	12.400
27/10/2008	754	0	38.000	287	0	12.400

- **Caixa Laietana I**

Cifras en miles de euros

	SERIE A			SERIE B		
	ES0312273487			ES0312273495		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
14/07/2016	14	27.431	0	19	13.500	0
29/03/2016	55	4.540	27.431	44	0	13.500
25/09/2015	72	3.995	31.971	48	0	13.500
25/03/2015	103	6.164	35.966	53	0	13.500
25/09/2014	184	7.809	42.130	70	0	13.500
25/03/2014	184	7.456	49.940	64	0	13.500
25/09/2013	209	7.228	57.396	64	0	13.500
25/03/2013	276	7.869	64.624	72	0	13.500
25/09/2012	641	16.298	72.493	118	0	13.500
26/03/2012	1.079	16.138	88.791	159	0	13.500
26/09/2011	1.067	10.387	104.929	146	0	13.500
25/03/2011	862	5.411	115.316	117	0	13.500
27/09/2010	814	5.483	120.727	108	0	13.500
25/03/2010	889	7.146	126.211	110	0	13.500
25/09/2009	1.459	8.558	133.356	160	0	13.500
25/03/2009	5.455	3.486	141.914	534	0	13.500

	SERIE C			SERIE D		
	ES0312273503			ES0312273511		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
14/07/2016	13	5.100	0	33	6.000	0
29/03/2016	27	0	5.100	63	0	6.000
25/09/2015	28	0	5.100	64	0	6.000
25/03/2015	30	0	5.100	66	0	6.000
25/09/2014	37	0	5.100	74	0	6.000
25/03/2014	34	0	5.100	70	0	6.000
25/09/2013	35	0	5.100	72	0	6.000
25/03/2013	37	0	5.100	74	0	6.000
25/09/2012	55	0	5.100	95	0	6.000
26/03/2012	70	0	5.100	113	0	6.000
26/09/2011	66	0	5.100	108	0	6.000
25/03/2011	54	0	5.100	94	0	6.000
27/09/2010	51	0	5.100	91	0	6.000
25/03/2010	52	0	5.100	91	0	6.000
25/09/2009	71	0	5.100	114	0	6.000
25/03/2009	216	0	5.100	294	0	6.000

- **Caja Cantabria I**

Cifras en miles de euros

	SERIE A			SERIE B		
	ES0312273446			ES0312273453		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
20/09/2016	101	4.533	113.583	30	0	12.700
21/03/2016	210	5.304	118.116	41	0	12.700
21/09/2015	262	5.855	123.420	45	0	12.700
20/03/2015	328	6.041	129.275	50	0	12.700
22/09/2014	515	4.949	135.317	66	0	12.700
20/03/2014	469	5.575	140.265	60	0	12.700
20/09/2013	485	5.832	145.840	60	0	12.700
20/03/2013	613	5.384	151.673	69	0	12.700
20/09/2012	1.212	4.454	157.057	115	0	12.700
20/03/2012	1.708	4.400	161.511	150	0	12.700
20/09/2011	1.540	4.436	165.911	134	0	12.700
21/03/2011	1.282	5.897	170.347	112	0	12.700
20/09/2010	1.156	6.501	176.244	100	0	12.700
22/03/2010	1.275	5.557	182.745	105	0	12.700
21/09/2009	2.057	5.699	188.302	154	0	12.700
20/03/2009	7.894	9.499	194.001	519	0	12.700

	SERIE C			SERIE D		
	ES0312273461			ES0312273479		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
20/09/2016	45	0	10.300	33	0	3.500
21/03/2016	54	0	10.300	36	0	3.500
21/09/2015	58	0	10.300	38	0	3.500
20/03/2015	61	0	10.300	38	0	3.500
22/09/2014	75	0	10.300	44	0	3.500
20/03/2014	69	0	10.300	41	0	3.500
20/09/2013	70	0	10.300	42	0	3.500
20/03/2013	76	0	10.300	44	0	3.500
20/09/2012	114	0	10.300	57	0	3.500
20/03/2012	142	0	10.300	66	0	3.500
20/09/2011	130	0	10.300	62	0	3.500
21/03/2011	111	0	10.300	56	0	3.500
20/09/2010	102	0	10.300	52	0	3.500
22/03/2010	106	0	10.300	54	0	3.500
21/09/2009	146	0	10.300	68	0	3.500
20/03/2009	450	0	10.300	178	0	3.500

- **Caja Granada I**

Cifras en miles de euros

	SERIE A			SERIE B		
	ES0312273164			ES0312273172		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
21/11/2016	41	10.115	66.001	42	0	18.000
20/05/2016	107	13.861	76.115	53	0	18.000
20/11/2015	202	39.451	89.976	60	0	18.000
20/05/2015	333	24.036	129.427	71	0	18.000
20/11/2014	586	20.327	153.463	93	0	18.000
20/05/2014	535	13.357	173.790	83	0	18.000
20/11/2013	569	14.925	187.148	83	0	18.000
20/05/2013	659	14.371	202.072	87	0	18.000
20/11/2012	1.401	8.493	216.443	144	0	18.000
21/05/2012	2.289	8.419	224.936	208	0	18.000
21/11/2011	2.537	18.171	233.355	214	0	18.000
20/05/2011	1.990	11.973	251.526	167	0	18.000
22/11/2010	1.800	19.212	263.499	147	0	18.000
20/05/2010	1.850	14.806	282.711	144	0	18.000
20/11/2009	2.699	14.569	297.517	188	0	18.000
20/05/2009	7.429	18.900	312.086	436	0	18.000
20/11/2008	9.189	18.123	330.986	506	0	18.000
20/05/2008	8.397	19.991	349.109	438	0	18.000

	SERIE C			SERIE D		
	ES0312273180			ES0312273198		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
21/11/2016	56	0	8.000	58	0	4.800
20/05/2016	60	0	8.000	60	0	4.800
20/11/2015	64	0	8.000	63	0	4.800
20/05/2015	68	0	8.000	65	0	4.800
20/11/2014	78	0	8.000	71	0	4.800
20/05/2014	73	0	8.000	68	0	4.800
20/11/2013	74	0	8.000	69	0	4.800
20/05/2013	75	0	8.000	69	0	4.800
20/11/2012	101	0	8.000	85	0	4.800
21/05/2012	129	0	8.000	102	0	4.800
21/11/2011	132	0	8.000	104	0	4.800
20/05/2011	110	0	8.000	90	0	4.800
22/11/2010	103	0	8.000	86	0	4.800
20/05/2010	100	0	8.000	84	0	4.800
20/11/2009	120	0	8.000	97	0	4.800
20/05/2009	230	0	8.000	162	0	4.800
20/11/2008	262	0	8.000	182	0	4.800
20/05/2008	226	0	8.000	157	0	4.800

- **Caja Vital Kutxa I**

Cifras en miles de euros

	SERIE A			SERIE B		
	ES0312273081			ES0312273099		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
16/11/2016	13	4.117	95.395	10	0	12.600
17/05/2016	84	4.377	99.512	19	0	12.600
16/11/2015	125	4.038	103.889	23	0	12.600
18/05/2015	197	3.961	107.927	30	0	12.600
17/11/2014	357	3.999	111.888	47	0	12.600
16/05/2014	290	3.480	115.887	39	0	12.600
18/11/2013	301	3.762	119.367	39	0	12.600
16/05/2013	340	4.792	123.129	42	0	12.600
16/11/2012	778	4.723	127.921	82	0	12.600
16/05/2012	1.288	4.696	132.644	126	0	12.600
16/11/2011	1.346	3.516	137.340	129	0	12.600
16/05/2011	1.062	5.278	140.856	100	0	12.600
16/11/2010	876	4.311	146.135	82	0	12.600
17/05/2010	912	4.983	150.446	82	0	12.600
16/11/2009	1.325	3.540	155.429	113	0	12.600
18/05/2009	3.693	4.123	158.969	294	0	12.600
17/11/2008	4.329	3.749	163.092	335	0	12.600
16/05/2008	4.132	5.276	166.841	311	0	12.600
16/11/2007	2.422	3.183	172.117	179	0	12.600

	SERIE C			SERIE D		
	ES0312273107			ES0312273115		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
16/11/2016	21	0	8.200	36	0	3.800
17/05/2016	27	0	8.200	38	0	3.800
16/11/2015	29	0	8.200	40	0	3.800
18/05/2015	34	0	8.200	42	0	3.800
17/11/2014	45	0	8.200	47	0	3.800
16/05/2014	40	0	8.200	44	0	3.800
18/11/2013	40	0	8.200	45	0	3.800
16/05/2013	42	0	8.200	45	0	3.800
16/11/2012	68	0	8.200	58	0	3.800
16/05/2012	97	0	8.200	71	0	3.800
16/11/2011	98	0	8.200	72	0	3.800
16/05/2011	79	0	8.200	63	0	3.800
16/11/2010	68	0	8.200	57	0	3.800
17/05/2010	68	0	8.200	57	0	3.800
16/11/2009	88	0	8.200	67	0	3.800
18/05/2009	206	0	8.200	121	0	3.800
17/11/2008	233	0	8.200	134	0	3.800
16/05/2008	217	0	8.200	126	0	3.800
16/11/2007	126	0	8.200	74	0	3.800

- **CCM I**

Cifras en miles de euros

	SERIE A			SERIE B		
	ES0312273248			ES0312273255		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
28/11/2016	2.206	14.782	325.603	364	0	45.600
30/05/2016	2.313	16.382	340.385	364	0	45.600
30/11/2015	2.456	13.900	356.767	372	0	45.600
28/05/2015	2.486	15.019	370.667	362	0	45.600
28/11/2014	2.613	13.016	385.686	368	0	45.600
28/05/2014	2.697	19.640	398.702	362	0	45.600
28/11/2013	2.865	18.815	418.341	368	0	45.600
28/05/2013	1.524	29.854	437.157	218	0	45.600
28/11/2012	3.147	21.729	467.011	364	0	45.600
28/05/2012	5.182	23.229	488.739	531	0	45.600
28/11/2011	5.392	18.114	511.969	533	0	45.600
30/05/2011	4.385	25.223	530.083	429	0	45.600
29/11/2010	3.831	23.111	555.305	372	0	45.600
28/05/2010	3.962	37.412	578.416	361	0	45.600
30/11/2009	5.992	40.550	615.828	487	0	45.600
28/05/2009	14.541	23.142	656.379	1.045	0	45.600
28/11/2008	18.643	18.982	679.521	1.287	0	45.600
28/05/2008	15.013	17.497	698.503	1.013	0	45.600

	SERIE C			SERIE D		
	ES0312273263			ES0312273271		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
28/11/2016	349	0	28.000	182	0	10.400
30/05/2016	349	0	28.000	182	0	10.400
30/11/2015	357	0	28.000	185	0	10.400
28/05/2015	347	0	28.000	181	0	10.400
28/11/2014	353	0	28.000	183	0	10.400
28/05/2014	347	0	28.000	181	0	10.400
28/11/2013	353	0	28.000	183	0	10.400
28/05/2013	260	0	28.000	149	0	10.400
28/11/2012	352	0	28.000	184	0	10.400
28/05/2012	453	0	28.000	221	0	10.400
28/11/2011	455	0	28.000	221	0	10.400
30/05/2011	391	0	28.000	198	0	10.400
29/11/2010	358	0	28.000	186	0	10.400
28/05/2010	347	0	28.000	181	0	10.400
30/11/2009	429	0	28.000	213	0	10.400
28/05/2009	768	0	28.000	338	0	10.400
28/11/2008	919	0	28.000	395	0	10.400
28/05/2008	726	0	28.000	313	0	10.400

- **Sa Nostra**

Cifras en miles de euros

	SERIE A			SERIE B		
	ES0312273123			ES0312273131		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
16/11/2016	5	2.044	34.266	5	0	6.288
17/05/2016	30	970	36.310	11	1.112	6.288
16/11/2015	46	2.474	37.281	13	0	7.400
18/05/2015	75	2.653	39.754	18	0	7.400
17/11/2014	140	3.133	42.407	28	0	7.400
16/05/2014	117	2.434	45.540	23	0	7.400
18/11/2013	124	2.575	47.975	23	0	7.400
16/05/2013	140	2.198	50.549	24	0	7.400
16/11/2012	324	2.506	52.747	48	0	7.400
16/05/2012	555	3.894	55.253	74	0	7.400
16/11/2011	607	4.350	59.147	76	0	7.400
16/05/2011	489	3.696	63.498	59	0	7.400
16/11/2010	413	3.783	67.193	48	0	7.400
17/05/2010	445	4.838	70.976	48	0	7.400
16/11/2009	670	4.535	75.814	67	0	7.400
18/05/2009	1.953	5.899	80.349	172	0	7.400
17/11/2008	2.341	3.970	86.248	197	0	7.400
16/05/2008	2.285	4.949	90.218	183	0	7.400
16/11/2007	1.311	2.233	95.167	102	0	7.400

	SERIE C			SERIE D		
	ES0312273149			ES0312273156		
	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO	INTERESES	CAPITAL	SALDO PRINCIPAL PENDIENTE DE PAGO
16/11/2016	7	0	2.636	10	0	1.100
17/05/2016	10	464	2.636	11	0	1.100
16/11/2015	11	0	3.100	11	0	1.100
18/05/2015	13	0	3.100	12	0	1.100
17/11/2014	17	0	3.100	14	0	1.100
16/05/2014	15	0	3.100	13	0	1.100
18/11/2013	15	0	3.100	13	0	1.100
16/05/2013	16	0	3.100	13	0	1.100
16/11/2012	26	0	3.100	17	0	1.100
16/05/2012	37	0	3.100	20	0	1.100
16/11/2011	37	0	3.100	21	0	1.100
16/05/2011	30	0	3.100	18	0	1.100
16/11/2010	26	0	3.100	17	0	1.100
17/05/2010	26	0	3.100	17	0	1.100
16/11/2009	33	0	3.100	19	0	11.000
18/05/2009	78	0	3.100	35	0	1.100
17/11/2008	88	0	3.100	39	0	1.100
16/05/2008	82	0	3.100	37	0	1.100
16/11/2007	46	0	3.100	21	0	1.100

e) Calificación crediticia de los Bonos emitidos por el fondo

El detalle de las calificaciones obtenidas por los Bonos emitidos por el fondo por cada una de las series se muestra a continuación:

• **BBK I**

Denominación	A	A	B	C	D
Serie	ES0312273008	ES0312273008	ES0312273016	ES0312273024	ES0312273032
Fecha último cambio de calificación crediticia	07/03/2016	14/05/2016	29/04/2013	29/04/2013	29/04/2013
Agencia de calificación crediticia	Fitch	Moody's	Moody's	Moody's	Moody's
Calificación - Situación actual	A-	Aa2	Ba3	B3	Caa3
Calificación - Situación cierre anual anterior	A-	Aa3	Ba3	B3	Caa3
Calificación - Situación inicial	A-	Aaa	Baa2	Ba2	B3

• **BBK II**

Denominación	A	A	B	B	C	D
Serie	ES0312273362	ES0312273362	ES0312273370	ES0312273370	ES0312273388	ES0312273396
Fecha último cambio de calificación crediticia	23/12/2016	14/05/2016	23/12/2016	25/09/2014	23/01/2015	10/07/2015
Agencia de calificación crediticia	Fitch	Moody's	Fitch	Moody's	Moody's	Moody's
Calificación - Situación actual	A-	Aa2	B	Ba2	B1	Caa1
Calificación - Situación cierre anual anterior	AA-	Aa2	BBB	Ba2	B3	Caa2
Calificación - Situación inicial	AA-	Aa2	BB	A2	Baa3	Ba2

- **Sa Nostra I**

Denominación	A	A	B	C	D
Serie	ES0312273123	ES0312273123	ES0312273131	ES0312273149	ES0312273156
Fecha último cambio de calificación crediticia	17/05/2013	08/01/2015	17/05/2013	17/05/2013	18/04/2011
Agencia de calificación crediticia	Fitch	Standard & Poor's	Fitch	Fitch	Fitch
Calificación - Situación actual	A	BBB	BBB	BB	B
Calificación - Situación cierre anual anterior	A	A-	BBB	BB	B
Calificación - Situación inicial	AAA	A	A	BBB-	BB-

- **Caja Vital Kutxa I**

Denominación	A	A	B	B	C	C	D	D
Serie	ES0312273081	ES0312273081	ES0312273099	ES0312273099	ES0312273107	ES0312273107	ES0312273115	ES0312273115
Fecha último cambio de calificación crediticia	30/06/2015	23/01/2015	12/12/2016	10/07/2015	12/12/2016	10/07/2015	12/12/2016	08/10/2010
Agencia de calificación crediticia	Fitch	Moody's	Fitch	Moody's	Fitch	Moody's	Fitch	Moody's
Calificación - Situación actual	AA	Aa2	BBB	A3	B	B2	CCC	C
Calificación - Situación cierre anual anterior	AA	Aa2	A	A3	BB	B2	B	C
Calificación - Situación inicial	AAA	Aaa	A	Ba3	BBB-	B3	BB-	C

- **Granada I**

Denominación	A	A	B	B	C	C	D	D
Serie	ES0312273164	ES0312273164	ES0312273172	ES0312273172	ES0312273180	ES0312273180	ES0312273198	ES0312273198
Fecha último cambio de calificación crediticia	26/03/2015	23/01/2015	26/03/2015	10/07/2015	26/03/2015	13/12/2010	26/03/2015	13/12/2010
Agencia de calificación crediticia	Fitch	Moody's	Fitch	Moody's	Fitch	Moody's	Fitch	Moody's
Calificación - Situación actual	A-	A1	B	B1	CCC	Caa3	CC	C
Calificación - Situación cierre anual anterior	A-	A1	B	B1	CCC	Caa3	CC	C
Calificación - Situación inicial	AAA	Aa2	A	Ba1	BBB-	Caa3	BB-	C

- **CCM I**

Denominación	A	A	B	C	D
Serie	ES0312273248	ES0312273248	ES0312273255	ES0312273263	ES0312273271
Fecha último cambio de calificación crediticia	17/05/2013	29/04/2016	17/05/2013	17/04/2012	17/04/2012
Agencia de calificación crediticia	Fitch	Standard & Poor's	Fitch	Fitch	Fitch
Calificación - Situación actual	A-	AA-	BB	CCC	CC
Calificación - Situación cierre anual anterior	A-	A	BB	CCC	CC
Calificación - Situación inicial	AAA	AA	A	BBB-	BB

- **Caja Cantabria I**

Denominación	A	A	B	B	C	C	D	D
Serie	ES0312273446	ES0312273446	ES0312273453	ES0312273453	ES0312273461	ES0312273461	ES0312273479	ES0312273479
Fecha último cambio de calificación crediticia	15/10/2012	10/07/2015	17/05/2013	10/07/2015	13/04/2015	10/07/2015	13/04/2015	01/03/2011
Agencia de calificación crediticia	Fitch	Moody's	Fitch	Moody's	Fitch	Moody's	Fitch	Moody's
Calificación - Situación actual	A+	Aa2	BBB+	Baa2	B	Caa1	CCC	C
Calificación - Situación cierre anual anterior	A+	Aa2	BBB+	Ba1	BB	Caa1	CCC	C
Calificación - Situación inicial	AAA	Aaa	A	B2	BBB-	Caa1	BB-	C

- **Caixa Galicia I**

Denominación	A	A	B	B	C	C	D	D
Serie	ES0312273289	ES0312273289	ES0312273297	ES0312273297	ES0312273305	ES0312273305	ES0312273313	ES0312273313
Fecha último cambio de calificación crediticia	30/06/2015	23/01/2015	10/03/2008	14/05/2016	17/05/2013	14/05/2016	17/05/2013	14/05/2016
Agencia de calificación crediticia	Fitch	Moody's	Fitch	Moody's	Fitch	Moody's	Fitch	Moody's
Calificación - Situación actual	AA+	Aa2	A	A2	BB+	Ba2	B+	Caa2
Calificación - Situación cierre anual anterior	AA	A1	A	A3	BB+	B1	B+	Ca
Calificación - Situación inicial	AAA	Aaa	A	Baa2	BBB-	Ba3	BB-	Ca

- **Caixa Galicia II**

Denominación	A	A	B	B	C	C	D	D
Serie	ES0312273404	ES0312273404	ES0312273412	ES0312273412	ES0312273420	ES0312273420	ES0312273438	ES0312273438
Fecha último cambio de calificación crediticia	07/03/2016	23/01/2015	14/07/2008	10/07/2015	17/05/2013	23/01/2015	06/09/2012	10/07/2015
Agencia de calificación crediticia	Fitch	Moody's	Fitch	Moody's	Fitch	Moody's	Fitch	Moody's
Calificación - Situación actual	AA+	Aa2	A	Aa3	BB-	Ba1	B	Caa1
Calificación - Situación cierre anual anterior	AA-	Aa2	A	Aa3	BB-	Ba1	B	Caa1
Calificación - Situación inicial	AAA	Aaa	A	Baa3	BBB-	B1	BB-	Caa3

f) Variaciones o acciones realizadas por las diferentes agencias de calificación crediticia respecto de los bonos emitidos por el fondo, respecto del cedente, de los administradores, agentes de pagos o contrapartidas de las permutas financieras existentes o cualquier otra contrapartida de contratos suscritos por la sociedad gestora en nombre del fondo

	Variaciones
BBK I	Durante el ejercicio 2016 el fondo se ha visto afectado por una variación de las calificaciones de los bonos A, tal y como se recoge en el apartado anterior.
BBK II	Durante el ejercicio 2016 el fondo se ha visto afectado por una variación de las calificaciones de los bonos A y B, tal y como se recoge en el apartado anterior.
Sa Nostra	Durante el ejercicio 2016 el fondo no se ha visto afectado por una variación de las calificaciones de los bonos, tal y como se recoge en el apartado anterior.
Vital I	Durante el ejercicio 2016 el fondo se ha visto afectado por una variación de las calificaciones de los bonos B, C y D tal y como se recoge en el apartado anterior.
Granada I	Durante el ejercicio 2016 el fondo no se ha visto afectado por una variación de las calificaciones de los bonos, tal y como se recoge en el apartado anterior.
CCM I	Durante el ejercicio 2016 el fondo se ha visto afectado por variación de las calificaciones de los bonos de la serie A, tal y como se recoge en el apartado anterior.
Caja Cantabria I	Durante el ejercicio 2016 el fondo no se ha visto afectado por una variación de las calificaciones de los bonos, tal y como se recoge en el apartado anterior.
Caixa Galicia I	Durante el ejercicio 2016 el fondo se ha visto afectado por una variación de las calificaciones de los bonos B, C y D, tal y como se recoge en el apartado anterior.
Caixa Galicia II	Durante el ejercicio 2016 el fondo se ha visto afectado por una variación de las calificaciones de los bonos A, tal y como se recoge en el apartado anterior.

g) Saldos de cartera de préstamos titulizados

Se refleja a continuación el cuadro estadístico de la cartera de activos cedidos al fondo:

• **SERIE BBKI**

Saldo Nominal Titulizado	1.500.000
Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento	811.282
Porcentaje de Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento/ Saldo Nominal Titulizado	54,09%
Saldo Nominal Pendiente de Cobro	824.548
Porcentaje de Saldo Nominal Pendiente de Cobro/ Saldo Nominal Titulizado	54,97%
Amortizaciones Acumuladas desde origen del Fondo	675.452

• **SERIE BBK II**

Saldo Nominal Titulizado	1.000.000
Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento	491.797
Porcentaje de Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento/ Saldo Nominal Titulizado	49,18%
Saldo Nominal Pendiente de Cobro	496.288
Porcentaje de Saldo Nominal Pendiente de Cobro/ Saldo Nominal Titulizado	49,63%
Amortizaciones Acumuladas desde origen del Fondo	503.712

• **SERIE GALICIA I**

Saldo Nominal Titulizado	900.000
Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento	438517
Porcentaje de Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento/ Saldo Nominal Titulizado	48,72%
Saldo Nominal Pendiente de Cobro	440.211
Porcentaje de Saldo Nominal Pendiente de Cobro/ Saldo Nominal Titulizado	48,91%
Amortizaciones Acumuladas desde origen del Fondo	459.789

• **SERIE GALICIA II**

Saldo Nominal Titulizado	950.000
Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento	434541
Porcentaje de Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento/ Saldo Nominal Titulizado	45,74%
Saldo Nominal Pendiente de Cobro	435.954
Porcentaje de Saldo Nominal Pendiente de Cobro/ Saldo Nominal Titulizado	45,89%
Amortizaciones Acumuladas desde origen del Fondo	514.046

• **SERIE CANTABRIA**

Saldo Nominal Titulizado	230.000
Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento	138711
Porcentaje de Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento/ Saldo Nominal Titulizado	60,31%
Saldo Nominal Pendiente de Cobro	141.360
Porcentaje de Saldo Nominal Pendiente de Cobro/ Saldo Nominal Titulizado	61,46%
Amortizaciones Acumuladas desde origen del Fondo	88.640

- **SERIE GRANADA**

Saldo Nominal Titulizado	399.900
Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento	100902
Porcentaje de Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento/ Saldo Nominal Titulizado	25,23%
Saldo Nominal Pendiente de Cobro	101.559
Porcentaje de Saldo Nominal Pendiente de Cobro/ Saldo Nominal Titulizado	25,40%
Amortizaciones Acumuladas desde origen del Fondo	298.341

- **SERIE VITAL**

Saldo Nominal Titulizado	199.900
Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento	78420
Porcentaje de Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento/ Saldo Nominal Titulizado	39,23%
Saldo Nominal Pendiente de Cobro	120.282
Porcentaje de Saldo Nominal Pendiente de Cobro/ Saldo Nominal Titulizado	60,17%
Amortizaciones Acumuladas desde origen del Fondo	79.618

- **SERIE CCM I**

Saldo Nominal Titulizado	800.000
Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento	409359
Porcentaje de Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento/ Saldo Nominal Titulizado	51,17%
Saldo Nominal Pendiente de Cobro	432.049
Porcentaje de Saldo Nominal Pendiente de Cobro/ Saldo Nominal Titulizado	54,01%
Amortizaciones Acumuladas desde origen del Fondo	367.951

- **SERIE SA NOSTRA**

Saldo Nominal Titulizado	109.000
Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento	44487
Porcentaje de Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento/ Saldo Nominal Titulizado	40,81%
Saldo Nominal Pendiente de Cobro	44.640
Porcentaje de Saldo Nominal Pendiente de Cobro/ Saldo Nominal Titulizado	40,95%
Amortizaciones Acumuladas desde origen del Fondo	64.360

5. Factores que han influido en los flujos de tesorería generados y aplicados en el ejercicio

Tal y como se indica en el folleto informativo del Fondo, los principales flujos generados y aplicados durante el ejercicio 2016, son los derivados de las cantidades percibidas por el Fondo de los activos titulizados y de los pagos efectuados a los acreedores del fondo conforme a las condiciones establecidas en la documentación formal del fondo.

6. Escenario hipotético de flujos futuros de efectivo de los pasivos emitidos por el Fondo hasta su vencimiento, en base a la actualización, a la fecha de las cuentas anuales, de los parámetros utilizados en el momento de constitución del Fondo, en relación con las tasas de morosidad, fallidos, amortización anticipada respecto a los activos titulizados

El detalle de los flujos futuros de los pasivos emitidos por el fondo teniendo en cuenta diferentes tasas de amortización anticipada, se muestra en las páginas a continuación:

Serie NAVARRA I

No aplicaría este apartado puesto que el estado actual del fondo es “liquidado”, no originándose flujos futuros.

Serie Caixa MANLLEU I

No aplicaría este apartado puesto que el estado actual del fondo es “liquidado”, no originándose flujos futuros.

Serie Caixa Círculo Burgos I

No aplicaría este apartado puesto que el estado actual del fondo es “liquidado”, no originándose flujos futuros.

Serie Caja España I

No aplicaría este apartado puesto que el estado actual del fondo es “liquidado”, no originándose flujos futuros.

Cifras en euros

Serie BBK I

Tasa de amortización anticipada 0%

Vida Media (años) 7,857935731

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	714.171.128,80 €	0,00 €
22/03/2017	664.140.902,22 €	50.030.226,58 €
22/09/2017	642.676.546,03 €	21.464.356,19 €
22/03/2018	621.478.309,14 €	21.198.236,89 €
22/09/2018	600.246.108,33 €	21.232.200,81 €
22/03/2019	578.985.537,15 €	21.260.571,18 €
22/09/2019	557.703.604,41 €	21.281.932,74 €
22/03/2020	536.410.788,22 €	21.292.816,19 €
22/09/2020	515.120.717,63 €	21.290.070,59 €
22/03/2021	493.844.792,08 €	21.275.925,55 €
22/09/2021	472.595.918,48 €	21.248.873,60 €
22/03/2022	451.365.272,72 €	21.230.645,76 €
22/09/2022	430.124.745,75 €	21.240.526,97 €
22/03/2023	408.894.420,14 €	21.230.325,61 €
22/09/2023	387.776.906,73 €	21.117.513,41 €
22/03/2024	366.778.931,97 €	20.997.974,76 €
22/09/2024	345.951.344,64 €	20.827.587,33 €
22/03/2025	325.243.375,36 €	20.707.969,28 €
22/09/2025	304.682.537,33 €	20.560.838,03 €
22/03/2026	284.275.620,47 €	20.406.916,86 €
22/09/2026	264.051.430,54 €	20.224.189,93 €
22/03/2027	243.961.968,09 €	20.089.462,45 €
22/09/2027	223.961.979,14 €	19.999.988,95 €
22/03/2028	204.041.579,35 €	19.920.399,79 €
22/09/2028	184.230.038,79 €	19.811.540,56 €
22/03/2029	164.553.980,76 €	19.676.058,03 €
22/09/2029	145.093.976,75 €	19.460.004,01 €
22/03/2030	125.899.042,81 €	19.194.933,94 €
22/09/2030	107.029.940,34 €	18.869.102,47 €
22/03/2031	88.463.758,82 €	18.566.181,52 €
22/09/2031	70.308.699,46 €	18.155.059,36 €
22/03/2032	52.492.903,08 €	17.815.796,38 €
22/09/2032	35.002.985,38 €	17.489.917,70 €
22/03/2033	0,00 €	35.002.985,38 €
Totales	714.171.128,80 €	

Vida Media (años) 16,23287671

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2017	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2017	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2018	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2018	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2019	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2019	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2020	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2020	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2021	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2021	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2022	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2022	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2023	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2023	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2024	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2024	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2025	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2025	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2026	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2026	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2027	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2027	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2028	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2028	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2029	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2029	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2030	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2030	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2031	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2031	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2032	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2032	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2033	0,00 €	81.000.000,00 €
Totales	81.000.000,00 €	

Vida Media (años) 16,23287671

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2017	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2017	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2018	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2018	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2019	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2019	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2020	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2020	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2021	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2021	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2022	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2022	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2023	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2023	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2024	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2024	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2025	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2025	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2026	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2026	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2027	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2027	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2028	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2028	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2029	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2029	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2030	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2030	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2031	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2031	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2032	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2032	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2033	0,00 €	13.500.000,00 €
Totales		13.500.000,00 €

Vida Media (años) 16,23287671

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2017	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2017	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2018	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2018	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2019	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2019	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2020	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2020	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2021	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2021	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2022	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2022	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2023	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2023	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2024	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2024	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2025	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2025	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2026	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2026	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2027	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2027	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2028	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2028	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2029	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2029	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2030	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2030	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2031	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2031	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2032	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2032	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2033	0,00 €	14.300.000,00 €
Totales		14.300.000,00 €

Cifras en euros

Serie BBK I

Tasa de amortización anticipada 5%

Vida Media (años) 4,651401458

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	714.171.128,80 €	0,00 €
22/03/2017	644.247.015,90 €	69.924.112,90 €
22/09/2017	604.067.687,13 €	40.179.328,77 €
22/03/2018	565.153.132,88 €	38.914.554,25 €
22/09/2018	527.171.676,07 €	37.981.456,81 €
22/03/2019	490.105.703,93 €	37.065.972,14 €
22/09/2019	453.939.475,30 €	36.166.228,63 €
22/03/2020	418.661.109,66 €	35.278.365,64 €
22/09/2020	384.262.172,83 €	34.398.936,83 €
22/03/2021	350.732.210,82 €	33.529.962,01 €
22/09/2021	318.062.536,75 €	32.669.674,07 €
22/03/2022	286.222.948,69 €	31.839.588,06 €
22/09/2022	255.164.709,07 €	31.058.239,62 €
22/03/2023	224.888.481,99 €	30.276.227,08 €
22/09/2023	195.477.446,05 €	29.411.035,94 €
22/03/2024	166.916.833,13 €	28.560.612,92 €
22/09/2024	139.236.358,98 €	27.680.474,15 €
22/03/2025	112.363.385,27 €	26.872.973,71 €
22/09/2025	86.305.355,55 €	26.058.029,72 €
22/03/2026	61.048.809,54 €	25.256.546,01 €
22/09/2026	36.602.636,19 €	24.446.173,35 €
22/03/2027	0,00 €	36.602.636,19 €
Totales	714.171.128,80 €	714.171.128,80 €

Vida Media (años) 10,22739726

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2017	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2017	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2018	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2018	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2019	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2019	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2020	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2020	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2021	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2021	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2022	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2022	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2023	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2023	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2024	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2024	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2025	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2025	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2026	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2026	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2027	0,00 €	81.000.000,00 €
Totales	81.000.000,00 €	81.000.000,00 €

Vida Media (años) 10,22739726

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2017	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2017	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2018	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2018	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2019	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2019	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2020	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2020	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2021	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2021	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2022	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2022	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2023	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2023	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2024	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2024	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2025	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2025	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2026	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2026	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2027	0,00 €	13.500.000,00 €
Totales		13.500.000,00 €

Vida Media (años) 10,22739726

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2017	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2017	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2018	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2018	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2019	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2019	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2020	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2020	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2021	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2021	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2022	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2022	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2023	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2023	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2024	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2024	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2025	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2025	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2026	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2026	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2027	0,00 €	14.300.000,00 €
Totales		14.300.000,00 €

Cifras en euros

Serie BBK I

Tasa de amortización anticipada 10%

Vida Media (años) 3,331444104

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	714.171.128,80 €	0,00 €
22/03/2017	624.439.418,29 €	89.731.710,51 €
22/09/2017	566.531.380,56 €	57.908.037,73 €
22/03/2018	511.764.194,54 €	54.767.186,02 €
22/09/2018	459.685.059,07 €	52.079.135,47 €
22/03/2019	410.166.078,40 €	49.518.980,67 €
22/09/2019	363.087.019,42 €	47.079.058,98 €
22/03/2020	318.337.087,75 €	44.749.931,67 €
22/09/2020	275.814.146,96 €	42.522.940,79 €
22/03/2021	235.418.907,93 €	40.395.239,03 €
22/09/2021	197.058.523,80 €	38.360.384,13 €
22/03/2022	160.623.031,72 €	36.435.492,08 €
22/09/2022	125.988.646,96 €	34.634.384,76 €
22/03/2023	93.085.926,73 €	32.902.720,23 €
22/09/2023	61.931.413,72 €	31.154.513,01 €
22/03/2024	32.444.953,60 €	29.486.460,12 €
22/09/2024	0,00 €	32.444.953,60 €
Totales		714.171.128,80 €

Vida Media (años) 7,731506849

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2017	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2017	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2018	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2018	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2019	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2019	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2020	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2020	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2021	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2021	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2022	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2022	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2023	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2023	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2024	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2024	0,00 €	81.000.000,00 €
Totales		81.000.000,00 €

Vida Media (años) 7,731506849

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2017	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2017	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2018	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2018	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2019	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2019	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2020	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2020	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2021	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2021	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2022	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2022	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2023	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2023	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2024	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2024	0,00 €	13.500.000,00 €
Totales		13.500.000,00 €

Vida Media (años) 7,731506849

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2017	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2017	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2018	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2018	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2019	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2019	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2020	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2020	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2021	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2021	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2022	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2022	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2023	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2023	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2024	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2024	0,00 €	14.300.000,00 €
Totales		14.300.000,00 €

Cifras en euros

Serie BBK I

Tasa de amortización anticipada 15%

Vida Media (años) 2,591513318

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	714.171.128,80 €	0,00 €
22/03/2017	604.792.779,92 €	109.378.348,88 €
22/09/2017	530.140.506,52 €	74.652.273,40 €
22/03/2018	461.300.090,17 €	68.840.416,35 €
22/09/2018	397.557.187,72 €	63.742.902,45 €
22/03/2019	338.538.522,43 €	59.018.665,29 €
22/09/2019	283.898.949,31 €	54.639.573,12 €
22/03/2020	233.322.446,18 €	50.576.503,13 €
22/09/2020	186.519.699,57 €	46.802.746,61 €
22/03/2021	143.220.737,98 €	43.298.961,59 €
22/09/2021	103.177.226,14 €	40.043.511,84 €
22/03/2022	66.137.614,08 €	37.039.612,06 €
22/09/2022	31.849.818,69 €	34.287.795,39 €
22/03/2023	0,00 €	31.849.818,69 €
Totales		714.171.128,80 €

Vida Media (años) 6,224657534

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2017	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2017	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2018	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2018	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2019	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2019	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2020	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2020	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2021	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2021	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2022	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2022	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2023	0,00 €	81.000.000,00 €
Totales		81.000.000,00 €

Vida Media (años)	6,224657534
--------------------------	-------------

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2017	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2017	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2018	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2018	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2019	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2019	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2020	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2020	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2021	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2021	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2022	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2022	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2023	0,00 €	13.500.000,00 €
Totales		13.500.000,00 €

Vida Media (años)	6,224657534
--------------------------	-------------

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2017	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2017	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2018	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2018	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2019	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2019	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2020	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2020	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2021	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2021	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2022	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2022	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2023	0,00 €	14.300.000,00 €
Totales		14.300.000,00 €

Cifras en euros

Serie BBK I

Tasa de amortización anticipada 20%

Vida Media (años)	2,115440924
--------------------------	-------------

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	714.171.128,80 €	0,00 €
22/03/2017	585.381.771,30 €	128.789.357,50 €
22/09/2017	494.966.113,07 €	90.415.658,23 €
22/03/2018	413.741.833,54 €	81.224.279,53 €
22/09/2018	340.553.472,03 €	73.188.361,51 €
22/03/2019	274.612.670,90 €	65.940.801,13 €
22/09/2019	215.206.337,84 €	59.406.333,06 €
22/03/2020	161.695.332,22 €	53.511.005,62 €
22/09/2020	113.507.171,68 €	48.188.160,54 €
22/03/2021	70.124.058,30 €	43.383.113,38 €
22/09/2021	31.081.180,57 €	39.042.877,73 €
22/03/2022	0,00 €	31.081.180,57 €
Totales		714.171.128,80 €

Vida Media (años)	5,224657534
--------------------------	-------------

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2017	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2017	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2018	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2018	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2019	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2019	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2020	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2020	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2021	81.000.000,00 €	0,00 €
22/09/2021	81.000.000,00 €	0,00 €
22/03/2022	0,00 €	81.000.000,00 €
Totales		81.000.000,00 €

Vida Media (años)	5,224657534
--------------------------	-------------

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2017	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2017	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2018	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2018	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2019	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2019	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2020	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2020	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2021	13.500.000,00 €	0,00 €
22/09/2021	13.500.000,00 €	0,00 €
22/03/2022	0,00 €	13.500.000,00 €
Totales	13.500.000,00 €	

Vida Media (años)	5,224657534
--------------------------	-------------

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2017	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2017	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2018	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2018	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2019	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2019	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2020	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2020	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2021	14.300.000,00 €	0,00 €
22/09/2021	14.300.000,00 €	0,00 €
22/03/2022	0,00 €	14.300.000,00 €
Totales	14.300.000,00 €	

Cifras en euros

Serie BBK II

Tasa de amortización anticipada 0%

Vida Media (años) 7,496475262

Vida Media (años) 14,42739726

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	450.241.919,40 €	0,00 €
02/06/2017	422.964.667,76 €	27.277.251,64 €
02/12/2017	407.670.369,09 €	15.294.298,67 €
02/06/2018	392.275.561,78 €	15.394.807,31 €
02/12/2018	377.076.986,91 €	15.198.574,87 €
02/06/2019	361.747.408,75 €	15.329.578,16 €
02/12/2019	346.652.523,26 €	15.094.885,49 €
02/06/2020	331.436.793,44 €	15.215.729,82 €
02/12/2020	316.458.005,96 €	14.978.787,48 €
02/06/2021	301.384.879,83 €	15.073.126,13 €
02/12/2021	286.561.095,56 €	14.823.784,27 €
02/06/2022	271.676.507,95 €	14.884.587,61 €
02/12/2022	257.074.092,20 €	14.602.415,75 €
02/06/2023	242.484.800,98 €	14.589.291,22 €
02/12/2023	228.235.600,20 €	14.249.200,78 €
02/06/2024	214.026.221,78 €	14.209.378,42 €
02/12/2024	200.228.589,33 €	13.797.632,45 €
02/06/2025	186.488.696,17 €	13.739.893,16 €
02/12/2025	173.127.702,06 €	13.360.994,11 €
02/06/2026	159.863.498,36 €	13.264.203,70 €
02/12/2026	147.031.713,21 €	12.831.785,15 €
02/06/2027	134.338.437,66 €	12.693.275,55 €
02/12/2027	122.062.424,15 €	12.276.013,51 €
02/06/2028	109.887.230,47 €	12.175.193,68 €
02/12/2028	98.107.569,17 €	11.779.661,30 €
02/06/2029	86.493.366,61 €	11.614.202,56 €
02/12/2029	75.314.943,32 €	11.178.423,29 €
02/06/2030	64.273.662,56 €	11.041.280,76 €
02/12/2030	53.708.844,40 €	10.564.818,16 €
02/06/2031	0,00 €	53.708.844,40 €
Totales	450.241.919,40 €	

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2017	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2017	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2018	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2018	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2019	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2019	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2020	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2020	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2021	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2021	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2022	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2022	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2023	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2023	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2024	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2024	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2025	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2025	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2026	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2026	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2027	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2027	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2028	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2028	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2029	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2029	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2030	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2030	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2031	0,00 €	30.500.000,00 €
Totales	30.500.000,00 €	

Vida Media (años) 14,42739726

Vida Media (años) 14,42739726

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2021	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2021	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2022	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2022	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2023	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2023	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2024	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2024	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2025	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2025	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2026	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2026	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2027	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2027	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2028	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2028	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2029	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2029	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2030	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2030	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2031	0,00 €	7.000.000,00 €
Totales	7.000.000,00 €	

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2021	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2021	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2022	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2022	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2023	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2023	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2024	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2024	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2025	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2025	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2026	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2026	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2027	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2027	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2028	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2028	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2029	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2029	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2030	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2030	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2031	0,00 €	7.000.000,00 €
Totales	7.000.000,00 €	

Cifras en euros

Serie BBK II

Tasa de amortización anticipada 5%

Vida Media (años) 4,702909733

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	450.241.919,40 €	0,00 €
02/06/2017	410.841.327,77 €	39.400.591,63 €
02/12/2017	384.198.420,71 €	26.642.907,06 €
02/06/2018	358.119.010,63 €	26.079.410,08 €
02/12/2018	332.885.763,81 €	25.233.246,82 €
02/06/2019	308.150.375,08 €	24.735.388,73 €
02/12/2019	284.266.116,46 €	23.884.258,62 €
02/06/2020	260.856.258,05 €	23.409.858,41 €
02/12/2020	238.266.745,68 €	22.589.512,37 €
02/06/2021	216.145.872,25 €	22.120.873,43 €
02/12/2021	194.825.622,22 €	21.320.250,03 €
02/06/2022	173.975.915,09 €	20.849.707,13 €
02/12/2022	153.927.983,66 €	20.047.931,43 €
02/06/2023	134.392.816,51 €	19.535.167,15 €
02/12/2023	115.684.587,03 €	18.708.229,48 €
02/06/2024	97.482.435,19 €	18.202.151,84 €
02/12/2024	80.145.657,12 €	17.336.778,07 €
02/06/2025	63.298.698,55 €	16.846.958,57 €
02/12/2025	47.250.494,26 €	16.048.204,29 €
02/06/2026	0,00 €	47.250.494,26 €
Totales	450.241.919,40 €	

Vida Media (años) 9,424657534

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2017	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2017	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2018	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2018	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2019	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2019	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2020	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2020	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2021	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2021	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2022	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2022	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2023	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2023	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2024	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2024	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2025	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2025	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2026	0,00 €	30.500.000,00 €
Totales	30.500.000,00 €	

Vida Media (años) 9,424657534

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2021	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2021	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2022	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2022	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2023	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2023	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2024	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2024	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2025	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2025	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2026	0,00 €	7.000.000,00 €
Totales		7.000.000,00 €

Vida Media (años) 9,424657534

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2021	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2021	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2022	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2022	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2023	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2023	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2024	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2024	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2025	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2025	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2026	0,00 €	7.000.000,00 €
Totales		7.000.000,00 €

Cifras en euros

Serie BBK II

Tasa de amortización anticipada 10%

Vida Media (años) 3,516516097

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	450.241.919,40 €	0,00 €
02/06/2017	398.779.174,06 €	51.462.745,34 €
02/12/2017	361.390.653,14 €	37.388.520,92 €
02/06/2018	325.762.470,93 €	35.628.182,21 €
02/12/2018	292.106.277,95 €	33.656.192,98 €
02/06/2019	259.996.713,83 €	32.109.564,12 €
02/12/2019	229.722.354,12 €	30.274.359,71 €
02/06/2020	200.836.223,06 €	28.886.131,06 €
02/12/2020	173.626.873,02 €	27.209.350,04 €
02/06/2021	147.679.479,84 €	25.947.393,18 €
02/12/2021	123.274.786,31 €	24.404.693,53 €
02/06/2022	100.025.786,00 €	23.249.000,31 €
02/12/2022	78.217.815,41 €	21.807.970,59 €
02/06/2023	57.510.033,70 €	20.707.781,71 €
02/12/2023	38.174.539,03 €	19.335.494,67 €
02/06/2024	0,00 €	38.174.539,03 €
Totales		450.241.919,40 €

Vida Media (años) 7,424657534

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2017	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2017	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2018	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2018	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2019	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2019	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2020	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2020	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2021	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2021	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2022	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2022	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2023	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2023	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2024	0,00 €	30.500.000,00 €
Totales		30.500.000,00 €

Vida Media (años) 7,424657534

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2021	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2021	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2022	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2022	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2023	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2023	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2024	0,00 €	7.000.000,00 €
Totales		7.000.000,00 €

Vida Media (años) 7,424657534

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2021	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2021	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2022	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2022	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2023	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2023	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2024	0,00 €	7.000.000,00 €
Totales		7.000.000,00 €

Cifras en euros

Serie BBK II

Tasa de amortización anticipada 15%

Vida Media (años) 2,810320546

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	450.241.919,40 €	0,00 €
02/06/2017	386.823.726,98 €	63.418.192,42 €
02/12/2017	339.291.365,42 €	47.532.361,56 €
02/06/2018	295.198.025,71 €	44.093.339,71 €
02/12/2018	254.596.850,41 €	40.601.175,30 €
02/06/2019	216.900.498,30 €	37.696.352,11 €
02/12/2019	182.257.477,34 €	34.643.020,96 €
02/06/2020	150.084.007,52 €	32.173.469,82 €
02/12/2020	120.553.163,38 €	29.530.844,14 €
02/06/2021	93.136.124,64 €	27.417.038,74 €
02/12/2021	68.018.463,37 €	25.117.661,27 €
02/06/2022	44.718.158,46 €	23.300.304,91 €
02/12/2022	0,00 €	44.718.158,46 €
Totales	450.241.919,40 €	

Vida Media (años) 5,923287671

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2017	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2017	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2018	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2018	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2019	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2019	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2020	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2020	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2021	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2021	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2022	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2022	0,00 €	30.500.000,00 €
Totales	30.500.000,00 €	

Vida Media (años) 5,923287671

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2021	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2021	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2022	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2022	0,00 €	7.000.000,00 €
Totales	7.000.000,00 €	

Vida Media (años) 5,923287671

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2021	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2021	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2022	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2022	0,00 €	7.000.000,00 €
Totales	7.000.000,00 €	

Cifras en euros

Serie BBK II

Tasa de amortización anticipada 20%

Vida Media (años) 2,346377444

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	450.241.919,40 €	0,00 €
02/06/2017	375.020.506,88 €	75.221.412,52 €
02/12/2017	317.943.660,63 €	57.076.846,25 €
02/06/2018	266.413.100,23 €	51.530.560,40 €
02/12/2018	220.212.515,13 €	46.200.585,10 €
02/06/2019	178.486.954,85 €	41.725.560,28 €
02/12/2019	141.156.194,31 €	37.330.760,54 €
02/06/2020	107.426.631,15 €	33.729.563,16 €
02/12/2020	77.296.925,94 €	30.129.705,21 €
02/06/2021	50.076.959,56 €	27.219.966,38 €
02/12/2021	0,00 €	50.076.959,56 €
Totales	450.241.919,40 €	

Vida Media (años) 4,923287671

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2017	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2017	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2018	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2018	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2019	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2019	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2020	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2020	30.500.000,00 €	0,00 €
02/06/2021	30.500.000,00 €	0,00 €
02/12/2021	0,00 €	30.500.000,00 €
Totales	30.500.000,00 €	

Vida Media (años) 4,923287671

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2021	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2021	0,00 €	7.000.000,00 €
Totales	7.000.000,00 €	

Vida Media (años) 4,923287671

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2017	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2018	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2019	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2020	7.000.000,00 €	0,00 €
02/06/2021	7.000.000,00 €	0,00 €
02/12/2021	0,00 €	7.000.000,00 €
Totales	7.000.000,00 €	

Cifras en euros

Serie Caja Vital Kutxa I

Tasa de amortización anticipada 0%

Vida Media (años) 8,34477668

Vida Media (años) 18,57644317

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	95.394.771,53 €	0,00 €
16/05/2017	90.031.628,06 €	5.363.143,47 €
16/11/2017	87.262.516,15 €	2.769.111,91 €
16/05/2018	84.499.045,16 €	2.763.470,99 €
16/11/2018	81.730.185,42 €	2.768.859,74 €
16/05/2019	78.956.508,37 €	2.773.677,05 €
16/11/2019	76.176.538,29 €	2.779.970,08 €
16/05/2020	73.394.904,86 €	2.781.633,43 €
16/11/2020	70.612.700,24 €	2.782.204,62 €
16/05/2021	67.822.859,07 €	2.789.841,17 €
16/11/2021	65.027.208,14 €	2.795.650,93 €
16/05/2022	62.229.539,21 €	2.797.668,93 €
16/11/2022	59.444.746,20 €	2.784.793,01 €
16/05/2023	56.659.315,62 €	2.785.430,58 €
16/11/2023	53.873.021,14 €	2.786.294,48 €
16/05/2024	51.084.774,71 €	2.788.246,43 €
16/11/2024	48.305.464,27 €	2.779.310,44 €
16/05/2025	45.525.662,01 €	2.779.802,26 €
16/11/2025	42.761.349,46 €	2.764.312,55 €
16/05/2026	40.002.371,98 €	2.758.977,48 €
16/11/2026	37.250.874,17 €	2.751.497,81 €
16/05/2027	34.506.080,15 €	2.744.794,02 €
16/11/2027	31.784.339,50 €	2.721.740,65 €
16/05/2028	29.108.837,77 €	2.675.501,73 €
16/11/2028	26.467.100,43 €	2.641.737,34 €
16/05/2029	23.849.608,44 €	2.617.491,99 €
16/11/2029	21.251.826,74 €	2.597.781,70 €
16/05/2030	18.681.113,93 €	2.570.712,81 €
16/11/2030	16.135.861,01 €	2.545.252,92 €
16/05/2031	13.633.579,98 €	2.502.281,03 €
16/11/2031	11.154.723,81 €	2.478.856,17 €
16/05/2032	8.694.047,66 €	2.460.676,15 €
16/11/2032	6.250.255,96 €	2.443.791,70 €
16/05/2033	3.895.695,86 €	2.354.560,10 €
16/11/2033	1.621.569,37 €	2.274.126,49 €
16/05/2034	0,00 €	1.621.569,37 €
16/11/2034	0,00 €	0,00 €
16/05/2035	0,00 €	0,00 €
16/11/2035	0,00 €	0,00 €
Totales	95.394.771,53 €	

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2022	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2022	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2023	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2023	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2024	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2024	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2025	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2025	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2026	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2026	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2027	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2027	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2028	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2028	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2029	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2029	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2030	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2030	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2031	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2031	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2032	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2032	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2033	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2033	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2034	12.037.998,35 €	562.001,65 €
16/11/2034	9.960.747,53 €	2.077.250,82 €
16/05/2035	7.979.212,80 €	1.981.534,73 €
16/11/2035	0,00 €	7.979.212,80 €
Totales	12.600.000,00 €	

Vida Media (años) 18,88767123

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2022	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2022	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2023	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2023	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2024	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2024	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2025	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2025	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2026	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2026	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2027	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2027	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2028	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2028	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2029	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2029	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2030	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2030	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2031	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2031	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2032	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2032	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2033	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2033	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2034	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2034	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2035	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2035	0,00 €	8.200.000,00 €
Totales		8.200.000,00 €

Vida Media (años) 18,88767123

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2022	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2022	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2023	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2023	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2024	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2024	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2025	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2025	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2026	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2026	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2027	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2027	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2028	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2028	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2029	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2029	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2030	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2030	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2031	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2031	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2032	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2032	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2033	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2033	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2034	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2034	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2035	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2035	0,00 €	3.800.000,00 €
Totales		3.800.000,00 €

Cifras en euros

Serie Caja Vital Kutxa I

Tasa de amortización anticipada 5%

Vida Media (años) 4,72244458

Vida Media (años) 11,35085696

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	95.394.771,53 €	0,00 €
16/05/2017	87.103.318,34 €	8.291.453,19 €
16/11/2017	81.562.268,46 €	5.541.049,88 €
16/05/2018	76.164.353,13 €	5.397.915,33 €
16/11/2018	70.894.989,92 €	5.269.363,21 €
16/05/2019	65.751.560,46 €	5.143.429,46 €
16/11/2019	60.729.464,25 €	5.022.096,21 €
16/05/2020	55.830.320,15 €	4.899.144,10 €
16/11/2020	51.052.169,74 €	4.778.150,41 €
16/05/2021	46.384.945,49 €	4.667.224,25 €
16/11/2021	41.827.721,23 €	4.557.224,26 €
16/05/2022	37.381.559,36 €	4.446.161,87 €
16/11/2022	33.058.598,19 €	4.322.961,17 €
16/05/2023	28.842.268,20 €	4.216.329,99 €
16/11/2023	24.729.696,25 €	4.112.571,95 €
16/05/2024	20.717.219,69 €	4.012.476,56 €
16/11/2024	16.813.242,65 €	3.903.977,04 €
16/05/2025	13.005.645,80 €	3.807.596,85 €
16/11/2025	9.308.018,51 €	3.697.627,29 €
16/05/2026	5.707.478,47 €	3.600.540,04 €
16/11/2026	2.203.760,54 €	3.503.717,93 €
16/05/2027	0,00 €	2.203.760,54 €
16/11/2027	0,00 €	0,00 €
16/05/2028	0,00 €	0,00 €
16/11/2028	0,00 €	0,00 €
Totales	95.394.771,53 €	

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2022	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2022	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2023	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2023	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2024	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2024	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2025	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2025	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2026	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2026	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2027	11.393.686,47 €	1.206.313,53 €
16/11/2027	8.091.282,16 €	3.302.404,31 €
16/05/2028	4.917.062,59 €	3.174.219,57 €
16/11/2028	0,00 €	4.917.062,59 €
Totales	12.600.000,00 €	

Vida Media (años) 11,88493151

Vida Media (años) 11,88493151

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2022	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2022	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2023	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2023	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2024	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2024	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2025	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2025	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2026	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2026	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2027	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2027	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2028	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2028	0,00 €	8.200.000,00 €
Totales		8.200.000,00 €

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2022	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2022	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2023	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2023	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2024	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2024	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2025	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2025	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2026	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2026	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2027	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2027	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2028	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2028	0,00 €	3.800.000,00 €
Totales		3.800.000,00 €

Cifras en euros

Serie Caja Vital Kutxa I

Tasa de amortización anticipada 10%

Vida Media (años) 3,332513002

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	95.394.771,53 €	0,00 €
16/05/2017	84.188.536,21 €	11.206.235,32 €
16/11/2017	76.020.499,39 €	8.168.036,82 €
16/05/2018	68.262.833,11 €	7.757.666,28 €
16/11/2018	60.884.762,35 €	7.378.070,76 €
16/05/2019	53.868.049,56 €	7.016.712,79 €
16/11/2019	47.193.286,26 €	6.674.763,30 €
16/05/2020	40.848.130,85 €	6.345.155,41 €
16/11/2020	34.817.317,49 €	6.030.813,36 €
16/05/2021	29.078.180,04 €	5.739.137,45 €
16/11/2021	23.618.068,29 €	5.460.111,75 €
16/05/2022	18.426.926,02 €	5.191.142,27 €
16/11/2022	13.506.298,59 €	4.920.627,43 €
16/05/2023	8.829.248,76 €	4.677.049,83 €
16/11/2023	4.383.459,45 €	4.445.789,31 €
16/05/2024	156.365,00 €	4.227.094,45 €
16/11/2024	0,00 €	156.365,00 €
16/05/2025	0,00 €	0,00 €
16/11/2025	0,00 €	0,00 €
Totales		95.394.771,53 €

Vida Media (años) 8,424047539

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2022	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2022	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2023	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2023	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2024	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2024	8.747.999,24 €	3.852.000,76 €
16/05/2025	4.938.080,26 €	3.809.918,98 €
16/11/2025	0,00 €	4.938.080,26 €
Totales		12.600.000,00 €

Vida Media (años)	8,882191781
--------------------------	-------------

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2022	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2022	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2023	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2023	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2024	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2024	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2025	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2025	0,00 €	8.200.000,00 €
Totales		8.200.000,00 €

Vida Media (años)	8,882191781
--------------------------	-------------

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2022	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2022	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2023	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2023	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2024	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2024	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2025	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2025	0,00 €	3.800.000,00 €
Totales		3.800.000,00 €

Cifras en euros

Serie Caja Vital Kutxa I

Tasa de amortización anticipada 15%

Vida Media (años) 2,583928545

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	95.394.771,53 €	0,00 €
16/05/2017	81.298.274,44 €	14.096.497,09 €
16/11/2017	70.647.957,64 €	10.650.316,80 €
16/05/2018	60.792.818,83 €	9.855.138,81 €
16/11/2018	51.665.781,26 €	9.127.037,57 €
16/05/2019	43.213.428,81 €	8.452.352,45 €
16/11/2019	35.384.070,16 €	7.829.358,65 €
16/05/2020	28.135.953,01 €	7.248.117,15 €
16/11/2020	21.426.896,37 €	6.709.056,64 €
16/05/2021	15.209.701,36 €	6.217.195,01 €
16/11/2021	9.449.573,50 €	5.760.127,86 €
16/05/2022	4.116.275,67 €	5.333.297,83 €
16/11/2022	0,00 €	4.116.275,67 €
16/05/2023	0,00 €	0,00 €
16/11/2023	0,00 €	0,00 €
Totales	95.394.771,53 €	

Vida Media (años) 6,633061371

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2022	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2022	11.792.924,51 €	807.075,49 €
16/05/2023	7.235.488,62 €	4.557.435,89 €
16/11/2023	0,00 €	7.235.488,62 €
Totales	12.600.000,00 €	

Vida Media (años) 6,879452055

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2022	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2022	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2023	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2023	0,00 €	8.200.000,00 €
Totales	8.200.000,00 €	

Vida Media (años) 6,879452055

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2022	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2022	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2023	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2023	0,00 €	3.800.000,00 €
Totales	3.800.000,00 €	

Cifras en euros

Serie Caja Vital Kutxa I

Tasa de amortización anticipada 20%

Vida Media (años) 2,113924025

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	95.394.771,53 €	0,00 €
16/05/2017	78.443.525,82 €	16.951.245,71 €
16/11/2017	65.455.118,90 €	12.988.406,92 €
16/05/2018	53.751.529,78 €	11.703.589,12 €
16/11/2018	43.203.513,79 €	10.548.015,99 €
16/05/2019	33.697.762,71 €	9.505.751,08 €
16/11/2019	25.129.404,96 €	8.568.357,75 €
16/05/2020	17.410.015,74 €	7.719.389,22 €
16/11/2020	10.456.406,77 €	6.953.608,97 €
16/05/2021	4.185.489,27 €	6.270.917,50 €
16/11/2021	0,00 €	4.185.489,27 €
16/05/2022	0,00 €	0,00 €
16/11/2022	0,00 €	0,00 €
Totales	95.394.771,53 €	

Vida Media (años) 5,559050455

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	12.600.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	12.600.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	11.131.312,96 €	1.468.687,04 €
16/05/2022	6.036.442,36 €	5.094.870,60 €
16/11/2022	0,00 €	6.036.442,36 €
Totales	12.600.000,00 €	

Vida Media (años) 5,879452055

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	8.200.000,00 €	0,00 €
16/05/2022	8.200.000,00 €	0,00 €
16/11/2022	0,00 €	8.200.000,00 €
Totales	8.200.000,00 €	

Vida Media (años) 5,879452055

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	3.800.000,00 €	0,00 €
16/05/2022	3.800.000,00 €	0,00 €
16/11/2022	0,00 €	3.800.000,00 €
Totales	3.800.000,00 €	

Cifras en euros

Serie Sa Nostra I

Tasa de amortización anticipada 0%

Vida Media (años) 7,39216838

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	34.266.245,30 €	0,00 €
16/05/2017	31.469.583,16 €	2.796.662,14 €
16/11/2017	30.238.824,96 €	1.230.758,20 €
16/05/2018	29.025.323,55 €	1.213.501,41 €
16/11/2018	27.829.741,51 €	1.195.582,04 €
16/05/2019	26.635.185,08 €	1.194.556,43 €
16/11/2019	25.443.271,95 €	1.191.913,13 €
16/05/2020	24.267.437,05 €	1.175.834,90 €
16/11/2020	23.109.183,75 €	1.158.253,30 €
16/05/2021	21.974.044,78 €	1.135.138,97 €
16/11/2021	20.851.776,06 €	1.122.268,72 €
16/05/2022	19.746.056,85 €	1.105.719,21 €
16/11/2022	18.650.100,45 €	1.095.956,40 €
16/05/2023	17.566.845,78 €	1.083.254,67 €
16/11/2023	16.511.169,67 €	1.055.676,11 €
16/05/2024	15.475.842,16 €	1.035.327,51 €
16/11/2024	14.464.422,71 €	1.011.419,45 €
16/05/2025	13.475.302,58 €	989.120,13 €
16/11/2025	12.518.885,42 €	956.417,16 €
16/05/2026	11.592.180,10 €	926.705,32 €
16/11/2026	10.695.821,54 €	896.358,56 €
16/05/2027	9.820.001,39 €	875.820,15 €
16/11/2027	8.961.141,66 €	858.859,73 €
16/05/2028	8.136.060,88 €	825.080,78 €
16/11/2028	7.357.887,27 €	778.173,61 €
16/05/2029	6.597.702,80 €	760.184,47 €
16/11/2029	5.857.845,11 €	739.857,69 €
16/05/2030	5.131.347,20 €	726.497,91 €
16/11/2030	4.412.346,40 €	719.000,80 €
16/05/2031	3.719.833,54 €	692.512,86 €
16/11/2031	3.059.099,28 €	660.734,26 €
16/05/2032	2.426.160,66 €	632.938,62 €
16/11/2032	1.807.171,94 €	618.988,72 €
16/05/2033	1.203.688,48 €	603.483,46 €
16/11/2033	610.732,23 €	592.956,25 €
16/05/2034	0,00 €	610.732,23 €
Totales	34.266.245,30 €	

Vida Media (años) 17,38356164

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2017	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2017	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2018	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2018	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2019	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2019	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2020	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2020	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2021	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2021	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2022	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2022	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2023	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2023	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2024	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2024	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2025	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2025	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2026	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2026	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2027	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2027	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2028	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2028	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2029	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2029	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2030	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2030	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2031	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2031	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2032	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2032	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2033	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2033	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2034	0,00 €	6.287.554,30 €
Totales	6.287.554,30 €	

Vida Media (años) 17,38356164

Vida Media (años) 17,38356164

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2017	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2017	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2018	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2018	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2019	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2019	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2020	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2020	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2021	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2021	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2022	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2022	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2023	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2023	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2024	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2024	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2025	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2025	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2026	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2026	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2027	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2027	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2028	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2028	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2029	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2029	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2030	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2030	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2031	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2031	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2032	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2032	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2033	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2033	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2034	0,00 €	2.636.417,63 €
Totales	2.636.417,63 €	

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2022	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2022	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2023	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2023	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2024	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2024	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2025	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2025	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2026	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2026	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2027	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2027	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2028	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2028	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2029	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2029	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2030	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2030	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2031	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2031	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2032	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2032	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2033	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2033	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2034	0,00 €	1.100.000,00 €
Totales	1.100.000,00 €	

Cifras en euros

Serie Sa Nostra I

Tasa de amortización anticipada 5%

Vida Media (años) 4,113072832

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	34.266.245,30 €	0,00 €
16/05/2017	30.385.992,29 €	3.880.253,01 €
16/11/2017	28.146.188,39 €	2.239.803,90 €
16/05/2018	25.979.573,33 €	2.166.615,06 €
16/11/2018	23.884.977,64 €	2.094.595,69 €
16/05/2019	21.843.709,18 €	2.041.268,46 €
16/11/2019	19.856.053,85 €	1.987.655,33 €
16/05/2020	17.934.107,91 €	1.921.945,94 €
16/11/2020	16.077.734,16 €	1.856.373,75 €
16/05/2021	14.290.828,03 €	1.786.906,13 €
16/11/2021	12.561.410,95 €	1.729.417,08 €
16/05/2022	10.891.726,53 €	1.669.684,42 €
16/11/2022	9.273.496,64 €	1.618.229,89 €
16/05/2023	7.708.375,29 €	1.565.121,35 €
16/11/2023	6.209.913,26 €	1.498.462,03 €
16/05/2024	4.769.216,32 €	1.440.696,94 €
16/11/2024	3.388.401,46 €	1.380.814,86 €
16/05/2025	2.064.364,75 €	1.324.036,71 €
16/11/2025	806.092,09 €	1.258.272,66 €
16/05/2026	0,00 €	806.092,09 €
Totales	34.266.245,30 €	

Vida Media (años) 9,378082192

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2017	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2017	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2018	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2018	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2019	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2019	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2020	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2020	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2021	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2021	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2022	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2022	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2023	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2023	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2024	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2024	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2025	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2025	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2026	0,00 €	6.287.554,30 €
Totales		6.287.554,30 €

Vida Media (años)	9,378082192
--------------------------	-------------

Vida Media (años)	9,378082192
--------------------------	-------------

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2017	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2017	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2018	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2018	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2019	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2019	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2020	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2020	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2021	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2021	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2022	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2022	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2023	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2023	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2024	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2024	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2025	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2025	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2026	0,00 €	2.636.417,63 €
Totales	2.636.417,63 €	

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2022	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2022	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2023	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2023	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2024	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2024	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2025	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2025	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2026	0,00 €	1.100.000,00 €
Totales	1.100.000,00 €	

Cifras en euros

Serie Sa Nostra I

Tasa de amortización anticipada 10%

Vida Media (años) 2,936233476

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	34.266.245,30 €	0,00 €
16/05/2017	29.307.511,52 €	4.958.733,78 €
16/11/2017	26.112.696,97 €	3.194.814,55 €
16/05/2018	23.094.501,38 €	3.018.195,59 €
16/11/2018	20.244.946,23 €	2.849.555,15 €
16/05/2019	17.538.723,81 €	2.706.222,42 €
16/11/2019	14.970.293,66 €	2.568.430,15 €
16/05/2020	12.546.209,42 €	2.424.084,24 €
16/11/2020	10.260.766,21 €	2.285.443,21 €
16/05/2021	8.112.573,04 €	2.148.193,17 €
16/11/2021	6.084.531,72 €	2.028.041,32 €
16/05/2022	4.174.320,81 €	1.910.210,91 €
16/11/2022	2.369.269,26 €	1.805.051,55 €
16/05/2023	667.064,15 €	1.702.205,11 €
16/11/2023	0,00 €	667.064,15 €
Totales	34.266.245,30 €	

Vida Media (años) 6,879452055

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2017	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2017	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2018	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2018	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2019	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2019	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2020	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2020	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2021	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2021	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2022	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2022	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2023	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2023	0,00 €	6.287.554,30 €
Totales	6.287.554,30 €	

Vida Media (años) 6,879452055

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2017	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2017	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2018	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2018	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2019	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2019	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2020	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2020	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2021	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2021	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2022	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2022	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2023	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2023	0,00 €	2.636.417,63 €
Totales	2.636.417,63 €	

Vida Media (años) 6,879452055

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2022	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2022	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2023	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2023	0,00 €	1.100.000,00 €
Totales	1.100.000,00 €	

Cifras en euros

Serie Sa Nostra I

Tasa de amortización anticipada 15%

Vida Media (años) 2,298070655

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	34.266.245,30 €	0,00 €
16/05/2017	28.238.208,82 €	6.028.036,48 €
16/11/2017	24.142.279,97 €	4.095.928,85 €
16/05/2018	20.369.364,72 €	3.772.915,25 €
16/11/2018	16.896.931,83 €	3.472.432,89 €
16/05/2019	13.685.644,73 €	3.211.287,10 €
16/11/2019	10.717.562,21 €	2.968.082,52 €
16/05/2020	7.987.900,83 €	2.729.661,38 €
16/11/2020	5.480.304,14 €	2.507.596,69 €
16/05/2021	3.183.669,78 €	2.296.634,36 €
16/11/2021	1.071.950,47 €	2.111.719,31 €
16/05/2022	0,00 €	1.071.950,47 €
16/11/2022	0,00 €	0,00 €
Totales	34.266.245,30 €	

Vida Media (años) 5,810097821

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2017	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2017	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2018	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2018	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2019	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2019	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2020	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2020	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2021	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2021	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2022	5.422.527,09 €	865.027,21 €
16/11/2022	0,00 €	5.422.527,09 €
Totales	6.287.554,30 €	

Vida Media (años) 5,879452055

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2017	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2017	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2018	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2018	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2019	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2019	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2020	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2020	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2021	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2021	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2022	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2022	0,00 €	2.636.417,63 €
Totales	2.636.417,63 €	

Vida Media (años) 5,879452055

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2022	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2022	0,00 €	1.100.000,00 €
Totales	1.100.000,00 €	

Cifras en euros

Serie Sa Nostra I

Tasa de amortización anticipada 20%

Vida Media (años) 1,893482822

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	34.266.245,30 €	0,00 €
16/05/2017	27.182.152,15 €	7.084.093,15 €
16/11/2017	22.238.760,55 €	4.943.391,60 €
16/05/2018	17.803.003,10 €	4.435.757,45 €
16/11/2018	13.827.927,72 €	3.975.075,38 €
16/05/2019	10.250.896,15 €	3.577.031,57 €
16/11/2019	7.033.791,26 €	3.217.104,89 €
16/05/2020	4.154.099,60 €	2.879.691,66 €
16/11/2020	1.579.623,58 €	2.574.476,02 €
16/05/2021	0,00 €	1.579.623,58 €
16/11/2021	0,00 €	0,00 €
Totales		34.266.245,30 €

Vida Media (años) 4,822159249

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2017	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2017	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2018	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2018	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2019	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2019	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2020	6.287.554,30 €	0,00 €
16/11/2020	6.287.554,30 €	0,00 €
16/05/2021	5.572.964,39 €	714.589,91 €
16/11/2021	0,00 €	5.572.964,39 €
Totales		6.287.554,30 €

Vida Media (años) 4,879452055

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2017	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2017	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2018	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2018	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2019	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2019	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2020	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2020	2.636.417,63 €	0,00 €
16/05/2021	2.636.417,63 €	0,00 €
16/11/2021	0,00 €	2.636.417,63 €
Totales		2.636.417,63 €

Vida Media (años) 4,879452055

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2017	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2017	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2018	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2018	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2019	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2019	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2020	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2020	1.100.000,00 €	0,00 €
16/05/2021	1.100.000,00 €	0,00 €
16/11/2021	0,00 €	1.100.000,00 €
Totales		1.100.000,00 €

Cifras en euros

Serie Caja Granada I

Tasa de amortización anticipada 0%

Vida Media (años) 5,008612892

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	66.000.542,68 €	0,00 €
20/05/2017	52.176.567,25 €	13.823.975,43 €
20/11/2017	49.880.171,62 €	2.296.395,63 €
20/05/2018	47.632.841,32 €	2.247.330,30 €
20/11/2018	45.377.515,64 €	2.255.325,68 €
20/05/2019	43.115.169,27 €	2.262.346,37 €
20/11/2019	40.847.580,61 €	2.267.588,66 €
20/05/2020	38.561.466,47 €	2.286.114,14 €
20/11/2020	36.264.210,64 €	2.297.255,83 €
20/05/2021	33.966.537,19 €	2.297.673,45 €
20/11/2021	31.682.145,84 €	2.284.391,35 €
20/05/2022	29.409.603,26 €	2.272.542,58 €
20/11/2022	27.126.429,53 €	2.283.173,73 €
20/05/2023	24.817.624,10 €	2.308.805,43 €
20/11/2023	22.498.081,40 €	2.319.542,70 €
20/05/2024	20.196.773,85 €	2.301.307,55 €
20/11/2024	17.877.069,32 €	2.319.704,53 €
20/05/2025	15.553.987,21 €	2.323.082,11 €
20/11/2025	13.258.511,21 €	2.295.476,00 €
20/05/2026	10.989.825,41 €	2.268.685,80 €
20/11/2026	8.744.650,54 €	2.245.174,87 €
20/05/2027	0,00 €	8.744.650,54 €
Totales	66.000.542,68 €	

Vida Media (años) 10,3890411

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2017	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2017	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2018	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2018	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2019	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2019	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2020	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2020	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2021	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2021	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2022	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2022	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2023	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2023	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2024	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2024	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2025	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2025	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2026	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2026	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2027	0,00 €	18.000.000,00 €
Totales	18.000.000,00 €	

Vida Media (años) 10,3890411

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2017	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2017	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2018	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2018	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2019	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2019	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2020	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2020	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2021	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2021	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2022	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2022	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2023	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2023	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2024	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2024	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2025	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2025	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2026	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2026	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2027	0,00 €	8.000.000,00 €
Totales		8.000.000,00 €

Vida Media (años) 10,3890411

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2017	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2017	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2018	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2018	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2019	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2019	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2020	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2020	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2021	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2021	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2022	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2022	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2023	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2023	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2024	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2024	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2025	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2025	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2026	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2026	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2027	0,00 €	4.800.000,00 €
Totales		4.800.000,00 €

Cifras en euros

Serie Caja Granada I

Tasa de amortización anticipada 5%

Vida Media (años) 2,952036167

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	66.000.542,68 €	0,00 €
20/05/2017	49.887.979,63 €	16.112.563,05 €
20/11/2017	45.592.572,16 €	4.295.407,47 €
20/05/2018	41.453.141,14 €	4.139.431,02 €
20/11/2018	37.408.241,81 €	4.044.899,33 €
20/05/2019	33.456.499,02 €	3.951.742,79 €
20/11/2019	29.597.383,98 €	3.859.115,04 €
20/05/2020	25.815.319,52 €	3.782.064,46 €
20/11/2020	22.115.780,44 €	3.699.539,08 €
20/05/2021	18.507.447,35 €	3.608.333,09 €
20/11/2021	15.001.761,73 €	3.505.685,62 €
20/05/2022	11.594.748,79 €	3.407.012,94 €
20/11/2022	8.261.484,78 €	3.333.264,01 €
20/05/2023	0,00 €	8.261.484,78 €
Totales	66.000.542,68 €	

Vida Media (años) 6,38630137

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2017	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2017	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2018	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2018	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2019	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2019	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2020	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2020	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2021	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2021	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2022	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2022	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2023	0,00 €	18.000.000,00 €
Totales	18.000.000,00 €	

Vida Media (años) 6,38630137

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2017	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2017	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2018	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2018	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2019	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2019	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2020	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2020	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2021	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2021	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2022	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2022	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2023	0,00 €	8.000.000,00 €
Totales	8.000.000,00 €	

Vida Media (años) 6,38630137

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2017	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2017	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2018	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2018	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2019	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2019	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2020	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2020	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2021	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2021	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2022	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2022	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2023	0,00 €	4.800.000,00 €
Totales	4.800.000,00 €	

Cifras en euros

Serie Caja Granada I

Tasa de amortización anticipada 10%

Vida Media (años) 2,952036167

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	66.000.542,68 €	0,00 €
20/05/2017	49.887.979,63 €	16.112.563,05 €
20/11/2017	45.592.572,16 €	4.295.407,47 €
20/05/2018	41.453.141,14 €	4.139.431,02 €
20/11/2018	37.408.241,81 €	4.044.899,33 €
20/05/2019	33.456.499,02 €	3.951.742,79 €
20/11/2019	29.597.383,98 €	3.859.115,04 €
20/05/2020	25.815.319,52 €	3.782.064,46 €
20/11/2020	22.115.780,44 €	3.699.539,08 €
20/05/2021	18.507.447,35 €	3.608.333,09 €
20/11/2021	15.001.761,73 €	3.505.685,62 €
20/05/2022	11.594.748,79 €	3.407.012,94 €
20/11/2022	8.261.484,78 €	3.333.264,01 €
20/05/2023	0,00 €	8.261.484,78 €
Totales	66.000.542,68 €	

Vida Media (años) 6,38630137

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2017	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2017	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2018	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2018	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2019	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2019	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2020	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2020	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2021	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2021	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2022	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2022	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2023	0,00 €	18.000.000,00 €
Totales	18.000.000,00 €	

Vida Media (años) 6,38630137

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2017	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2017	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2018	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2018	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2019	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2019	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2020	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2020	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2021	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2021	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2022	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2022	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2023	0,00 €	8.000.000,00 €
Totales	8.000.000,00 €	

Vida Media (años) 6,38630137

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2017	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2017	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2018	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2018	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2019	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2019	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2020	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2020	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2021	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2021	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2022	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2022	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2023	0,00 €	4.800.000,00 €
Totales	4.800.000,00 €	

Cifras en euros

Serie Caja Granada I

Tasa de amortización anticipada 15%

Vida Media (años) 1,674484257

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	66.000.542,68 €	0,00 €
20/05/2017	45.351.396,03 €	20.649.146,65 €
20/11/2017	37.394.277,93 €	7.957.118,10 €
20/05/2018	30.079.096,63 €	7.315.181,30 €
20/11/2018	23.299.568,65 €	6.779.527,98 €
20/05/2019	17.016.796,29 €	6.282.772,36 €
20/11/2019	11.195.641,18 €	5.821.155,11 €
20/05/2020	5.788.518,25 €	5.407.122,93 €
20/11/2020	0,00 €	5.788.518,25 €
Totales		66.000.542,68 €

Vida Media (años) 3,890410959

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2017	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2017	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2018	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2018	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2019	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2019	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2020	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2020	0,00 €	18.000.000,00 €
Totales		18.000.000,00 €

Vida Media (años) 3,890410959

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2017	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2017	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2018	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2018	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2019	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2019	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2020	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2020	0,00 €	8.000.000,00 €
Totales		8.000.000,00 €

Vida Media (años) 3,890410959

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2017	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2017	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2018	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2018	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2019	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2019	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2020	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2020	0,00 €	4.800.000,00 €
Totales		4.800.000,00 €

Cifras en euros

Serie Caja Granada I

Tasa de amortización anticipada 20%

Vida Media (años) 1,388835763

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	66.000.542,68 €	0,00 €
20/05/2017	43.120.582,99 €	22.879.959,69 €
20/11/2017	33.498.964,03 €	9.621.618,96 €
20/05/2018	24.880.133,93 €	8.618.830,10 €
20/11/2018	17.107.276,84 €	7.772.857,09 €
20/05/2019	10.097.558,40 €	7.009.718,44 €
20/11/2019	3.777.145,08 €	6.320.413,32 €
20/05/2020	0,00 €	3.777.145,08 €
Totales		66.000.542,68 €

Vida Media (años) 3,38630137

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2017	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2017	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2018	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2018	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2019	18.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2019	18.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2020	0,00 €	18.000.000,00 €
Totales		18.000.000,00 €

Vida Media (años) 3,38630137

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2017	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2017	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2018	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2018	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2019	8.000.000,00 €	0,00 €
20/11/2019	8.000.000,00 €	0,00 €
20/05/2020	0,00 €	8.000.000,00 €
Totales		8.000.000,00 €

Vida Media (años) 3,38630137

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2017	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2017	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2018	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2018	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2019	4.800.000,00 €	0,00 €
20/11/2019	4.800.000,00 €	0,00 €
20/05/2020	0,00 €	4.800.000,00 €
Totales		4.800.000,00 €

Cifras en euros

Serie CCM I

Tasa de amortización anticipada 0%

Vida Media (años) 8,163627658

Vida Media (años) 18,76399792

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	325.602.933,20 €	0,00 €
28/05/2017	288.723.166,63 €	36.879.766,57 €
28/11/2017	280.383.206,73 €	8.339.959,90 €
28/05/2018	272.106.251,57 €	8.276.955,16 €
28/11/2018	263.777.305,72 €	8.328.945,85 €
28/05/2019	255.395.262,90 €	8.382.042,82 €
28/11/2019	246.966.132,48 €	8.429.130,42 €
28/05/2020	238.497.320,72 €	8.468.811,76 €
28/11/2020	229.986.700,28 €	8.510.620,44 €
28/05/2021	221.461.953,37 €	8.524.746,91 €
28/11/2021	212.923.093,29 €	8.538.860,08 €
28/05/2022	204.359.712,74 €	8.563.380,55 €
28/11/2022	195.759.836,44 €	8.599.876,30 €
28/05/2023	187.122.242,91 €	8.637.593,53 €
28/11/2023	178.445.383,48 €	8.676.859,43 €
28/05/2024	169.732.394,42 €	8.712.989,06 €
28/11/2024	161.021.235,68 €	8.711.158,74 €
28/05/2025	152.304.539,83 €	8.716.695,85 €
28/11/2025	143.578.933,42 €	8.725.606,41 €
28/05/2026	134.878.705,87 €	8.700.227,55 €
28/11/2026	126.196.283,96 €	8.682.421,91 €
28/05/2027	117.540.270,86 €	8.656.013,10 €
28/11/2027	108.965.621,83 €	8.574.649,03 €
28/05/2028	100.377.925,99 €	8.587.695,84 €
28/11/2028	91.788.385,73 €	8.589.540,26 €
28/05/2029	83.214.769,79 €	8.573.615,94 €
28/11/2029	74.682.816,04 €	8.531.953,75 €
28/05/2030	66.227.324,84 €	8.455.491,20 €
28/11/2030	57.855.995,10 €	8.371.329,74 €
28/05/2031	49.583.525,15 €	8.272.469,95 €
28/11/2031	41.482.416,52 €	8.101.108,63 €
28/05/2032	33.621.887,63 €	7.860.528,89 €
28/11/2032	25.999.080,69 €	7.622.806,94 €
28/05/2033	18.423.241,55 €	7.575.839,14 €
28/11/2033	10.892.574,16 €	7.530.667,39 €
28/05/2034	3.517.582,71 €	7.374.991,45 €
28/11/2034	0,00 €	3.517.582,71 €
28/05/2035	0,00 €	0,00 €
28/11/2035	0,00 €	0,00 €
Totales	325.602.933,20 €	

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2017	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2017	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2018	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2018	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2019	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2019	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2020	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2020	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2021	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2021	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2022	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2022	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2023	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2023	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2024	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2024	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2025	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2025	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2026	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2026	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2027	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2027	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2028	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2028	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2029	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2029	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2030	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2030	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2031	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2031	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2032	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2032	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2033	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2033	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2034	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2034	41.954.737,65 €	3.645.262,35 €
28/05/2035	35.024.857,70 €	6.929.879,95 €
28/11/2035	0,00 €	35.024.857,70 €
Totales	45.600.000,00 €	

Vida Media (años) 18,92054795

Vida Media (años) 18,92054795

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2017	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2017	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2018	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2018	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2019	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2019	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2020	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2020	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2021	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2021	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2022	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2022	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2023	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2023	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2024	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2024	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2025	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2025	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2026	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2026	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2027	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2027	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2028	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2028	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2029	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2029	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2030	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2030	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2031	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2031	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2032	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2032	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2033	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2033	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2034	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2034	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2035	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2035	0,00 €	28.000.000,00 €
Totales		28.000.000,00 €

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2017	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2017	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2018	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2018	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2019	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2019	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2020	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2020	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2021	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2021	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2022	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2022	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2023	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2023	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2024	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2024	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2025	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2025	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2026	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2026	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2027	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2027	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2028	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2028	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2029	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2029	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2030	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2030	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2031	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2031	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2032	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2032	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2033	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2033	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2034	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2034	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2035	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2035	0,00 €	10.400.000,00 €
Totales		10.400.000,00 €

Cifras en euros

Serie CCM I

Tasa de amortización anticipada 5,00%

Vida Media (años) 4,565782132

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	325.602.933,20 €	0,00 €
28/05/2017	278.825.211,22 €	46.777.721,98 €
28/11/2017	261.532.562,57 €	17.292.648,65 €
28/05/2018	244.733.456,17 €	16.799.106,40 €
28/11/2018	228.296.664,30 €	16.436.791,87 €
28/05/2019	212.212.083,63 €	16.084.580,67 €
28/11/2019	196.477.037,34 €	15.735.046,29 €
28/05/2020	181.090.313,60 €	15.386.723,74 €
28/11/2020	166.041.197,12 €	15.049.116,48 €
28/05/2021	151.349.044,61 €	14.692.152,51 €
28/11/2021	137.005.072,13 €	14.343.972,48 €
28/05/2022	122.990.286,60 €	14.014.785,53 €
28/11/2022	109.284.593,32 €	13.705.693,28 €
28/05/2023	95.879.146,62 €	13.405.446,70 €
28/11/2023	82.764.993,73 €	13.114.152,89 €
28/05/2024	69.938.087,60 €	12.826.906,13 €
28/11/2024	57.429.305,50 €	12.508.782,10 €
28/05/2025	45.223.442,43 €	12.205.863,07 €
28/11/2025	33.309.653,90 €	11.913.788,53 €
28/05/2026	21.715.026,37 €	11.594.627,53 €
28/11/2026	10.424.122,81 €	11.290.903,56 €
28/05/2027	0,00 €	10.424.122,81 €
28/11/2027	0,00 €	0,00 €
28/05/2028	0,00 €	0,00 €
Totales		325.602.933,20 €

Vida Media (años) 11,28506238

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2017	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2017	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2018	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2018	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2019	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2019	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2020	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2020	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2021	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2021	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2022	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2022	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2023	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2023	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2024	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2024	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2025	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2025	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2026	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2026	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2027	45.038.055,43 €	561.944,57 €
28/11/2027	34.404.264,10 €	10.633.791,33 €
28/05/2028	0,00 €	34.404.264,10 €
Totales		45.600.000,00 €

Vida Media (años) 11,41369863

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2017	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2017	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2018	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2018	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2019	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2019	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2020	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2020	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2021	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2021	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2022	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2022	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2023	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2023	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2024	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2024	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2025	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2025	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2026	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2026	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2027	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2027	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2028	0,00 €	28.000.000,00 €
Totales		28.000.000,00 €

Vida Media (años) 11,41369863

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2017	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2017	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2018	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2018	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2019	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2019	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2020	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2020	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2021	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2021	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2022	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2022	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2023	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2023	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2024	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2024	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2025	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2025	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2026	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2026	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2027	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2027	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2028	0,00 €	10.400.000,00 €
Totales		10.400.000,00 €

Cifras en euros

Serie CCM I

Tasa de amortización anticipada 10,00%

Vida Media (años) 3,207811321

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	325.602.933,20 €	0,00 €
28/05/2017	268.972.788,73 €	56.630.144,47 €
28/11/2017	243.209.979,47 €	25.762.809,26 €
28/05/2018	218.789.046,04 €	24.420.933,43 €
28/11/2018	195.520.895,62 €	23.268.150,42 €
28/05/2019	173.347.404,62 €	22.173.491,00 €
28/11/2019	152.220.581,13 €	21.126.823,49 €
28/05/2020	132.096.203,49 €	20.124.377,64 €
28/11/2020	112.922.698,50 €	19.173.504,99 €
28/05/2021	94.680.842,86 €	18.241.855,64 €
28/11/2021	77.324.704,02 €	17.356.138,84 €
28/05/2022	60.800.184,08 €	16.524.519,94 €
28/11/2022	45.054.281,61 €	15.745.902,47 €
28/05/2023	30.047.362,79 €	15.006.918,82 €
28/11/2023	15.741.425,82 €	14.305.936,97 €
28/05/2024	2.105.028,29 €	13.636.397,53 €
28/11/2024	0,00 €	2.105.028,29 €
28/05/2025	0,00 €	0,00 €
Totales		325.602.933,20 €

Vida Media (años) 8,292892446

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2017	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2017	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2018	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2018	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2019	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2019	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2020	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2020	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2021	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2021	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2022	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2022	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2023	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2023	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2024	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2024	34.743.104,26 €	10.856.895,74 €
28/05/2025	0,00 €	34.743.104,26 €
Totales		45.600.000,00 €

Vida Media (años) 8,410958904

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2017	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2017	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2018	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2018	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2019	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2019	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2020	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2020	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2021	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2021	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2022	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2022	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2023	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2023	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2024	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2024	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2025	0,00 €	28.000.000,00 €
Totales		28.000.000,00 €

Vida Media (años) 8,410958904

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2017	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2017	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2018	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2018	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2019	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2019	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2020	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2020	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2021	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2021	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2022	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2022	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2023	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2023	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2024	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2024	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2025	0,00 €	10.400.000,00 €
Totales		10.400.000,00 €

Cifras en euros

Serie CCM I

Tasa de amortización anticipada 15,00%

Vida Media (años) 2,480824128

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	325.602.933,20 €	0,00 €
28/05/2017	259.203.055,42 €	66.399.877,78 €
28/11/2017	225.450.216,24 €	33.752.839,18 €
28/05/2018	194.266.665,93 €	31.183.550,31 €
28/11/2018	165.338.953,64 €	28.927.712,29 €
28/05/2019	138.498.976,94 €	26.839.976,70 €
28/11/2019	113.598.242,03 €	24.900.734,91 €
28/05/2020	90.500.640,61 €	23.097.601,42 €
28/11/2020	69.070.604,23 €	21.430.036,38 €
28/05/2021	49.212.401,46 €	19.858.202,77 €
28/11/2021	30.809.734,35 €	18.402.667,11 €
28/05/2022	13.744.475,09 €	17.065.259,26 €
28/11/2022	0,00 €	13.744.475,09 €
28/05/2023	0,00 €	0,00 €
28/11/2023	0,00 €	0,00 €
Totales		325.602.933,20 €

Vida Media (años) 6,703843153

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2017	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2017	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2018	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2018	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2019	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2019	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2020	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2020	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2021	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2021	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2022	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2022	43.505.663,93 €	2.094.336,07 €
28/05/2023	28.801.305,82 €	14.704.358,11 €
28/11/2023	0,00 €	28.801.305,82 €
Totales		45.600.000,00 €

Vida Media (años)	6,912328767
--------------------------	-------------

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2017	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2017	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2018	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2018	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2019	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2019	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2020	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2020	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2021	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2021	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2022	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2022	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2023	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2023	0,00 €	28.000.000,00 €
Totales	28.000.000,00 €	

Vida Media (años)	6,912328767
--------------------------	-------------

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2017	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2017	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2018	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2018	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2019	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2019	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2020	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2020	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2021	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2021	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2022	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2022	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2023	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2023	0,00 €	10.400.000,00 €
Totales	10.400.000,00 €	

Cifras en euros

Serie CCM I

Tasa de amortización anticipada 20,00%

Vida Media (años)	2,028822109
--------------------------	-------------

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	325.602.933,20 €	0,00 €
28/05/2017	249.553.167,56 €	76.049.765,64 €
28/11/2017	208.287.161,77 €	41.266.005,79 €
28/05/2018	171.156.296,49 €	37.130.865,28 €
28/11/2018	137.637.154,93 €	33.519.141,56 €
28/05/2019	107.373.057,29 €	30.264.097,64 €
28/11/2019	80.048.841,10 €	27.324.216,19 €
28/05/2020	55.381.764,35 €	24.667.076,75 €
28/11/2020	33.107.450,78 €	22.274.313,57 €
28/05/2021	13.017.418,78 €	20.090.032,00 €
28/11/2021	0,00 €	13.017.418,78 €
28/05/2022	0,00 €	0,00 €
Totales	325.602.933,20 €	

Vida Media (años)	5,352715542
--------------------------	-------------

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2017	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2017	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2018	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2018	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2019	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2019	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2020	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2020	45.600.000,00 €	0,00 €
28/05/2021	45.600.000,00 €	0,00 €
28/11/2021	40.496.118,66 €	5.103.881,34 €
28/05/2022	0,00 €	40.496.118,66 €
Totales	45.600.000,00 €	

Vida Media (años)	5,408219178
--------------------------	-------------

Vida Media (años)	5,408219178
--------------------------	-------------

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2017	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2017	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2018	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2018	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2019	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2019	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2020	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2020	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2021	28.000.000,00 €	0,00 €
28/11/2021	28.000.000,00 €	0,00 €
28/05/2022	0,00 €	28.000.000,00 €
Totales		28.000.000,00 €

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2017	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2017	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2018	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2018	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2019	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2019	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2020	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2020	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2021	10.400.000,00 €	0,00 €
28/11/2021	10.400.000,00 €	0,00 €
28/05/2022	0,00 €	10.400.000,00 €
Totales		10.400.000,00 €

Cifras en euros

Serie Caixa Galicia I

Tasa de amortización anticipada 0%

Vida Media (años) 9,884296476

Vida Media (años) 9,927248075

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	377.842.493,34 €	0,00 €
17/01/2017	365.618.745,12 €	12.223.748,22 €
17/07/2017	355.902.175,34 €	9.716.569,78 €
17/01/2018	346.097.395,18 €	9.804.780,16 €
17/07/2018	336.273.618,50 €	9.823.776,69 €
17/01/2019	326.437.493,39 €	9.836.125,11 €
17/07/2019	316.608.119,37 €	9.829.374,02 €
17/01/2020	306.800.600,14 €	9.807.519,24 €
17/07/2020	297.054.604,36 €	9.745.995,78 €
17/01/2021	287.383.995,34 €	9.670.609,01 €
17/07/2021	277.772.566,80 €	9.611.428,54 €
17/01/2022	268.229.626,44 €	9.542.940,36 €
17/07/2022	258.795.270,66 €	9.434.355,78 €
17/01/2023	249.462.393,47 €	9.332.877,19 €
17/07/2023	240.188.326,20 €	9.274.067,27 €
17/01/2024	230.987.769,16 €	9.200.557,04 €
17/07/2024	221.835.880,64 €	9.151.888,52 €
17/01/2025	212.761.757,37 €	9.074.123,27 €
17/07/2025	203.799.086,07 €	8.962.671,30 €
17/01/2026	194.954.800,31 €	8.844.285,76 €
17/07/2026	186.231.394,08 €	8.723.406,22 €
17/01/2027	177.643.153,44 €	8.588.240,64 €
17/07/2027	169.263.199,65 €	8.379.953,79 €
17/01/2028	161.091.351,24 €	8.171.848,42 €
17/07/2028	153.137.799,75 €	7.953.551,49 €
17/01/2029	145.387.722,43 €	7.750.077,31 €
17/07/2029	137.770.548,57 €	7.617.173,86 €
17/01/2030	130.358.040,35 €	7.412.508,22 €
17/07/2030	123.176.611,57 €	7.181.428,78 €
17/01/2031	116.250.868,84 €	6.925.742,73 €
17/07/2031	109.493.161,89 €	6.757.706,95 €
17/01/2032	102.929.181,47 €	6.563.980,42 €
17/07/2032	96.556.786,98 €	6.372.394,49 €
17/01/2033	90.341.606,28 €	6.215.180,70 €
17/07/2033	84.188.344,64 €	6.153.261,65 €
17/01/2034	78.124.925,60 €	6.063.419,04 €
17/07/2034	72.154.070,24 €	5.970.855,36 €
17/01/2035	0,00 €	72.154.070,24 €
Totales	377.842.493,34 €	

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	36.900.000,00 €	0,00 €
17/01/2017	35.862.125,72 €	1.037.874,28 €
17/07/2017	34.909.065,05 €	953.060,67 €
17/01/2018	33.947.352,16 €	961.712,89 €
17/07/2018	32.983.775,98 €	963.576,18 €
17/01/2019	32.018.988,59 €	964.787,39 €
17/07/2019	31.054.863,38 €	964.125,20 €
17/01/2020	30.092.881,83 €	961.981,55 €
17/07/2020	29.136.934,88 €	955.946,95 €
17/01/2021	28.188.382,32 €	948.552,56 €
17/07/2021	27.245.634,54 €	942.747,78 €
17/01/2022	26.309.604,51 €	936.030,04 €
17/07/2022	25.384.225,11 €	925.379,39 €
17/01/2023	24.468.799,36 €	915.425,75 €
17/07/2023	23.559.142,04 €	909.657,32 €
17/01/2024	22.656.695,06 €	902.446,98 €
17/07/2024	21.759.021,79 €	897.673,28 €
17/01/2025	20.868.976,20 €	890.045,58 €
17/07/2025	19.989.862,51 €	879.113,69 €
17/01/2026	19.122.360,80 €	867.501,71 €
17/07/2026	18.266.715,69 €	855.645,11 €
17/01/2027	17.424.328,45 €	842.387,24 €
17/07/2027	16.602.371,26 €	821.957,19 €
17/01/2028	15.800.826,32 €	801.544,94 €
17/07/2028	15.020.693,28 €	780.133,04 €
17/01/2029	14.260.518,23 €	760.175,05 €
17/07/2029	13.513.379,17 €	747.139,06 €
17/01/2030	12.786.314,96 €	727.064,20 €
17/07/2030	12.081.916,45 €	704.398,52 €
17/01/2031	11.402.597,18 €	679.319,26 €
17/07/2031	10.739.759,90 €	662.837,28 €
17/01/2032	10.095.924,50 €	643.835,40 €
17/07/2032	9.470.881,02 €	625.043,48 €
17/01/2033	8.861.258,03 €	609.622,99 €
17/07/2033	8.257.708,45 €	603.549,59 €
17/01/2034	7.662.971,17 €	594.737,27 €
17/07/2034	7.077.313,11 €	585.658,06 €
17/01/2035	0,00 €	7.077.313,11 €
Totales	36.900.000,00 €	

Vida Media (años) 9,927248075

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	21.600.000,00 €	0,00 €
17/01/2017	20.992.463,83 €	607.536,17 €
17/07/2017	20.434.574,66 €	557.889,17 €
17/01/2018	19.871.620,78 €	562.953,88 €
17/07/2018	19.307.576,18 €	564.044,59 €
17/01/2019	18.742.822,59 €	564.753,59 €
17/07/2019	18.178.456,61 €	564.365,97 €
17/01/2020	17.615.345,46 €	563.111,15 €
17/07/2020	17.055.766,76 €	559.578,71 €
17/01/2021	16.500.516,48 €	555.250,28 €
17/07/2021	15.948.664,12 €	551.852,36 €
17/01/2022	15.400.744,10 €	547.920,02 €
17/07/2022	14.859.058,60 €	541.685,50 €
17/01/2023	14.323.199,63 €	535.858,98 €
17/07/2023	13.790.717,29 €	532.482,33 €
17/01/2024	13.262.455,65 €	528.261,65 €
17/07/2024	12.736.988,36 €	525.467,28 €
17/01/2025	12.215.986,07 €	521.002,29 €
17/07/2025	11.701.382,93 €	514.603,14 €
17/01/2026	11.193.577,05 €	507.805,88 €
17/07/2026	10.692.711,62 €	500.865,43 €
17/01/2027	10.199.606,90 €	493.104,73 €
17/07/2027	9.718.461,22 €	481.145,67 €
17/01/2028	9.249.264,19 €	469.197,04 €
17/07/2028	8.792.600,94 €	456.663,24 €
17/01/2029	8.347.620,43 €	444.980,52 €
17/07/2029	7.910.270,73 €	437.349,70 €
17/01/2030	7.484.672,17 €	425.598,56 €
17/07/2030	7.072.341,33 €	412.330,84 €
17/01/2031	6.674.691,03 €	397.650,30 €
17/07/2031	6.286.688,72 €	388.002,31 €
17/01/2032	5.909.809,46 €	376.879,26 €
17/07/2032	5.543.930,35 €	365.879,11 €
17/01/2033	5.187.077,87 €	356.852,48 €
17/07/2033	4.833.780,55 €	353.297,32 €
17/01/2034	4.485.641,66 €	348.138,89 €
17/07/2034	4.142.817,43 €	342.824,23 €
17/01/2035	0,00 €	4.142.817,43 €
Totales		21.600.000,00 €

Vida Media (años) 9,927248075

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	15.300.000,00 €	0,00 €
17/01/2017	14.869.661,88 €	430.338,12 €
17/07/2017	14.474.490,38 €	395.171,50 €
17/01/2018	14.075.731,38 €	398.759,00 €
17/07/2018	13.676.199,80 €	399.531,59 €
17/01/2019	13.276.166,00 €	400.033,80 €
17/07/2019	12.876.406,77 €	399.759,23 €
17/01/2020	12.477.536,37 €	398.870,40 €
17/07/2020	12.081.168,12 €	396.368,25 €
17/01/2021	11.687.865,84 €	393.302,28 €
17/07/2021	11.296.970,42 €	390.895,42 €
17/01/2022	10.908.860,41 €	388.110,01 €
17/07/2022	10.525.166,51 €	383.693,90 €
17/01/2023	10.145.599,73 €	379.566,78 €
17/07/2023	9.768.424,75 €	377.174,98 €
17/01/2024	9.394.239,42 €	374.185,33 €
17/07/2024	9.022.033,42 €	372.205,99 €
17/01/2025	8.652.990,13 €	369.043,29 €
17/07/2025	8.288.479,58 €	364.510,56 €
17/01/2026	7.928.783,74 €	359.695,83 €
17/07/2026	7.574.004,07 €	354.779,68 €
17/01/2027	7.224.721,55 €	349.282,51 €
17/07/2027	6.883.910,03 €	340.811,52 €
17/01/2028	6.551.562,13 €	332.347,90 €
17/07/2028	6.228.092,33 €	323.469,80 €
17/01/2029	5.912.897,80 €	315.194,53 €
17/07/2029	5.603.108,43 €	309.789,37 €
17/01/2030	5.301.642,79 €	301.465,65 €
17/07/2030	5.009.575,11 €	292.067,68 €
17/01/2031	4.727.906,15 €	281.668,96 €
17/07/2031	4.453.071,18 €	274.834,97 €
17/01/2032	4.186.115,04 €	266.956,14 €
17/07/2032	3.926.950,67 €	259.164,37 €
17/01/2033	3.674.180,16 €	252.770,51 €
17/07/2033	3.423.927,89 €	250.252,27 €
17/01/2034	3.177.329,51 €	246.598,38 €
17/07/2034	2.934.495,68 €	242.833,83 €
17/01/2035	0,00 €	2.934.495,68 €
Totales		15.300.000,00 €

Cifras en euros

Serie Caixa Galicia I

Tasa de amortización anticipada 5%

Vida Media (años) 5,543892757

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	377.842.493,34 €	0,00 €
17/01/2017	356.559.651,21 €	21.282.842,13 €
17/07/2017	337.937.224,02 €	18.622.427,19 €
17/01/2018	319.688.122,75 €	18.249.101,27 €
17/07/2018	301.875.821,94 €	17.812.300,81 €
17/01/2019	284.496.121,22 €	17.379.700,72 €
17/07/2019	267.557.316,30 €	16.938.804,93 €
17/01/2020	251.063.502,33 €	16.493.813,96 €
17/07/2020	235.043.236,17 €	16.020.266,17 €
17/01/2021	219.498.562,48 €	15.544.673,69 €
17/07/2021	204.401.398,43 €	15.097.164,05 €
17/01/2022	189.749.868,54 €	14.651.529,89 €
17/07/2022	175.572.939,63 €	14.176.928,91 €
17/01/2023	161.851.660,88 €	13.721.278,75 €
17/07/2023	148.531.979,62 €	13.319.681,26 €
17/01/2024	135.618.552,69 €	12.913.426,93 €
17/07/2024	123.076.393,92 €	12.542.158,77 €
17/01/2025	110.925.319,05 €	12.151.074,87 €
17/07/2025	99.189.253,21 €	11.736.065,84 €
17/01/2026	87.864.772,07 €	11.324.481,14 €
17/07/2026	76.944.090,13 €	10.920.681,94 €
17/01/2027	66.431.407,14 €	10.512.682,99 €
17/07/2027	0,00 €	66.431.407,14 €
Totales	377.842.493,34 €	

Vida Media (años) 5,567894104

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	36.900.000,00 €	0,00 €
17/01/2017	34.973.554,31 €	1.926.445,69 €
17/07/2017	33.146.952,60 €	1.826.601,71 €
17/01/2018	31.356.968,98 €	1.789.983,62 €
17/07/2018	29.609.829,42 €	1.747.139,55 €
17/01/2019	27.905.121,94 €	1.704.707,49 €
17/07/2019	26.243.660,21 €	1.661.461,73 €
17/01/2020	24.625.845,92 €	1.617.814,29 €
17/07/2020	23.054.480,10 €	1.571.365,82 €
17/01/2021	21.529.763,31 €	1.524.716,80 €
17/07/2021	20.048.940,99 €	1.480.822,31 €
17/01/2022	18.611.829,21 €	1.437.111,78 €
17/07/2022	17.221.269,20 €	1.390.560,01 €
17/01/2023	15.875.402,14 €	1.345.867,05 €
17/07/2023	14.568.926,23 €	1.306.475,91 €
17/01/2024	13.302.298,23 €	1.266.628,00 €
17/07/2024	12.072.086,48 €	1.230.211,75 €
17/01/2025	10.880.234,64 €	1.191.851,84 €
17/07/2025	9.729.089,43 €	1.151.145,21 €
17/01/2026	8.618.314,96 €	1.110.774,47 €
17/07/2026	7.547.147,60 €	1.071.167,37 €
17/01/2027	6.515.999,26 €	1.031.148,33 €
17/07/2027	0,00 €	6.515.999,26 €
Totales	36.900.000,00 €	

Vida Media (años) 5,567894104

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	21.600.000,00 €	0,00 €
17/01/2017	20.472.324,47 €	1.127.675,53 €
17/07/2017	19.403.094,20 €	1.069.230,27 €
17/01/2018	18.355.298,91 €	1.047.795,29 €
17/07/2018	17.332.583,08 €	1.022.715,84 €
17/01/2019	16.334.705,52 €	997.877,55 €
17/07/2019	15.362.142,56 €	972.562,96 €
17/01/2020	14.415.129,32 €	947.013,24 €
17/07/2020	13.495.305,43 €	919.823,89 €
17/01/2021	12.602.788,28 €	892.517,15 €
17/07/2021	11.735.965,46 €	866.822,82 €
17/01/2022	10.894.729,29 €	841.236,17 €
17/07/2022	10.080.742,95 €	813.986,35 €
17/01/2023	9.292.918,33 €	787.824,62 €
17/07/2023	8.528.151,94 €	764.766,39 €
17/01/2024	7.786.711,16 €	741.440,78 €
17/07/2024	7.066.587,21 €	720.123,95 €
17/01/2025	6.368.917,84 €	697.669,37 €
17/07/2025	5.695.076,74 €	673.841,10 €
17/01/2026	5.044.867,30 €	650.209,44 €
17/07/2026	4.417.842,50 €	627.024,80 €
17/01/2027	3.814.243,47 €	603.599,02 €
17/07/2027	0,00 €	3.814.243,47 €
Totales	21.600.000,00 €	

Vida Media (años) 5,567894104

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	15.300.000,00 €	0,00 €
17/01/2017	14.501.229,83 €	798.770,17 €
17/07/2017	13.743.858,39 €	757.371,44 €
17/01/2018	13.001.670,06 €	742.188,33 €
17/07/2018	12.277.246,35 €	724.423,72 €
17/01/2019	11.570.416,41 €	706.829,93 €
17/07/2019	10.881.517,65 €	688.898,76 €
17/01/2020	10.210.716,60 €	670.801,05 €
17/07/2020	9.559.174,68 €	651.541,93 €
17/01/2021	8.926.975,03 €	632.199,65 €
17/07/2021	8.312.975,53 €	613.999,49 €
17/01/2022	7.717.099,92 €	595.875,62 €
17/07/2022	7.140.526,25 €	576.573,66 €
17/01/2023	6.582.483,82 €	558.042,44 €
17/07/2023	6.040.774,29 €	541.709,53 €
17/01/2024	5.515.587,07 €	525.187,22 €
17/07/2024	5.005.499,27 €	510.087,80 €
17/01/2025	4.511.316,80 €	494.182,47 €
17/07/2025	4.034.012,69 €	477.304,11 €
17/01/2026	3.573.447,67 €	460.565,02 €
17/07/2026	3.129.305,10 €	444.142,57 €
17/01/2027	2.701.755,79 €	427.549,31 €
17/07/2027	0,00 €	2.701.755,79 €
Totales	15.300.000,00 €	

Cifras en euros

Serie Caixa Galicia I

Tasa de amortización anticipada 10%

Vida Media (años) 3,886702486

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	377.842.493,34 €	0,00 €
17/01/2017	347.534.550,83 €	30.307.942,51 €
17/07/2017	320.455.357,13 €	27.079.193,70 €
17/01/2018	294.630.796,68 €	25.824.560,45 €
17/07/2018	270.077.506,98 €	24.553.289,70 €
17/01/2019	246.738.889,83 €	23.338.617,14 €
17/07/2019	224.573.355,18 €	22.165.534,65 €
17/01/2020	203.537.393,33 €	21.035.961,86 €
17/07/2020	183.614.231,40 €	19.923.161,92 €
17/01/2021	164.762.142,89 €	18.852.088,51 €
17/07/2021	146.911.402,89 €	17.850.740,00 €
17/01/2022	130.021.268,23 €	16.890.134,66 €
17/07/2022	114.083.834,45 €	15.937.433,78 €
17/01/2023	99.044.406,81 €	15.039.427,64 €
17/07/2023	84.815.435,48 €	14.228.971,34 €
17/01/2024	71.371.094,94 €	13.444.340,54 €
17/07/2024	0,00 €	71.371.094,94 €
Totales		377.842.493,34 €

Vida Media (años) 3,903468525

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	36.900.000,00 €	0,00 €
17/01/2017	34.088.317,19 €	2.811.682,81 €
17/07/2017	31.432.224,02 €	2.656.093,16 €
17/01/2018	28.899.192,98 €	2.533.031,05 €
17/07/2018	26.490.855,95 €	2.408.337,03 €
17/01/2019	24.201.661,44 €	2.289.194,50 €
17/07/2019	22.027.530,05 €	2.174.131,39 €
17/01/2020	19.964.194,08 €	2.063.335,97 €
17/07/2020	18.010.008,34 €	1.954.185,74 €
17/01/2021	16.160.880,04 €	1.849.128,30 €
17/07/2021	14.409.970,14 €	1.750.909,90 €
17/01/2022	12.753.282,29 €	1.656.687,85 €
17/07/2022	11.190.041,18 €	1.563.241,11 €
17/01/2023	9.714.882,01 €	1.475.159,17 €
17/07/2023	8.319.217,36 €	1.395.664,65 €
17/01/2024	7.000.514,10 €	1.318.703,26 €
17/07/2024	0,00 €	7.000.514,10 €
Totales		36.900.000,00 €

Vida Media (años) 3,903468525

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	21.600.000,00 €	0,00 €
17/01/2017	19.954.136,89 €	1.645.863,11 €
17/07/2017	18.399.350,65 €	1.554.786,24 €
17/01/2018	16.916.600,77 €	1.482.749,88 €
17/07/2018	15.506.842,51 €	1.409.758,26 €
17/01/2019	14.166.826,21 €	1.340.016,30 €
17/07/2019	12.894.163,93 €	1.272.662,28 €
17/01/2020	11.686.357,51 €	1.207.806,42 €
17/07/2020	10.542.443,91 €	1.143.913,60 €
17/01/2021	9.460.027,34 €	1.082.416,57 €
17/07/2021	8.435.104,47 €	1.024.922,87 €
17/01/2022	7.465.335,97 €	969.768,50 €
17/07/2022	6.550.268,01 €	915.067,97 €
17/01/2023	5.686.760,20 €	863.507,81 €
17/07/2023	4.869.785,77 €	816.974,43 €
17/01/2024	4.097.861,91 €	771.923,86 €
17/07/2024	0,00 €	4.097.861,91 €
Totales		21.600.000,00 €

Vida Media (años) 3,903468525

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	15.300.000,00 €	0,00 €
17/01/2017	14.134.180,30 €	1.165.819,70 €
17/07/2017	13.032.873,38 €	1.101.306,92 €
17/01/2018	11.982.592,21 €	1.050.281,17 €
17/07/2018	10.984.013,44 €	998.578,77 €
17/01/2019	10.034.835,23 €	949.178,21 €
17/07/2019	9.133.366,12 €	901.469,11 €
17/01/2020	8.277.836,57 €	855.529,55 €
17/07/2020	7.467.564,44 €	810.272,14 €
17/01/2021	6.700.852,70 €	766.711,73 €
17/07/2021	5.974.865,67 €	725.987,03 €
17/01/2022	5.287.946,32 €	686.919,35 €
17/07/2022	4.639.773,17 €	648.173,14 €
17/01/2023	4.028.121,81 €	611.651,36 €
17/07/2023	3.449.431,59 €	578.690,22 €
17/01/2024	2.902.652,19 €	546.779,40 €
17/07/2024	0,00 €	2.902.652,19 €
Totales		15.300.000,00 €

Cifras en euros

Serie Caixa Galicia I

Tasa de amortización anticipada 15%

Vida Media (años) 3,004700213

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	377.842.493,34 €	0,00 €
17/01/2017	338.577.436,82 €	39.265.056,52 €
17/07/2017	303.491.260,98 €	35.086.175,84 €
17/01/2018	270.922.270,33 €	32.568.990,65 €
17/07/2018	240.775.183,11 €	30.147.087,22 €
17/01/2019	212.876.219,19 €	27.898.963,92 €
17/07/2019	187.075.981,16 €	25.800.238,04 €
17/01/2020	163.232.221,89 €	23.843.759,27 €
17/07/2020	141.237.917,72 €	21.994.304,16 €
17/01/2021	120.968.285,32 €	20.269.632,41 €
17/07/2021	102.277.806,80 €	18.690.478,52 €
17/01/2022	85.057.364,15 €	17.220.442,65 €
17/07/2022	69.236.831,57 €	15.820.532,58 €
17/01/2023	0,00 €	69.236.831,57 €
Totales		377.842.493,34 €

Vida Media (años) 3,017615421

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	36.900.000,00 €	0,00 €
17/01/2017	33.209.748,59 €	3.690.251,41 €
17/07/2017	29.768.281,58 €	3.441.467,01 €
17/01/2018	26.573.715,51 €	3.194.566,07 €
17/07/2018	23.616.704,56 €	2.957.010,95 €
17/01/2019	20.880.203,32 €	2.736.501,25 €
17/07/2019	18.349.557,96 €	2.530.645,36 €
17/01/2020	16.010.816,02 €	2.338.741,94 €
17/07/2020	13.853.479,97 €	2.157.336,05 €
17/01/2021	11.865.310,28 €	1.988.169,69 €
17/07/2021	10.032.033,68 €	1.833.276,60 €
17/01/2022	8.342.947,20 €	1.689.086,48 €
17/07/2022	6.791.172,47 €	1.551.774,73 €
17/01/2023	0,00 €	6.791.172,47 €
Totales		36.900.000,00 €

Vida Media (años) 3,017615421

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	21.600.000,00 €	0,00 €
17/01/2017	19.439.852,83 €	2.160.147,17 €
17/07/2017	17.425.335,56 €	2.014.517,27 €
17/01/2018	15.555.345,66 €	1.869.989,89 €
17/07/2018	13.824.412,43 €	1.730.933,24 €
17/01/2019	12.222.558,04 €	1.601.854,39 €
17/07/2019	10.741.204,66 €	1.481.353,38 €
17/01/2020	9.372.184,99 €	1.369.019,67 €
17/07/2020	8.109.354,13 €	1.262.830,86 €
17/01/2021	6.945.547,48 €	1.163.806,65 €
17/07/2021	5.872.409,96 €	1.073.137,52 €
17/01/2022	4.883.676,41 €	988.733,55 €
17/07/2022	3.975.320,47 €	908.355,94 €
17/01/2023	0,00 €	3.975.320,47 €
Totales	21.600.000,00 €	

Vida Media (años) 3,017615421

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	15.300.000,00 €	0,00 €
17/01/2017	13.769.895,76 €	1.530.104,24 €
17/07/2017	12.342.946,02 €	1.426.949,74 €
17/01/2018	11.018.369,85 €	1.324.576,17 €
17/07/2018	9.792.292,14 €	1.226.077,71 €
17/01/2019	8.657.645,28 €	1.134.646,86 €
17/07/2019	7.608.353,30 €	1.049.291,98 €
17/01/2020	6.638.631,03 €	969.722,27 €
17/07/2020	5.744.125,84 €	894.505,19 €
17/01/2021	4.919.762,80 €	824.363,04 €
17/07/2021	4.159.623,72 €	760.139,08 €
17/01/2022	3.459.270,79 €	700.352,93 €
17/07/2022	2.815.852,00 €	643.418,79 €
17/01/2023	0,00 €	2.815.852,00 €
Totales	15.300.000,00 €	

Cifras en euros

Serie Caixa Galicia I

Tasa de amortización anticipada 20%

Vida Media (años) 2,436309309

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	377.842.493,34 €	0,00 €
17/01/2017	329.722.302,05 €	48.120.191,29 €
17/07/2017	287.078.839,36 €	42.643.462,69 €
17/01/2018	248.555.911,24 €	38.522.928,12 €
17/07/2018	213.862.604,38 €	34.693.306,86 €
17/01/2019	182.626.296,77 €	31.236.307,61 €
17/07/2019	154.520.675,08 €	28.105.621,69 €
17/01/2020	129.247.790,07 €	25.272.885,01 €
17/07/2020	106.564.025,40 €	22.683.764,67 €
17/01/2021	86.224.349,92 €	20.339.675,47 €
17/07/2021	67.978.138,84 €	18.246.211,08 €
17/01/2022	0,00 €	67.978.138,84 €
Totales	377.842.493,34 €	

Vida Media (años) 2,446742913

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	36.900.000,00 €	0,00 €
17/01/2017	32.341.182,74 €	4.558.817,26 €
17/07/2017	28.158.450,75 €	4.182.731,99 €
17/01/2018	24.379.886,03 €	3.778.564,72 €
17/07/2018	20.976.954,02 €	3.402.932,01 €
17/01/2019	17.913.105,66 €	3.063.848,35 €
17/07/2019	15.156.334,16 €	2.756.771,51 €
17/01/2020	12.677.414,82 €	2.478.919,34 €
17/07/2020	10.452.452,25 €	2.224.962,56 €
17/01/2021	8.457.412,31 €	1.995.039,94 €
17/07/2021	6.667.712,18 €	1.789.700,13 €
17/01/2022	0,00 €	6.667.712,18 €
Totales	36.900.000,00 €	

Vida Media (años) 2,446742913

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	21.600.000,00 €	0,00 €
17/01/2017	18.931.424,04 €	2.668.575,96 €
17/07/2017	16.482.995,56 €	2.448.428,48 €
17/01/2018	14.271.152,80 €	2.211.842,76 €
17/07/2018	12.279.192,60 €	1.991.960,20 €
17/01/2019	10.485.720,39 €	1.793.472,21 €
17/07/2019	8.872.000,48 €	1.613.719,91 €
17/01/2020	7.420.925,75 €	1.451.074,74 €
17/07/2020	6.118.508,64 €	1.302.417,11 €
17/01/2021	4.950.680,38 €	1.167.828,26 €
17/07/2021	3.903.051,03 €	1.047.629,34 €
17/01/2022	0,00 €	3.903.051,03 €
Totales	21.600.000,00 €	

Vida Media (años) 2,446742913

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	15.300.000,00 €	0,00 €
17/01/2017	13.409.758,70 €	1.890.241,30 €
17/07/2017	11.675.455,19 €	1.734.303,51 €
17/01/2018	10.108.733,23 €	1.566.721,96 €
17/07/2018	8.697.761,42 €	1.410.971,81 €
17/01/2019	7.427.385,28 €	1.270.376,15 €
17/07/2019	6.284.333,68 €	1.143.051,60 €
17/01/2020	5.256.489,07 €	1.027.844,61 €
17/07/2020	4.333.943,62 €	922.545,45 €
17/01/2021	3.506.731,93 €	827.211,68 €
17/07/2021	2.764.661,15 €	742.070,79 €
17/01/2022	0,00 €	2.764.661,15 €
Totales	15.300.000,00 €	

Cifras en euros

Serie Caixa Galicia II

Tasa de amortización anticipada 0%

Vida Media (años) 8,994678101

Vida Media (años) 19,77898901

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	343.157.157,00 €	0,00 €
27/04/2017	328.169.788,33 €	14.987.368,67 €
27/10/2017	318.567.879,01 €	9.601.909,32 €
27/04/2018	308.927.779,24 €	9.640.099,77 €
27/10/2018	299.270.388,58 €	9.657.390,66 €
27/04/2019	289.604.469,54 €	9.665.919,04 €
27/10/2019	279.944.390,92 €	9.660.078,62 €
27/04/2020	270.280.977,75 €	9.663.413,17 €
27/10/2020	260.635.951,18 €	9.645.026,57 €
27/04/2021	251.001.994,57 €	9.633.956,61 €
27/10/2021	241.389.719,70 €	9.612.274,87 €
27/04/2022	231.795.927,08 €	9.593.792,62 €
27/10/2022	222.254.504,90 €	9.541.422,18 €
27/04/2023	212.801.501,55 €	9.453.003,35 €
27/10/2023	203.371.774,20 €	9.429.727,35 €
27/04/2024	193.938.716,52 €	9.433.057,68 €
27/10/2024	184.518.296,49 €	9.420.420,03 €
27/04/2025	175.125.377,06 €	9.392.919,43 €
27/10/2025	165.769.844,49 €	9.355.532,57 €
27/04/2026	156.501.497,10 €	9.268.347,39 €
27/10/2026	147.312.026,12 €	9.189.470,98 €
27/04/2027	138.187.520,13 €	9.124.505,99 €
27/10/2027	129.203.193,39 €	8.984.326,74 €
27/04/2028	120.447.676,75 €	8.755.516,64 €
27/10/2028	111.774.202,15 €	8.673.474,60 €
27/04/2029	103.148.365,70 €	8.625.836,45 €
27/10/2029	94.583.346,17 €	8.565.019,53 €
27/04/2030	86.081.276,76 €	8.502.069,41 €
27/10/2030	77.671.966,05 €	8.409.310,71 €
27/04/2031	69.390.138,32 €	8.281.827,73 €
27/10/2031	61.219.513,33 €	8.170.624,99 €
27/04/2032	53.166.186,07 €	8.053.327,26 €
27/10/2032	45.339.227,45 €	7.826.958,62 €
27/04/2033	37.850.169,82 €	7.489.057,63 €
27/10/2033	30.436.607,95 €	7.413.561,87 €
27/04/2034	23.089.922,35 €	7.346.685,60 €
27/10/2034	15.825.066,49 €	7.264.855,86 €
27/04/2035	8.677.566,03 €	7.147.500,46 €
27/10/2035	1.745.150,90 €	6.932.415,13 €
27/04/2036	0,00 €	1.745.150,90 €
27/10/2036	0,00 €	0,00 €
Totales	343.157.157,00 €	

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2017	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2017	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2018	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2018	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2019	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2019	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2020	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2020	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2021	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2021	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2022	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2022	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2023	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2023	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2024	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2024	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2025	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2025	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2026	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2026	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2027	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2027	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2028	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2028	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2029	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2029	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2030	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2030	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2031	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2031	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2032	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2032	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2033	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2033	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2034	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2034	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2035	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2035	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2036	39.562.634,42 €	5.037.365,58 €
27/10/2036	0,00 €	39.562.634,42 €
Totales	44.600.000,00 €	

Vida Media (años) 19,83561644

Vida Media (años) 19,83561644

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2017	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2017	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2018	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2018	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2019	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2019	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2020	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2020	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2021	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2021	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2022	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2022	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2023	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2023	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2024	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2024	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2025	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2025	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2026	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2026	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2027	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2027	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2028	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2028	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2029	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2029	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2030	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2030	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2031	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2031	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2032	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2032	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2033	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2033	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2034	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2034	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2035	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2035	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2036	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2036	0,00 €	38.000.000,00 €
Totales		38.000.000,00 €

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2017	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2017	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2018	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2018	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2019	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2019	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2020	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2020	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2021	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2021	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2022	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2022	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2023	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2023	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2024	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2024	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2025	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2025	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2026	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2026	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2027	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2027	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2028	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2028	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2029	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2029	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2030	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2030	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2031	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2031	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2032	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2032	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2033	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2033	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2034	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2034	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2035	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2035	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2036	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2036	0,00 €	12.400.000,00 €
Totales		12.400.000,00 €

Cifras en euros

Serie Caixa Galicia II

Tasa de amortización anticipada 5,00%

Vida Media (años) 4,817433654

Vida Media (años) 11,23346264

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	343.157.157,00 €	0,00 €
27/04/2017	317.594.395,68 €	25.562.761,32 €
27/10/2017	297.675.390,63 €	19.919.005,05 €
27/04/2018	278.211.154,51 €	19.464.236,12 €
27/10/2018	259.216.228,92 €	18.994.925,59 €
27/04/2019	240.687.755,87 €	18.528.473,05 €
27/10/2019	222.628.446,71 €	18.059.309,16 €
27/04/2020	205.017.401,76 €	17.611.044,95 €
27/10/2020	187.865.128,30 €	17.152.273,46 €
27/04/2021	171.152.848,31 €	16.712.279,99 €
27/10/2021	154.880.167,53 €	16.272.680,78 €
27/04/2022	139.032.898,97 €	15.847.268,56 €
27/10/2022	123.634.291,36 €	15.398.607,61 €
27/04/2023	108.709.190,66 €	14.925.100,70 €
27/10/2023	94.180.631,79 €	14.528.558,87 €
27/04/2024	80.012.060,15 €	14.168.571,64 €
27/10/2024	66.210.427,84 €	13.801.632,31 €
27/04/2025	52.781.429,74 €	13.428.998,10 €
27/10/2025	39.725.641,52 €	13.055.788,22 €
27/04/2026	27.083.533,97 €	12.642.107,55 €
27/10/2026	14.836.478,76 €	12.247.055,21 €
27/04/2027	2.960.681,99 €	11.875.796,77 €
27/10/2027	0,00 €	2.960.681,99 €
27/04/2028	0,00 €	0,00 €
Totales	343.157.157,00 €	

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2017	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2017	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2018	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2018	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2019	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2019	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2020	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2020	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2021	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2021	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2022	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2022	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2023	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2023	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2024	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2024	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2025	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2025	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2026	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2026	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2027	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2027	36.122.067,14 €	8.477.932,86 €
27/04/2028	0,00 €	36.122.067,14 €
Totales	44.600.000,00 €	

Vida Media (años) 11,32876712

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2017	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2017	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2018	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2018	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2019	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2019	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2020	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2020	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2021	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2021	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2022	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2022	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2023	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2023	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2024	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2024	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2025	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2025	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2026	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2026	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2027	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2027	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2028	0,00 €	38.000.000,00 €
Totales		38.000.000,00 €

Vida Media (años) 11,32876712

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2017	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2017	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2018	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2018	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2019	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2019	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2020	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2020	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2021	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2021	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2022	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2022	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2023	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2023	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2024	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2024	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2025	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2025	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2026	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2026	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2027	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2027	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2028	0,00 €	12.400.000,00 €
Totales		12.400.000,00 €

Cifras en euros

Serie Caixa Galicia II

Tasa de amortización anticipada 10%

Vida Media (años) 3,336284386

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	343.157.157,00 €	0,00 €
27/04/2017	307.064.668,91 €	36.092.488,09 €
27/10/2017	277.348.187,87 €	29.716.481,04 €
27/04/2018	249.066.362,41 €	28.281.825,46 €
27/10/2018	222.181.989,08 €	26.884.373,33 €
27/04/2019	196.634.332,86 €	25.547.656,22 €
27/10/2019	172.370.897,85 €	24.263.435,01 €
27/04/2020	149.318.262,93 €	23.052.634,92 €
27/10/2020	127.437.552,38 €	21.880.710,55 €
27/04/2021	106.662.829,23 €	20.774.723,15 €
27/10/2021	86.949.355,21 €	19.713.474,02 €
27/04/2022	68.240.837,27 €	18.708.517,94 €
27/10/2022	50.520.873,07 €	17.719.964,20 €
27/04/2023	33.776.079,09 €	16.744.793,98 €
27/10/2023	17.892.553,26 €	15.883.525,83 €
27/04/2024	2.800.525,72 €	15.092.027,54 €
27/10/2024	0,00 €	2.800.525,72 €
27/04/2025	0,00 €	0,00 €
Totales		343.157.157,00 €

Vida Media (años) 8,197192211

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2017	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2017	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2018	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2018	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2019	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2019	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2020	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2020	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2021	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2021	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2022	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2022	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2023	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2023	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2024	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2024	33.076.329,62 €	11.523.670,38 €
27/04/2025	0,00 €	33.076.329,62 €
Totales		44.600.000,00 €

Vida Media (años) 8,326027397

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2017	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2017	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2018	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2018	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2019	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2019	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2020	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2020	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2021	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2021	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2022	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2022	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2023	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2023	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2024	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2024	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2025	0,00 €	38.000.000,00 €
Totales		38.000.000,00 €

Vida Media (años) 8,326027397

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2017	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2017	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2018	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2018	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2019	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2019	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2020	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2020	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2021	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2021	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2022	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2022	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2023	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2023	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2024	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2024	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2025	0,00 €	12.400.000,00 €
Totales		12.400.000,00 €

Cifras en euros

Serie Caixa Galicia II

Tasa de amortización anticipada 15%

Vida Media (años) 2,555622121

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	343.157.157,00 €	0,00 €
27/04/2017	296.620.301,76 €	46.536.855,24 €
27/10/2017	257.626.277,78 €	38.994.023,98 €
27/04/2018	221.489.487,61 €	36.136.790,17 €
27/10/2018	188.047.674,65 €	33.441.812,96 €
27/04/2019	157.108.748,30 €	30.938.926,35 €
27/10/2019	128.499.211,40 €	28.609.536,90 €
27/04/2020	102.034.976,66 €	26.464.234,74 €
27/10/2020	77.576.635,50 €	24.458.341,16 €
27/04/2021	54.966.259,16 €	22.610.376,34 €
27/10/2021	34.075.663,03 €	20.890.596,13 €
27/04/2022	14.772.505,59 €	19.303.157,44 €
27/10/2022	0,00 €	14.772.505,59 €
27/04/2023	0,00 €	0,00 €
Totales		343.157.157,00 €

Vida Media (años) 6,289428346

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2017	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2017	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2018	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2018	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2019	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2019	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2020	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2020	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2021	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2021	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2022	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2022	41.571.450,77 €	3.028.549,23 €
27/04/2023	0,00 €	41.571.450,77 €
Totales		44.600.000,00 €

Vida Media (años)	6,323287671
--------------------------	-------------

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2017	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2017	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2018	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2018	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2019	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2019	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2020	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2020	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2021	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2021	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2022	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2022	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2023	0,00 €	38.000.000,00 €
Totales		38.000.000,00 €

Vida Media (años)	6,323287671
--------------------------	-------------

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2017	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2017	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2018	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2018	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2019	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2019	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2020	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2020	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2021	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2021	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2022	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2022	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2023	0,00 €	12.400.000,00 €
Totales		12.400.000,00 €

Cifras en euros

Serie Caixa Galicia II

Tasa de amortización anticipada 20,00%

Vida Media (años)	2,07309941
--------------------------	------------

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	343.157.157,00 €	0,00 €
27/04/2017	286.300.987,95 €	56.856.169,05 €
27/10/2017	238.548.752,23 €	47.752.235,72 €
27/04/2018	195.472.577,21 €	43.076.175,02 €
27/10/2018	156.690.084,03 €	38.782.493,18 €
27/04/2019	121.784.449,81 €	34.905.634,22 €
27/10/2019	90.382.002,01 €	31.402.447,80 €
27/04/2020	62.122.626,21 €	28.259.375,80 €
27/10/2020	36.713.104,34 €	25.409.521,87 €
27/04/2021	13.860.622,99 €	22.852.481,35 €
27/10/2021	0,00 €	13.860.622,99 €
27/04/2022	0,00 €	0,00 €
Totales		343.157.157,00 €

Vida Media (años)	5,248600188
--------------------------	-------------

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2017	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2017	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2018	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2018	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2019	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2019	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2020	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2020	44.600.000,00 €	0,00 €
27/04/2021	44.600.000,00 €	0,00 €
27/10/2021	37.919.574,01 €	6.680.425,99 €
27/04/2022	0,00 €	37.919.574,01 €
Totales		44.600.000,00 €

Vida Media (años)	5,323287671
--------------------------	-------------

Vida Media (años)	5,323287671
--------------------------	-------------

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2017	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2017	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2018	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2018	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2019	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2019	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2020	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2020	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2021	38.000.000,00 €	0,00 €
27/10/2021	38.000.000,00 €	0,00 €
27/04/2022	0,00 €	38.000.000,00 €
Totales		38.000.000,00 €

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2017	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2017	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2018	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2018	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2019	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2019	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2020	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2020	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2021	12.400.000,00 €	0,00 €
27/10/2021	12.400.000,00 €	0,00 €
27/04/2022	0,00 €	12.400.000,00 €
Totales		12.400.000,00 €

Cifras en euros

Serie Caja Cantabria I

Tasa de amortización anticipada 0,00%

Vida Media (años) 7,801980535

Vida Media (años) 17,85147147

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	113.582.812,75 €	0,00 €
20/03/2017	104.592.056,28 €	8.990.756,47 €
20/09/2017	101.298.896,89 €	3.293.159,39 €
20/03/2018	98.051.448,59 €	3.247.448,30 €
20/09/2018	94.798.831,58 €	3.252.617,01 €
20/03/2019	91.535.915,76 €	3.262.915,82 €
20/09/2019	88.261.604,80 €	3.274.310,96 €
20/03/2020	84.976.788,71 €	3.284.816,09 €
20/09/2020	81.684.366,85 €	3.292.421,86 €
20/03/2021	78.380.944,60 €	3.303.422,25 €
20/09/2021	75.070.864,02 €	3.310.080,58 €
20/03/2022	71.768.315,12 €	3.302.548,90 €
20/09/2022	68.462.458,51 €	3.305.856,61 €
20/03/2023	65.148.481,73 €	3.313.976,78 €
20/09/2023	61.824.641,29 €	3.323.840,44 €
20/03/2024	58.491.411,77 €	3.333.229,52 €
20/09/2024	55.147.320,76 €	3.344.091,01 €
20/03/2025	51.791.481,16 €	3.355.839,60 €
20/09/2025	48.434.695,82 €	3.356.785,34 €
20/03/2026	45.099.984,74 €	3.334.711,08 €
20/09/2026	41.784.391,05 €	3.315.593,69 €
20/03/2027	38.485.213,00 €	3.299.178,05 €
20/09/2027	35.206.778,95 €	3.278.434,05 €
20/03/2028	31.967.466,09 €	3.239.312,86 €
20/09/2028	28.739.502,72 €	3.227.963,37 €
20/03/2029	25.530.634,50 €	3.208.868,22 €
20/09/2029	22.339.861,40 €	3.190.773,10 €
20/03/2030	19.170.936,35 €	3.168.925,05 €
20/09/2030	16.092.142,43 €	3.078.793,92 €
20/03/2031	13.133.729,56 €	2.958.412,87 €
20/09/2031	10.257.663,26 €	2.876.066,30 €
20/03/2032	7.436.462,46 €	2.821.200,80 €
20/09/2032	4.692.438,02 €	2.744.024,44 €
20/03/2033	2.005.710,15 €	2.686.727,87 €
20/09/2033	0,00 €	2.005.710,15 €
20/03/2034	0,00 €	0,00 €
20/09/2034	0,00 €	0,00 €
20/03/2035	0,00 €	0,00 €
Totales	113.582.812,75 €	

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2017	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2017	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2018	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2018	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2019	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2019	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2020	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2020	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2021	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2021	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2022	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2022	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2023	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2023	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2024	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2024	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2025	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2025	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2026	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2026	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2027	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2027	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2028	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2028	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2029	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2029	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2030	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2030	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2031	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2031	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2032	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2032	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2033	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2033	12.053.842,57 €	646.157,43 €
20/03/2034	9.475.175,49 €	2.578.667,08 €
20/09/2034	6.996.785,64 €	2.478.389,85 €
20/03/2035	0,00 €	6.996.785,64 €
Totales	12.700.000,00 €	

Vida Media (años) 18,22739726

Vida Media (años) 18,22739726

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2017	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2017	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2018	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2018	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2019	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2019	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2020	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2020	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2021	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2021	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2022	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2022	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2023	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2023	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2024	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2024	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2025	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2025	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2026	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2026	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2027	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2027	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2028	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2028	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2029	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2029	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2030	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2030	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2031	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2031	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2032	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2032	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2033	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2033	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2034	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2034	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2035	0,00 €	10.300.000,00 €
Totales		10.300.000,00 €

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2017	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2017	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2018	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2018	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2019	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2019	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2020	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2020	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2021	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2021	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2022	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2022	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2023	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2023	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2024	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2024	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2025	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2025	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2026	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2026	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2027	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2027	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2028	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2028	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2029	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2029	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2030	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2030	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2031	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2031	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2032	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2032	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2033	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2033	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2034	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2034	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2035	0,00 €	3.500.000,00 €
Totales		3.500.000,00 €

Cifras en euros

Serie Caja Cantabria I

Tasa de amortización anticipada 5%

Vida Media (años) 4,457470362

Vida Media (años) 10,92618958

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	113.582.812,75 €	0,00 €
20/03/2017	101.219.616,63 €	12.363.196,12 €
20/09/2017	94.763.668,99 €	6.455.947,64 €
20/03/2018	88.513.433,97 €	6.250.235,02 €
20/09/2018	82.412.791,52 €	6.100.642,45 €
20/03/2019	76.452.901,78 €	5.959.889,74 €
20/09/2019	70.629.182,87 €	5.823.718,91 €
20/03/2020	64.939.153,12 €	5.690.029,75 €
20/09/2020	59.382.401,83 €	5.556.751,29 €
20/03/2021	53.952.234,65 €	5.430.167,18 €
20/09/2021	48.649.859,13 €	5.302.375,52 €
20/03/2022	43.486.301,54 €	5.163.557,59 €
20/09/2022	38.447.286,62 €	5.039.014,92 €
20/03/2023	33.524.917,28 €	4.922.369,34 €
20/09/2023	28.714.561,44 €	4.810.355,84 €
20/03/2024	24.013.920,08 €	4.700.641,36 €
20/09/2024	19.418.804,29 €	4.595.115,79 €
20/03/2025	14.925.714,02 €	4.493.090,27 €
20/09/2025	10.542.925,90 €	4.382.788,12 €
20/03/2026	6.290.729,81 €	4.252.196,09 €
20/09/2026	2.162.937,49 €	4.127.792,32 €
20/03/2027	0,00 €	2.162.937,49 €
20/09/2027	0,00 €	0,00 €
20/03/2028	0,00 €	0,00 €
Totales	113.582.812,75 €	

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2017	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2017	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2018	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2018	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2019	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2019	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2020	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2020	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2021	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2021	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2022	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2022	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2023	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2023	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2024	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2024	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2025	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2025	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2026	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2026	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2027	10.853.766,69 €	1.846.233,31 €
20/09/2027	6.964.608,45 €	3.889.158,24 €
20/03/2028	0,00 €	6.964.608,45 €
Totales	12.700.000,00 €	

Vida Media (años) 11,22465753

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2017	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2017	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2018	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2018	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2019	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2019	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2020	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2020	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2021	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2021	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2022	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2022	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2023	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2023	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2024	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2024	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2025	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2025	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2026	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2026	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2027	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2027	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2028	0,00 €	10.300.000,00 €
Totales		10.300.000,00 €

Vida Media (años) 11,22465753

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2017	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2017	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2018	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2018	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2019	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2019	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2020	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2020	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2021	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2021	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2022	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2022	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2023	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2023	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2024	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2024	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2025	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2025	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2026	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2026	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2027	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2027	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2028	0,00 €	3.500.000,00 €
Totales		3.500.000,00 €

Cifras en euros

Serie Caja Cantabria I

Tasa de amortización anticipada 10%

Vida Media (años) 3,128739937

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	113.582.812,75 €	0,00 €
20/03/2017	97.861.499,78 €	15.721.312,97 €
20/09/2017	88.409.050,97 €	9.452.448,81 €
20/03/2018	79.470.178,22 €	8.938.872,75 €
20/09/2018	70.968.821,34 €	8.501.356,88 €
20/03/2019	62.878.190,97 €	8.090.630,37 €
20/09/2019	55.176.849,55 €	7.701.341,42 €
20/03/2020	47.846.407,51 €	7.330.442,04 €
20/09/2020	40.871.395,70 €	6.975.011,81 €
20/03/2021	34.230.817,46 €	6.640.578,24 €
20/09/2021	27.912.451,50 €	6.318.365,96 €
20/03/2022	21.914.531,16 €	5.997.920,34 €
20/09/2022	16.210.349,70 €	5.704.181,46 €
20/03/2023	10.780.545,33 €	5.429.804,37 €
20/09/2023	5.609.785,24 €	5.170.760,09 €
20/03/2024	685.714,58 €	4.924.070,66 €
20/09/2024	0,00 €	685.714,58 €
20/03/2025	0,00 €	0,00 €
Totales		113.582.812,75 €

Vida Media (años) 8,065522712

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2017	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2017	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2018	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2018	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2019	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2019	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2020	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2020	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2021	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2021	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2022	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2022	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2023	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2023	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2024	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2024	8.694.643,83 €	4.005.356,17 €
20/03/2025	0,00 €	8.694.643,83 €
Totales		12.700.000,00 €

Vida Media (años) 8,221917808

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2017	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2017	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2018	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2018	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2019	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2019	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2020	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2020	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2021	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2021	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2022	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2022	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2023	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2023	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2024	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2024	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2025	0,00 €	10.300.000,00 €
Totales		10.300.000,00 €

Vida Media (años) 8,221917808

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2017	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2017	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2018	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2018	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2019	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2019	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2020	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2020	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2021	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2021	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2022	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2022	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2023	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2023	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2024	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2024	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2025	0,00 €	3.500.000,00 €
Totales		3.500.000,00 €

Cifras en euros

Serie Caja Cantabria I

Tasa de amortización anticipada 15%

Vida Media (años) 2,399724737

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	113.582.812,75 €	0,00 €
20/03/2017	94.530.363,43 €	19.052.449,32 €
20/09/2017	82.247.340,66 €	12.283.022,77 €
20/03/2018	70.919.840,97 €	11.327.499,69 €
20/09/2018	60.428.560,42 €	10.491.280,55 €
20/03/2019	50.706.410,07 €	9.722.150,35 €
20/09/2019	41.695.162,62 €	9.011.247,45 €
20/03/2020	33.342.892,50 €	8.352.270,12 €
20/09/2020	25.603.541,02 €	7.739.351,48 €
20/03/2021	18.428.177,92 €	7.175.363,10 €
20/09/2021	11.779.243,09 €	6.648.934,83 €
20/03/2022	5.631.817,07 €	6.147.426,02 €
20/09/2022	0,00 €	5.631.817,07 €
20/03/2023	0,00 €	0,00 €
20/09/2023	0,00 €	0,00 €
Totales		113.582.812,75 €

Vida Media (años) 6,508843617

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2017	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2017	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2018	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2018	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2019	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2019	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2020	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2020	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2021	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2021	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2022	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2022	12.637.805,17 €	62.194,83 €
20/03/2023	7.358.705,71 €	5.279.099,46 €
20/09/2023	0,00 €	7.358.705,71 €
Totales		12.700.000,00 €

Vida Media (años) 6,723287671

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2017	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2017	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2018	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2018	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2019	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2019	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2020	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2020	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2021	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2021	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2022	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2022	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2023	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2023	0,00 €	10.300.000,00 €
Totales	10.300.000,00 €	

Vida Media (años) 6,723287671

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2017	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2017	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2018	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2018	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2019	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2019	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2020	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2020	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2021	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2021	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2022	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2022	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2023	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2023	0,00 €	3.500.000,00 €
Totales	3.500.000,00 €	

Cifras en euros

Serie Caja Cantabria I

Tasa de amortización anticipada 20%

Vida Media (años) 1,940356493

Bonos Serie A		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	113.582.812,75 €	0,00 €
20/03/2017	91.238.865,26 €	22.343.947,49 €
20/09/2017	76.290.535,36 €	14.948.329,90 €
20/03/2018	62.859.309,33 €	13.431.226,03 €
20/09/2018	50.752.709,96 €	12.106.599,37 €
20/03/2019	39.835.130,57 €	10.917.579,39 €
20/09/2019	29.987.746,54 €	9.847.384,03 €
20/03/2020	21.105.429,80 €	8.882.316,74 €
20/09/2020	13.095.471,68 €	8.009.958,12 €
20/03/2021	5.868.054,42 €	7.227.417,26 €
20/09/2021	0,00 €	5.868.054,42 €
20/03/2022	0,00 €	0,00 €
20/09/2022	0,00 €	0,00 €
Totales	113.582.812,75 €	

Vida Media (años) 5,439310955

Bonos Serie B		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2017	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2017	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2018	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2018	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2019	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2019	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2020	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2020	12.700.000,00 €	0,00 €
20/03/2021	12.700.000,00 €	0,00 €
20/09/2021	12.049.992,67 €	650.007,33 €
20/03/2022	6.185.202,50 €	5.864.790,17 €
20/09/2022	0,00 €	6.185.202,50 €
Totales	12.700.000,00 €	

Vida Media (años)	5,723287671
--------------------------	-------------

Vida Media (años)	5,723287671
--------------------------	-------------

Bonos Serie C		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2017	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2017	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2018	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2018	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2019	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2019	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2020	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2020	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2021	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2021	10.300.000,00 €	0,00 €
20/03/2022	10.300.000,00 €	0,00 €
20/09/2022	0,00 €	10.300.000,00 €
Totales		10.300.000,00 €

Bonos Serie D		
Fecha Pago	Saldo Vivo	Principal Amortizado
31/12/2016	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2017	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2017	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2018	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2018	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2019	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2019	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2020	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2020	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2021	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2021	3.500.000,00 €	0,00 €
20/03/2022	3.500.000,00 €	0,00 €
20/09/2022	0,00 €	3.500.000,00 €
Totales		3.500.000,00 €

7. Liquidación anticipada

Navarra I

No aplicaría este apartado de liquidación anticipada, puesto que el estado actual del fondo es “liquidado”.

Manlleu I

No aplicaría este apartado de liquidación anticipada, puesto que el estado actual del fondo es “liquidado”.

BBK I

En base a los modelos de la sociedad Gestora y suponiendo una evolución similar del fondo a la del presente ejercicio, durante el próximo ejercicio no se producirá un suceso de liquidación anticipada en los términos recogidos en la documentación de constitución. Bajo el supuesto de continuidad del Fondo y las hipótesis utilizadas en el apartado anterior (punto 6), con una tasa de amortización anticipada de 5% el vencimiento final aproximado del mismo se estima para la fecha de pago de 22/03/2027. No obstante lo anterior, no existe garantía de que no se pueda producir alguno de los supuestos de liquidación anticipada que se recogen en el Folleto de Emisión durante el próximo ejercicio.

BBK II

En base a los modelos de la sociedad Gestora y suponiendo una evolución similar del fondo a la del presente ejercicio, durante el próximo ejercicio no se producirá un suceso de liquidación anticipada en los términos recogidos en la documentación de constitución. Bajo el supuesto de continuidad del Fondo y las hipótesis utilizadas en el apartado anterior (punto 6), con una tasa de amortización anticipada de 5% el vencimiento final aproximado del mismo se estima para la fecha de pago de 02/06/2026. No obstante lo anterior, no existe garantía de que no se pueda producir alguno de los supuestos de liquidación anticipada que se recogen en el Folleto de Emisión durante el próximo ejercicio.

Vital Kutxa

En base a los modelos de la sociedad Gestora y suponiendo una evolución similar del fondo a la del presente ejercicio, durante el próximo ejercicio no se producirá un suceso de liquidación anticipada en los términos recogidos en la documentación de constitución. Bajo el supuesto de continuidad del Fondo y las hipótesis utilizadas en el apartado anterior (punto 6), con una tasa de amortización anticipada de 5% el vencimiento final aproximado del mismo se estima para la fecha de pago de 16/11/2028. No obstante lo anterior, no existe garantía de que no se pueda producir alguno de los supuestos de liquidación anticipada que se recogen en el Folleto de Emisión durante el próximo ejercicio.

Sa Nostra

En base a los modelos de la sociedad Gestora y suponiendo una evolución similar del fondo a la del presente ejercicio, durante el próximo ejercicio no se producirá un suceso de liquidación anticipada en los términos recogidos en la documentación de constitución. Bajo el supuesto de continuidad del Fondo y las hipótesis utilizadas en el apartado anterior (punto 6), con una tasa de amortización anticipada de 5% el vencimiento final aproximado del mismo se estima para la fecha de pago de 16/05/2026. No obstante lo anterior, no existe garantía de que no se pueda producir alguno de los supuestos de liquidación anticipada que se recogen en el Folleto de Emisión durante el próximo ejercicio.

Caja España I

No aplicaría este apartado de liquidación anticipada, puesto que el estado actual del fondo es “liquidado”.

Granada I

En base a los modelos de la sociedad Gestora y suponiendo una evolución similar del fondo a la del presente ejercicio, durante el próximo ejercicio no se producirá un suceso de liquidación anticipada en los términos recogidos en la documentación de constitución. Bajo el supuesto de continuidad del Fondo y las hipótesis utilizadas en el apartado anterior (punto 6), con una tasa de amortización anticipada de 20% el vencimiento final aproximado del mismo se estima para la fecha de pago de 20/05/2020. No obstante lo anterior, no existe garantía de que no se pueda producir alguno de los supuestos de liquidación anticipada que se recogen en el Folleto de Emisión durante el próximo ejercicio.

CCMI

En base a los modelos de la sociedad Gestora y suponiendo una evolución similar del fondo a la del presente ejercicio, durante el próximo ejercicio no se producirá un suceso de liquidación anticipada en los términos recogidos en la documentación de constitución. Bajo el supuesto de continuidad del Fondo y las hipótesis utilizadas en el apartado anterior (punto 6), con una tasa de amortización anticipada de 0% el vencimiento final aproximado del mismo se estima para la fecha de pago de 28/11/2035. No obstante lo anterior, no existe garantía de que no se pueda producir alguno de los supuestos de liquidación anticipada que se recogen en el Folleto de Emisión durante el próximo ejercicio.

Caixa Galicia I

En base a los modelos de la sociedad Gestora y suponiendo una evolución similar del fondo a la del presente ejercicio, durante el próximo ejercicio no se producirá un suceso de liquidación anticipada en los términos recogidos en la documentación de constitución. Bajo el supuesto de continuidad del Fondo y las hipótesis utilizadas en el apartado anterior (punto 6), con una tasa de amortización anticipada de 5% el vencimiento final aproximado del mismo se estima para la fecha de pago de 17/07/2027. No obstante lo anterior, no existe garantía de que no se pueda producir alguno de los supuestos de liquidación anticipada que se recogen en el Folleto de Emisión durante el próximo ejercicio.

Caja Círculo I

No aplicaría este apartado de liquidación anticipada, puesto que el estado actual del fondo es “liquidado”.

Caixa Galicia II

En base a los modelos de la sociedad Gestora y suponiendo una evolución similar del fondo a la del presente ejercicio, durante el próximo ejercicio no se producirá un suceso de liquidación anticipada en los términos recogidos en la documentación de constitución. Bajo el supuesto de continuidad del Fondo y las hipótesis utilizadas en el apartado anterior (punto 6), con una tasa de amortización anticipada de 0% el vencimiento final aproximado del mismo se estima para la fecha de pago de 27/10/2036. No obstante lo anterior, no existe garantía de que no se pueda producir alguno de los supuestos de liquidación anticipada que se recogen en el Folleto de Emisión durante el próximo ejercicio.

Caixa Laietana

No aplicaría este apartado de liquidación anticipada, puesto que el estado actual del fondo es “liquidado”.

Cantabria I

En base a los modelos de la sociedad Gestora y suponiendo una evolución similar del fondo a la del presente ejercicio, durante el próximo ejercicio no se producirá un suceso de liquidación anticipada en los términos recogidos en la documentación de constitución. Bajo el supuesto de continuidad del Fondo y las hipótesis utilizadas en el apartado anterior (punto 6), con una tasa de amortización anticipada de 5% el vencimiento final aproximado del mismo se estima para la fecha de pago de 20/03/2028. No obstante lo anterior, no existe garantía de que no se pueda producir alguno de los supuestos de liquidación anticipada que se recogen en el Folleto de Emisión durante el próximo ejercicio.

8. Otra información de los activos y pasivos

Tanto los activos titulizados como los Bonos emitidos se encuentran denominados en euros.

9. Informe sobre el cumplimiento de las reglas de funcionamiento del fondo

- **BBK I:**

ACTIVOS SUBYACENTES

NIVELES DE MOROSIDAD Y FALLIDOS

Concepto	Meses impago	Días impago	Importe impagado acumulado		Ratio			Ref. Folleto
			Situación actual 31/12/2016	situación cierre anual anterior 31/12/2015	situación actual 31/12/2016	situación cierre anual anterior 31/12/2015	Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a		90	13.928	14.181	3,42	3,49	3,51	
2. Activos Morosos por otras razones								
TOTAL MOROSOS			13.928	14.181	3,42	3,49	3,51	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a		18			2,6	2,56	2,65	
4. Activos Fallidos por otras razones					0		0	
TOTAL FALLIDOS					2,60	2,56	2,65	

RENEGOCIACIÓN DE LOS ACTIVOS

LÍMITE A LA RENEGOCIACIÓN		
	DEFINICIÓN DOCUMENTACIÓN	LÍMITE ACTUAL
NOVACIONES DE TIPO DE INTERÉS	Las modificaciones en el tipo de interés, se podrán realizar siempre que se mantenga la contrapartida inicial del Contrato de Swap, de acuerdo con lo previsto tanto en la Escritura de Constitución como en el Folleto	N/A <i>No hay contrapartida de swap</i>
FECHA FINALIZACIÓN	22/03/2047	22/03/2047

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	TRIMESTRAL	
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)	22	MARZO SEPTIEMBRE

Anterior Fecha de Pago de Cupón	22/09/2016	
Anterior Fecha de Determinación	15/09/2016	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Próxima Fecha de Pago	22/03/2017	

FIJACIÓN DE TIPO DE INTERÉS: *TIPO DE INTERÉS DEL PRÓXIMO PERÍODO*

	ÍNDICE DE REFERENCIA *	MARGEN	FECHA FIJACIÓN	VALOR ÍNDICE REFERENCIA	TIPO DE INTERÉS APLICABLE
TRAMO A	FIJO	0,00 %	N/A	N/A	1,170%
TRAMO B	FIJO	0,00 %	N/A	N/A	1,300%
TRAMO C	FIJO	0,00 %	N/A	N/A	1,650%
TRAMO D	FIJO	0,00 %	N/A	N/A	3,000%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 6M	2,00 %	20/09/2016	-0,200 %	1,800%
PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN	EUR 6M	2,00 %	20/09/2016	-0,200 %	1,800%

* Euribor 6M más un margen, fijado 2 Días Hábiles antes de la Anterior Fecha de Pago.

INFORMACIÓN ADICIONAL

CÓDIGO LEI	95980020140005216158
Original Legal Entity Identifier	BLOOMBERG TICKER
TRAMO A	AYTCG 2007-BBK A
TRAMO B	AYTCG 2007-BBK B
TRAMO C	AYTCG 2007-BBK C
TRAMO D	AYTCG 2007-BBK D

CONTRAPARTIDAS

CONTRAPARTIDA	ENTIDAD	DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD
<i>Agente de Pagos</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Depositario Cuenta Tesorería</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Contrapartida Swap</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Depositario Garantía Swap</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Administrador</i>	BILBAO BIZKAIA KUTXA AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA	KUTXABANK, S.A.
<i>Depositario Reserva</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Commingling</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Back up Servicer</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Acreditante Línea Liquidez</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Depositario Garantía Línea</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Liquidez</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Avalista</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>

ACCIONES CORRECTIVAS

CONCLUIDAS

ACCIÓN	FECHA	ENTIDAD DEPOSITARIA
Asignación de Segundo Rating por la Agencia de Calificación "Fitch"	25/02/2011	
Establecimiento depósito en garantía obligaciones Entidad Contrapartida de Swap en CECA	25/02/2011	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO
Traspaso Contrato Agente Financiero a Barclays PLC	17/07/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
Reestructuración de la operación: Eliminación de la estructura del contrato de swap (en consecuencia cancelación depósito Garantía Swap), cambio remuneración de los Bonos de Tipo Variable a Tipo Fijo, incremento del Fondo de Reserva, adecuación downgrade language del Administrador.	21/03/2013	
Traslado Cuenta Tesorería a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
4ª Escritura de Modificación de la Escritura de Constitución a los efectos de modificar las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación por FITCH RATINGS ESPAÑA, S.A.U. ("FITCH") y MOODY'S INVESTORS SERVICE ESPAÑA, S.A. ("MOODY'S"), así como permitir que se apliquen criterios más actualizados de las Entidades de Calificación que se publiquen en el futuro, y otras modificaciones derivadas de la suscripción de un nuevo Contrato de Prestación de Servicios Financieros	16/03/2016	
Traslado Agente Financiero desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.

RATING MÍNIMO CONTRAPARTIDAS EN DOCUMENTACIÓN

AGENTE DE PAGOS / DEPOSITARIO CUENTA DE TESORERÍA

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	BBB+	F2	30	Naturales
MOODY'S	A3	N/A	30	Naturales

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BANCO SANTANDER, S.A.	FITCH	A-	F2	NO	N/P
	MOODY'S	A3	P-2	NO	N/P

ADMINISTRADOR

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	N/A	N/A	N/A	N/A
MOODY'S	N/A	N/A	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
KUTXABANK, S.A.	FITCH	BBB	F3	NO	N/P
	MOODY'S	Ba1	NP	NO	N/P

* NOTAS

No hay trigger de rating explícito, pero las agencias de rating sí consideran un trigger dinámico. Así, el trigger se detonaría si tuviéramos conocimiento de un potencial impacto negativo en la calificación de los Bonos derivado de la participación de la entidad como Administrador de los Activos

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

Sin actuaciones pendientes.

- **BBK II:**

ACTIVOS SUBYACENTES

NIVELES DE MOROSIDAD Y FALLIDOS

Concepto	Meses impago	Días impago	Importe impagado acumulado		Ratio			Ref. Folleto
			Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a		90	4.660	4.250	2,17	2,19	2,19	
2. Activos Morosos por otras razones								
TOTAL MOROSOS			4.660	4.250	2,17	2,19	2,19	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	18		4.547	3.652	1,65	1,38	1,65	
4. Activos Fallidos por otras razones								
TOTAL FALLIDOS			4.547	3.652	1,65	1,38	1,65	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES

RENEGOCIACIÓN DE LOS ACTIVOS

LÍMITE A LA RENEGOCIACIÓN		
	DEFINICIÓN DOCUMENTACIÓN	LIMITE ACTUAL
NOVACIONES DE TIPO DE INTERÉS	Las modificaciones en el tipo de interés, se podrán realizar siempre que se mantenga la contrapartida inicial del Contrato de Swap, de acuerdo con lo previsto tanto en la Escritura de Constitución como en el Folleto	N/A <i>No hay contrapartida de swap</i>
FECHA FINALIZACIÓN	02/06/2043	02/06/2043

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	TRIMESTRAL	
	2	JUNIO DICIEMBRE
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)		
Anterior Fecha de Pago de Cupón	02/12/2016	
Anterior Fecha de Determinación	25/11/2016	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Próxima Fecha de Pago	02/06/2017	

FIJACIÓN DE TIPO DE INTERÉS: TIPO DE INTERÉS DEL PRÓXIMO PERÍODO

	ÍNDICE DE REFERENCIA *	MARGEN	FECHA FIJACIÓN	VALOR ÍNDICE REFERENCIA	TIPO DE INTERÉS APLICABLE
TRAMO A	FIJO	1,30 %	N/A	N/A	1,170%
TRAMO B	FIJO	1,60 %	N/A	N/A	1,300%
TRAMO C	FIJO	2,00 %	N/A	N/A	1,650%
TRAMO D	FIJO	3,00 %	N/A	N/A	3,000%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 6M	2,00 %	30/11/2016	-0,219 %	1,781%
PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN	EUR 6M	2,00 %	30/11/2016	-0,219 %	1,781%

* Euribor 6M más un margen, fijado 2 Días Hábiles antes de la Anterior Fecha de Pago.

INFORMACIÓN ADICIONAL

CÓDIGO LEI	
Original Legal Entity Identifier	95980020140005216158
BLOOMBERG TICKER	
TRAMO A	AYTCG 2008-BBK2 A
TRAMO B	AYTCG 2008-BBK2 B
TRAMO C	AYTCG 2008-BBK2 C
TRAMO D	AYTCG 2008-BBK2 D

CONTRAPARTIDAS

CONTRAPARTIDA	ENTIDAD	DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD
Agente de Pagos	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
Depositario Cuenta Tesorería	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
Contrapartida Swap	NO APLICA	NO APLICA
Depositario Garantía Swap	NO APLICA	NO APLICA
Administrador	BILBAO BIZKAIA KUTXA AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA	KUTXABANK, S.A.
Depositario Reserva Commingling	NO APLICA	NO APLICA
Back up Servicer	NO APLICA	NO APLICA
Acreditante Línea Liquidez	NO APLICA	NO APLICA
Depositario Garantía Línea Liquidez	NO APLICA	NO APLICA
Avalista	NO APLICA	NO APLICA

ACCIONES CORRECTIVAS

CONCLUIDAS

ACCIÓN	FECHA	ENTIDAD DEPOSITARIA
Asignación de Segundo Rating por la Agencia de Calificación "Fitch"	25/02/2011	
Establecimiento depósito en garantía obligaciones Entidad Contrapartida de Swap en CECA	25/02/2011	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO
Traspaso Contrato Agente Financiero a Barclays PLC	17/07/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
Reestructuración de la operación: Eliminación de la estructura del contrato de swap (en consecuencia cancelación depósito Garantía Swap), cambio remuneración de los Bonos de Tipo Variable a Tipo Fijo, incremento del Fondo de Reserva, adecuación downgrade language del Administrador.	21/03/2013	
Traslado Cuenta Tesorería a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
4ª Escritura de Modificación de la Escritura de Constitución a los efectos de modificar las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación por FITCH RATINGS ESPAÑA, S.A.U. ("FITCH") y MOODY'S INVESTORS SERVICE ESPAÑA, S.A. ("MOODY'S"), así como permitir que se apliquen criterios más actualizados de las Entidades de Calificación que se publiquen en el futuro, y otras modificaciones derivadas de la suscripción de un nuevo Contrato de Prestación de Servicios Financieros	16/03/2016	
Traslado Agente Financiero desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.

RATING MÍNIMO CONTRAPARTIDAS EN DOCUMENTACIÓN

AGENTE DE PAGOS / DEPOSITARIO CUENTA DE TESORERÍA

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	BBB+	F2	30	Naturales
MOODY'S	A3	N/A	30	Naturales

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BANCO SANTANDER, S.A.	FITCH	A-	F2	NO	N/P
	MOODY'S	A3	P-2	NO	N/P

ADMINISTRADOR

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	BBB	F3	14	Naturales
MOODY'S	Ba1	N/A	30	Naturales

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
KUTXABANK, S.A.	FITCH	BBB	F3	NO	N/P
	MOODY'S	Ba1	N/A	NO	N/P

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

Sin actuaciones pendientes.

- SERIE CAIXA GALICIA I :**

ACTIVOS SUBYACENTES

NIVELES DE MOROSIDAD Y FALLIDOS

Concepto	Meses impago	Días impago	Importe impagado acumulado		Ratio			Ref. Folleto
			Situación actual 31/12/2016	situación cierre anual anterior 31/12/2015	situación actual 31/12/2016	situación cierre anual anterior 31/12/2015	Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a		90	288	204	1,48	1,08	0,87	
2. Activos Morosos por otras razones								
TOTAL MOROSOS			288	204	1,48	1,08	0,87	FOLLETO INFORMATIVO . GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	18		147	86	0,33	0,13	0,22	
4. Activos Fallidos por otras razones					0	0	0	
TOTAL FALLIDOS			147	86	0,33	0,13	0,22	FOLLETO INFORMATIVO . GLOSARIO DE DEFINICIONES

RENEGOCIACIÓN DE LOS ACTIVOS

LÍMITE A LA RENEGOCIACIÓN		
	DEFINICIÓN DOCUMENTACIÓN	LIMITE ACTUAL
NOVACIONES DE TIPO DE INTERÉS	Se podrán realizar siempre que se mantenga la Entidad de Contrapartida inicial del Contrato de Swap,	N/A
FECHA FINALIZACIÓN	27/04/2058	27/04/2058

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	TRIMESTRAL	
	15	ENERO JULIO
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)		
Anterior Fecha de Pago de Cupón	18/07/2016	
Anterior Fecha de Determinación	14/07/2016	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Próxima Fecha de Pago	17/01/2017	

FIJACIÓN DE TIPO DE INTERÉS: TIPO DE INTERÉS DEL PRÓXIMO PERÍODO

	ÍNDICE DE REFERENCIA *	MARGEN	FECHA FIJACIÓN	VALOR ÍNDICE REFERENCIA	TIPO DE INTERÉS APLICABLE
TRAMO A	EUR 6M	0,30 %	14/07/2016	-0,190 %	0,110%
TRAMO B	EUR 6M	0,60 %	14/07/2016	-0,190 %	0,410%
TRAMO C	EUR 6M	1,00 %	14/07/2016	-0,190 %	0,810%
TRAMO D	EUR 6M	2,00 %	14/07/2016	-0,190 %	1,810%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 6M	2,00 %	14/07/2016	-0,190 %	1,810%
PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN	EUR 6M	2,00 %	14/07/2016	-0,190 %	1,810%

* Euribor 6M más un margen, fijado 2 Días Hábiles antes de la Anterior Fecha de Pago.

INFORMACIÓN ADICIONAL

CÓDIGO LEI Original Legal Entity Identifier	95980020140005216158
	BLOOMBERG TICKER
TRAMO A	AYTCG 2008-CG1 A
TRAMO B	AYTCG 2008-CG1 B
TRAMO C	AYTCG 2008-CG1 C
TRAMO D	AYTCG 2008-CG1 D

CONTRAPARTIDAS

CONTRAPARTIDA	ENTIDAD	DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD
<i>Agente de Pagos</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Depositario Cuenta Tesorería</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Contrapartida Swap</i>	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO	CECABANK, S.A.
<i>Depositario Garantía Swap</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Administrador</i>	CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ABANCA CORPORACIÓN BANCARIA, S.A.
<i>Depositario Reserva Commingling</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Back up Servicer</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Acreditante Línea Liquidez</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Depositario Garantía Línea Liquidez</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Avalista</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>

ACCIONES CORRECTIVAS

CONCLUIDAS

ACCIÓN	FECHA	ENTIDAD DEPOSITARIA
Establecimiento en CECA de un depósito en garantía de las obligaciones de Caixa Galicia como Entidad de Contrapartida de Swap. Dicha garantía está regulada en el Anexo III al CMOF formalizado en la misma fecha.	17/04/2009	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO
Establecimiento en CECA de un depósito en garantía de las obligaciones de Caixa Galicia Administrador de los Activos. Dicha garantía vendrá definida por lo recogido en el Suplemento al Contrato de Admon formalizado en la misma fecha	08/10/2010	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO
Modificación Escritura a los efectos de incorporar a Moodys como Agencia de Rating partícipe en la operación. Se modifican contrato swap, contrato admon, contrato prestación de servicios financieros	20/12/2010	
Subrogación de CECA en la posición de Caixa Galicia como Entidad de Contrapartida de Swap	30/12/2010	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO
Establecimiento en CECA de un depósito en garantía de las obligaciones de CECA como Entidad de Contrapartida de Swap.	02/04/2012	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO
Traslado Agente Financiero desde CECA a Barclays Bank PLC SE	17/07/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
2ª Modificación Escritura a los efectos de recoger criterios actualizados de las Agencias de Rating. Se ven afectados el Contrato de Swap, el Contrato de Prestación de Servicios Financieros y el Contrato de Admon	27/07/2012	
Traslado del Depósito en garantía de las obligaciones del Administrador desde CECA a Barclays Bank PLC SE	02/08/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
Traslado del Depósito en garantía de las obligaciones de la Entidad de Contrapartida de Swap desde CECA a Barclays Bank PLC SE	08/08/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
3ª Modificación Escritura a los efectos de modificar las facultades de renegociación de los Activos por parte del Administrador a efectos de permitir la eliminación de la cláusula de suelo en los Préstamos Hipotecarios	19/12/2013	
Traslado Cuenta Tesorería a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
Traslado Cuenta Depósito Swap a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
Traslado Cuenta Depósito Administrador a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
ACCIÓN	FECHA	ENTIDAD DEPOSITARIA
4ª Escritura de Modificación de la Escritura de Constitución a los efectos de modificar las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación por FITCH RATINGS ESPAÑA, S.A.U. ("FITCH") y MOODY'S INVESTORS SERVICE ESPAÑA, S.A. ("MOODY'S"), así como permitir que se apliquen criterios más actualizados de las Entidades de Calificación que se publiquen en el futuro, y otras modificaciones derivadas de la suscripción de un nuevo Contrato de Servicios Financieros	16/03/2016	
Traslado Agente Financiero desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.
Traslado depositaría cuenta de depósito en garantía de la CS desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.
Traslado depositaría cuenta de depósito en garantía del AD desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.

RATING MÍNIMO CONTRAPARTIDAS EN DOCUMENTACIÓN

AGENTE DE PAGOS / DEPOSITARIO CUENTA DE TESORERÍA

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	A-	F2	30	Naturales
MOODY'S	A3	N/A	30	Naturales

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BANCO SANTANDER, S.A.	FITCH	A-	F2	NO	N/P
	MOODY'S	A3	P-2	NO	N/P

CONTRAPARTIDA SWAP

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	A-	F2	30	Naturales
CON COLATERAL	BBB-	F3	30	Naturales
MOODY'S	N/A	N/A		
CON COLATERAL	N/A	N/A		

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
CECABANK, S.A.	FITCH			NO *	N/P
	CON COLATERAL	BBB-	F3	NO	N/P
	MOODY'S			NO	N/P
	CON COLATERAL	Baa2	P-2	NO	N/P

* NOTAS

FITCH: Se ha establecido un depósito en Banco Santander, en garantía de las obligaciones de CECABANK como Entidad de Contrapartida de Swap.

MOODY'S: El establecimiento de un depósito por CECABANK supone que la participación de dicha Entidad como CS no tenga un impacto negativo sobre las calificaciones, por lo que el trigger no se ha detonado.

DEPOSITARIO GARANTÍA SWAP

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	A-	F2	N/A	N/A
MOODY'S	N/A	N/A	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BANCO SANTANDER, S.A.	FITCH	A-	F2	NO	N/P
	MOODY'S	A3	P-2	NO	N/P

ADMINISTRADOR

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	N/A	F2	N/A	N/A
MOODY'S	N/A	N/A	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
ABANCA CORPORACIÓN BANCARIA, S.A.	FITCH	BB+	B	NO *	N/P
	MOODY'S	B2	N/A	NO	N/P

* NOTAS

FITCH: Se ha establecido un depósito según las directrices establecidas en documentación.

MOODY'S: Si bien no existe rating explícito el depósito anterior está siendo ajustado igualmente bajo los requisitos de Moody's.

No existe trigger para la entidad depositaria, la Entidad Depositaria actual dispone de calificación suficiente.

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

Sin actuaciones pendientes.

- SERIE CAIXA GALICIA II:**

ACTIVOS SUBYACENTES

NIVELES DE MOROSIDAD Y FALLIDOS

Concepto	Meses impago	Días impago	Importe impagado acumulado		Ratio			Ref. Folleto
			Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a		90	440	275	2,90	2,57	2,81	
2. Activos Morosos por otras razones						0		
TOTAL MOROSOS			440	275	2,90	2,57	2,81	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	18		241	33	0,92	0,08	0,70	
4. Activos Fallidos por otras razones			0					
TOTAL FALLIDOS			241	33	0,92	0,08	0,70	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES

RENEGOCIACIÓN DE LOS ACTIVOS

LÍMITE A LA RENEGOCIACIÓN		
	DEFINICIÓN DOCUMENTACIÓN	LIMITE ACTUAL
NOVACIONES DE TIPO DE INTERÉS	Se podrán realizar siempre que se mantenga la Entidad de Contrapartida inicial del Contrato de Swap,	N/A
FECHA FINALIZACIÓN	27/04/2058	27/04/2058

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	SEMESTRAL	
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)	27	ABRIL OCTUBRE

Anterior Fecha de Pago de Cupón	27/10/2016	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Anterior Fecha de Determinación	20/10/2016	
Próxima Fecha de Pago	27/04/2017	

FIJACIÓN DE TIPO DE INTERÉS: *TIPO DE INTERÉS DEL PRÓXIMO PERÍODO*

	ÍNDICE DE REFERENCIA *	MARGEN	FECHA FIJACIÓN	VALOR ÍNDICE REFERENCIA	TIPO DE INTERÉS APLICABLE
TRAMO A	EUR 6M	0,30 %	25/10/2016	-0,212 %	0,088%
TRAMO B	EUR 6M	0,60 %	25/10/2016	-0,212 %	0,388%
TRAMO C	EUR 6M	1,00 %	25/10/2016	-0,212 %	0,788%
TRAMO D	EUR 6M	2,00 %	25/10/2016	-0,212 %	1,788%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 6M	2,00 %	25/10/2016	-0,212 %	1,788%
PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN	EUR 6M	2,00 %	25/10/2016	-0,212 %	1,788%

* Euribor 6M más un margen, fijado 2 Días Hábiles antes de la Anterior Fecha de Pago.

INFORMACIÓN ADICIONAL

CÓDIGO LEI	
Original Legal Entity Identifier	95980020140005216158
	BLOOMBERG TICKER
TRAMO A	AYTCG 2008-CG2 A
TRAMO B	AYTCG 2008-CG2 B
TRAMO C	AYTCG 2008-CG2 C
TRAMO D	AYTCG 2008-CG2 D

CONTRAPARTIDAS

CONTRAPARTIDA	ENTIDAD	DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD
<i>Agente de Pagos</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Depositario Cuenta Tesorería</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Contrapartida Swap</i>	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO	CECABANK, S.A.
<i>Depositario Garantía Swap</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Administrador</i>	CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ABANCA CORPORACIÓN BANCARIA, S.A.
<i>Depositario Reserva Commingling</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Back up Servicer</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Acreditante Línea Liquidez</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Depositario Garantía Línea Liquidez</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Avalista</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>

ACCIONES CORRECTIVAS

CONCLUIDAS

ACCIÓN	FECHA	ENTIDAD DEPOSITARIA
Establecimiento en CECA de un depósito en garantía de las obligaciones de Caixa Galicia como Entidad de Contrapartida de Swap. Dicha garantía está regulada en el Anexo III al CMOF formalizado en la misma fecha.	17/04/2009	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO
Establecimiento en CECA de un depósito en garantía de las obligaciones de Caixa Galicia Administrador de los Activos. Dicha garantía vendrá definida por lo recogido en el Suplemento al Contrato de Admon formalizado en la misma fecha	08/10/2010	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO
Modificación Escritura a los efectos de incorporar a Moodys como Agencia de Rating partícipe en la operación. Se modifican contrato swap, contrato admon, contrato prestación de servicios financieros	20/12/2010	
Subrogación de CECA en la posición de Caixa Galicia como Entidad de Contrapartida de Swap	30/12/2010	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO
Establecimiento en CECA de un depósito en garantía de las obligaciones de CECA como Entidad de Contrapartida de Swap.	02/04/2012	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO
Traslado Agente Financiero desde CECA a Barclays Bank PLC SE	17/07/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
2ª Modificación Escritura a los efectos de recoger criterios actualizados de las Agencias de Rating. Se ven afectados el Contrato de Swap, el Contrato de Prestación de Servicios Financieros y el Contrato de Admon	27/07/2012	
Traslado del Depósito en garantía de las obligaciones del Administrador desde CECA a Barclays Bank PLC SE	02/08/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
Traslado del Depósito en garantía de las obligaciones de la Entidad de Contrapartida de Swap desde CECA a Barclays Bank PLC SE	08/08/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
3ª Modificación Escritura a los efectos de modificar las facultades de renegociación de los Activos por parte del Administrador a efectos de permitir la eliminación de la cláusula de suelo en los Préstamos Hipotecarios	19/12/2013	
Traslado Cuenta Tesorería a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
Traslado Cuenta Depósito Swap a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
Traslado Cuenta Depósito Administrador a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
ACCIÓN	FECHA	ENTIDAD DEPOSITARIA
4ª Escritura de Modificación de la Escritura de Constitución a los efectos de modificar las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación por FITCH RATINGS ESPAÑA, S.A.U. ("FITCH") y MOODY'S INVESTORS SERVICE ESPAÑA, S.A. ("MOODY'S"), así como permitir que se apliquen criterios más actualizados de las Entidades de Calificación que se publiquen en el futuro, y otras modificaciones derivadas de la suscripción de un nuevo Contrato de Servicios Financieros	16/03/2016	
Traslado Agente Financiero desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.
Traslado depositaría cuenta de depósito en garantía de la CS desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.
Traslado depositaría cuenta de depósito en garantía del AD desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.

RATING MÍNIMO CONTRAPARTIDAS EN DOCUMENTACIÓN

AGENTE DE PAGOS / DEPOSITARIO CUENTA DE TESORERÍA

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	A-	F2	30	Naturales
MOODY'S	A3	N/A	30	Naturales

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BANCO SANTANDER, S.A.	FITCH	A-	F2	NO	N/P
	MOODY'S	A3	P-2	NO	N/P

CONTRAPARTIDA SWAP

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	A-	F2	30	Naturales
CON COLATERAL	BBB-	F3	30	Naturales
MOODY'S	N/A	N/A		
CON COLATERAL	N/A	N/A		

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
CECABANK, S.A.	FITCH			NO *	N/P
	CON COLATERAL	BBB-	F3	NO	N/P
	MOODY'S			NO	N/P
	CON COLATERAL	Ba2	P-2	NO	N/P

* NOTAS

FITCH: Se ha establecido un depósito en garantía de las obligaciones de la Entidad de Contrapartida de Swap, siguiendo las especificaciones recogidas en documentación.

MOODY'S: El establecimiento de un depósito supone que la participación de dicha Entidad de Contrapartida no tenga impacto negativo sobre las calificaciones, por lo que el trigger no se ha detonado.

DEPOSITARIO GARANTÍA SWAP

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	A-	F2	N/A	N/A
MOODY'S	N/A	N/A	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BANCO SANTANDER, S.A.	FITCH	A-	F2	NO	N/P
	MOODY'S	A3	P-2	NO	N/P

ADMINISTRADOR

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	N/A	F2	N/A	N/A
MOODY'S	N/A	N/A	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
ABANCA CORPORACIÓN BANCARIA, S.A.	FITCH	BB+	B	NO *	N/P
	MOODY'S	B2	N/A	NO	N/P

* NOTAS

FITCH: Se ha establecido un depósito en garantía de las obligaciones de la Entidad Administradora, siguiendo las especificaciones recogidas en documentación.

MOODY'S: Si bien no existe rating explícito depósito en garantía de las obligaciones de la Entidad Administradora, está siendo ajustado igualmente bajo los requisitos de Moodys.

No existe trigger para la entidad depositaria, la Entidad Depositaria actual dispone de calificación suficiente.

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

Sin actuaciones pendientes.

- SERIE CAJA CANTABRIA:**

ACTIVOS SUBYACENTES

NIVELES DE MOROSIDAD Y FALLIDOS

Concepto	Meses impago	Días impago	Importe impagado acumulado		Ratio			Ref. Folleto
			Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a		90	2.815	1.942	4,53	3,98	4,18	
2. Activos Morosos por otras razones						0		
TOTAL MOROSOS		90	2.815	1.942	4,53	3,98	4,18	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	18		2.168	1.890	3,21	2,96	2,94	
4. Activos Fallidos por otras razones			0		0	0	0	
TOTAL FALLIDOS			2.168	1.890	3,21	2,96	2,94	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES

RENEGOCIACIÓN DE LOS ACTIVOS

LÍMITE A LA RENEGOCIACIÓN		
	DEFINICIÓN DOCUMENTACIÓN	LÍMITE ACTUAL
NOVACIONES DE TIPO DE INTERÉS	Las modificaciones en el tipo de interés, se podrán realizar siempre que se mantenga la contrapartida inicial del Contrato de Swap, de acuerdo con lo previsto tanto en la Escritura de Constitución como en el Folleto	N/A
FECHA FINALIZACIÓN	20/03/2048	20/03/2048

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	TRIMESTRAL	
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)	20	MARZO SEPTIEMBRE
Anterior Fecha de Pago de Cupón	20/09/2016	
Anterior Fecha de Determinación	13/09/2016	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Próxima Fecha de Pago	20/03/2017	

FIJACIÓN DE TIPO DE INTERÉS: TIPO DE INTERÉS DEL PRÓXIMO PERÍODO

	ÍNDICE DE REFERENCIA *	MARGEN	FECHA FIJACIÓN	VALOR ÍNDICE REFERENCIA	TIPO DE INTERÉS APLICABLE
TRAMO A	EUR 6M	0,30 %	16/09/2016	-0,199 %	0,101%
TRAMO B	EUR 6M	0,60 %	16/09/2016	-0,199 %	0,401%
TRAMO C	EUR 6M	1,00 %	16/09/2016	-0,199 %	0,801%
TRAMO D	EUR 6M	2,00 %	16/09/2016	-0,199 %	1,801%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 6M	2,00 %	16/09/2016	-0,199 %	1,801%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 6M	2,00 %	16/09/2016	-0,199 %	1,801%

* Euribor 6M más un margen, fijado 2 Días Hábiles antes de la Anterior Fecha de Pago.

INFORMACIÓN ADICIONAL

CÓDIGO LEI	
Original Legal Entity Identifier	95980020140005216158
	BLOOMBERG TICKER
TRAMO A	AYTCG 2008-CC1 A
TRAMO B	AYTCG 2008-CC1 B
TRAMO C	AYTCG 2008-CC1 C
TRAMO D	AYTCG 2008-CC1 D

CONTRAPARTIDAS

CONTRAPARTIDA	ENTIDAD	DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD
Agente de Pagos	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
Depositario Cuenta Tesorería	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
Contrapartida Swap	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO	CECABANK, S.A.
Depositario Garantía Swap	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
Administrador	CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	LIBERBANK, S.A.
Depositario Reserva	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
Commingling		
Back up Servicer	NO APLICA	NO APLICA
Acreditante Línea Liquidez	NO APLICA	NO APLICA
Depositario Garantía Línea		
Liquidez	NO APLICA	NO APLICA
Avalista	NO APLICA	NO APLICA

ACCIONES CORRECTIVAS

CONCLUIDAS

ACCIÓN	FECHA	ENTIDAD DEPOSITARIA
Escritura de Modificación con objeto de incorporar a Moodys como Agencia de Calificación.	01/03/2011	
Establecimiento en CECA de un depósito en garantía de las obligaciones de CECA como CS	02/04/2012	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO
Apertura Cuenta de Tesorería (transitoria) en Banco Santander.	13/04/2012	BANCO SANTANDER, S.A.
Traslado depósito en garantía de las obligaciones de CECA como CS desde CECA a BBPLC SE	08/08/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
2ª Escritura de modificación el objeto de: (i) sustituir a CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORROS por BANCO SANTANDER, S.A. como Agente Financiero por descenso de su calificación crediticia y (ii) modificar las actuaciones a realizar por el Agente Financiero y la Entidad de Contrapartida del Contrato de Swap en caso de descenso de su calificación por MOODY'S INVESTORS SERVICE ESPAÑA, S.A. ("MOODY'S") y FITCH RATINGS ESPAÑA, S.A.U. ("FITCH"), así como permitir que se apliquen criterios más actualizados de las Entidades de Calificación que se publiquen en el futuro	09/08/2012	BANCO SANTANDER, S.A.
Formalización Suplemento al Contrato de Administración y Establecimiento en Banco Santander de un depósito en garantía de las obligaciones de Caja Cantabria (LIBERBANK) como Administrador de los Activos	15/04/2013	BANCO SANTANDER, S.A.
Traslado Cuenta Depósito Swap a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
Traslado depositaría cuenta de depósito en garantía de la CS desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.

RATING MÍNIMO CONTRAPARTIDAS EN DOCUMENTACIÓN

AGENTE DE PAGOS / DEPOSITARIO CUENTA DE TESORERÍA

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	BBB+	F2	30	Naturales
MOODY'S	N/A	N/A		

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BANCO SANTANDER, S.A.	FITCH	A-	F2	NO	N/P
	MOODY'S	A3	P-2	NO	N/P

CONTRAPARTIDA SWAP

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	BBB+	F2	30	Naturales
CON COLATERAL	BB+	N/A	30	Naturales
MOODY'S	N/A	N/A		
CON COLATERAL	N/A	N/A		

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
CECABANK, S.A.	FITCH			NO *	N/P
	CON COLATERAL	BBB-	F3	NO	N/P
	MOODY'S			NO	N/P
	CON COLATERAL	Ba2	P-2	NO	N/P

* NOTAS

FITCH: Se ha establecido un depósito en garantía de las obligaciones de la Entidad de Contrapartida de Swap, siguiendo las especificaciones recogidas en documentación.

MOODY'S: El establecimiento de un depósito supone que la participación de dicha Entidad de Contrapartida no tenga impacto negativo sobre las calificaciones, por lo que el trigger no se ha detonado.

DEPOSITARIO GARANTÍA SWAP

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	BBB+	F2	N/A	N/A
MOODY'S	N/A	N/A	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BANCO SANTANDER, S.A.	FITCH	A-	F2	NO	N/P
	MOODY'S	A3	P-2	NO	N/P

ADMINISTRADOR

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	N/A	F2	N/A	N/A
MOODY'S	N/A	N/A	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
LIBERBANK, S.A.	FITCH	BB	B	NO *	N/P
	MOODY'S	B1	N/A	NO	N/P

** NOTAS*

FITCH: Se ha establecido un depósito en garantía de las obligaciones de la Entidad Administradora, siguiendo las especificaciones recogidas en documentación.

MOODY'S: Si bien no existe rating explícito depósito en garantía de las obligaciones de la Entidad Administradora, está siendo ajustado igualmente bajo los requisitos de Moodys.

No existe trigger para la entidad depositaria, la Entidad Depositaria actual dispone de calificación suficiente.

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

Sin actuaciones pendientes.

- SERIE CAJA GRANADA:**

ACTIVOS SUBYACENTES

NIVELES DE MOROSIDAD Y FALLIDOS

Concepto	Meses impago	Días impago	Importe impagado acumulado		Ratio			Ref. Folleto
			Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a		90	1.312	1.378	9,87	9,47	10,12	
2. Activos Morosos por otras razones						0		
TOTAL MOROSOS			1.312	1.378	9,87	9,47	10,12	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	18		1.257	2.271	8,71	7,73	8,55	
4. Activos Fallidos por otras razones			0		0	0	0	
TOTAL FALLIDOS			1.257	2.271	8,71	7,73	8,55	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES

RENEGOCIACIÓN DE LOS ACTIVOS

LÍMITE A LA RENEGOCIACIÓN		
	DEFINICIÓN DOCUMENTACIÓN	LIMITE ACTUAL
NOVACIONES DE TIPO DE INTERÉS	Las modificaciones en el tipo de interés, se podrán realizar siempre que se mantenga la contrapartida inicial del Contrato de Swap, de acuerdo con lo previsto tanto en la Escritura de Constitución como en el Folleto	N/A
FECHA FINALIZACIÓN	20/05/2047	20/05/2047

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	SEMESTRAL	
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)	20	MAYO NOVIEMBRE

Anterior Fecha de Pago de Cupón	21/11/2016	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Anterior Fecha de Determinación	14/11/2016	
Próxima Fecha de Pago	22/05/2017	

FIJACIÓN DE TIPO DE INTERÉS: *TIPO DE INTERÉS DEL PRÓXIMO PERÍODO*

	ÍNDICE DE REFERENCIA *	MARGEN	FECHA FIJACIÓN	VALOR ÍNDICE REFERENCIA	TIPO DE INTERÉS APLICABLE
TRAMO A	EUR 6M	0,25 %	17/11/2016	-0,215 %	0,035%
TRAMO B	EUR 6M	0,60 %	17/11/2016	-0,215 %	0,385%
TRAMO C	EUR 6M	1,50 %	17/11/2016	-0,215 %	1,285%
TRAMO D	EUR 6M	2,50 %	17/11/2016	-0,215 %	2,285%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 6M	2,00 %	17/11/2016	-0,215 %	1,785%
PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN	EUR 6M	2,00 %	17/11/2016	-0,215 %	1,785%

* Euribor 6M más un margen, fijado 2 Días Hábiles antes de la Anterior Fecha de Pago.

INFORMACIÓN ADICIONAL

CÓDIGO LEI	95980020140005216158
Original Legal Entity Identifier	BLOOMBERG TICKER
TRAMO A	AYTCG 07-CGR1 A
TRAMO B	AYTCG 07-CGR1 B
TRAMO C	AYTCG 07-CGR1 C
TRAMO D	AYTCG 07-CGR1 D

CONTRAPARTIDAS

CONTRAPARTIDA	ENTIDAD	DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD
<i>Agente de Pagos</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Depositario Cuenta Tesorería</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Contrapartida Swap</i>	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO	CECABANK, S.A.
<i>Depositario Garantía Swap</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Administrador</i>	CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	BANCO MARE NOSTRUM, S.A.
<i>Depositario Reserva Commingling</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Back up Servicer</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Acreditante Línea Liquidez</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Depositario Garantía Línea Liquidez</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Avalista</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>

ACCIONES CORRECTIVAS

CONCLUIDAS

ACCIÓN	FECHA	ENTIDAD DEPOSITARIA
Modificación de Escritura a los efectos de incorporar a Moodys como Agencia de Calificación. Se ven afectados los contratos de Servicios Financieros, Swap y Administrador	13/12/2010	
Establecimiento en CECA en garantía de las obligaciones de CECA como Entidad de Contrapartida de Swap	02/04/2012	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO
Traslado Agente Financiero desde CECA a Barclays Bank PLC SE	17/07/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
Formalización Suplemento al Contrato de Admon y establecimiento en BB PLC SE de un depósito en garantía de las obligaciones del Administrador	08/08/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
Formalización Suplemento al Contrato de Administración y establecimiento Depósito en Barclays Bank PLC SE, en garantía obligaciones del Administrador	23/11/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
Suplemento al Contrato de Admon, incorporando cláusula de continuidad del Administrador, a los efectos de la orientación del BCE de 9 de julio de 2014 (BCE/2014/31)	10/10/2014	
Traslado Cuenta Tesorería a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
Traslado Cuenta Depósito Swap a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
Traslado Cuenta Depósito Administrador a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
2ª Escritura de Modificación de la Escritura de Constitución a los efectos de modificar las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación por FITCH RATINGS ESPAÑA, S.A.U. ("FITCH") y MOODY'S INVESTORS SERVICE ESPAÑA, S.A. ("MOODY'S"), así como permitir que se apliquen criterios más actualizados de las Entidades de Calificación que se publiquen en el futuro, y otras modificaciones derivadas de la suscripción de un nuevo Contrato de Servicios Financieros	16/03/2016	
Traslado Agente Financiero desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.
Traslado depositaría cuenta de depósito en garantía de la CS desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.
Traslado depositaría cuenta de depósito en garantía del AD desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.

RATING MÍNIMO CONTRAPARTIDAS EN DOCUMENTACIÓN

AGENTE DE PAGOS / DEPOSITARIO CUENTA DE TESORERÍA

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	BBB+	F2	30	Naturales
MOODY'S	A3	N/A	30	Naturales

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BANCO SANTANDER, S.A.	FITCH	A-	F2	NO	N/P
	MOODY'S	A3	P-2	NO	N/P

CONTRAPARTIDA SWAP

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	A	F1	30	Naturales
CON COLATERAL	BBB-	F3	10	Naturales
MOODY'S	A2	P-1	30	Hábiles
CON COLATERAL	A3	P-2	30	Hábiles

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
CECABANK, S.A.	FITCH			NO *	N/P
	CON COLATERAL	BBB	F3	NO	N/P
	MOODY'S			NO *	N/P
	CON COLATERAL	Baa2	P-2	NO	N/P

* NOTAS

FITCH: Se ha establecido un depósito en Banco Santander, en garantía de las obligaciones de CECABANK como Entidad de Contrapartida de Swap

MOODY'S: Se ha procedido con el establecimiento de un colateral en garantía de las obligaciones de la Contrapartida de Swap, de forma que el mantenimiento de CECABANK, S.A. como Contrapartida de Swap no impacta sobre la calificación otorgada a los Bonos.

Recibida una carta por parte de los Bonistas de la emisión, eximiendo a la Contrapartida de Swap de efectuar las acciones correctivas recogidas en documentación.

DEPOSITARIO GARANTÍA SWAP

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	N/A	F1	N/A	N/A
MOODY'S	N/A	P-1	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BANCO SANTANDER, S.A.	FITCH	A-	F2	NO *	N/P
	MOODY'S	A3	P-2	NO *	N/P

* NOTAS

FITCH: La Entidad Depositaria de la garantía no impacta sobre las calificaciones otorgadas a los Bonos. Recibida una carta por parte de los Bonistas de la emisión, eximiendo a la Contrapartida de Swap de efectuar las acciones correctivas recogidas en documentación.

MOODY'S: La Entidad Depositaria de la garantía no impacta sobre las calificaciones otorgadas a los Bonos. Recibida una carta por parte de los Bonistas de la emisión, eximiendo a la Contrapartida de Swap de efectuar las acciones correctivas recogidas en documentación.

ADMINISTRADOR

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	BBB-	F2	N/A	N/A
MOODY'S	N/A	N/A	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	FITCH	BB	B	SI	N/P
	MOODY'S	N/A	N/A	NO	N/P

* NOTAS

FITCH: Siguiendo lo establecido en documentación, se ha establecido un depósito en el Agente Financiero, en garantía de las obligaciones del Administrador

MOODY'S: Según se recoge en los documentos es necesario proceder con la búsqueda de un BUS. ("realizar los mayores esfuerzos"). No obstante el mantenimiento del actual Administrador no supone impacto alguno en las calificaciones asignadas.

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

Sin actuaciones pendientes.

- **VITAL I:**

ACTIVOS SUBYACENTES

NIVELES DE MOROSIDAD Y FALLIDOS

Concepto	Meses impago	Días impago	Importe impagado acumulado		Ratio			Ref. Folleto
			Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a		90	1.196	517	2,53	1,87	2,55	
2. Activos Morosos por otras razones						0		
TOTAL MOROSOS			1.196	517	2,53	1,87	2,55	FOLLETO INFORMATIVO . GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	18		1.195	495	1,52	1,39	1,43	
4. Activos Fallidos por otras razones			0		0	0	0	
TOTAL FALLIDOS			1.195	495	1,52	1,39	1,43	FOLLETO INFORMATIVO . GLOSARIO DE DEFINICIONES

RENEGOCIACIÓN DE LOS ACTIVOS

LÍMITE A LA RENEGOCIACIÓN		
	DEFINICIÓN DOCUMENTACIÓN	LIMITE ACTUAL
NOVACIONES DE TIPO DE INTERÉS	Las modificaciones en el tipo de interés, se podrán realizar siempre que se mantenga la contrapartida inicial del Contrato de Swap, de acuerdo con lo previsto tanto en la Escritura de Constitución como en el Folleto	N/A
FECHA FINALIZACIÓN	16/11/2047	16/11/2047

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	TRIMESTRAL	
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)	16	MAYO NOVIEMBRE

Anterior Fecha de Pago de Cupón	16/11/2016	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Anterior Fecha de Determinación	08/11/2016	
Próxima Fecha de Pago	16/05/2017	

FIJACIÓN DE TIPO DE INTERÉS: *TIPO DE INTERÉS DEL PRÓXIMO PERÍODO*

	ÍNDICE DE REFERENCIA *	MARGEN	FECHA FIJACIÓN	VALOR ÍNDICE REFERENCIA	TIPO DE INTERÉS APLICABLE
TRAMO A	EUR 6M	0,17 %	14/11/2016	-0,211 %	0,000%
TRAMO B	EUR 6M	0,30 %	14/11/2016	-0,211 %	0,089%
TRAMO C	EUR 6M	0,65 %	14/11/2016	-0,211 %	0,439%
TRAMO D	EUR 6M	2,00 %	14/11/2016	-0,211 %	1,789%
PRÉSTAMO SUBORDINADO					
FONDO DE RESERVA	EUR 6M	2,00 %	14/11/2016	-0,211 %	1,789%
PRÉSTAMO SUBORDINADO	EUR 6M	2,00 %	14/11/2016	-0,211 %	1,789%
GASTOS CONSTITUCIÓN	EUR 6M	2,00 %	14/11/2016	-0,211 %	1,789%

* Euribor 6M más un margen, fijado 2 Días Hábiles antes de la Anterior Fecha de Pago.

INFORMACIÓN ADICIONAL

CÓDIGO LEI	95980020140005216158
Original Legal Entity Identifier	
	BLOOMBERG TICKER
TRAMO A	AYTCG 2007-BIT A
TRAMO B	AYTCG 2007-BIT B
TRAMO C	AYTCG 2007-BIT C
TRAMO D	AYTCG 2007-BIT D

CONTRAPARTIDAS

CONTRAPARTIDA	ENTIDAD	DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD
<i>Agente de Pagos</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Depositario Cuenta Tesorería</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Contrapartida Swap</i>	CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ÁLAVA	KUTXABANK, S.A.
<i>Depositario Garantía Swap</i>	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.
<i>Administrador</i>	CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ÁLAVA	KUTXABANK, S.A.
<i>Depositario Reserva Commingling</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Back up Servicer</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Acreditante Línea Liquidez</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Depositario Garantía Línea Liquidez</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Avalista</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>

ACCIONES CORRECTIVAS

CONCLUIDAS

ACCIÓN	FECHA	ENTIDAD DEPOSITARIA
Modificación de la escritura a los efectos de incorporar a Moodys como Agencia de Rating	08/10/2010	
Establecimiento en BBVA de depósito en garantía de las obligaciones de Caja Vital como Entidad de Contrapartida de Swap	22/07/2011	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.
Traslado Agente Financiero desde CECA a Barclays Bank PLC SE	17/07/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
Formalización Suplemento al Contrato de Administración y establecimiento Depósito en Barclays Bank PLC SE, en garantía obligaciones del Administrador	31/07/2013	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
Traslado Cuenta Tesorería a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
Traslado Cuenta Depósito Administrador a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
2ª Escritura de Modificación de la Escritura de Constitución a los efectos de modificar las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación por FITCH RATINGS ESPAÑA, S.A.U. ("FITCH") y MOODY'S INVESTORS SERVICE ESPAÑA, S.A. ("MOODY'S"), así como permitir que se apliquen criterios más actualizados de las Entidades de Calificación que se publiquen en el futuro, y otras modificaciones derivadas de la suscripción de un nuevo Contrato de Prestación de Servicios Financieros	16/03/2016	
Traslado Agente Financiero desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.
Traslado depositaría cuenta de depósito en garantía del AD desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.

RATING MÍNIMO CONTRAPARTIDAS EN DOCUMENTACIÓN

AGENTE DE PAGOS / DEPOSITARIO CUENTA DE TESORERÍA

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	A-	F2	30	Naturales
MOODY'S	A3	N/A	30	Naturales

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BANCO SANTANDER, S.A.	FITCH	A-	F2	NO	N/P
	MOODY'S	A3	P-2	NO	N/P

CONTRAPARTIDA SWAP

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	A	F1	30	Naturales
<i>CON COLATERAL</i>	BBB-	F3	10	Naturales
MOODY'S	A2	P-1	30	Hábiles
CON COLATERAL	A3	P-2	10	Hábiles

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
KUTXABANK, S.A.	FITCH			NO *	N/P
	<i>CON COLATERAL</i>	BBB	F3	NO	N/P
	MOODY'S			NO *	N/P
	CON COLATERAL	Ba1	N/P	NO	N/P

* NOTAS

FITCH: Se ha procedido con el establecimiento de un colateral en garantía de las obligaciones de la Contrapartida de Swap, siguiendo con las especificaciones recogidas en documentación.

MOODY'S: Se ha procedido con el establecimiento de un colateral en garantía de las obligaciones de la Contrapartida de Swap, de forma que el mantenimiento de KUTXABANK como Contrapartida de Swap no impacta sobre la calificación otorgada a los Bonos. Recibida una carta por parte de los Bonistas de la emisión, eximiendo a la Contrapartida de Swap de efectuar las acciones correctivas recogidas en documentación.

DEPOSITARIO GARANTÍA SWAP

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	N/A	F1	N/A	N/A
MOODY'S	N/A	P-1	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	FITCH	A-	F2	NO *	N/P
	MOODY'S	A3	P-2	NO *	N/P

* NOTAS

FITCH: El mantenimiento de la CONTRAPARTIDA DEPÓSITO SWAP no impacta en las calificaciones. Recibida una carta por parte de los Bonistas de la emisión, eximiendo a la CDS de efectuar las acciones correctivas recogidas en documentación

MOODY'S: El mantenimiento de la CONTRAPARTIDA DEPÓSITO SWAP no impacta en las calificaciones. Recibida una carta por parte de los Bonistas de la emisión, eximiendo a la CDS de efectuar las acciones correctivas recogidas en documentación.

ADMINISTRADOR

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
FITCH	N/A	N/A	N/A	N/A
MOODY'S	N/A	N/A	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
KUTXABANK, S.A.	FITCH	BBB	F3	NO *	N/P
	MOODY'S	Ba1	NP	NO *	N/P

* NOTAS

FITCH: No hay trigger de rating explícito, pero las agencias de rating sí consideran un trigger dinámico. El trigger se detonaría si tuviéramos conocimiento de un potencial impacto negativo en la calificación de los Bonos derivado de la participación de Kutxabank como Administrador de los Activos.

En julio de 2013, Fitch comunicó que la permanencia de Kutxabank impactaría en la calificación otorgada a los bonos. El Administrador procedió a la constitución de un Depósito en garantía de sus obligaciones.

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

Sin actuaciones pendientes.

- **CCM I:**

ACTIVOS SUBYACENTES

NIVELES DE MOROSIDAD Y FALLIDOS

Concepto	Meses impago	Días impago	Importe impagado acumulado		Ratio			Ref. Folleto
			Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a		90	23.509	24.238	8,40	8,42	8,79	
2. Activos Morosos por otras razones						0		
TOTAL MOROSOS			23.509	24.238	8,40	8,42	8,79	FOLLETO INFORMATIVO . GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	18		22.943	23.113	6,29	5,81	6,23	
4. Activos Fallidos por otras razones			0		0	0	0	
TOTAL FALLIDOS			22.943	23.113	6,29	5,81	6,23	FOLLETO INFORMATIVO . GLOSARIO DE DEFINICIONES

RENEGOCIACIÓN DE LOS ACTIVOS

LÍMITE A LA RENEGOCIACIÓN		
	DEFINICIÓN DOCUMENTACIÓN	LIMITE ACTUAL
NOVACIONES DE TIPO DE INTERÉS	Las modificaciones en el tipo de interés, se podrán realizar siempre que se mantenga la contrapartida inicial del Contrato de Swap, de acuerdo con lo previsto tanto en la Escritura de Constitución como en el Folleto	N/A <i>No hay contrapartida de swap</i>
FECHA FINALIZACIÓN		27/11/2047

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	TRIMESTRAL	
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)	28	MAYO NOVIEMBRE

Anterior Fecha de Pago de Cupón	28/11/2016	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Anterior Fecha de Determinación	21/11/2016	
Próxima Fecha de Pago	29/05/2017	

FIJACIÓN DE TIPO DE INTERÉS: *TIPO DE INTERÉS DEL PRÓXIMO PERÍODO*

	ÍNDICE DE REFERENCIA *	MARGEN	FECHA FIJACIÓN	VALOR ÍNDICE REFERENCIA	TIPO DE INTERÉS APLICABLE
TRAMO A	FIJO	0,00 %	N/A	N/A	1,300%
TRAMO B	FIJO	0,00 %	N/A	N/A	1,600%
TRAMO C	FIJO	0,00 %	N/A	N/A	2,000%
TRAMO D	FIJO	0,00 %	N/A	N/A	3,000%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 6M	2,00 %	24/11/2016	-0,219 %	1,781%
PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN	EUR 6M	2,00 %	24/11/2016	-0,219 %	1,781%

* Euribor 6M más un margen, fijado 2 Días Hábiles antes de la Anterior Fecha de Pago.

INFORMACIÓN ADICIONAL

CÓDIGO LEI	95980020140005216158
Original Legal Entity Identifier	BLOOMBERG TICKER
TRAMO A	AYTCG 2007-CCM1 A
TRAMO B	AYTCG 2007-CCM1 B
TRAMO C	AYTCG 2007-CCM1 C
TRAMO D	AYTCG 2007-CCM1 D

CONTRAPARTIDAS

CONTRAPARTIDA	ENTIDAD	DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD
<i>Agente de Pagos</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Depositario Cuenta Tesorería</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Contrapartida Swap</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Depositario Garantía Swap</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Administrador</i>	CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.
<i>Depositario Reserva Commingling</i>	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
<i>Back up Servicer</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Acreditante Línea Liquidez</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Depositario Garantía Línea Liquidez</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>
<i>Avalista</i>	<i>NO APLICA</i>	<i>NO APLICA</i>

ACCIONES CORRECTIVAS

CONCLUIDAS

ACCIÓN	FECHA	ENTIDAD DEPOSITARIA
Establecimiento en CECA de un depósito en garantía de las obligaciones de CECA como Entidad de Contrapartida de Swap	23/11/2011	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO
Novación del contrato de Depósito en garantía de las obligaciones de CECA como CS	02/04/2012	
Apertura cuenta de tesorería transitoria en Banco Santander, S.A.	13/04/2012	BANCO SANTANDER, S.A.
Traspaso Agente Financiero desde CECA a Banco Santander	18/09/2012	BANCO SANTANDER, S.A.
Traspaso Contrapartida SWAP desde CECA a Banco Castilla la Mancha	18/09/2012	BANCO DE CASTILLA LA MANCHA, S.A.
2ª Modificación Escritura. Limitación rating Fitch A+ y rating S&P limitado a efectos CS	18/09/2012	
Establecimiento de un depósito en Banco Santander, en garantía de las obligaciones de Banco Castilla la Mancha como Administrador de los Activos.	17/01/2013	BANCO SANTANDER, S.A.
Modificación de Escritura a los efectos de convertir el Tipo de Interés aplicable a los Bonos de la Serie a tipo fijo, eliminar de la estructura de los Bonos de la Serie el Contrato de Swap, modificar la forma de cálculo del importe de depósito en garantía de las obligaciones del Administrador.	08/04/2013	

RATING MÍNIMO CONTRAPARTIDAS EN DOCUMENTACIÓN

AGENTE DE PAGOS / DEPOSITARIO CUENTA DE TESORERÍA

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
STANDARD & POORS	BBB+	A-2	60	Naturales
FITCH	BBB+	F2	30	Naturales

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BANCO SANTANDER, S.A.	STANDARD & POORS	A-	A-2	NO	N/P
	FITCH	A-	F2	NO	N/P

ADMINISTRADOR

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
STANDARD & POORS	N/A	N/A	N/A	N/A
FITCH	BBB+	F2	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.	STANDARD & POORS	N/A	N/A	NO	N/P
	FITCH	BB	B	NO *	N/P

* NOTAS

FITCH: Establecido Depósito en garantía de las obligaciones del Administrador, que provoca que el trigger no se detone.

DEPOSITO COMMINGLING

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
STANDARD & POORS	N/A	N/A	N/A	N/A
FITCH	BBB+	F2	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BANCO SANTANDER, S.A.	STANDARD & POORS	N/A	N/A	NO	N/P
	FITCH	BBB+	F2	NO	N/P

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

Sin actuaciones pendientes.

- **SA NOSTRA:**

ACTIVOS SUBYACENTES

NIVELES DE MOROSIDAD Y FALLIDOS

Concepto	Meses impago	Días impago	Importe impagado acumulado		Ratio			Ref. Folleto
			Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a		90	163	232	2,8	3,37	2,87	
2. Activos Morosos por otras razones						0		
TOTAL MOROSOS			163	232	2,8	3,37	2,87	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	18		156	203	2,62	2,5	2,70	
4. Activos Fallidos por otras razones			0		0	0	0	
TOTAL FALLIDOS			156	203	2,62	2,5	2,70	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES

RENEGOCIACIÓN DE LOS ACTIVOS

LÍMITE A LA RENEGOCIACIÓN		
	DEFINICIÓN DOCUMENTACIÓN	LIMITE ACTUAL
NOVACIONES DE TIPO DE INTERÉS	Se podrán realizar siempre que se mantenga la Entidad de Contrapartida inicial del Contrato de Swap,	N/A
FECHA FINALIZACIÓN	16/05/2047	16/05/2047

CARACTERÍSTICAS DE LA EMISIÓN

FECHAS DE PAGO

Frecuencia de pago de cupón	SEMESTRAL	
Fechas de pago de cupón (o siguiente Día Hábil)	16	MAYO NOVIEMBRE

Anterior Fecha de Pago de Cupón	16/11/2016	
Anterior Fecha de Determinación	10/11/2016	5 días hábiles antes de la Fecha de Pago
Próxima Fecha de Pago	16/05/2017	

FIJACIÓN DE TIPO DE INTERÉS: TIPO DE INTERÉS DEL PRÓXIMO PERÍODO

	ÍNDICE DE REFERENCIA *	MARGEN	FECHA FIJACIÓN	VALOR ÍNDICE REFERENCIA	TIPO DE INTERÉS APLICABLE
TRAMO A	EUR 6M	0,17 %	14/11/2016	-0,211 %	0,000%
TRAMO B	EUR 6M	0,30 %	14/11/2016	-0,211 %	0,089%
TRAMO C	EUR 6M	0,65 %	14/11/2016	-0,211 %	0,439%
TRAMO D	EUR 6M	2,00 %	14/11/2016	-0,211 %	1,789%
PRÉSTAMO SUBORDINADO FONDO DE RESERVA	EUR 6M	2,00 %	14/11/2016	-0,211 %	1,789%
PRÉSTAMO SUBORDINADO GASTOS CONSTITUCIÓN	AMORTIZADO	AMORTIZADO	AMORTIZADO	AMORTIZADO	AMORTIZADO

* Euribor 6M más un margen, fijado 2 Días Hábiles antes de la Anterior Fecha de Pago.

INFORMACIÓN ADICIONAL

CÓDIGO LEI	
Original Legal Entity Identifier	95980020140005216158
BLOOMBERG TICKER	
TRAMO A	AYTCG 07-SAN1 A
TRAMO B	AYTCG 07-SAN1 B
TRAMO C	AYTCG 07-SAN1 C
TRAMO D	AYTCG 07-SAN1 D

CONTRAPARTIDAS

CONTRAPARTIDA	ENTIDAD	DENOMINACIÓN ACTUAL ENTIDAD
Agente de Pagos	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
Depositario Cuenta Tesorería	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
Contrapartida Swap	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO	CECABANK, S.A.
Depositario Garantía Swap	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
Administrador	CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	BANCO MARE NOSTRUM, S.A.
Depositario Reserva Commingling	BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.
Back up Servicer	NO APLICA	NO APLICA
Acreditante Línea Liquidez	NO APLICA	NO APLICA
Depositario Garantía Línea Liquidez	NO APLICA	NO APLICA
Avalista	NO APLICA	NO APLICA

ACCIONES CORRECTIVAS

CONCLUIDAS

ACCIÓN	FECHA	ENTIDAD DEPOSITARIA
Establecimiento de una Garantía Financiera Pignoraticia en garantía de las obligaciones de Sa Nostra como Administrador de los Activos.	10/02/2010	
Modificación de Escritura a los efectos de incorporar a S&P como Entidad de Calificación. Modificación Contrato Prestación de Servicios Financieros y Formalización Anexo III, y Modificación Anexo I.	18/02/2011	
Establecimiento en CECA de un depósito en garantía de las obligaciones de CECA como CS	23/11/2011	CONFEDERACIÓN ESPAÑOLA DE CAJAS DE AHORRO
Modificación Contrato depósito Garantía Swap en CECA	02/04/2012	
Establecimiento Cuenta de Tesorería transitoria en Banco Santander	13/04/2012	BANCO SANTANDER, S.A.
Traslado Agente Financiero desde CECA a Barclays Bank PLC SE	17/07/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
Apertura Cuenta de Depósito en Barclays Bank PLC SE en garantía de las obligaciones del Administrador	02/08/2012	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
2ª Modificación escritura a los efectos de modificar las actuaciones a realizar por el Agente Financiero y la Entidad de Contrapartida del Contrato de Swap en caso de descenso de su calificación por S&P y FITCH , así como permitir que se apliquen criterios más actualizados de las Entidades de Calificación que se publiquen en el futuro. Se ven afectados los contratos de Prestación de Servicios Financieros y Swap.	09/08/2012	
Traslado depósito a BBPLC SE del depósito en garantía de las obligaciones de la Contrapartida de Swap	12/02/2013	BARCLAYS BANK PLC, SUCURSAL EN ESPAÑA
Traslado Cuenta Tesorería a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
Traslado Cuenta Depósito Swap a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
Traslado Cuenta Depósito Administrador a Barclays Bank (UK)	08/05/2015	BARCLAYS BANK PLC
2ª Escritura de Modificación de la Escritura de Constitución a los efectos de modificar las actuaciones a realizar por el Agente Financiero en caso de descenso de su calificación por FITCH RATINGS ESPAÑA, S.A.U. ("FITCH") y STANDARD & POOR'S CREDIT MARKET SERVICES EUROPE LIMITED ("STANDARD & POOR'S" o "S&P"), así como permitir que se apliquen criterios más actualizados de las Entidades de Calificación que se publiquen en el futuro, y otras modificaciones derivadas de la suscripción de un nuevo Contrato de Servicios Financieros.	16/03/2016	
ACCIÓN	FECHA	ENTIDAD DEPOSITARIA
Traslado Agente Financiero desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.
Traslado depositaría cuenta de depósito en garantía de la CS desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.
Traslado depositaría cuenta de depósito en garantía del AD desde Barclays Bank PLC hasta Banco Santander, S.A.	16/03/2016	BANCO SANTANDER, S.A.

RATING MÍNIMO CONTRAPARTIDAS EN DOCUMENTACIÓN

AGENTE DE PAGOS / DEPOSITARIO CUENTA DE TESORERÍA

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
STANDARD & POORS	BBB-	N/A	60	Naturales
FITCH	BBB+	F2	30	Naturales

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BANCO SANTANDER, S.A.	STANDARD & POORS	A-	A-2	NO	N/P
	FITCH	A-	F2	NO	N/P

CONTRAPARTIDA SWAP

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
STANDARD & POORS	BBB	N/A	10	Hábiles
CON COLATERAL	BBB-	N/A	60	Naturales
FITCH	A-	F2	14	Naturales
CON COLATERAL	BBB-	F3	30	Naturales

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
CECABANK, S.A.	STANDARD & POORS			NO	N/P
	CON COLATERAL	BBB	A-2	NO	N/P
	FITCH			NO *	N/P
	CON COLATERAL	BBB-	F3	NO	N/P

* NOTAS

S&P: Conforme recogido en documentación, el trigger se detonará en caso de que el mantenimiento de CECABANK suponga que los Bonos no puedan mantener la calificación A-. Confirmación de S&P de que la operación sin swap puede mantener dicha calificación.

FITCH: Se ha establecido un depósito en Banco Santander, en garantía de las obligaciones de CECABANK como Entidad de Contrapartida de Swap

DEPOSITARIO GARANTÍA SWAP

CONDICIONES DOCUMENTACIÓN				
AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		PLAZO ACTUACIONES	HÁBILES / NATURALES
	Largo plazo	Corto plazo		
STANDARD & POORS	N/A	N/A	N/A	N/A
FITCH	A-	F2	N/A	N/A

RATING CONTRAPARTIDA					
ENTIDAD CONTRAPARTIDA	AGENCIA DE CALIFICACIÓN	RATING MÍNIMO EXIGIBLE		TRIGGER ACTIVADO	PLAZO SUBSANACIÓN
		Largo plazo	Corto plazo		
BANCO SANTANDER, S.A.	STANDARD & POORS	A-	A-2	NO	N/P
	FITCH	A-	F2	NO	N/P

*** NOTAS**

Existe una cuenta abierta para regular el potencial establecimiento de un depósito en garantía del Administrador. Actualmente no es necesario proceder con un depósito, y por lo tanto, la cuenta, aunque abierta, no está siendo utilizada. No hay trigger explícito para el Administrador

ADMINISTRADOR

PROCESOS A EFECTUAR

ACTUACIONES EN CAMINO

Sin actuaciones pendientes.

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2016

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 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	810	7003	48.310	7006	47.217	7009	39,40	7012	45,18	7015	37,89		
2. Activos Morosos por otras razones					7004	0	7007	0	7010	0	7013	0	7016	0		
Total Morosos					7005	48.310	7008	47.217	7011	39,40	7014	45,18	7017	37,89	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	162	7020	0	7021	46.370	7024	44.710	7027	27,85	7030	30,90	7033	27,07		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,06	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	46.370	7026	44.710	7029	27,85	7032	30,90	7035	27,07	7036	

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/12/2016

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

Los Consejeros abajo firmantes de HAYA TITULIZACIÓN, S.G.F.T., S.A.U. tras la formulación de las cuentas anuales y el informe de gestión de AyT Colaterales Global Hipotecario, F.T.A. correspondientes al ejercicio anual cerrado el 31 de diciembre de 2016, proceden a suscribir el presente documento, comprensivo de la memoria, balance, cuenta de pérdidas y ganancias, estado de flujos de efectivo, estado de ingresos y gastos reconocidos, Anexo I e informe de gestión, en hojas de papel timbrado cuya numeración se detalla en la Diligencia expedida a continuación por la Secretaria del Consejo, D^a M^a Rosario Arias Allende, según ha sido formulado en el Consejo de Administración del día 28 de marzo de 2017.

Madrid, 28 de marzo de 2017

D. Carlos Abad Rico
Presidente

D. Juan Lostao Boya
Consejero

D. Miguel Sotomayor Aparicio
Consejero

D. César de la Vega Junquera
Consejero