

**I. DATOS IDENTIFICATIVOS**

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA  
Número de registro del Fondo: 8933  
NIF Fondo: V85296705  
Denominación del compartimento:  
Número de registro del compartimento:  
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.  
NIF Gestora: A80732142  
Fondo Abierto: NO  
Fondo Privado: NO  
Estados agregados: NO  
Fecha: 30/09/2019

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

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

S.01

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	342.442	1001	372.237
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	342.442	1002	372.237
1. Activos titulizados	0003	342.442	1003	372.237
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	341.003	1004	371.218
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005		1005	
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	4.617	1025	4.409
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-3.178	1027	-3.390
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0039		1039	
<b>III. Otros activos no corrientes</b>	0040		1040	

S.01

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	82.077	1041	101.150
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042	1.691	1042	1.899
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	50.131	1043	52.814
1. Activos titulizados	0044	50.131	1044	52.814
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	49.721	1045	52.499
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046		1046	
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	45	1065	46
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	1	1066	1
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	1.157	1067	1.145
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	12	1068	14
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-805	1069	-891
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
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	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0082	6	1082	2
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	6	1084	2
<b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b>	0085	30.250	1085	46.435
1. Tesorería	0086	30.250	1086	46.435
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	424.519	1088	473.387

S.01

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	371.636	1089	414.664
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0090		1090	
1. Provisión garantías financieras	0091		1091	
2. Provisión por margen de intermediación	0092		1092	
3. Otras provisiones	0093		1093	
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0094	371.636	1094	414.664
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	342.822	1095	372.522
1.1 Series no subordinadas	0096	0	1096	0
1.2 Series subordinadas	0097	342.822	1097	372.522
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101	16.718	1101	28.492
2.1 Préstamo subordinado	0102	24.504	1102	36.000
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-7.786	1105	-7.508
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	12.095	1108	13.650
3.1 Derivados de cobertura	0109	12.095	1109	13.650
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	
4.1 Garantías financieras	0113		1113	
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	0116		1116	

S.01

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	64.978	1117	72.373
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0118		1118	
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	0119		1119	
1. Provisión garantías financieras	0120		1120	
2. Provisión por margen de intermediación	0121		1121	
3. Otras provisiones	0122		1122	
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	0123	64.956	1123	72.336
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	55.271	1124	62.249
1.1 Series no subordinadas	0125	0	1125	0
1.2 Series subordinadas	0126	55.247	1126	62.209
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	24	1128	40
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	9.524	1131	9.896
2.1 Préstamo subordinado	0132	12.920	1132	3.500
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	-5.108	1135	-5.028
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	104	1136	141
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	1.608	1137	11.284
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	161	1139	91
3.1 Derivados de cobertura	0140	161	1140	91
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	1	1143	100
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	1	1144	100
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	0148	22	1148	37
1. Comisiones	0149	11	1149	13
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	10	1150	11
1.2 Comisión administrador	0151	903	1151	872
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	1	1152	1
1.4 Comisión variable	0153	447	1153	447
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-1.351	1155	-1.319
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	11	1157	24
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158	-12.095	1158	-13.650
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159		1159	
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	-12.095	1160	-13.650
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161		1161	
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	424.519	1162	473.387

S.02

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2019		Acumulado anterior 30/09/2018
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	291	1201	297	2201	889	3201	983
1.1 Activos titulizados	0202	291	1202	297	2202	889	3202	983
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-266	1204	-351	2204	-906	3204	-1.039
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-51	1205	-79	2205	-172	3205	-233
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-215	1206	-273	2206	-734	3206	-806
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0208	-233	1208	-154	2208	-566	3208	-628
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	-208	1209	-208	2209	-583	3209	-684
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	0210	0	1210	0	2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0215	0	1215	0	2215		3215	
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0217	-52	1217	-53	2217	-158	3217	-187
7.1 Servicios exteriores	0218	-12	1218	-8	2218	-41	3218	-43
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	0	2219	-6	3219	-3
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	-11	1222	-7	2222	-35	3222	-41
7.2 Tributos	0223	-6	1223	-6	2223	-14	3223	-27
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-34	1224	-39	2224	-103	3224	-116
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-21	1225	-24	2225	-65	3225	-73
7.3.2 Comisión administrador	0226	-10	1226	-12	2226	-32	3226	-35
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-2	1227	-3	2227	-6	3227	-8
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228		3228	
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0231	2	1231	69	2231	298	3231	-33
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	2	1232	69	2232	298	3232	-33
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233		3233	
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	0234	0	1234	0	2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237		3237	
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0238	0	1238	0	2238	53	3238	39
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0239	258	1239	191	2239	390	3239	865
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0241	0	1241	0	2241		3241	
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

S.03

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2019		Acumulado anterior 30/09/2018
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	-1.075	1300	-89	2300	-11.367	3300	-177
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	-1.028	1301	-52	2301	-11.222	3301	-190
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	293	1302	217	2302	793	3302	756
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-54	1303	-78	2303	-188	3303	-233
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	135	1304	179	2304	496	3304	442
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-322	1305	-370	2305	-993	3305	-1.155
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	-1.080	1307	0	2307	-11.331	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	0309	-23	1309	-26	2309	-71	3309	-79
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-21	1310	-24	2310	-65	3310	-72
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-2	1312	-2	2312	-6	3312	-7
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>	0315	-24	1315	-11	2315	-73	3315	93
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	-24	1320	-11	2320	-73	3320	-67
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	160
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>	0322	-700	1322	-1.400	2322	-4.819	3322	-3.783
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b>	0325	-700	1325	-1.400	2325	-3.627	3325	-3.783
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	7.456	1326	7.856	2326	22.628	3326	23.791
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.962	1327	2.265	2327	9.282	3327	10.880
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	211	1328	234	2328	863	3328	756
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	261	3330	160
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-10.330	1331	-11.755	2331	-36.662	3331	-39.369
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	0332	0	1332	0	2332	-1.192	3332	0
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	-1.192	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336	0	2336	0	3336	0
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	0337	-1.775	1337	-1.489	2337	-16.185	3337	-3.960
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	32.025	1338	43.649	2338	46.435	3338	46.119
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	30.250	1339	42.159	2339	30.250	3339	42.159

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2019		Acumulado anterior 30/09/2018
<b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>0356</b>	<b>0</b>	<b>1356</b>	<b>0</b>	<b>2356</b>		<b>3356</b>	
<b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	641	1357	600	2357	989	3357	2.594
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	641	1358	600	2358	989	3358	2.594
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	233	1360	154	2360	566	3360	628
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-874	1362	-753	2362	-1.555	3362	-3.222
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>0363</b>	<b>0</b>	<b>1363</b>	<b>0</b>	<b>2363</b>	<b>0</b>	<b>3363</b>	<b>0</b>
<b>3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368		3368	
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>0369</b>	<b>0</b>	<b>1369</b>	<b>0</b>	<b>2369</b>		<b>3369</b>	
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>0370</b>	<b>0</b>	<b>1370</b>	<b>0</b>	<b>2370</b>	<b>0</b>	<b>3370</b>	<b>0</b>

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2019								Situación cierre anual anterior 31/12/2018								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	1,46	0400	1,88	0420	0	0440	3,88	1380	1,29	1400	1,73	1420	0	1440	3,94	2380	0,08	2400	0	2420	0	2440	0
Certificados de transmisión de hipoteca	0381		0401		0421		0441		1381		1401		1421		1441		2381		2401		2421		2441	
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO B**

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	9	0467	6	0474	0	0481		0488	6	0495	1.138	0502	0	0509	1.144
De 1 a 3 meses	0461	10	0468	11	0475	0	0482		0489	12	0496	1.138	0503	0	0510	1.150
De 3 a 6 meses	0462	9	0469	25	0476	1	0483	1	0490	27	0497	1.158	0504		0511	1.184
De 6 a 9 meses	0463	4	0470	14	0477	0	0484	0	0491	15	0498	334	0505		0512	349
De 9 a 12 meses	0464	2	0471	15	0478	0	0485	1	0492	15	0499	230	0506		0513	245
Más de 12 meses	0465	21	0472	1.103	0479	11	0486	133	0493	1.247	0500	2.896	0507		0514	4.143
<b>Total</b>	<b>0466</b>	<b>55</b>	<b>0473</b>	<b>1.175</b>	<b>0480</b>	<b>13</b>	<b>0487</b>	<b>135</b>	<b>0494</b>	<b>1.322</b>	<b>0501</b>	<b>6.893</b>	<b>0508</b>	<b>0</b>	<b>1515</b>	<b>8.215</b>

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	0522	6	0529	0	0536		0543	6	0550	1.138	0557	0	0564	1.144	0571	4.248	0578	4.248	0584	26,94
De 1 a 3 meses	0516	10	0523	11	0530	0	0537		0544	12	0551	1.138	0558	0	0565	1.150	0572	3.141	0579	3.141	0585	36,61
De 3 a 6 meses	0517	9	0524	25	0531	1	0538	1	0545	27	0552	1.158	0559		0566	1.184	0573	3.558	0580	3.558	0586	33,29
De 6 a 9 meses	0518	4	0525	14	0532	0	0539	0	0546	15	0553	334	0560		0567	349	0574	965	0581	965	0587	36,13
De 9 a 12 meses	0519	2	0526	15	0533	0	0540	1	0547	15	0554	230	0561		0568	245	0575	713	0582	713	0588	34,37
Más de 12 meses	0520	21	0527	1.103	0534	11	0541	133	0548	1.247	0555	2.896	0562		0569	4.143	0576	8.021	0583	8.021	0589	51,65
<b>Total</b>	<b>0521</b>	<b>55</b>	<b>0528</b>	<b>1.175</b>	<b>0535</b>	<b>13</b>	<b>0542</b>	<b>135</b>	<b>0549</b>	<b>1.322</b>	<b>0556</b>	<b>6.893</b>	<b>0563</b>	<b>0</b>	<b>0570</b>	<b>8.215</b>	<b>0577</b>	<b>20.645</b>			<b>0590</b>	<b>39,79</b>

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO C**

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 12/12/2007	
Inferior a 1 año	0600	240	1600	172	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	951	1601	797	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	2.168	1602	1.565	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	1.850	1603	3.068	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	3.283	1604	2.771	2604	1.057
Entre 5 y 10 años	0605	37.480	1605	38.547	2605	21.324
Superior a 10 años	0606	350.525	1606	382.351	2606	1.177.619
<b>Total</b>	0607	<b>396.498</b>	1607	<b>429.271</b>	2607	<b>1.200.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	0608	<b>14,89</b>	1608	<b>15,51</b>	2608	<b>25,77</b>

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 12/12/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	13,16	1609	12,42	2609	1,48

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO D**

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 12/12/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	3.453	0630	254.651	1620	3.384	1630	252.064	2620	1.796	2630	210.689
40% - 60%	0621	1.081	0631	139.817	1621	1.302	1631	174.979	2621	2.305	2631	385.177
60% - 80%	0622	7	0632	1.385	1622	8	1632	1.561	2622	2.937	2632	604.134
80% - 100%	0623	2	0633	400	1623	2	1633	409	2623	0	2633	0
100% - 120%	0624	1	0634	244	1624		1634		2624	0	2634	0
120% - 140%	0625		0635		1625	1	1635	258	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627	0	2637	0
<b>Total</b>	0628	<b>4.544</b>	0638	<b>396.498</b>	1628	<b>4.697</b>	1638	<b>429.271</b>	2628	<b>7.038</b>	2638	<b>1.200.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>	0639	<b>33,78</b>	0649		1639	<b>35,21</b>	1649		2639	<b>57,30</b>	2649	

S.05.1

**Denominación Fondo:** AyT Génova Hipotecario XI, FTH

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados:** NO

**Fecha:** 30/09/2019

**Entidades cedentes de los activos titulizados:** A08663619 CAIXABANK, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 12/12/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,27	1650	0,27	2650	4,59
Tipo de interés nominal máximo	0651	2	1651	2,85	2651	5,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,09	1652	0,01	2652	4,06

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO F**

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 12/12/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	749	0683	57.841	1660	780	1683	62.869	2660	1.084	2683	161.087
Aragón	0661	155	0684	11.480	1661	157	1684	12.347	2661	218	2684	33.713
Asturias	0662	51	0685	3.420	1662	52	1685	3.657	2662	83	2685	11.393
Baleares	0663	242	0686	22.252	1663	249	1686	24.219	2663	372	2686	63.283
Canarias	0664	441	0687	34.218	1664	460	1687	37.213	2664	666	2687	96.381
Cantabria	0665	95	0688	6.543	1665	98	1688	7.065	2665	134	2688	19.482
Castilla-León	0666	189	0689	12.320	1666	194	1689	13.382	2666	290	2689	41.572
Castilla La Mancha	0667	65	0690	5.060	1667	68	1690	5.491	2667	224	2690	34.140
Cataluña	0668	697	0691	69.729	1668	724	1691	75.313	2668	1.017	2691	195.853
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	0
Extremadura	0670	28	0693	1.981	1670	28	1693	2.116	2670	45	2693	7.001
Galicia	0671	114	0694	6.968	1671	118	1694	7.673	2671	175	2694	24.038
Madrid	0672	960	0695	102.357	1672	996	1695	111.467	2672	1.677	2695	347.767
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	128	0697	10.229	1674	131	1697	10.947	2674	167	2697	24.358
Navarra	0675	32	0698	2.511	1675	32	1698	2.656	2675	54	2698	8.555
La Rioja	0676	5	0699	386	1676	5	1699	421	2676	7	2699	1.353
Comunidad Valenciana	0677	488	0700	38.790	1677	499	1700	41.444	2677	655	2700	99.030
País Vasco	0678	105	0701	10.413	1678	106	1701	10.991	2678	170	2701	30.994
<b>Total España</b>	0679	<b>4.544</b>	0702	<b>396.498</b>	1679	<b>4.697</b>	1702	<b>429.271</b>	2679	<b>7.038</b>	2702	<b>1.200.000</b>
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
<b>Total general</b>	0682	<b>4.544</b>	0705	<b>396.498</b>	1682	<b>4.697</b>	1705	<b>429.271</b>	2682	<b>7.038</b>	2705	<b>1.200.000</b>

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 30/09/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 12/12/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,36			1710	1,32			2710	0,95		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2019			Situación cierre anual anterior 31/12/2018			Situación inicial 12/12/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0312302005	A1	5.064	0	0	5.064	0	0	5.064	50.000	253.200			
ES0312302013	A2	18.000	20.390	367.019	18.000	21.552	387.931	18.000	50.000	900.000			
ES0312302021	B	360	33.172	11.942	360	50.000	18.000	360	50.000	18.000			
ES0312302039	C	336	33.172	11.146	336	50.000	16.800	336	50.000	16.800			
ES0312302047	D	240	33.172	7.961	240	50.000	12.000	240	50.000	12.000			
<b>Total</b>		0723	24.000	0724	398.069	1723	24.000	1724	434.731	2723	24.000	2724	1.200.000

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO B**

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado	0738	0739					
			0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736			0737				
ES0312302005	A1	NS	EURIBOR 3 MESES	0,08	0	0	0	SI	0	0	0						
ES0312302013	A2	S	EURIBOR 3 MESES	0,20	0	0	0	SI	367.019	0	367.019						
ES0312302021	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,30	0	0	0	SI	11.942	0	11.942						
ES0312302039	C	S	EURIBOR 3 MESES	0,60	0,20	3	0	SI	11.146	0	11.149						
ES0312302047	D	S	EURIBOR 3 MESES	2,50	2,10	21	0	SI	7.961	0	7.983						
<b>Total</b>						0740	24	0741	0	0743	398.069	0744	0	0745	398.093	0746	

	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 12/12/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,05	0748	0,07	0749	5,12

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2019								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2018							
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	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0312302021	B	310	6.058	0	2.275	0	0	0	0	0	0	2.275	0	0	0	2.275	
ES0312302039	C	289	5.654	8	2.702	0	0	12	0	0	12	2.660	0	0	12	2.660	
ES0312302013	A2	9.524	532.981	0	101.539	11.755	501.236	0	101.539	11.755	501.236	0	101.539	11.755	501.236	0	
ES0312302047	D	207	4.039	46	4.591	0	0	67	0	0	67	4.367	0	0	67	4.367	
ES0312302005	A1		253.200		13.601		253.200		13.601		253.200		13.601		253.200		
<b>Total</b>		0754	10.330	0755	801.931	0756	54	0757	124.708	1754	11.755	1755	754.436	1756	78	1757	124.441

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO D**

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 12/12/2007
				0762	0763	0764
ES0312302013	A2	29/09/2016	FCH	A+	A+	AAA
ES0312302013	A2	30/01/2015	SYP	A-	A-	AAA
ES0312302021	B	29/09/2016	FCH	A+	A+	A
ES0312302021	B	30/01/2015	SYP	A-	A-	A
ES0312302039	C	27/02/2019	FCH	BBB+	A+	BBB+
ES0312302039	C	24/02/2017	SYP	A-	A-	BBB+
ES0312302047	D	27/02/2019	FCH	BBB+	BBB	BB
ES0312302047	D	21/03/2018	SYP	A-	A-	BB-

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO E**

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 12/12/2007	
Inferior a 1 año	0765	0	1765	434.731	2765	
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769	367.019	1769		2769	253.200
Entre 5 y 10 años	0770	31.049	1770		2770	
Superior a 10 años	0771		1771		2771	946.800
<b>Total</b>	<b>0772</b>	<b>398.069</b>	<b>1772</b>	<b>434.731</b>	<b>2772</b>	<b>1.200.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>0773</b>	<b>4,70</b>	<b>1773</b>	<b>0</b>	<b>2773</b>	<b>15,67</b>

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 12/12/2007	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	24.504	1775	35.799	2775	36.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	24.504	1776	36.000	2776	36.000
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	6,16	1777	8,23	2777	3
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783	Notas Explicativas	2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	0	1792	0	2792	
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características
Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 12/12/2007	
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806

AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Permuta 1	BANCO SANTANDER S.A	TRIMESTRAL	Suma de (i) intereses ordinarios de las Participaciones Hipotecarias, correspondientes al tipo de interés de referencia (calculado mediante la deducción del margen aplicable a cada liquidación del Préstamo Hipotecario) y en (ii) concepto de la parte variable de los intereses de demora de las Participaciones Hipotecarias, esto es, el tipo de interés de referencia sobre el que se pagan dichos intereses de demora durante el Periodo de Liquidación en curso, entre el Importe Nominal, multiplicado por 360 y dividido por los días efectivos existentes en dicho Periodo de Liquidación	Suma de los Importes Nacionales Individuales. Importe Ncional Individual de cada Préstamo Hipotecario : se dividirán (i) las cantidades efectivamente ingresadas por el Fondo en concepto de intereses ordinarios de las Participaciones Hipotecarias, correspondientes al tipo de interés de referencia (calculado mediante la deducción del margen aplicable a cada liquidación del Préstamo Hipotecario) y en concepto de la parte variable de los intereses de demora de las Participaciones Hipotecarias, esto es, el tipo de interés de referencia sobre el que se pagan dichos intereses de demora entre (ii) el tipo de interés de referencia aplicado en cada liquidación en el correspondiente Préstamo Hipotecario que será siempre Euribor a un año	Importe Ncional del Periodo de Liquidación por el tipo de interés EURIBOR a 3 meses	Suma de los Importes Nacionales Individuales. Importe Ncional Individual de cada Préstamo Hipotecario : se dividirán (i) las cantidades efectivamente ingresadas por el Fondo en concepto de intereses ordinarios de las Participaciones Hipotecarias, correspondientes al tipo de interés de referencia (calculado mediante la deducción del margen aplicable a cada liquidación del Préstamo Hipotecario) y en concepto de la parte variable de los intereses de demora de las Participaciones Hipotecarias, esto es, el tipo de interés de referencia sobre el que se pagan dichos intereses de demora entre (ii) el tipo de interés de referencia aplicado en cada liquidación en el correspondiente Préstamo Hipotecario que será siempre Euribor a un año	-12.256	-13.741	-48.439			
<b>Total</b>							0808	-12.256	0809	-13.741	0810	-48.439

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO B**

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)			Valor en libros (miles de euros)			Otras características	
	Situación actual 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 12/12/2007	Situación actual 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 12/12/2007		
Préstamos hipotecarios	0811	1811	2811	0829	1829	2829	3829	
Cédulas hipotecarias	0812	1812	2812	0830	1830	2830	3830	
Préstamos a promotores	0813	1813	2813	0831	1831	2831	3831	
Préstamos a PYMES	0814	1814	2814	0832	1832	2832	3832	
Préstamos a empresas	0815	1815	2815	0833	1833	2833	3833	
Préstamos corporativos	0816	1816	2816	0834	1834	2834	3834	
Cédulas territoriales	0817	1817	2817	0835	1835	2835	3835	
Bonos de tesorería	0818	1818	2818	0836	1836	2836	3836	
Deuda subordinada	0819	1819	2819	0837	1837	2837	3837	
Créditos AAPP	0820	1820	2820	0838	1838	2838	3838	
Préstamos consumo	0821	1821	2821	0839	1839	2839	3839	
Préstamos automoción	0822	1822	2822	0840	1840	2840	3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823	1823	2823	0841	1841	2841	3841	
Cuentas a cobrar	0824	1824	2824	0842	1842	2842	3842	
Derechos de crédito futuros	0825	1825	2825	0843	1843	2843	3843	
Bonos de titulización	0826	1826	2826	0844	1844	2844		
<b>Total</b>	0827	1827	2827	0845	1845	2845	3845	

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

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

**CUADRO A**

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	1.304	7006	1.305	7009	1,47	7012	1,31	7015	1,28		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.304	7008	1.305	7011	1,47	7014	1,31	7017	1.304.338	7018	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	1.245	7024	1.237	7027	1,01	7030	1,01	7033	1,01		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	1.245	7026	1.237	7029	1,01	7032	1,01	7035	1,01	7036	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

**Denominación Fondo:** AyT Génova Hipotecario XI, FTH

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados:** NO

**Fecha:** 30/09/2019

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

**CUADRO B**

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
<b>Amortización secuencial: series</b>	0854	0858	1858	2858
b) El importe a que asciende el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias en morosidad que presenten más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, sea superior al % establecido para cada ISIN del Saldo Vivo de los Activos en es	1,25	0,48	0,27	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.3.4
b) El importe a que asciende el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias en morosidad que presenten más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, sea superior al % establecido para cada ISIN del Saldo Vivo de los Activos en es	1	0,48	0,27	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.3.4
b) El importe a que asciende el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias en morosidad que presenten más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, sea superior al % establecido para cada ISIN del Saldo Vivo de los Activos en es	0,75	0,48	0,27	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.3.4
c) Cuando el SALDO VIVO DE LOS ACTIVOS en la fecha de Determinación correspondiente a la Fecha de Pago en curso sea inferior al porcentaje establecido del SALDO INICIAL que se haya ejercitado la opción de amortización anticipada	10	33	33,17	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.3.4
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series</b>	0855	0859	1859	2859
Saldo acumulado de Activos Fallidos (sin deducción de las posibles recuperaciones obtenidas de esos Activos Fallidos) fuese superior al porcentaje recogido para cada ISIN del Saldo Inicial de la cartera de Participaciones Hipotecarias	7	1,81	1,81	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL LA NOTA DE VALORES. APARTADO 3.4.6.3
Saldo acumulado de Activos Fallidos (sin deducción de las posibles recuperaciones obtenidas de esos Activos Fallidos) fuese superior al porcentaje recogido para cada ISIN del Saldo Inicial de la cartera de Participaciones Hipotecarias	4,50	1,81	1,81	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL LA NOTA DE VALORES. APARTADO 3.4.6.3
Saldo acumulado de Activos Fallidos (sin deducción de las posibles recuperaciones obtenidas de esos Activos Fallidos) fuese superior al porcentaje recogido para cada ISIN del Saldo Inicial de la cartera de Participaciones Hipotecarias	4	1,81	1,81	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL LA NOTA DE VALORES. APARTADO 3.4.6.3
<b>No Reducción del Fondo de Reserva</b>	0856	0860	1860	2860
(iii) Cuando en la Fecha de Determinación correspondiente a la Fecha de Pago en curso el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera superior al porcentaje recogido del Sal	1	0,48	0,27	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL A LA NOTA DE VALORES. APARTADO 3.4.2.2.
<b>OTROS TRIGGERS</b>	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

**CUADRO C**

**Informe cumplimiento reglas de funcionamiento**

Contiene



Información adicional  
en fichero adjunto

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO A**

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	1862	0	2862	Días del mes /Base 365	3862	0,020	4862	150	5862	30	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	CAIXABANK	1863	0	2863	Días del mes /Base 365	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Trimestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	CAIXABANK, S.A.	1864	0	2864	Días del mes /Base 365	3864	0,002	4864	0	5864	0	6864	Trimestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	S
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	N
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Caixabank
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo adicional 3.7.2.3

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo											Total		
		31/03/2019	30/06/2019	30/09/2019											
<b>Ingresos y gastos del periodo de cálculo</b>	0872														
Margen de intereses	0873	-197	-178	-208											-583
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	24	271	2											298
Dotaciones a provisiones (neto)	0875	0	0	0											0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876	9	44												53
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-46	-59	-52											-158
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	-210	78	-258	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-390
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879														0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880		-78												-78
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881														0
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	210	0	258	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	468
Comisión variable pagada	0883														0
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884														0

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

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

S.06

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

**NOTAS EXPLICATIVAS**



**INFORME DE AUDITOR**

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