

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: 31/12/2016

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: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	469.840	1001	523.470
I. Activos financieros a largo plazo	0002	469.840	1002	523.470
1. Activos titulizados	0003	469.840	1003	523.470
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	468.923	1004	520.869
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005		1005	0
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	6.456	1025	10.713
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-5.539	1027	-8.112
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 Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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	108.616	1041	108.959
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	2.218	1042	2.745
V. Activos financieros a corto plazo	0043	61.420	1043	63.454
1. Activos titulizados	0044	61.420	1044	63.454
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	61.157	1045	62.873
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046		1046	0
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	91	1065	151
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	1	1066	2
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	1.179	1067	1.723
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	25	1068	42
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-1.033	1069	-1.337
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	44.978	1085	42.760
1. Tesorería	0086	44.978	1086	42.760
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	578.456	1088	632.429

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: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	520.564	1089	574.204
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	520.564	1094	574.204
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	470.026	1095	523.575
1.1 Series no subordinadas	0096	0	1096	0
1.2 Series subordinadas	0097	470.026	1097	523.575
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	28.272	1101	25.853
2.1 Préstamo subordinado	0102	36.000	1102	36.000
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	-7.728	1105	-10.147
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	0
3. Derivados	0108	22.266	1108	24.776
3.1 Derivados de cobertura	0109	22.266	1109	24.776
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 Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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	80.158	1117	83.001
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	80.118	1123	82.982
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	71.735	1124	75.272
1.1 Series no subordinadas	0125	0	1125	0
1.2 Series subordinadas	0126	71.694	1126	75.135
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	41	1128	137
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	7.960	1131	6.976
2.1 Préstamo subordinado	0132	3.500	1132	3.500
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	-4.821	1135	-4.714
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	136	1136	145
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	9.144	1137	8.045
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	0
3. Derivados	0139	282	1139	240
3.1 Derivados de cobertura	0140	282	1140	240
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	142	1143	494
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	142	1144	494
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	40	1148	19
1. Comisiones	0149	16	1149	17
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	14	1150	15
1.2 Comisión administrador	0151	772	1151	714
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	1	1152	2
1.4 Comisión variable	0153	447	1153	447
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-1.220	1155	-1.161
1.7 Otras comisiones	0156		1156	0
2. Otros	0157	24	1157	2
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-22.266	1158	-24.776
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-22.266	1160	-24.776
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	0
TOTAL PASIVO	0162	578.456	1162	632.429

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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	635	1201		2201	2.926	3201	4.466
1.1 Activos titulizados	0202	635	1202		2202	2.926	3202	4.466
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203		2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-347	1204		2204	-1.552	3204	-2.844
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-80	1205		2205	-462	3205	-1.668
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-267	1206		2206	-1.090	3206	-1.176
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207		2207		3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-462	1208		2208	-1.860	3208	-1.983
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-175	1209		2209	-487	3209	-361
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	1	1216		2216	5	3216	5
7. Otros gastos de explotación	0217	-144	1217		2217	-363	3217	-611
7.1 Servicios exteriores	0218	-94	1218		2218	-145	3218	-227
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219		2219	-18	3219	-20
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	-94	1222		2222	-128	3222	-207
7.2 Tributos	0223	-4	1223		2223	-27	3223	-158
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-45	1224		2224	-190	3224	-226
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-28	1225		2225	-119	3225	-147
7.3.2 Comisión administrador	0226	-14	1226		2226	-58	3226	-64
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-2	1227		2227	-11	3227	-13
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	0	1230		2230	-1	3230	-2
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	1.206	1231		2231	2.876	3231	-2.296
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	1.206	1232		2232	2.876	3232	-2.296
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	170	1238		2238	221	3238	-101
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-1.060	1239		2239	-2.254	3239	3.364
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

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	217	1300		2300	-3	3300	38
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	103	1301		2301	235	3301	573
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	649	1302		2302	2.613	3302	4.560
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-80	1303		2303	-560	3303	-1.805
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	-410	1304		2304	-385	3304	203
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-57	1305		2305	-1.433	3305	-2.385
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306		2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307		2307		3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308		2308		3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-31	1309		2309	-130	3309	-175
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-28	1310		2310	-118	3310	-148
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311		2311		3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-2	1312		2312	-11	3312	-13
2.4 Comisión variable	0313	0	1313		2313		3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314		2314	0	3314	-14
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	145	1315		2315	-108	3315	-360
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316		2316		3316	
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317		2317		3317	
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318		2318		3318	
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319		2319		3319	
3.5 Otros pagos de explotación	0320	-148	1320		2320	-164	3320	-360
3.6 Otros cobros de explotación	0321	292	1321		2321	56	3321	
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	4.963	1322		2322	2.221	3322	-2.966
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323		2323		3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324		2324		3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	4.963	1325		2325	2.221	3325	-3.451
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	8.256	1326		2326	34.475	3326	34.778
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	7.582	1327		2327	22.228	3327	19.612
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	442	1328		2328	1.760	3328	1.637
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329		2329		3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	511	1330		2330	748	3330	58
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-11.827	1331		2331	-56.989	3331	-59.536
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332		2332		3332	485
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333		2333		3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334		2334		3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335		2335		3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336		2336		3336	485
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	5.180	1337		2337	2.218	3337	-2.928
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	39.798	1338		2338	42.760	3338	45.688
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	44.978	1339		2339	44.978	3339	42.760

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350		2350		3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351		2351		3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352		2352		3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353		2353		3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354		2354		3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0355	0	1355		2355		3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356		2356		3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	1.917	1357		2357	649	3357	2.734
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	1.917	1358		2358	649	3358	2.734
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359		2359		3359	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	462	1360		2360	1.860	3360	1.982
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361		2361		3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-2.380	1362		2362	-2.510	3362	-4.716
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363		2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el periodo	0364	0	1364		2364		3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365		2365		3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366		2366		3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367		2367		3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368		2368		3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369		2369		3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370		2370	0	3370	0

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

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

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	1,42	0400	1,28	0420	0	0440	3,97	1380	2,09	1400	0	1420	0	1440	3,93	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: 31/12/2016

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	8	0467	5	0474	0	0481		0488	5	0495	742	0502	0	0509	747
De 1 a 3 meses	0461	9	0468	12	0475	1	0482		0489	13	0496	1.120	0503	0	0510	1.133
De 3 a 6 meses	0462	3	0469	8	0476	0	0483	0	0490	9	0497	355	0504		0511	364
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	2	0477	0	0484	0	0491	2	0498	87	0505		0512	89
De 9 a 12 meses	0464		0471		0478		0485		0492		0499		0506		0513	
Más de 12 meses	0465	36	0472	1.169	0479	25	0486	217	0493	1.410	0500	6.013	0507		0514	7.424
Total	0466	57	0473	1.196	0480	26	0487	217	0494	1.439	0501	8.317	0508	0	1515	9.757

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	8	0522	5	0529	0	0536		0543	5	0550	742	0557	0	0564	747	0571	2.272	0578	1.741.092	0584	32,90
De 1 a 3 meses	0516	9	0523	12	0530	1	0537		0544	13	0551	1.120	0558	0	0565	1.133	0572	3.559	0579	3.559	0585	31,82
De 3 a 6 meses	0517	3	0524	8	0531	0	0538	0	0545	9	0552	355	0559		0566	364	0573	858	0580	858	0586	42,37
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	2	0532	0	0539	0	0546	2	0553	87	0560		0567	89	0574	164	0581	164	0587	54,39
De 9 a 12 meses	0519		0526		0533		0540		0547		0554		0561		0568		0575		0582		0588	
Más de 12 meses	0520	36	0527	1.169	0534	25	0541	217	0548	1.410	0555	6.013	0562		0569	7.424	0576	13.210	0583	13.758	0589	56,20
Total	0521	57	0528	1.196	0535	26	0542	217	0549	1.439	0556	8.317	0563	0	0570	9.757	0577	20.064			0590	48,63

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: 31/12/2016

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 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 12/12/2007	
Inferior a 1 año	0600	213	1600	337	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	751	1601	721	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	974	1602	1.351	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	1.950	1603		2603	
Entre 4 y 5 años	0604	2.780	1604	4.033	2604	1.057
Entre 5 y 10 años	0605	36.553	1605	34.866	2605	21.324
Superior a 10 años	0606	494.494	1606	554.870	2606	1.177.619
Total	0607	537.715	1607	596.178	2607	1.200.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	17,22	1608	18,06	2608	25,77

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 12/12/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	10,44	1609	9,45	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: 31/12/2016

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 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				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	3.277	0630	256.148	1620	3.197	1630	258.487	2620	1.796	2630	210.689
40% - 60%	0621	1.906	0631	277.279	1621	1.960	1631	291.039	2621	2.305	2631	385.177
60% - 80%	0622	17	0632	3.467	1622	274	1632	46.268	2622	2.937	2632	604.134
80% - 100%	0623	3	0633	531	1623	3	1633	384	2623	0	2633	0
100% - 120%	0624		0634		1624	0	1634	0	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625	1	0635	290	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	5.204	0638	537.715	1628	5.434	1638	596.178	2628	7.038	2638	1.200.000
Media ponderada (%)			0639	39,30			1639	41,20			2639	57,30

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: 31/12/2016

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 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 12/12/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,40	1650	0,78	2650	4,59
Tipo de interés nominal máximo	0651	1,96	1651	2,44	2651	5,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,19	1652	0,41	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: 31/12/2016

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 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				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	857	0683	79.794	1660	884	1683	87.593	2660	1.084	2683	161.087
Aragón	0661	169	0684	15.503	1661	176	1684	17.319	2661	218	2684	33.713
Asturias	0662	60	0685	4.671	1662	66	1685	5.263	2662	83	2685	11.393
Baleares	0663	283	0686	30.341	1663	303	1686	34.181	2663	372	2686	63.283
Canarias	0664	520	0687	46.880	1664	539	1687	51.661	2664	666	2687	96.381
Cantabria	0665	105	0688	8.743	1665	110	1688	9.593	2665	134	2688	19.482
Castilla-León	0666	218	0689	17.072	1666	226	1689	19.076	2666	290	2689	41.572
Castilla La Mancha	0667	74	0690	6.549	1667	75	1690	7.270	2667	224	2690	34.140
Cataluña	0668	790	0691	92.956	1668	830	1691	103.144	2668	1.017	2691	195.853
Ceuta	0669		0692		1669	0	1692	0	2669	0	2692	0
Extremadura	0670	31	0693	2.830	1670	31	1693	3.046	2670	45	2693	7.001
Galicia	0671	132	0694	9.666	1671	142	1694	10.789	2671	175	2694	24.038
Madrid	0672	1.126	0695	140.498	1672	1.183	1695	156.802	2672	1.677	2695	347.767
Melilla	0673		0696		1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	135	0697	12.973	1674	141	1697	14.615	2674	167	2697	24.358
Navarra	0675	39	0698	3.626	1675	39	1698	3.901	2675	54	2698	8.555
La Rioja	0676	6	0699	556	1676	6	1699	611	2676	7	2699	1.353
Comunidad Valenciana	0677	543	0700	51.431	1677	563	1700	56.494	2677	655	2700	99.030
País Vasco	0678	116	0701	13.627	1678	120	1701	14.820	2678	170	2701	30.994
Total España	0679	5.204	0702	537.715	1679	5.434	1702	596.178	2679	7.038	2702	1.200.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	5.204	0705	537.715	1682	5.434	1705	596.178	2682	7.038	2705	1.200.000

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: 31/12/2016
Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 12/12/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,22			1710	1,24			2710	0,95		
Sector	0711		0712		1711	0	1712	0	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: 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 12/12/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0312302005	A1	5.064	0	0	0	0	0	5.064	50.000	253.200			
ES0312302013	A2	18.000	27.496	494.920	18.000	31.000	551.909	18.000	50.000	900.000			
ES0312302021	B	360	50.000	18.000	360	50.000	18.000	360	50.000	18.000			
ES0312302039	C	336	50.000	16.800	336	50.000	16.800	336	50.000	16.800			
ES0312302047	D	240	50.000	12.000	240	50.000	12.000	240	50.000	12.000			
Total		0723	24.000	0724	541.720	1723	18.936	1724	598.709	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: 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		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
			0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737				0738	0739
ES0312302013	A2	NS	EURIBOR 3 MESES	0,20	0	0	0	SI	494.920	0		494.920				
ES0312302021	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,30	0	0	0	SI	18.000	0		18.000				
ES0312302039	C	S	EURIBOR 3 MESES	0,60	0,30	6	0	SI	16.800	0		16.806				
ES0312302005	A1	NS	EURIBOR 3 MESES	0,08	0	0	0	SI	0	0		0				
ES0312302047	D	S	EURIBOR 3 MESES	2,50	2,20	34	0	SI	12.000	0		12.034				
Total						0740	41	0741		0743	541.720	0744	0745	541.761	0746	

	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 12/12/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,06	0748	0,29	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: 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								
ES0312302013	A2	11.827	405.080	0	101.539	59.536	348.089	1.334	101.345								
ES0312302021	B	0	0	0	2.275	0	0	59	2.257								
ES0312302039	C	0	0	13	2.579	0	0	106	2.512								
ES0312302047	D	0	0	67	3.904	0	0	306	3.625								
ES0312302005			253.200		13.601	0	253.200	0	13.601								
Total		0754	11.827	0755	658.280	0756	80	0757	123.897	1754	59.536	1755	601.289	1756	1.805	1757	123.340

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: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 12/12/2007
				0762	0763	0764
ES0312302013		29/09/2016	FCH	A+	A-	AAA
ES0312302013		30/01/2015	SYP	A-	A-	AAA
ES0312302021		29/09/2016	FCH	A+	A-	A
ES0312302021		30/01/2015	SYP	A-	A-	A
ES0312302039		29/09/2016	FCH	A	BBB+	BBB+
ES0312302039		02/12/2014	SYP	BBB	BBB	BBB+
ES0312302047		10/10/2014	FCH	BBB	BBB	BB
ES0312302047		17/12/2007	SYP	BB-	BB-	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: 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 12/12/2007	
Inferior a 1 año	0765		1765		2765	
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769	253.200
Entre 5 y 10 años	0770	494.920	1770	551.909	2770	
Superior a 10 años	0771	46.800	1771	46.800	2771	946.800
Total	0772	541.720	1772	598.709	2772	1.200.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	6,53	1773	6,47	2773	15,67

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: 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 12/12/2007	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	36.000	1775		2775	36.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	32.203	1776		2776	36.000
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	5,94	1777		2777	3
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		2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782		2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783		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		2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787		2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788		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	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	91,36	1792		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: 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 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	-22.548	-25.016	-48.439			
Total							0808	-22.548	0809	-25.016	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: 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 12/12/2007		Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		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			
Total	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: 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	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	90	7003	1.421	7006	2.113	7009	1,42	7012	2,86	7015	2,64		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013	0	7016			
Total Morosos					7005	1.421	7008	2.113	7011	1,42	7014	2,86	7017	2,64	7018	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020		7021	1.349	7024	1.629	7027	1,22	7030	1,58	7033	2,45		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025		7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	1.349	7026	1.629	7029	1,22	7032	1,58	7035	2,45	7036	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES

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

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

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
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	2,90	2,90	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	1,25	2,90	2,90	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	2,90	2,90	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.3.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	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	4,50	1,69	1,69	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	1,69	1,69	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	7	1,69	1,69	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL LA NOTA DE VALORES. APARTADO 3.4.6.3
No Reducción del Fondo de Reserva	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	2,83	2,82	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL A LA NOTA DE VALORES. APARTADO 3.4.2.2.
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

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	HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	1862	0	2862	Días del mes /Base 365	3862	0,020	4862	150	5862	0	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	BARCLAYS BANK, S.A.	1863	0	2863	Días del mes /Base 365	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Trimestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	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: 31/12/2016

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	
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			
		31/03/2016	30/06/2016	30/09/2016	31/12/2016										
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872														
Margen de intereses	0873	-49	-99	-165	-174										-487
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	134	1.206	330	1.206										2.876
Dotaciones a provisiones (neto)	0875	0	0	0	0										0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876	0	0	51	171										221
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-72	-71	-71	-143										-357
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	14	1.036	144	1.060	0	0	0	0	0	0	0	0	0	2.254
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879	0	0	0	0										0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880	-14	-1.036	-144	-1.060										-2.254
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881	0	0	0	0										0
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Comisión variable pagada	0883	0	0	0	0										0
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884	0	0	0	0										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: 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												

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: 31/12/2016

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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