

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A.
Número de registro del Fondo: 8715
NIF Fondo: V85076677
Denominación del compartimento: bonos de titulización de la Serie AyT Colaterales Global Hipotecario BBK II
Número de registro del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2021

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 Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	246.615	1001	265.476
I. Activos financieros a largo plazo	0002	246.615	1002	265.476
1. Activos titulizados	0003	246.615	1003	265.476
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	246.145	1005	264.788
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	2.903	1025	4.008
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-2.433	1027	-3.320
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	

S.01

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	64.311	1041	67.028
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	41.248	1043	41.459
1. Activos titulizados	0044	41.248	1044	41.457
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	40.686	1046	40.975
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	40	1065	62
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	2	1066	1
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	3.208	1067	2.434
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	7	1068	7
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-2.694	1069	-2.022
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	2
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	2
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	0	1084	
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	23.063	1085	25.569
1. Tesorería	0086	23.063	1086	25.569
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	310.926	1088	332.504

S.01

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	259.634	1089	280.030
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	259.634	1094	280.030
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	247.175	1095	265.929
1.1 Series no subordinadas	0096	202.675	1096	221.429
1.2 Series subordinadas	0097	44.500	1097	44.500
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	12.459	1101	14.101
2.1 Préstamo subordinado	0102	39.700	1102	39.700
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	-27.241	1105	-25.599
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108		1108	
3.1 Derivados de cobertura	0109		1109	
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	
4.1 Garantías financieras	0113		1113	
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

S.01

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) PASIVO CORRIENTE	0117	51.292	1117	52.474
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	
V. Provisiones a corto plazo	0119		1119	
1. Provisión garantías financieras	0120		1120	
2. Provisión por margen de intermediación	0121		1121	
3. Otras provisiones	0122		1122	
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	51.279	1123	52.462
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	45.160	1124	46.681
1.1 Series no subordinadas	0125	44.838	1125	46.326
1.2 Series subordinadas	0126		1126	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	322	1128	355
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	6.119	1131	5.780
2.1 Préstamo subordinado	0132		1132	
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	54	1136	56
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	6.064	1137	5.724
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139		1139	
3.1 Derivados de cobertura	0140		1140	
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	12	1148	13
1. Comisiones	0149	3	1149	3
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	3	1150	3
1.2 Comisión administrador	0151	362	1151	346
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152		1152	
1.4 Comisión variable	0153	1.754	1153	1.754
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-2.116	1155	-2.100
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	9	1157	9
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158		1158	
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160		1160	
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	310.926	1162	332.504

S.02

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2021		Acumulado anterior 30/06/2020
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	277	1201	311	2201	621	3201	932
1.1 Activos titulizados	0202	277	1202	311	2202	621	3202	932
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-1.226	1204	-1.382	2204	-2.459	3204	-2.780
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.056	1205	-1.189	2205	-2.121	3205	-2.401
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-170	1206	-193	2206	-338	3206	-379
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	0	1208	0	2208		3208	
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-949	1209	-1.071	2209	-1.838	3209	-1.848
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216	3	3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-18	1217	-20	2217	-36	3217	-41
7.1 Servicios exteriores	0218	0	1218	0	2218	-1	3218	0
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219	0	2219	0	3219	0
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-18	1224	-20	2224	-35	3224	-40
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-10	1225	-11	2225	-20	3225	-22
7.3.2 Comisión administrador	0226	-8	1226	-9	2226	-16	3226	-18
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227		3227	
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228		3228	
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	2	1231	-657	2231	214	3231	-419
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	2	1232	-657	2232	214	3232	-419
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233		3233	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234	0	2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238		3238	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	965	1239	1.748	2239	1.657	3239	2.308
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241		3241	
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

S.03

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2021		Acumulado anterior 30/06/2020
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-1.884	1300	-2.071	2300	-1.528	3300	-1.527
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-1.863	1301	-2.040	2301	-1.509	3301	-1.495
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	290	1302	398	2302	644	3302	943
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-2.154	1303	-2.438	2303	-2.154	3303	-2.438
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	3305	0
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-20	1309	-23	2309	-20	3309	-23
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-20	1310	-23	2310	-20	3310	-23
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	0
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	0	1315	-9	2315	2	3315	-10
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	0	1320	-9	2320	-1	3320	-10
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	3	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-10.401	1322	-14.063	2322	-979	3322	-3.021
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulación	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	-10.401	1325	-14.063	2325	-979	3325	-3.021
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	5.960	1326	6.227	2326	11.961	3326	12.542
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	3.532	1327	1.768	2327	6.540	3327	5.992
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	350	1328	371	2328	762	3328	873
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-20.242	1331	-22.429	2331	-20.242	3331	-22.429
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332	0	2332	0	3332	0
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336	0	2336	0	3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-12.284	1337	-16.135	2337	-2.506	3337	-4.548
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	35.347	1338	41.642	2338	25.569	3338	30.055
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	23.063	1339	25.507	2339	23.063	3339	25.507

S.04

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2021		Acumulado anterior 30/06/2020
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	0	1357	0	2357	0	3357	0
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	0	1358	0	2358	0	3358	0
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	0	1360	0	2360	0	3360	0
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	0	1362	0	2362	0	3362	0
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368		3368	
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369		3369	
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

S.05.1

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2021								Situación cierre anual anterior 31/12/2020								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	2,09	0401	0	0421	0	0441	4,72	1381	2,06	1401	0	1421	0	1441	4,28	2381	1,38	2401	0,10	2421	0	2441	0
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 Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

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	69	0467	22	0474	1	0481		0488	23	0495	5.152	0502	1	0509	5.176
De 1 a 3 meses	0461	22	0468	18	0475	1	0482	0	0489	18	0496	1.777	0503	0	0510	1.795
De 3 a 6 meses	0462	5	0469	8	0476	0	0483	0	0490	8	0497	287	0504		0511	295
De 6 a 9 meses	0463	5	0470	17	0477	0	0484	0	0491	18	0498	383	0505		0512	401
De 9 a 12 meses	0464	2	0471	3	0478	0	0485	0	0492	3	0499	101	0506		0513	104
Más de 12 meses	0465	51	0472	3.180	0479	7	0486	150	0493	3.336	0500	2.132	0507		0514	5.468
Total	0466	154	0473	3.247	0480	9	0487	150	0494	3.406	0501	9.832	0508	1	1515	13.239

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	69	0522	22	0529	1	0536		0543	23	0550	5.152	0557	1	0564	5.176	0571	12.001	0578		0584	43,13
De 1 a 3 meses	0516	22	0523	18	0530	1	0537	0	0544	18	0551	1.777	0558	0	0565	1.795	0572	4.371	0579		0585	41,07
De 3 a 6 meses	0517	5	0524	8	0531	0	0538	0	0545	8	0552	287	0559		0566	295	0573	766	0580		0586	38,56
De 6 a 9 meses	0518	5	0525	17	0532	0	0539	0	0546	18	0553	383	0560		0567	401	0574	942	0581		0587	42,54
De 9 a 12 meses	0519	2	0526	3	0533	0	0540	0	0547	3	0554	101	0561		0568	104	0575	257	0582		0588	40,44
Más de 12 meses	0520	51	0527	3.180	0534	7	0541	150	0548	3.336	0555	2.132	0562		0569	5.468	0576	9.978	0583		0589	54,80
Total	0521	154	0528	3.247	0535	9	0542	150	0549	3.406	0556	9.832	0563	1	0570	13.239	0577	28.316			0590	46,76

S.05.1

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/04/2007	
Inferior a 1 año	0600	392	1600	348	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	1.168	1601	892	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	2.560	1602	2.338	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	3.212	1603	3.413	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	4.174	1604	4.541	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	43.660	1605	42.856	2605	2.254
Superior a 10 años	0606	237.775	1606	257.817	2606	997.746
Total	0607	292.942	1607	312.205	2607	1.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	13,43	1608	13,83	2608	25,54

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/04/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	16,46	1609	15,99	2609	3,58

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 19/04/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	3.406	0630	172.929	1620	3.276	1630	166.267	2620	140	2630	28.705
40% - 60%	0621	983	0631	95.121	1621	1.217	1631	115.904	2621	1	2631	85
60% - 80%	0622	178	0632	24.713	1622	216	1632	29.855	2622	6.185	2632	799.422
80% - 100%	0623	1	0633	178	1623	1	1633	178	2623	1.000	2633	171.788
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624	0	2634	0
120% - 140%	0625		0635		1625		1635		2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627	0	2637	0
Total	0628	4.568	0638	292.942	1628	4.710	1638	312.205	2628	7.326	2638	1.000.000
Media ponderada (%)	0639	39,65	0649		1639	40,79	1649		2639	70,75	2649	

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/04/2007	
	Tipo de interés medio ponderado	0650	0,41	1650	0,46	2650
Tipo de interés nominal máximo	0651	3,84	1651	3,84	2651	6,83
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,01	1652	0,02	2652	3,95

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 19/04/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	14	0683	1.272	1660	14	1683	1.328	2660	110	2683	19.711
Aragón	0661	119	0684	8.204	1661	122	1684	8.769	2661	184	2684	25.462
Asturias	0662	2	0685	332	1662	2	1685	335	2662	5	2685	867
Baleares	0663	2	0686	167	1663	2	1686	175	2663	2	2686	346
Canarias	0664	1	0687	60	1664	1	1687	67	2664	3	2687	491
Cantabria	0665	434	0688	26.186	1665	442	1688	27.681	2665	631	2688	79.441
Castilla-León	0666	38	0689	2.273	1666	38	1689	2.367	2666	60	2689	7.066
Castilla La Mancha	0667	121	0690	9.092	1667	126	1690	9.809	2667	189	2690	26.767
Cataluña	0668	42	0691	2.702	1668	44	1691	2.885	2668	65	2691	9.224
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	0
Extremadura	0670		0693		1670		1693		2670	0	2693	0
Galicia	0671	3	0694	255	1671	3	1694	260	2671	4	2694	459
Madrid	0672	758	0695	50.596	1672	788	1695	54.171	2672	1.320	2695	182.483
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	5	0697	434	1674	5	1697	448	2674	9	2697	1.174
Navarra	0675	3	0698	187	1675	3	1698	194	2675	4	2698	514
La Rioja	0676	64	0699	3.908	1676	65	1699	4.126	2676	91	2699	11.659
Comunidad Valenciana	0677	358	0700	23.632	1677	364	1700	24.680	2677	560	2700	73.847
País Vasco	0678	2.604	0701	163.641	1678	2.691	1701	174.909	2678	4.089	2701	560.489
Total España	0679	4.568	0702	292.942	1679	4.710	1702	312.205	2679	7.326	2702	1.000.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	4.568	0705	292.942	1682	4.710	1705	312.205	2682	7.326	2705	1.000.000

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 19/04/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,02			1710	0,98			2710	0,55		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2021
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2021			Situación cierre anual anterior 31/12/2020			Situación inicial 19/04/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0312273362	A	9.555	25.904	247.513	9.555	28.023	267.755	9.555	100.000	955.500			
ES0312273370	B	305	100.000	30.500	305	100.000	30.500	305	100.000	30.500			
ES0312273388	C	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000			
ES0312273396	D	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000			
Total		0723	10.000	0724	292.013	1723	10.000	1724	312.255	2723	10.000	2724	1.000.000

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2021
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
ES0312273362	A	NS	FIJO	0	1,30	256	0	SI	247.513	0	247.769						
ES0312273370	B	S	FIJO	0	1,60	39	0	SI	30.500	0	30.539						
ES0312273388	C	S	FIJO	0	2	11	0	SI	7.000	0	7.011						
ES0312273396	D	S	FIJO	0	3	17	0	SI	7.000	0	7.017						
Total						0740	322	0741		0743	292.013	0744		0745	292.335	0746	

	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/04/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	1,39	0748	1,38	0749	5,07

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2021
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2021								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2020							
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								
ES0312273362	A	20.242	731.008	1.736	147.340	22.429	691.382	2.018	143.733								
ES0312273370	B	0	0	243	8.110	0	0	245	7.622								
ES0312273388	C	0	0	70	2.245	0	0	70	2.105								
ES0312273396	D	0	0	105	3.206	0	0	105	2.996								
Total		0754	20.242	0755	731.008	0756	2.154	0757	160.900	1754	22.429	1755	691.382	1756	2.438	1757	156.455

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2021
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 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 19/04/2007
				0762	0763	0764
ES0312273362	A	06/08/2020	FCH	A	A	AA-
ES0312273362	A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aa2
ES0312273370	B	20/08/2020	FCH	A	A	BB
ES0312273370	B	26/04/2021	MDY	Ba1	Ba2	A2
ES0312273388	C	15/07/2020	FCH	BBB-	BBB-	
ES0312273388	C	23/01/2015	MDY	B1	B1	Baa3
ES0312273396	D	10/07/2015	MDY	Caa1	Caa1	Ba2

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2021
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 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/04/2007
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	247.513	1768		2768
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769
Entre 5 y 10 años	0770	44.500	1770	312.255	2770
Superior a 10 años	0771		1771		1.000.000
Total	0772	292.013	1772	312.255	1.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	5,79	1773	6,17	14,44

S.05.3

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo		Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/04/2007	
1	Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	18.692	1775	20.167	2775	39.700
1.1	Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	39.700	1776	39.700	2776	39.700
1.2	Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	6,40	1777	6,46	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	84,76	1792	85,75	2792	95,55
5	Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1	Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2	Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3	Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características		
Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 19/04/2007			
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806		
Total						0808		0809		0810	

S.05.3

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/04/2007		Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/04/2007			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
	Situación actual 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación actual 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación actual 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Última Fecha Pago									
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	3.365	7006	2.587	7009	2,28	7012	2,18	7015	2,35		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	3.365	7008	2.587	7011	2,28	7014	2,18	7017	3.364.641	7018	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	3.319	7024	2.545	7027	1,79	7030	1,73	7033	1,76		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	3.319	7026	2.545	7029	1,79	7032	1,73	7035	1,76	7036	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

S.05.4

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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
si el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) es superior al % establecido para cada ISIN.	1,25	0,34	0,42	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv) Y CONDICIONES FINALES
si el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) es superior al % establecido para cada ISIN.	1	0,34	0,42	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv) Y CONDICIONES FINALES
si el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) es superior al % establecido para cada ISIN.	0,75	0,34	0,42	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv) Y CONDICIONES FINALES
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Saldo Vivo de los Activos Fallidos acumulados represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo	22	1,89	1,89	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6. Y CONDICIONES FINALES
Saldo Vivo de los Activos Fallidos acumulados represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo	20	1,89	1,89	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6. Y CONDICIONES FINALES
Saldo Vivo de los Activos Fallidos acumulados represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo	18	1,89	1,89	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6. Y CONDICIONES FINALES
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera superior al porcentaje recogido del Saldo Vivo de los Activos que no tengan la consideración de Activos Fallidos (PORCENTA	1	0,34	0,42	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.1 y CONDICIONES FNALES
b) Cuando el saldo acumulado de los Activos Fallidos sea superior al porcentaje recogido del Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Cesión (PORCENTAJE DE ACTIVOS FALLIDOS)	10	1,89	1,89	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.1 y CONDICIONES FNALES
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861
a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos no Fallidos en la fecha de Determinación correspondiente a la Fecha de Pago en curso sea inferior al porcentaje establecido del Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Constitución sin que se haya ejercitado la opci	10	28,78	29,20	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2021

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	6	2862	Días del mes /Días año	3862	0,010	4862	0	5862	0	6862	Semestral	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	Semestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BSCH	1864	0	2864		3864		4864		5864		6864		7864		8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Kutxabank
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo adicional 3.4.6

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)	Fecha cálculo	Fecha cálculo											Total	
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872													
Margen de intereses	0873													
Deterioro de activos financieros (neto)	0874													
Dotaciones a provisiones (neto)	0875													
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876													
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877													
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878													
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879													
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880													
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881													
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882													
Comisión variable pagada	0883													
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884													

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2021

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	02/06/2021											
Saldo inicial	0886	20.167											
Cobros del periodo	0887	20.941											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-20											
Pagos por derivados	0889	0											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-18.692											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-22.396											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0											
Resto pagos/retenciones	0893	0											
Saldo disponible	0894	0											
Liquidación de comisión variable	0895	0											

S.06

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

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