

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT.11, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA
Número de registro del Fondo: 3952
NIF Fondo: V83453696
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2017

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)

Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2017		Periodo anterior 31/12/2016
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	36.588	1001	40.008
I. Activos financieros a largo plazo	0002	36.588	1002	40.008
1. Activos titulizados	0003	36.588	1003	40.008
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	36.341	1004	39.710
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005		1005	
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	
1.18 Bonos de titulización	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	1.260	1025	1.330
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-1.012	1027	-1.032
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	

Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2017		Periodo anterior 31/12/2016
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	8.704	1041	10.339
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	135	1042	131
V. Activos financieros a corto plazo	0043	4.878	1043	5.158
1. Activos titulizados	0044	4.878	1044	5.158
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	4.827	1045	5.064
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046		1046	
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	
1.18 Bonos de titulización	0062		1062	
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	17	1065	33
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	3	1066	2
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	339	1067	318
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	8	1068	7
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-315	1069	-266
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	3.691	1085	5.050
1. Tesorería	0086	3.691	1086	5.050
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	45.292	1088	50.347

Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2017		Periodo anterior 31/12/2016
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	37.954	1089	41.458
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	37.954	1094	41.458
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	36.002	1095	39.325
1.1 Series no subordinadas	0096	23.902	1096	27.225
1.2 Series subordinadas	0097	12.100	1097	12.100
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	1.915	1101	2.053
2.1 Préstamo subordinado	0102	2.141	1102	2.368
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	-226	1105	-315
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	37	1108	80
3.1 Derivados de cobertura	0109	37	1109	80
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.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2017		Periodo anterior 31/12/2016
B) PASIVO CORRIENTE	0117	7.375	1117	8.968
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	7.358	1123	8.946
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	7.106	1124	8.256
1.1 Series no subordinadas	0125	7.098	1125	8.244
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	8	1128	12
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	171	1131	413
2.1 Préstamo subordinado	0132	169	1132	411
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	2	1136	2
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137		1137	
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	9	1139	17
3.1 Derivados de cobertura	0140	9	1140	17
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	72	1143	259
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	72	1144	259
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	16	1148	23
1. Comisiones	0149	11	1149	11
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	8	1150	8
1.2 Comisión administrador	0151	7	1151	7
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	1152	2
1.4 Comisión variable	0153		1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-7	1155	-7
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	5	1157	12
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-37	1158	-80
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-37	1160	-80
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	45.292	1162	50.347

Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2017		Acumulado anterior 30/06/2016
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	313	1201	209	2201	467	3201	446
1.1 Activos titulizados	0202	313	1202	209	2202	467	3202	446
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-18	1204	-37	2204	-41	3204	-90
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-11	1205	-27	2205	-25	3205	-75
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-2	1206	-3	2206	-5	3206	-8
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-6	1207	-7	2207	-12	3207	-7
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-9	1208	-19	2208	-31	3208	-58
A) MARGEN DE INTERESES	0209	286	1209	153	2209	395	3209	298
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210		3210	0
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	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215		3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-275	1217	-207	2217	-301	3217	-226
7.1 Servicios exteriores	0218	-10	1218	-10	2218	-18	3218	-13
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-6	1219	-3	2219	-9	3219	-3
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220		3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	-5	1222	-7	2222	-8	3222	-10
7.2 Tributos	0223	-8	1223	-1	2223	-12	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-257	1224	-196	2224	-272	3224	-212
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-11	1225	-10	2225	-21	3225	-20
7.3.2 Comisión administrador	0226	-1	1226	-2	2226	-2	3226	-3
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-3	1227	-3	2227	-6	3227	-5
7.3.4 Comisión variable	0228	-243	1228	-184	2228	-243	3228	-184
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	3	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-40	1231	-7	2231	-15	3231	-63
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-40	1232	-7	2232	-15	3232	-63
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233		3233	0
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	10	3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	29	1239	61	2239	-89	3239	-9
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241		3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2017		Acumulado anterior 30/06/2016
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-194	1300	-119	2300	-67	3300	85
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	103	1301	103	2301	205	3301	308
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	179	1302	276	2302	282	3302	490
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-29	1303	-89	2303	-29	3303	-96
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	8	1304	15	2304	8	3304	15
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-47	1305	-85	2305	-47	3305	-85
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	-2	1306	2	2306	-2	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	-5	1307	-10	2307	-5	3307	-10
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	-6	2308	0	3308	-6
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-273	1309	-212	2309	-282	3309	-212
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-21	1310	-20	2310	-21	3310	-20
2.2 Comisión administrador	0311	-2	1311	-2	2311	-2	3311	-2
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-8	1312	-6	2312	-17	3312	-6
2.4 Comisión variable	0313	-243	1313	-184	2313	-243	3313	-184
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-24	1315	-10	2315	10	3315	-11
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	
3.5 Otros pagos de explotación	0320	-24	1320	-10	2320	-37	3320	-11
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	47	3321	
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-3.240	1322	-3.167	2322	-1.262	3322	-831
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	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	-2.771	1325	-2.954	2325	-793	3325	-618
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	960	1326	1.028	2326	1.897	3326	2.144
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	353	1327	446	2327	915	3327	1.262
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	341	1328	470	2328	819	3328	874
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	45	1330	0	2330	45	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-4.469	1331	-4.898	2331	-4.469	3331	-4.898
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-469	1332	-213	2332	-469	3332	-213
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	-469	1334	-213	2334	-469	3334	-213
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	-3.434	1337	-3.286	2337	-1.329	3337	-746
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	7.126	1338	7.890	2338	5.020	3338	5.350
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	3.691	1339	4.604	2339	3.691	3339	4.604

Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2017		Acumulado anterior 30/06/2016
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356		3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	6	1357	-16	2357	11	3357	-7
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	6	1358	-16	2358	11	3358	-7
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	9	1360	19	2360	31	3360	58
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-15	1362	-3	2362	-43	3362	-51
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	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365		3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366		3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367		3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368		3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369		3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: A65587198 CATALUNYA BANC, S.A. | A28371292 UNION DE CREDITO PARA LA FINANCIACION MOBILIARIA E INMOBILIARIA, CREDIFIMO, E.F.C. S.A | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2017								Situación cierre anual anterior 31/12/2016								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	7,48	0400	0,44	0420	0	0440	6,23	1380	6,96	1400	0,35	1420	0	1440	13,50	2380	0	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	
Prestamos 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.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: A65587198 CATALUNYA BANC, S.A. | A28371292 UNION DE CREDITO PARA LA FINANCIACION MOBILIARIA E INMOBILIARIA, CREDIFIMO, E.F.C. S.A | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | 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	72	0467	18	0474	2	0481		0488	20	0495	1.839	0502	1	0509	1.860
De 1 a 3 meses	0461	11	0468	6	0475	1	0482		0489	6	0496	355	0503	0	0510	361
De 3 a 6 meses	0462	1	0469	1	0476	0	0483	0	0490	2	0497	32	0504		0511	34
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	2	0477	0	0484	0	0491	3	0498	43	0505	0	0512	45
De 9 a 12 meses	0464	4	0471	3	0478	0	0485	0	0492	4	0499	111	0506	0	0513	114
Más de 12 meses	0465	31	0472	332	0479	7	0486	105	0493	444	0500	1.074	0507	1	0514	1.520
Total	0466	120	0473	362	0480	11	0487	106	0494	479	0501	3.453	0508	2	1515	3.934

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	72	0522	18	0529	2	0536		0543	20	0550	1.839	0557	1	0564	1.860	0571	6.550	0578	978	0584	28,39
De 1 a 3 meses	0516	11	0523	6	0530	1	0537		0544	6	0551	355	0558	0	0565	361	0572	988	0579	625	0585	36,58
De 3 a 6 meses	0517	1	0524	1	0531	0	0538	0	0545	2	0552	32	0559		0566	34	0573	78	0580		0586	43,36
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	2	0532	0	0539	0	0546	3	0553	43	0560	0	0567	45	0574	109	0581	109	0587	41,79
De 9 a 12 meses	0519	4	0526	3	0533	0	0540	0	0547	4	0554	111	0561	0	0568	114	0575	357	0582	54	0588	31,97
Más de 12 meses	0520	31	0527	332	0534	7	0541	105	0548	444	0555	1.074	0562	1	0569	1.520	0576	2.929	0583	2.360	0589	51,88
Total	0521	120	0528	362	0535	11	0542	106	0549	479	0556	3.453	0563	2	0570	3.934	0577	11.010			0590	35,73

S.05.1
Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2017
Entidades cedentes de los activos titulizados: A65587198 CATALUNYA BANC, S.A. A28371292 UNION DE CREDITO PARA LA FINANCIACION MOBILIARIA E INMOBILIARIA, CREDIFIMO, E.F.C. S.A. A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 29/10/2002	
Inferior a 1 año	0600	58	1600	74	2600	30.522
Entre 1 y 2 años	0601	279	1601	257	2601	38.820
Entre 2 y 3 años	0602	755	1602	434	2602	41.580
Entre 3 y 4 años	0603	2.913	1603	1.492	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	5.552	1604	5.094	2604	51.507
Entre 5 y 10 años	0605	14.524	1605	17.056	2605	39.368
Superior a 10 años	0606	18.684	1606	22.015	2606	201.203
Total	0607	42.765	1607	46.422	2607	403.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	10,09	1608	10,39	2608	11,92

Antigüedad	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 29/10/2002	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	16,38	1609	15,90	2609	1,97

AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

S.05.1
Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2017
Entidades cedentes de los activos titulizados: A65587198 CATALUNYA BANC, S.A. A28371292 UNION DE CREDITO PARA LA FINANCIACION MOBILIARIA E INMOBILIARIA, CREDIFIMO, E.F.C. S.A A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 29/10/2002			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.157	0630	26.986	1620	1.174	1630	28.287	2620	641	2630	42.206
40% - 60%	0621	318	0631	15.075	1621	366	1631	17.524	2621	939	2631	63.548
60% - 80%	0622	13	0632	704	1622	11	1632	611	2622	3.119	2632	230.400
80% - 100%	0623		0633		1623		1633		2623	328	2633	25.310
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624	223	2634	19.614
120% - 140%	0625		0635		1625		1635	0	2625	108	2635	10.594
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626	55	2636	6.116
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627	40	2637	5.212
Total	0628	1.488	0638	42.765	1628	1.551	1638	46.422	2628	5.453	2638	403.000
Media ponderada (%)	0639	34,09	0649		1639	35,32	1649		2639	70,15	2649	

AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

S.05.1

Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: A65587198 CATALUNYA BANC, S.A. | A28371292 UNION DE CREDITO PARA LA FINANCIACION MOBILIARIA E INMOBILIARIA, CREDIFIMO, E.F.C. S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 29/10/2002	
Tipo de interés medio ponderado	0650	1,39	1650	1,10	2650	4,94
Tipo de interés nominal máximo	0651	7,50	1651	7,50	2651	7,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0	1652	0,08	2652	2,12

S.05.1

Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: A65587198 CATALUNYA BANC, S.A. | A28371292 UNION DE CREDITO PARA LA FINANCIACION MOBILIARIA E INMOBILIARIA, CREDIFIMO, E.F.C. S.A | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 29/10/2002			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	718	0683	14.859	1660	753	1683	16.372	2660	2.308	2683	148.711
Aragón	0661	3	0684	100	1661	3	1684	106	2661	12	2684	764
Asturias	0662	1	0685	22	1662	1	1685	23	2662	8	2685	545
Baleares	0663		0686		1663		1686		2663	0	2686	0
Canarias	0664	18	0687	905	1664	18	1687	928	2664	66	2687	5.195
Cantabria	0665		0688		1665		1688		2665	1	2688	82
Castilla-León	0666	45	0689	1.282	1666	49	1689	1.375	2666	79	2689	7.072
Castilla La Mancha	0667	6	0690	256	1667	6	1690	266	2667	39	2690	2.794
Cataluña	0668	292	0691	8.923	1668	301	1691	9.795	2668	571	2691	45.602
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	0
Extremadura	0670	9	0693	354	1670	9	1693	366	2670	52	2693	2.636
Galicia	0671	2	0694	71	1671	2	1694	72	2671	9	2694	623
Madrid	0672	207	0695	9.446	1672	211	1695	9.849	2672	1.976	2695	157.123
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	1	0697	37	1674	1	1697	39	2674	3	2697	173
Navarra	0675	1	0698	53	1675	1	1698	55	2675	4	2698	316
La Rioja	0676	11	0699	269	1676	11	1699	285	2676	22	2699	1.776
Comunidad Valenciana	0677	2	0700	31	1677	2	1700	33	2677	11	2700	443
País Vasco	0678	172	0701	6.156	1678	183	1701	6.857	2678	292	2701	29.145
Total España	0679	1.488	0702	42.765	1679	1.551	1702	46.422	2679	5.453	2702	403.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	1.488	0705	42.765	1682	1.551	1705	46.422	2682	5.453	2705	403.000

AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

S.05.1
Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2017
Entidades cedentes de los activos titulizados: A65587198 CATALUNYA BANC, S.A. A28371292 UNION DE CREDITO PARA LA FINANCIACION MOBILIARIA E INMOBILIARIA, CREDIFIMO, E.F.C. S.A A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 29/10/2002			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	2,17			1710	2,05			2710	0,61		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

S.05.2
Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2017
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2017			Situación cierre anual anterior 31/12/2016			Situación inicial 29/10/2002					
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			
ES0338541008	A	3.909	7.930	31.000	3.909	9.074	35.470	3.909	100.000	390.900			
ES0338541016	B	121	100.000	12.100	121	100.000	12.100	121	100.000	12.100			
Total		0723	4.030	0724	43.100	1723	4.030	1724	47.570	2723	4.030	2724	403.000

S.05.2
Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2017
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas	
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado	Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas				
			0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736			0737	0738	0739	
ES0338541008	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,24	0,04	0	0	SI	31.000	0	31.000					
ES0338541016	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,57	0,37	8	0	SI	12.100	0	12.108					
Total						0740	8	0741	0743	43.100	0744	0745	43.108	0746		

	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 29/10/2002	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,13	0748	0,18	0749	0

AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

S.05.2
Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2017
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2017								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2016							
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								
ES0338541016	B	0	0	23	4.220	0	0	37	4.171								
ES0338541008	A	4.469	359.900	7	55.436	4.898	351.555	52	55.408								
Total		0754	4.469	0755	359.900	0756	29	0757	59.656	1754	4.898	1755	351.555	1756	89	1757	59.579

AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

S.05.2
Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2017
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 30/06/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 29/10/2002
				0762	0763	0764
ES0338541008	A	26/10/2015	SYP	A-	A-	AAA
ES0338541016	B	17/03/2015	SYP	B	B	A

AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

S.05.2
Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2017
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 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 29/10/2002
Inferior a 1 año	0765	43.100	1765		2765
Entre 1 y 2 años	0766		1766	47.570	2766
Entre 2 y 3 años	0767		1767	0	2767
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769
Entre 5 y 10 años	0770		1770		2770
Superior a 10 años	0771		1771		2771
Total	0772	43.100	1772	47.570	2772
Vida residual media ponderada (años)	0773	0,75	1773	1,36	2773
					403.000
					403.000
					13,14

S.05.3

Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 29/10/2002	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	2.141	1775	2.368	2775	10.075
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	2.141	1776	2.368	2776	10.075
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	4,97	1777	4	2777	2
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778		2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780		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		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784		2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	
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		2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	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	71,93	1792	76,48	2792	94
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.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

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 30/06/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 29/10/2002				
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806			
Permuta 1	CECABANK S.A	SEMESTRAL	Será el resultado de multiplicar el tipo medio ponderado de los activos cubiertos por el Importe Nocional multiplicado por 360 y dividido por los días efectivos existentes en dicho Periodo de Liquidación.	El Saldo Vivo de los Activos referenciados a a 70% Euribor ño, tipo vpo 98-01 establecido,tipo fijo ,VPO 98-01 ,VPO 96-99 y tipos fijos en la Fecha de Determinación anterior (incluidos los Activos totalmente amortizados durante el Periodo de Determinación)	Tipo de Interés de Referencia de los Bonos fijado para el correspondiente Periodo de Devengo de Intereses de los Bonos más un margen del 60%	El Saldo Vivo de los Activos referenciados a a 70% Euribor ño, tipo vpo 98-01 establecido,tipo fijo ,VPO 98-01 ,VPO 96-99 y tipos fijos en la Fecha de Determinación anterior (incluidos los Activos totalmente amortizados durante el Periodo de Determinación)	-46	-96	-4.484				
Total							0808	-46	0809	-96	0810	-4.484	

Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

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 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 29/10/2002		Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 29/10/2002			
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	

Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

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 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	452	7006	44	7009	4,49	7012	3,55	7015	8,03		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	452	7008	44	7011	4,49	7014	3,55	7017	452.073	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	435	7024	811	7027	3,13	7030	7,47	7033	4,99		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	435	7026	811	7029	3,13	7032	7,47	7035	4,99	7036	

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto		
	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016			Última Fecha Pago
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

S.05.4

Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

S.05.5

Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

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	30	2862	Días del mes /Base 365	3862	0	4862	0	5862	0	6862	Semestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	UNION DE CREDITO PARA LA FINANCIACION MOBILIARIA E INMOBILIARIA, CREDIFIMO, E.F.C. S.A	1863	0	2863	Días del mes /Días año	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Semestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BNP PARIBAS ESPAÑA, S.A.BNP PARIBAS ESPAÑA, S.A.	1864	6	2864		3864	0	4864	0	5864	0	6864	Semestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	S
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	N
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Banco Mare Nostrum , BBVA , Kutxabank , Credifimo
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo adicional V.1.2

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
		31/03/2017	30/06/2017										
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872												
Margen de intereses	0873	109	286										395
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	25	-40										-15
Dotaciones a provisiones (neto)	0875												0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876	10											10
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-26	-33										-58
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	118	214	0	0	0	0	0	0	0	0	0	331
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879												0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880	-118											-118
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881		-243										-243
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	0	29	0	0	0	0	0	0	0	0	0	29
Comisión variable pagada	0883		243										243
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884												

S.05.5
Denominación Fondo: AyT.11 Fondo de Titulización Hipotecaria
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2017

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.11 Fondo de Titulización Hipotecaria

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

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