

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 Caja Navarra I
Número de registro del compartimento: 8796
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2017

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)

S.01

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

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	392.263	1001	406.152
I. Activos financieros a largo plazo	0002	392.263	1002	406.152
1. Activos titulizados	0003	392.263	1003	406.152
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	386.708	1005	397.796
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	11.458	1025	12.336
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-5.904	1027	-3.979
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	0
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 Caixa Galicia II

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	69.962	1041	80.592
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	23.875	1043	26.072
1. Activos titulizados	0044	23.875	1044	26.072
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	23.421	1046	25.524
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	8	1065	20
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	247	1066	305
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	380	1067	298
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	29	1068	31
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-211	1069	-106
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		1082	
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084		1084	
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	46.086	1085	54.520
1. Tesorería	0086	46.086	1086	54.520
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	462.224	1088	486.744

S.01

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

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	434.507	1089	462.051
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	434.507	1094	462.051
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	393.600	1095	407.523
1.1 Series no subordinadas	0096	298.600	1096	312.523
1.2 Series subordinadas	0097	95.000	1097	95.000
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	23.612	1101	26.049
2.1 Préstamo subordinado	0102	33.250	1102	33.250
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	-9.638	1105	-7.201
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	9.802	1108	10.686
3.1 Derivados de cobertura	0109	9.802	1109	10.686
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	7.493	1112	17.792
4.1 Garantías financieras	0113	7.493	1113	17.792
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 Caixa Galicia II

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
B) PASIVO CORRIENTE	0117	37.519	1117	35.380
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	37.481	1123	35.357
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	31.986	1124	30.817
1.1 Series no subordinadas	0125	31.623	1125	30.634
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	363	1128	183
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	4.652	1131	4.151
2.1 Préstamo subordinado	0132	667	1132	667
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	287	1136	122
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	3.698	1137	3.362
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	843	1139	389
3.1 Derivados de cobertura	0140	843	1140	389
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	38	1148	23
1. Comisiones	0149	26	1149	11
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	26	1150	11
1.2 Comisión administrador	0151	518	1151	485
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152		1152	0
1.4 Comisión variable	0153	1.118	1153	1.118
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-1.636	1155	-1.603
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	12	1157	12
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-9.802	1158	-10.686
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-9.802	1160	-10.686
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	462.224	1162	486.744

S.02

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

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2017		Acumulado anterior 30/09/2016
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	770	1201	1.009	2201	2.481	3201	3.224
1.1 Activos titulizados	0202	770	1202	1.009	2202	2.481	3202	3.224
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203		3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-380	1204	-510	2204	-1.185	3204	-1.770
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-213	1205	-335	2205	-684	3205	-1.233
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-168	1206	-175	2206	-501	3206	-537
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-479	1208	-129	2208	-1.659	3208	-1.255
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-90	1209	370	2209	-362	3209	199
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		3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-26	1217	-30	2217	-78	3217	-91
7.1 Servicios exteriores	0218	0	1218	0	2218	0	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	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	0
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	-26	1224	-30	2224	-77	3224	-91
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-15	1225	-16	2225	-45	3225	-47
7.3.2 Comisión administrador	0226	-11	1226	-11	2226	-33	3226	-34
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227		3227	-1
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228		3228	0
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	-9
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-997	1231	-2.208	2231	-2.029	3231	-2.596
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-997	1232	-2.208	2232	-2.029	3232	-2.596
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		3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	1.113	1239	1.868	2239	2.469	3239	2.488
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

S.03

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

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2017		Acumulado anterior 30/09/2016
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	795	1300	4.516	2300	-9.485	3300	4.294
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	795	1301	1.035	2301	844	3301	1.055
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	795	1302	1.035	2302	2.553	3302	3.317
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	0	1303	0	2303	-504	3303	-1.034
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	624	3304	1.161
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	-1.829	3305	-2.389
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	0	1309	0	2309	-30	3309	-34
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	0	1310	0	2310	-30	3310	-32
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	-2
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	3.481	2315	-10.299	3315	3.273
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	0	2320	-10.299	3320	0
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	3.481	2321	0	3321	3.273
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	4.400	1322	3.926	2322	1.052	3322	2.214
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	4.400	1325	3.926	2325	1.052	3325	2.214
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	0	1326	0	2326	0	3326	0
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.056	1327	639	2327	3.930	3327	3.246
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	3.343	1328	3.287	2328	10.056	3328	9.817
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	0	1331	0	2331	-12.934	3331	-10.849
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	5.194	1337	8.442	2337	-8.433	3337	6.508
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	40.892	1338	44.621	2338	54.520	3338	46.555
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	46.086	1339	53.063	2339	46.086	3339	53.063

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

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2017		Acumulado anterior 30/09/2016
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	-347	1357	6.498	2357	-774	3357	7.034
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-347	1358	6.498	2358	-774	3358	7.034
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	479	1360	129	2360	1.659	3360	1.255
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-132	1362	-6.627	2362	-885	3362	-8.289
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

S.05.1

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

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2017								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		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	2,81	0401	0	0421	0	0441	1,64	1381	2,90	1401	0	1421	0	1441	1,43	2381	1,52	2401	0,14	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 Caixa Galicia II
Denominación del compartimento: 9109
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2017
Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	4.017	0467	1.087	0474	238	0481	0	0488	1.325	0495	402.098	0502	8	0509	403.430
De 1 a 3 meses	0461	55	0468	30	0475	9	0482	0	0489	38	0496	6.345	0503	0	0510	6.384
De 3 a 6 meses	0462	17	0469	19	0476	4	0483	2	0490	26	0497	2.137	0504		0511	2.163
De 6 a 9 meses	0463	6	0470	16	0477	3	0484	3	0491	22	0498	838	0505		0512	860
De 9 a 12 meses	0464	11	0471	40	0478	3	0485	9	0492	52	0499	1.432	0506		0513	1.484
Más de 12 meses	0465	57	0472	305	0479	19	0486	126	0493	450	0500	7.051	0507		0514	7.502
Total	0466	4.163	0473	1.497	0480	276	0487	141	0494	1.914	0501	419.901	0508	8	1515	421.823

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	4.017	0522	1.087	0529	238	0536	0	0543	1.325	0550	402.098	0557	8	0564	403.430	0571	777.798	0578		0584	51,87
De 1 a 3 meses	0516	55	0523	30	0530	9	0537		0544	38	0551	6.345	0558	0	0565	6.384	0572	10.812	0579		0585	59,04
De 3 a 6 meses	0517	17	0524	19	0531	4	0538	2	0545	26	0552	2.137	0559		0566	2.163	0573	3.536	0580		0586	61,16
De 6 a 9 meses	0518	6	0525	16	0532	3	0539	3	0546	22	0553	838	0560		0567	860	0574	1.336	0581		0587	64,40
De 9 a 12 meses	0519	11	0526	40	0533	3	0540	9	0547	52	0554	1.432	0561		0568	1.484	0575	2.633	0582		0588	56,34
Más de 12 meses	0520	57	0527	305	0534	19	0541	126	0548	450	0555	7.051	0562		0569	7.502	0576	12.673	0583		0589	59,20
Total	0521	4.163	0528	1.497	0535	276	0542	141	0549	1.914	0556	419.901	0563	8	0570	421.823	0577	808.788			0590	52,15

S.05.1

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

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 19/04/2007	
Inferior a 1 año	0600	85	1600	106	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	170	1601	155	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	572	1602	411	2602	13
Entre 3 y 4 años	0603	814	1603	786	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	1.622	1604	1.090	2604	306
Entre 5 y 10 años	0605	16.038	1605	13.164	2605	2.732
Superior a 10 años	0606	402.667	1606	420.242	2606	946.949
Total	0607	421.968	1607	435.954	2607	950.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	22,91	1608	23,52	2608	31,73

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 19/04/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	10,73	1609	10,01	2609	1,76

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II
Denominación del compartimento: 9109
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2017
Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				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	1.141	0630	58.352	1620	1.100	1630	56.060	2620	681	2630	47.037
40% - 60%	0621	1.060	0631	103.745	1621	1.062	1631	105.370	2621	1.077	2631	121.686
60% - 80%	0622	1.507	0632	191.316	1622	1.533	1632	194.259	2622	2.354	2632	323.721
80% - 100%	0623	464	0633	68.555	1623	537	1633	80.265	2623	2.789	2633	457.556
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	4.172	0638	421.968	1628	4.232	1638	435.954	2628	6.901	2638	950.000
Media ponderada (%)	0639	61,93	0649		1639	62,92	1649		2639	76,79	2649	

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II

S.05.1

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

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 19/04/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,80	1650	0,82	2650	5,29
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,25	1651	6,25	2651	6,54
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,09	1652	0,19	2652	3,75

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II
Denominación del compartimento: 9109
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2017
Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				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	436	0683	47.142	1660	441	1683	48.468	2660	761	2683	104.331
Aragón	0661	40	0684	4.849	1661	40	1684	4.942	2661	168	2684	24.235
Asturias	0662	54	0685	4.804	1662	54	1685	4.913	2662	126	2685	14.095
Baleares	0663	39	0686	5.207	1663	40	1686	5.464	2663	55	2686	9.211
Canarias	0664	67	0687	7.471	1664	67	1687	7.602	2664	185	2687	25.209
Cantabria	0665	4	0688	383	1665	4	1688	391	2665	15	2688	2.651
Castilla-León	0666	203	0689	20.258	1666	204	1689	20.828	2666	412	2689	51.449
Castilla La Mancha	0667	41	0690	4.618	1667	42	1690	4.753	2667	89	2690	13.213
Cataluña	0668	462	0691	70.289	1668	471	1691	73.006	2668	912	2691	181.657
Ceuta	0669	1	0692	185	1669	1	1692	200	2669	1	2692	235
Extremadura	0670	61	0693	4.638	1670	61	1693	4.749	2670	83	2693	7.875
Galicia	0671	1.801	0694	140.077	1671	1.835	1694	145.347	2671	2.252	2694	234.284
Madrid	0672	238	0695	32.518	1672	242	1695	33.489	2672	482	2695	90.725
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	44	0697	4.382	1674	44	1697	4.542	2674	86	2697	12.202
Navarra	0675	16	0698	1.534	1675	16	1698	1.584	2675	25	2698	3.329
La Rioja	0676	13	0699	1.464	1676	14	1699	1.577	2676	56	2699	8.315
Comunidad Valenciana	0677	576	0700	61.618	1677	580	1700	63.293	2677	1.084	2700	147.104
País Vasco	0678	76	0701	10.533	1678	76	1701	10.806	2678	109	2701	19.880
Total España	0679	4.172	0702	421.968	1679	4.232	1702	435.954	2679	6.901	2702	950.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	4.172	0705	421.968	1682	4.232	1705	435.954	2682	6.901	2705	950.000

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II
Denominación del compartimento: 9109
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2017
Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 19/04/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,05			1710	1,03			2710	0,76		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II
Denominación del compartimento: 9109
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2017
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2017			Situación cierre anual anterior 31/12/2016			Situación inicial 19/04/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal	Nº de pasivos emitidos		Nominal	Nº de pasivos emitidos		Nominal			
		0720	0721	unitario (€)	1720	1721	unitario (€)	2720	2721	unitario (€)			
		Principal pendiente			Principal pendiente			Principal pendiente					
		0722			1722			2722					
ES0312273404	A	8.550	38.623	330.223	8.550	40.135	343.157	8.550	100.000	855.000			
ES0312273412	B	446	100.000	44.600	446	100.000	44.600	446	100.000	44.600			
ES0312273420	C	380	100.000	38.000	380	100.000	38.000	380	100.000	38.000			
ES0312273438	D	124	100.000	12.400	124	100.000	12.400	124	100.000	12.400			
Total		0723	9.500	0724	425.223	1723	9.500	1724	438.157	2723	9.500	2724	950.000

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II
Denominación del compartimento: 9109
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2017
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
ES0312273404	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,30	0,09	75	0	SI	330.223	0	330.298						
ES0312273412	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,60	0,39	68	0	SI	44.600	0	44.668						
ES0312273420	C	S	EURIBOR 6 MESES	1	0,79	125	0	SI	38.000	0	38.125						
ES0312273438	D	S	EURIBOR 6 MESES	2	1,79	95	0	SI	12.400	0	12.495						
Total						0740	363	0741		0743	425.223	0744		0745	425.586	0746	

	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 19/04/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,23	0748	0,30	0749	5,36

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II
Denominación del compartimento: 9109
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2017
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2017								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2016							
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								
ES0312273412	B		0		6.680	0	0	0	6.488								
ES0312273420	C		0		7.052	0	0	0	6.736								
ES0312273404	A		524.777		79.575	0	501.360	0	79.141								
ES0312273438	D		0		3.411	0	0	0	3.183								
Total		0754	0	0755	524.777	0756	0	0757	96.717	1754	0	1755	501.360	1756	0	1757	95.548

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II
Denominación del compartimento: 9109
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2017
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 30/09/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 19/04/2007
				0762	0763	0764
ES0312273404	A	07/03/2016	FCH	AA+	AA+	AAA
ES0312273404	A	23/01/2015	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0312273412	B	14/07/2008	FCH	A	A	A
ES0312273412	B	10/07/2015	MDY	Aa3	Aa3	Baa3
ES0312273420	C	17/05/2013	FCH	BB-	BB-	BBB-
ES0312273420	C	27/07/2017	MDY	Baa3	Ba1	B1
ES0312273438	D	06/09/2012	FCH	B	B	BB-
ES0312273438	D	10/07/2015	MDY	Caa1	Caa1	Caa3

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II
Denominación del compartimento: 9109
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2017
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 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		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		1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769	
Entre 5 y 10 años	0770	330.223	1770	343.157	2770	
Superior a 10 años	0771	95.000	1771	95.000	2771	950.000
Total	0772	425.223	1772	438.157	2772	950.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	10,96	1773	10,40	2773	11,26

S.05.3

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

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 19/04/2007	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	29.124	1775	33.250	2775	33.250
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	33.250	1776	30.751	2776	33.250
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	6,85	1777	7	2777	3
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	77,66	1792	78,32	2792	90
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	

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II

S.05.3

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

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

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 30/09/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 19/04/2007	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Permuta 1	CECABANK	SEMESTRAL	La suma de los intereses devengados, vencidos e ingresados al Fondo durante el Periodo de Liquidación que vence de los Activos de la Serie correspondiente, disminuida en el importe de los Intereses Corridos que, en su caso, hubiere pagado el Fondo durante el mismo Periodo de Liquidación entre (ii) el Importe Nominal	el Saldo Vivo de los Activos (una vez deducidos los Activos Fallidos) en la Fecha de Determinación anterior que no se encuentren con retrasos en el pago de los importes vencidos por más de noventa (90) días en la Fecha de Determinación en curso (incluidos los Activos totalmente amortizados durante el 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 50 %	el Saldo Vivo de los Activos (una vez deducidos los Activos Fallidos) en la Fecha de Determinación anterior que no se encuentren con retrasos en el pago de los importes vencidos por más de noventa (90) días en la Fecha de Determinación en curso (incluidos los Activos totalmente amortizados durante el Periodo de Determinación)	-10.645	-11.075	-12.621	
Total							0808 -10.645	0809 -11.075	0810 -12.621	

S.05.3

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

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

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 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 19/04/2007		Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		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 Caixa Galicia II

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

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 30/09/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación actual 30/09/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación actual 30/09/2017	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	550	7006	440	7009	2,81	7012	2,90	7015	3,04		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	550	7008	440	7011	2,81	7014	2,90	7017	550.321	7018	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	396	7024	241	7027	1,44	7030	0,92	7033	1,09		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0,03		
Total Fallidos					7023	396	7026	241	7029	1,44	7032	0,92	7035	1,12	7036	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016			
	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 Caixa Galicia II

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

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
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	2,92	2,79	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	2,92	2,79	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	2,92	2,79	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.	10	1,03	1,03	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.	7	1,03	1,03	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.	5	1,03	1,03	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	2,92	2,79	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)	3,20	1,03	1,03	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	44,76	43,94	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

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II
Denominación del compartimento: 9109
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2017

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	6	2862	Días del mes /Base 360	3862	0,010	4862	0	5862	0	6862	Semestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	Caixa Galicia	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	BANCO SANTANDER, S.A.	1864	0	2864		3864	0	4864	0	5864	0	6864	Semestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II
Denominación del compartimento: 9109
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2017

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	Abanca
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											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 Caixa Galicia II
Denominación del compartimento: 9109
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2017

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	27/04/2017											
Saldo inicial	0886	30.751											
Cobros del periodo	0887	13.670											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-31											
Pagos por derivados	0889	-1.829											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-29.124											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-13.437											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0											
Resto pagos/retenciones	0893	0											
Saldo disponible	0894	0											
Liquidación de comisión variable	0895	0											

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie Caixa Galicia II

S.06

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

Denominación del compartimento: 9109

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

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