

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A.
Número de registro del Fondo: 8715
NIF Fondo: V85076677
Denominación del compartimento: bonos de titulización de la Serie AyT Colaterales Global Hipotecario BBK II
Número de registro del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2020

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

S.01

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2020		Periodo anterior 31/12/2019
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	285.229	1001	303.333
I. Activos financieros a largo plazo	0002	285.229	1002	303.333
1. Activos titulizados	0003	285.229	1003	303.333
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	284.267	1005	302.201
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	4.154	1025	3.743
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-3.193	1027	-2.611
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	

S.01

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	68.469	1041	74.751
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	42.962	1043	44.695
1. Activos titulizados	0044	42.962	1044	44.695
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	42.314	1046	44.280
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	73	1065	83
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	3	1066	2
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	2.470	1067	2.387
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	7	1068	8
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-1.904	1069	-2.066
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	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	25.507	1085	30.055
1. Tesorería	0086	25.507	1086	30.055
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	353.698	1088	378.084

S.01

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2020		Periodo anterior 31/12/2019
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	302.175	1089	322.356
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	302.175	1094	322.356
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	285.856	1095	303.747
1.1 Series no subordinadas	0096	241.356	1096	259.247
1.2 Series subordinadas	0097	44.500	1097	44.500
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101	16.319	1101	18.609
2.1 Préstamo subordinado	0102	39.700	1102	39.700
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-23.381	1105	-21.091
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108		1108	
3.1 Derivados de cobertura	0109		1109	
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	
4.1 Garantías financieras	0113		1113	
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

S.01

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) PASIVO CORRIENTE	0117	51.523	1117	55.728
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	
V. Provisiones a corto plazo	0119		1119	
1. Provisión garantías financieras	0120		1120	
2. Provisión por margen de intermediación	0121		1121	
3. Otras provisiones	0122		1122	
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	51.519	1123	55.715
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	46.147	1124	50.721
1.1 Series no subordinadas	0125	45.784	1125	50.321
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	400
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	5.372	1131	4.993
2.1 Préstamo subordinado	0132		1132	
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	66	1136	61
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	5.306	1137	4.933
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139		1139	
3.1 Derivados de cobertura	0140		1140	
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	4	1148	13
1. Comisiones	0149	4	1149	4
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	4	1150	4
1.2 Comisión administrador	0151	330	1151	312
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152		1152	
1.4 Comisión variable	0153	1.754	1153	1.754
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-2.083	1155	-2.066
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	0	1157	9
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158		1158	
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160		1160	
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	353.698	1162	378.084

S.02

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2020		Acumulado anterior 30/06/2019
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	311	1201	564	2201	932	3201	1.107
1.1 Activos titulizados	0202	311	1202	564	2202	932	3202	1.107
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203		3203	
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-1.382	1204	-1.525	2204	-2.780	3204	-3.056
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.189	1205	-1.332	2205	-2.401	3205	-2.672
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-193	1206	-193	2206	-379	3206	-384
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	0	1208	0	2208		3208	
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-1.071	1209	-961	2209	-1.848	3209	-1.949
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216		3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-20	1217	-22	2217	-41	3217	-45
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	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-20	1224	-22	2224	-40	3224	-45
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-11	1225	-12	2225	-22	3225	-25
7.3.2 Comisión administrador	0226	-9	1226	-10	2226	-18	3226	-20
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227		3227	
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228		3228	
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-657	1231	145	2231	-419	3231	426
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-657	1232	145	2232	-419	3232	426
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233		3233	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234	0	2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238		3238	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	1.748	1239	838	2239	2.308	3239	1.568
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241		3241	
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

S.03

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2020		Acumulado anterior 30/06/2019
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-2.071	1300	-2.174	2300	-1.527	3300	-1.641
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-2.040	1301	-2.149	2301	-1.495	3301	-1.615
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	398	1302	561	2302	943	3302	1.095
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-2.438	1303	-2.711	2303	-2.438	3303	-2.711
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	3305	0
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-23	1309	-25	2309	-23	3309	-25
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-23	1310	-25	2310	-23	3310	-25
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	0
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-9	1315	0	2315	-10	3315	-1
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	-9	1320	0	2320	-10	3320	-1
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-14.063	1322	-12.511	2322	-3.021	3322	-1.492
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulación	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	-14.063	1325	-12.511	2325	-3.021	3325	-1.492
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	6.227	1326	6.505	2326	12.542	3326	13.028
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.768	1327	4.203	2327	5.992	3327	8.067
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	371	1328	549	2328	873	3328	1.181
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	-22.429	1331	-23.769	2331	-22.429	3331	-23.769
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	-16.135	1337	-14.686	2337	-4.548	3337	-3.133
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	41.642	1338	41.908	2338	30.055	3338	30.355
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	25.507	1339	27.222	2339	25.507	3339	27.222

S.04

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2020		Acumulado anterior 30/06/2019
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	0	1357	0	2357	0	3357	0
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	0	1358	0	2358	0	3358	0
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	0	1360	0	2360	0	3360	0
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	0	1362	0	2362	0	3362	0
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368		3368	
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369		3369	
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

S.05.1

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2020								Situación cierre anual anterior 31/12/2019								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	1,99	0401	0	0421	0	0441	4,28	1381	1,74	1401	0	1421	0	1441	4,60	2381	1,38	2401	0,10	2421	0	2441	0
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	95	0467	31	0474	2	0481		0488	33	0495	7.357	0502	1	0509	7.391
De 1 a 3 meses	0461	30	0468	23	0475	1	0482	0	0489	24	0496	2.520	0503	1	0510	2.545
De 3 a 6 meses	0462	7	0469	11	0476	0	0483	0	0490	11	0497	688	0504		0511	699
De 6 a 9 meses	0463	4	0470	10	0477		0484	1	0491	11	0498	314	0505		0512	325
De 9 a 12 meses	0464	2	0471	8	0478		0485	0	0492	8	0499	120	0506		0513	128
Más de 12 meses	0465	51	0472	2.441	0479	7	0486	130	0493	2.578	0500	3.032	0507		0514	5.610
Total	0466	189	0473	2.524	0480	10	0487	131	0494	2.664	0501	14.031	0508	2	1515	16.698

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	95	0522	31	0529	2	0536		0543	33	0550	7.357	0557	1	0564	7.391	0571	16.913	0578		0584	43,70
De 1 a 3 meses	0516	30	0523	23	0530	1	0537	0	0544	24	0551	2.520	0558	1	0565	2.545	0572	5.770	0579		0585	44,11
De 3 a 6 meses	0517	7	0524	11	0531	0	0538	0	0545	11	0552	688	0559		0566	699	0573	1.667	0580		0586	41,92
De 6 a 9 meses	0518	4	0525	10	0532		0539	1	0546	11	0553	314	0560		0567	325	0574	639	0581		0587	50,86
De 9 a 12 meses	0519	2	0526	8	0533		0540	0	0547	8	0554	120	0561		0568	128	0575	296	0582		0588	43,29
Más de 12 meses	0520	51	0527	2.441	0534	7	0541	130	0548	2.578	0555	3.032	0562		0569	5.610	0576	10.180	0583		0589	55,11
Total	0521	189	0528	2.524	0535	10	0542	131	0549	2.664	0556	14.031	0563	2	0570	16.698	0577	35.464			0590	47,08

S.05.1

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007	
Inferior a 1 año	0600	331	1600	350	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	672	1601	807	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	2.026	1602	1.612	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	3.756	1603	3.238	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	4.161	1604	4.517	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	41.706	1605	39.871	2605	2.254
Superior a 10 años	0606	280.551	1606	302.216	2606	997.746
Total	0607	333.204	1607	352.611	2607	1.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	14,25	1608	14,64	2608	25,54

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	15,50	1609	15,03	2609	3,58

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 19/04/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	3.050	0630	153.747	1620	2.772	1630	134.798	2620	140	2630	28.705
40% - 60%	0621	1.509	0631	141.845	1621	1.820	1631	167.476	2621	1	2631	85
60% - 80%	0622	276	0632	37.295	1622	358	1632	48.408	2622	6.185	2632	799.422
80% - 100%	0623	2	0633	316	1623	9	1633	1.145	2623	1.000	2633	171.788
100% - 120%	0624		0634		1624	4	1634	334	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625		0635		1625	2	1635	253	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627	2	1637	197	2627	0	2637	0
Total	0628	4.837	0638	333.204	1628	4.967	1638	352.611	2628	7.326	2638	1.000.000
Media ponderada (%)	0639	42,06	0649		1639	43,93	1649		2639	70,75	2649	

AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007	
	Tipo de interés medio ponderado	0650	0,52	1650	0,55	2650
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,18	1651	11,93	2651	6,83
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,01	1652	0,01	2652	3,95

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 19/04/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	14	0683	1.382	1660	15	1683	1.456	2660	110	2683	19.711
Aragón	0661	123	0684	9.161	1661	123	1684	9.518	2661	184	2684	25.462
Asturias	0662	2	0685	339	1662	2	1685	343	2662	5	2685	867
Baleares	0663	2	0686	182	1663	2	1686	190	2663	2	2686	346
Canarias	0664	2	0687	70	1664	2	1687	80	2664	3	2687	491
Cantabria	0665	450	0688	29.537	1665	457	1688	31.025	2665	631	2688	79.441
Castilla-León	0666	40	0689	2.531	1666	41	1689	2.629	2666	60	2689	7.066
Castilla La Mancha	0667	134	0690	10.800	1667	137	1690	11.257	2667	189	2690	26.767
Cataluña	0668	45	0691	3.121	1668	45	1691	3.267	2668	65	2691	9.224
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	0
Extremadura	0670		0693		1670		1693		2670	0	2693	0
Galicia	0671	3	0694	264	1671	3	1694	269	2671	4	2694	459
Madrid	0672	814	0695	58.306	1672	840	1695	62.237	2672	1.320	2695	182.483
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	6	0697	503	1674	6	1697	520	2674	9	2697	1.174
Navarra	0675	3	0698	203	1675	4	1698	283	2675	4	2698	514
La Rioja	0676	67	0699	4.394	1676	69	1699	4.628	2676	91	2699	11.659
Comunidad Valenciana	0677	370	0700	26.154	1677	379	1700	27.596	2677	560	2700	73.847
País Vasco	0678	2.762	0701	186.258	1678	2.842	1701	197.313	2678	4.089	2701	560.489
Total España	0679	4.837	0702	333.204	1679	4.967	1702	352.611	2679	7.326	2702	1.000.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	4.837	0705	333.204	1682	4.967	1705	352.611	2682	7.326	2705	1.000.000

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 19/04/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,94			1710	0,91			2710	0,55		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2020
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2020			Situación cierre anual anterior 31/12/2019			Situación inicial 19/04/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0312273370	B	305	100.000	30.500	305	100.000	30.500	305	100.000	30.500			
ES0312273388	C	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000			
ES0312273396	D	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000			
ES0312273362	A	9.555	30.051	287.140	9.555	32.399	309.568	9.555	100.000	955.500			
Total		0723	10.000	0724	331.640	1723	10.000	1724	354.068	2723	10.000	2724	1.000.000

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2020
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		
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739
ES0312273370	B	S	FIJO	0	1,60	39	0	SI	30.500	0	30.539	
ES0312273388	C	S	FIJO	0	2	11	0	SI	7.000	0	7.011	
ES0312273396	D	S	FIJO	0	3	17	0	SI	7.000	0	7.017	
ES0312273362	A	NS	FIJO	0	1,30	297	0	SI	287.140	0	287.436	
Total						0740 363	0741		0743 331.640	0744	0745 332.003	0746

	Situación actual 30/06/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 19/04/2007
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747 1,38	0748 1,37	0749 5,07

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2020
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2020								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2019							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0312273362	A	22.429	691.382	2.018	143.733	23.769	648.592	2.293	139.576								
ES0312273370	B	0	0	245	7.622	0	0	243	7.134								
ES0312273388	C	0	0	70	2.105	0	0	70	1.965								
ES0312273396	D	0	0	105	2.996	0	0	105	2.786								
Total		0754	22.429	0755	691.382	0756	2.438	0757	156.455	1754	23.769	1755	648.592	1756	2.711	1757	151.461

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2020
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 30/06/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 19/04/2007
				0762	0763	0764
ES0312273362	A	23/12/2016	FCH	A-	A-	AA-
ES0312273362	A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aa2
ES0312273370	B	14/11/2017	FCH	CCC	CCC	BB
ES0312273370	B	25/09/2014	MDY	Ba2	Ba2	A2
ES0312273388	C	23/01/2015	MDY	B1	B1	Baa3
ES0312273396	D	10/07/2015	MDY	Caa1	Caa1	Ba2

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2020
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 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007
Inferior a 1 año	0765		1765	0	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	309.568	2769
Entre 5 y 10 años	0770	287.140	1770	44.500	2770
Superior a 10 años	0771	44.500	1771		1.000.000
Total	0772	331.640	1772	354.068	2772
Vida residual media ponderada (años)	0773	6,46	1773	4,45	2773
					14,44

S.05.3

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	21.916	1775	23.526	2775	39.700
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	39.700	1776	39.700	2776	39.700
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	6,61	1777	6,64	2777	3
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783	Notas Explicativas	2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	86,58	1792	87,43	2792	95,55
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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 30/06/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 19/04/2007			
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806		
Total						0808		0809		0810	

S.05.3

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007		Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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 30/06/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación actual 30/06/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación actual 30/06/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Última Fecha Pago									
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	2.608	7006	2.517	7009	1,99	7012	1,74	7015	2,23		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	2.608	7008	2.517	7011	1,99	7014	1,74	7017	2,23	7018	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	2.555	7024	2.435	7027	1,54	7030	1,31	7033	1,51		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	2.555	7026	2.435	7029	1,54	7032	1,31	7035	1,51	7036	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

S.05.4

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
si el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) es superior al % establecido para cada ISIN.	1,25	0,47	0,60	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv) Y CONDICIONES FINALES
si el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) es superior al % establecido para cada ISIN.	1	0,47	0,60	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv) Y CONDICIONES FINALES
si el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) es superior al % establecido para cada ISIN.	0,75	0,47	0,60	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv) Y CONDICIONES FINALES
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Saldo Vivo de los Activos Fallidos acumulados represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo	22	1,92	1,85	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6. Y CONDICIONES FINALES
Saldo Vivo de los Activos Fallidos acumulados represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo	20	1,92	1,85	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6. Y CONDICIONES FINALES
Saldo Vivo de los Activos Fallidos acumulados represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo	18	1,92	1,85	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6. Y CONDICIONES FINALES
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera superior al porcentaje recogido del Saldo Vivo de los Activos que no tengan la consideración de Activos Fallidos (PORCENTA	1	0,47	0,60	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.1 y CONDICIONES FNALES
b) Cuando el saldo acumulado de los Activos Fallidos sea superior al porcentaje recogido del Saldo Vivo de los Activos en la Fecha de Cesión (PORCENTAJE DE ACTIVOS FALLIDOS)	10	1,92	1,85	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	32,81	33,16	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	1862	6	2862	Días del mes /Días año	3862	0,010	4862	0	5862	0	6862	Semestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	BARCLAYS BANK, S.A.	1863	0	2863	Días del mes /Base 365	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Semestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864		1864		2864		3864		4864		5864		6864		7864		8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

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

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Colaterales Global Hipotecario, FTA. Serie BBK II
Denominación del compartimento: 9021
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total		
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885	02/06/2020												
Saldo inicial	0886	23.526												
Cobros del periodo	0887	23.279												
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-23												
Pagos por derivados	0889	0												
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-21.916												
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-24.867												
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0												
Resto pagos/retenciones	0893	0												
Saldo disponible	0894	0												
Liquidación de comisión variable	0895	0												

S.06

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

Denominación del compartimento: 9021

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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