

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO XI, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA
Número de registro del Fondo: 8933
NIF Fondo: V85296705
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2018

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

S.01

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	384.409	1001	415.684
I. Activos financieros a largo plazo	0002	384.409	1002	415.684
1. Activos titulizados	0003	384.409	1003	415.684
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	383.361	1004	414.931
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005		1005	
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	
1.18 Bonos de 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	4.877	1025	4.803
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-3.829	1027	-4.051
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 Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	99.173	1041	107.479
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	2.022	1042	2.080
V. Activos financieros a corto plazo	0043	54.989	1043	59.256
1. Activos titulizados	0044	54.989	1044	59.256
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	54.687	1045	59.029
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046		1046	
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		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	46	1065	62
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	1	1066	1
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	1.173	1067	1.032
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	14	1068	18
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-933	1069	-885
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	
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	4	1082	25
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	4	1084	25
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	42.159	1085	46.119
1. Tesorería	0086	42.159	1086	46.119
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	483.583	1088	523.163

S.01

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	426.187	1089	461.339
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	426.187	1094	461.339
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	384.681	1095	415.860
1.1 Series no subordinadas	0096	0	1096	0
1.2 Series subordinadas	0097	384.681	1097	415.860
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	28.211	1101	28.962
2.1 Préstamo subordinado	0102	36.000	1102	36.000
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	-7.789	1105	-7.038
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	13.295	1108	16.517
3.1 Derivados de cobertura	0109	13.295	1109	16.517
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 Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) PASIVO CORRIENTE	0117	70.691	1117	78.341
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	70.659	1123	78.294
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	60.923	1124	69.113
1.1 Series no subordinadas	0125	0	1125	0
1.2 Series subordinadas	0126	60.883	1126	69.073
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	39	1128	40
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	9.646	1131	8.919
2.1 Préstamo subordinado	0132	3.500	1132	3.500
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	-5.002	1135	-4.924
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	136	1136	138
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	11.012	1137	10.204
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	89	1139	174
3.1 Derivados de cobertura	0140	89	1140	174
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	1	1143	87
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	1	1144	87
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	32	1148	47
1. Comisiones	0149	14	1149	14
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	11	1150	13
1.2 Comisión administrador	0151	860	1151	825
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	1152	1
1.4 Comisión variable	0153	447	1153	447
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-1.308	1155	-1.272
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	18	1157	33
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-13.295	1158	-16.517
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-13.295	1160	-16.517
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	483.583	1162	523.163

S.02

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2018		Acumulado anterior 30/09/2017
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	297	1201	480	2201	983	3201	1.493
1.1 Activos titulizados	0202	297	1202	480	2202	983	3202	1.493
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-351	1204	-346	2204	-1.039	3204	-1.026
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-79	1205	-78	2205	-233	3205	-233
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-273	1206	-268	2206	-806	3206	-793
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-154	1208	-304	2208	-628	3208	-1.039
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-208	1209	-171	2209	-684	3209	-571
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	1	2216	0	3216	2
7. Otros gastos de explotación	0217	-53	1217	-67	2217	-187	3217	-199
7.1 Servicios exteriores	0218	-8	1218	-21	2218	-43	3218	-53
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219	-2	2219	-3	3219	-3
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	-7	1222	-19	2222	-41	3222	-51
7.2 Tributos	0223	-6	1223	-3	2223	-27	3223	-17
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-39	1224	-42	2224	-116	3224	-129
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-24	1225	-27	2225	-73	3225	-81
7.3.2 Comisión administrador	0226	-12	1226	-13	2226	-35	3226	-40
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-3	1227	-3	2227	-8	3227	-8
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	69	1231	540	2231	-33	3231	1.288
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	69	1232	540	2232	-33	3232	1.288
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	-13	2238	39	3238	24
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	191	1239	-291	2239	865	3239	-543
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

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2018		Acumulado anterior 30/09/2017
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-89	1300	-161	2300	-177	3300	-96
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-52	1301	-85	2301	-190	3301	141
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	217	1302	344	2302	756	3302	1.519
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-78	1303	-78	2303	-233	3303	-234
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	179	1304	80	2304	442	3304	155
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-370	1305	-431	2305	-1.155	3305	-1.298
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	-26	1309	-29	2309	-79	3309	-89
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-24	1310	-26	2310	-72	3310	-81
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-2	1312	-3	2312	-7	3312	-8
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	-11	1315	-47	2315	93	3315	-148
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	-11	1320	-49	2320	-67	3320	-153
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	2	2321	160	3321	5
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-1.400	1322	-214	2322	-3.783	3322	-1.452
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	-1.400	1325	-214	2325	-3.783	3325	-1.452
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	7.856	1326	8.228	2326	23.791	3326	24.948
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	2.265	1327	4.794	2327	10.880	3327	14.850
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	234	1328	332	2328	756	3328	1.193
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	160	3330	203
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-11.755	1331	-13.569	2331	-39.369	3331	-42.646
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	-1.489	1337	-375	2337	-3.960	3337	-1.548
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	43.649	1338	43.806	2338	46.119	3338	44.978
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	42.159	1339	43.430	2339	42.159	3339	43.430

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2018		Acumulado anterior 30/09/2017
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	600	1357	978	2357	2.594	3357	2.861
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	600	1358	978	2358	2.594	3358	2.861
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	154	1360	304	2360	628	3360	1.039
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-753	1362	-1.282	2362	-3.222	3362	-3.900
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 Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2018								Situación cierre anual anterior 31/12/2017								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380	1,36	0400	1,68	0420	0	0440	4,12	1380	1,22	1400	1,50	1420	2,95	1440	5,62	2380	0,08	2400	0	2420	0	2440	0
Certificados de transmisión de hipoteca	0381		0401		0421		0441		1381		1401		1421		1441		2381		2401		2421		2441	
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	10	0467	6	0474	0	0481		0488	6	0495	997	0502	0	0509	1.003
De 1 a 3 meses	0461	8	0468	12	0475	1	0482		0489	12	0496	879	0503	0	0510	891
De 3 a 6 meses	0462	8	0469	20	0476	0	0483	0	0490	21	0497	805	0504		0511	826
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	1	0477	0	0484	0	0491	1	0498	27	0505		0512	28
De 9 a 12 meses	0464	2	0471	10	0478	0	0485	1	0492	10	0499	196	0506		0513	206
Más de 12 meses	0465	27	0472	1.142	0479	14	0486	148	0493	1.304	0500	3.849	0507		0514	5.153
Total	0466	56	0473	1.191	0480	15	0487	149	0494	1.355	0501	6.754	0508	0	1515	8.108

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	10	0522	6	0529	0	0536		0543	6	0550	997	0557	0	0564	1.003	0571	3.181	0578	3.181	0584	31,53
De 1 a 3 meses	0516	8	0523	12	0530	1	0537		0544	12	0551	879	0558	0	0565	891	0572	2.597	0579	2.597	0585	34,31
De 3 a 6 meses	0517	8	0524	20	0531	0	0538	0	0545	21	0552	805	0559		0566	826	0573	3.238	0580	3.238	0586	25,52
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	1	0532	0	0539	0	0546	1	0553	27	0560		0567	28	0574	112	0581	112	0587	24,87
De 9 a 12 meses	0519	2	0526	10	0533	0	0540	1	0547	10	0554	196	0561		0568	206	0575	490	0582	490	0588	42,09
Más de 12 meses	0520	27	0527	1.142	0534	14	0541	148	0548	1.304	0555	3.849	0562		0569	5.153	0576	9.806	0583	9.806	0589	52,55
Total	0521	56	0528	1.191	0535	15	0542	149	0549	1.355	0556	6.754	0563	0	0570	8.108	0577	19.425			0590	41,74

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 12/12/2007	
Inferior a 1 año	0600	188	1600	242	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	698	1601	539	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.480	1602	1.260	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	3.191	1603	2.307	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	2.664	1604	4.353	2604	1.057
Entre 5 y 10 años	0605	39.011	1605	40.800	2605	21.324
Superior a 10 años	0606	396.866	1606	430.296	2606	1.177.619
Total	0607	444.099	1607	479.795	2607	1.200.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	15,72	1608	16,37	2608	25,77

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 12/12/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	12,17	1609	11,43	2609	1,48

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 12/12/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	3.350	0630	253.416	1620	3.323	1630	254.028	2620	1.796	2630	210.689
40% - 60%	0621	1.391	0631	188.444	1621	1.594	1631	223.024	2621	2.305	2631	385.177
60% - 80%	0622	8	0632	1.564	1622	10	1632	1.953	2622	2.937	2632	604.134
80% - 100%	0623	2	0633	413	1623	3	1633	513	2623	0	2633	0
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624	0	2634	0
120% - 140%	0625	1	0635	263	1625	1	1635	276	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	4.752	0638	444.099	1628	4.931	1638	479.795	2628	7.038	2638	1.200.000
Media ponderada (%)	0639	35,71	0649		1639	37,19	1649		2639	57,30	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 12/12/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,26	1650	0,36	2650	4,59
Tipo de interés nominal máximo	0651	2	1651	2	2651	5,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,01	1652	0,09	2652	4,06

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 12/12/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	787	0683	64.782	1660	822	1683	70.866	2660	1.084	2683	161.087
Aragón	0661	158	0684	12.710	1661	162	1684	13.735	2661	218	2684	33.713
Asturias	0662	53	0685	3.859	1662	56	1685	4.215	2662	83	2685	11.393
Baleares	0663	252	0686	24.877	1663	263	1686	26.750	2663	372	2686	63.283
Canarias	0664	465	0687	38.267	1664	485	1687	41.819	2664	666	2687	96.381
Cantabria	0665	100	0688	7.383	1665	102	1688	7.917	2665	134	2688	19.482
Castilla-León	0666	198	0689	13.903	1666	206	1689	15.033	2666	290	2689	41.572
Castilla La Mancha	0667	68	0690	5.719	1667	70	1690	6.055	2667	224	2690	34.140
Cataluña	0668	737	0691	77.888	1668	755	1691	83.011	2668	1.017	2691	195.853
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	0
Extremadura	0670	28	0693	2.178	1670	28	1693	2.314	2670	45	2693	7.001
Galicia	0671	119	0694	8.011	1671	126	1694	8.615	2671	175	2694	24.038
Madrid	0672	1.010	0695	116.120	1672	1.057	1695	125.836	2672	1.677	2695	347.767
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	131	0697	11.193	1674	132	1697	11.981	2674	167	2697	24.358
Navarra	0675	32	0698	2.725	1675	34	1698	3.024	2675	54	2698	8.555
La Rioja	0676	5	0699	430	1676	6	1699	470	2676	7	2699	1.353
Comunidad Valenciana	0677	503	0700	42.786	1677	517	1700	45.944	2677	655	2700	99.030
País Vasco	0678	106	0701	11.266	1678	110	1701	12.211	2678	170	2701	30.994
Total España	0679	4.752	0702	444.099	1679	4.931	1702	479.795	2679	7.038	2702	1.200.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	4.752	0705	444.099	1682	4.931	1705	479.795	2682	7.038	2705	1.200.000

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 12/12/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,30			1710	1,26			2710	0,95		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2018			Situación cierre anual anterior 31/12/2017			Situación inicial 12/12/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0312302005	A1	5.064	0	0	5.064	0	0	5.064	50.000	253.200			
ES0312302013	A2	18.000	22.154	398.764	18.000	24.341	438.133	18.000	50.000	900.000			
ES0312302021	B	360	50.000	18.000	360	50.000	18.000	360	50.000	18.000			
ES0312302039	C	336	50.000	16.800	336	50.000	16.800	336	50.000	16.800			
ES0312302047	D	240	50.000	12.000	240	50.000	12.000	240	50.000	12.000			
Total		0723	24.000	0724	445.564	1723	24.000	1724	484.933	2723	24.000	2724	1.200.000

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2018

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		
ES0312302005	A1	NS	EURIBOR 3 MESES	0,08	0	0	0	SI	0	0	0			
ES0312302013	A2	S	EURIBOR 3 MESES	0,20	0	0	0	SI	398.764	0	398.764			
ES0312302021	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,30	0	0	0	SI	18.000	0	18.000			
ES0312302039	C	S	EURIBOR 3 MESES	0,60	0,27	6	0	SI	16.800	0	16.806			
ES0312302047	D	S	EURIBOR 3 MESES	2,50	2,17	33	0	SI	12.000	0	12.033			
Total						0740	39	0741	0743	445.564	0744	0745	445.604	0746

	Situación actual 30/09/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 12/12/2007			
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,07	0748	0,06	0749	5,12

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2018								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2017							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0312302013	A2	11.755	501.236	0	101.539	13.569	447.726	0	101.539								
ES0312302021	B	0	0	0	2.275	0	0	0	2.275								
ES0312302039	C	0	0	12	2.660	0	0	12	2.614								
ES0312302047	D	0	0	67	4.367	0	0	67	4.102								
ES0312302005	A1		253.200		13.601		253.200		13.601								
Total		0754	11.755	0755	754.436	0756	78	0757	124.441	1754	13.569	1755	700.926	1756	78	1757	124.131

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2018

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 30/09/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 12/12/2007
				0762	0763	0764
ES0312302013	A2	29/09/2016	FCH	A+	A+	AAA
ES0312302013	A2	30/01/2015	SYP	A-	A-	AAA
ES0312302021	B	29/09/2016	FCH	A+	A+	A
ES0312302021	B	30/01/2015	SYP	A-	A-	A
ES0312302039	C	23/04/2018	FCH	A+	A	BBB+
ES0312302039	C	24/02/2017	SYP	A-	BBB	BBB+
ES0312302047	D	10/10/2014	FCH	BBB	BBB	BB
ES0312302047	D	21/03/2018	SYP	A-	BB-	BB-

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2018

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 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 12/12/2007	
Inferior a 1 año	0765		1765		2765	
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769	398.764	1769	438.133	2769	253.200
Entre 5 y 10 años	0770	46.800	1770	46.800	2770	
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	946.800
Total	0772	445.564	1772	484.933	2772	1.200.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	7,19	1773	7,58	2773	15,67

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 12/12/2007	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	35.768	1775	35.630	2775	36.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	36.000	1776	36.000	2776	36.000
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	8,03	1777	7,35	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	N	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	0	1792	0	2792	
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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 30/09/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 12/12/2007	
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806

AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Permuta 1	BANCO SANTANDER S.A	TRIMESTRAL	Suma de (i) intereses ordinarios de las Participaciones Hipotecarias, correspondientes al tipo de interés de referencia (calculado mediante la deducción del margen aplicable a cada liquidación del Préstamo Hipotecario) y en (ii) concepto de la parte variable de los intereses de demora de las Participaciones Hipotecarias, esto es, el tipo de interés de referencia sobre el que se pagan dichos intereses de demora durante el Periodo de Liquidación en curso, entre el Importe Nominal, multiplicado por 360 y dividido por los días efectivos existentes en dicho Periodo de Liquidación	Suma de los Importes Nacionales Individuales. Importe Ncional Individual de cada Préstamo Hipotecario : se dividirán (i) las cantidades efectivamente ingresadas por el Fondo en concepto de intereses ordinarios de las Participaciones Hipotecarias, correspondientes al tipo de interés de referencia (calculado mediante la deducción del margen aplicable a cada liquidación del Préstamo Hipotecario) y en concepto de la parte variable de los intereses de demora de las Participaciones Hipotecarias, esto es, el tipo de interés de referencia sobre el que se pagan dichos intereses de demora entre (ii) el tipo de interés de referencia aplicado en cada liquidación en el correspondiente Préstamo Hipotecario que será siempre Euribor a un año	Importe Ncional del Periodo de Liquidación por el tipo de interés EURIBOR a 3 meses	Suma de los Importes Nacionales Individuales. Importe Ncional Individual de cada Préstamo Hipotecario : se dividirán (i) las cantidades efectivamente ingresadas por el Fondo en concepto de intereses ordinarios de las Participaciones Hipotecarias, correspondientes al tipo de interés de referencia (calculado mediante la deducción del margen aplicable a cada liquidación del Préstamo Hipotecario) y en concepto de la parte variable de los intereses de demora de las Participaciones Hipotecarias, esto es, el tipo de interés de referencia sobre el que se pagan dichos intereses de demora entre (ii) el tipo de interés de referencia aplicado en cada liquidación en el correspondiente Préstamo Hipotecario que será siempre Euribor a un año	-13.384	-16.692	-48.439			
Total							0808	-13.384	0809	-16.692	0810	-48.439

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 12/12/2007		Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 12/12/2007			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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 30/09/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación actual 30/09/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Última Fecha Pago							
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	1.337	7006	1.215	7009	1,37	7012	1,23	7015	1,28		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.337	7008	1.215	7011	1,37	7014	1,23	7017	1.336.833	7018	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	1.282	7024	1.176	7027	1,08	7030	1,04	7033	1,07		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	1.282	7026	1.176	7029	1,08	7032	1,04	7035	1,07	7036	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
b) El importe a que asciende el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias en morosidad que presenten más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, sea superior al % establecido para cada ISIN del Saldo Vivo de los Activos en es	1,25	0,29	0,21	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.3.4
b) El importe a que asciende el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias en morosidad que presenten más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, sea superior al % establecido para cada ISIN del Saldo Vivo de los Activos en es	1	0,29	0,21	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.3.4
b) El importe a que asciende el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias en morosidad que presenten más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, sea superior al % establecido para cada ISIN del Saldo Vivo de los Activos en es	0,75	0,29	0,21	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.3.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Saldo acumulado de Activos Fallidos (sin deducción de las posibles recuperaciones obtenidas de esos Activos Fallidos) fuese superior al porcentaje recogido para cada ISIN del Saldo Inicial de la cartera de Participaciones Hipotecarias	7	1,89	1,89	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL LA NOTA DE VALORES. APARTADO 3.4.6.3
Saldo acumulado de Activos Fallidos (sin deducción de las posibles recuperaciones obtenidas de esos Activos Fallidos) fuese superior al porcentaje recogido para cada ISIN del Saldo Inicial de la cartera de Participaciones Hipotecarias	4,50	1,89	1,89	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL LA NOTA DE VALORES. APARTADO 3.4.6.3
Saldo acumulado de Activos Fallidos (sin deducción de las posibles recuperaciones obtenidas de esos Activos Fallidos) fuese superior al porcentaje recogido para cada ISIN del Saldo Inicial de la cartera de Participaciones Hipotecarias	4	1,89	1,89	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL LA NOTA DE VALORES. APARTADO 3.4.6.3
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
(iii) Cuando en la Fecha de Determinación correspondiente a la Fecha de Pago en curso el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera superior al porcentaje recogido del Sal	1	0,29	0,21	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL A LA NOTA DE VALORES. APARTADO 3.4.2.2.
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	1862	0	2862	Días del mes /Base 365	3862	0,020	4862	150	5862	0	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	BARCLAYS BANK, S.A.	1863	0	2863	Días del mes /Base 365	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Trimestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	CAIXABANK, S.A.	1864	0	2864	Días del mes /Base 365	3864	0	4864	0	5864	0	6864	Trimestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	S
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	N
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Caixabank
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo adicional 3.7.2.3

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo											Total		
		31/03/2018	30/06/2018	30/09/2018											
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872														
Margen de intereses	0873	-234	-241	-208											-684
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	-216	114	69											-33
Dotaciones a provisiones (neto)	0875	0													0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876	39													39
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-68	-66	-53											-187
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	-480	-194	-191	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-865
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879	0													0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880	0													0
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881	0													0
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	480	194	191	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	865
Comisión variable pagada	0883	0													0
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884	0													0

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

S.06

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario XI, FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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