

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: 31/12/2020

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: 31/12/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2020		Periodo anterior 31/12/2019
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	265.476	1001	303.333
I. Activos financieros a largo plazo	0002	265.476	1002	303.333
1. Activos titulizados	0003	265.476	1003	303.333
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	264.788	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	4.008	1025	3.743
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-3.320	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: 31/12/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	67.028	1041	74.751
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	41.459	1043	44.695
1. Activos titulizados	0044	41.457	1044	44.695
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	40.975	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	62	1065	83
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	1	1066	2
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	2.434	1067	2.387
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	7	1068	8
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-2.022	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	2	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	2	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	25.569	1085	30.055
1. Tesorería	0086	25.569	1086	30.055
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	332.504	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: 31/12/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2020		Periodo anterior 31/12/2019
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	280.030	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	280.030	1094	322.356
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	265.929	1095	303.747
1.1 Series no subordinadas	0096	221.429	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	14.101	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	-25.599	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: 31/12/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) PASIVO CORRIENTE	0117	52.474	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	52.462	1123	55.715
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	46.681	1124	50.721
1.1 Series no subordinadas	0125	46.326	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	355	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	5.780	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	56	1136	61
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	5.724	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	13	1148	13
1. Comisiones	0149	3	1149	4
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	3	1150	4
1.2 Comisión administrador	0151	346	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	-2.100	1155	-2.066
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	9	1157	9
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158		1158	
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160		1160	
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	332.504	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: 31/12/2020

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2020		Acumulado anterior 31/12/2019
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	384	1201	963	2201	1.695	3201	2.613
1.1 Activos titulizados	0202	384	1202	963	2202	1.695	3202	2.613
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203		3203	
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-1.329	1204	-1.465	2204	-5.472	3204	-6.010
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.131	1205	-1.271	2205	-4.685	3205	-5.235
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-198	1206	-194	2206	-787	3206	-775
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	-945	1209	-502	2209	-3.777	3209	-3.397
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	-37	1217	-21	2217	-100	3217	-88
7.1 Servicios exteriores	0218	-10	1218	0	2218	-13	3218	-1
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219	0	2219	-1	3219	-1
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	-9	1222	0	2222	-12	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-28	1224	-21	2224	-87	3224	-87
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-10	1225	-11	2225	-44	3225	-48
7.3.2 Comisión administrador	0226	-8	1226	-9	2226	-35	3226	-39
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	-9	1230	0	2230	-9	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-246	1231	2.019	2231	-665	3231	2.203
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-246	1232	2.019	2232	-665	3232	2.203
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	1.229	1239	-1.496	2239	4.542	3239	1.283
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: 31/12/2020

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2020		Acumulado anterior 31/12/2019
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-1.937	1300	-1.609	2300	-3.079	3300	-2.689
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-1.906	1301	-1.586	2301	-3.013	3301	-2.639
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	386	1302	971	2302	1.716	3302	2.628
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-2.292	1303	-2.557	2303	-4.730	3303	-5.267
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	-21	1309	-24	2309	-44	3309	-49
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-21	1310	-24	2310	-44	3310	-49
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	-22	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	-22	3320	-1
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-8.609	1322	-6.634	2322	-1.407	3322	2.389
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	-8.609	1325	-6.634	2325	-1.407	3325	2.389
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	6.079	1326	6.414	2326	24.794	3326	26.166
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	4.265	1327	5.568	2327	13.974	3327	16.990
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	431	1328	1.745	2328	1.639	3328	3.362
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	-19.385	1331	-20.361	2331	-41.813	3331	-44.130
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	-10.546	1337	-8.244	2337	-4.486	3337	-300
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	36.115	1338	38.299	2338	30.055	3338	30.355
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	25.569	1339	30.055	2339	25.569	3339	30.055

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: 31/12/2020

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2020		Acumulado anterior 31/12/2019
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: 31/12/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2020								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	2,06	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: 31/12/2020
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	42	0467	12	0474	1	0481		0488	13	0495	3.078	0502	1	0509	3.091
De 1 a 3 meses	0461	24	0468	22	0475	1	0482		0489	22	0496	1.739	0503	1	0510	1.762
De 3 a 6 meses	0462	7	0469	10	0476	0	0483	0	0490	10	0497	601	0504		0511	611
De 6 a 9 meses	0463	2	0470	7	0477		0484	0	0491	7	0498	95	0505		0512	102
De 9 a 12 meses	0464	4	0471	15	0478		0485	0	0492	15	0499	217	0506		0513	232
Más de 12 meses	0465	52	0472	2.403	0479	7	0486	146	0493	2.555	0500	3.096	0507		0514	5.651
Total	0466	131	0473	2.468	0480	8	0487	146	0494	2.622	0501	8.825	0508	1	1515	11.449

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	42	0522	12	0529	1	0536		0543	13	0550	3.078	0557	1	0564	3.091	0571	7.075	0578		0584	43,69
De 1 a 3 meses	0516	24	0523	22	0530	1	0537		0544	22	0551	1.739	0558	1	0565	1.762	0572	4.379	0579		0585	40,24
De 3 a 6 meses	0517	7	0524	10	0531	0	0538	0	0545	10	0552	601	0559		0566	611	0573	1.265	0580		0586	48,31
De 6 a 9 meses	0518	2	0525	7	0532		0539	0	0546	7	0553	95	0560		0567	102	0574	334	0581		0587	30,50
De 9 a 12 meses	0519	4	0526	15	0533		0540	0	0547	15	0554	217	0561		0568	232	0575	558	0582		0588	41,59
Más de 12 meses	0520	52	0527	2.403	0534	7	0541	146	0548	2.555	0555	3.096	0562		0569	5.651	0576	10.381	0583		0589	54,44
Total	0521	131	0528	2.468	0535	8	0542	146	0549	2.622	0556	8.825	0563	1	0570	11.449	0577	23.991			0590	47,72

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: 31/12/2020

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 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007	
Inferior a 1 año	0600	348	1600	350	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	892	1601	807	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	2.338	1602	1.612	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	3.413	1603	3.238	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	4.541	1604	4.517	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	42.856	1605	39.871	2605	2.254
Superior a 10 años	0606	257.817	1606	302.216	2606	997.746
Total	0607	312.205	1607	352.611	2607	1.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	13,83	1608	14,64	2608	25,54

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	15,99	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: 31/12/2020
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 31/12/2020				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	3.276	0630	166.267	1620	2.772	1630	134.798	2620	140	2630	28.705
40% - 60%	0621	1.217	0631	115.904	1621	1.820	1631	167.476	2621	1	2631	85
60% - 80%	0622	216	0632	29.855	1622	358	1632	48.408	2622	6.185	2632	799.422
80% - 100%	0623	1	0633	178	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	4.710	0638	312.205	1628	4.967	1638	352.611	2628	7.326	2638	1.000.000
Media ponderada (%)	0639	40,79	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: 31/12/2020

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 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 19/04/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,46	1650	0,55	2650	5,12
Tipo de interés nominal máximo	0651	3,84	1651	11,93	2651	6,83
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,02	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: 31/12/2020
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 31/12/2020				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	1.328	1660	15	1683	1.456	2660	110	2683	19.711
Aragón	0661	122	0684	8.769	1661	123	1684	9.518	2661	184	2684	25.462
Asturias	0662	2	0685	335	1662	2	1685	343	2662	5	2685	867
Baleares	0663	2	0686	175	1663	2	1686	190	2663	2	2686	346
Canarias	0664	1	0687	67	1664	2	1687	80	2664	3	2687	491
Cantabria	0665	442	0688	27.681	1665	457	1688	31.025	2665	631	2688	79.441
Castilla-León	0666	38	0689	2.367	1666	41	1689	2.629	2666	60	2689	7.066
Castilla La Mancha	0667	126	0690	9.809	1667	137	1690	11.257	2667	189	2690	26.767
Cataluña	0668	44	0691	2.885	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	260	1671	3	1694	269	2671	4	2694	459
Madrid	0672	788	0695	54.171	1672	840	1695	62.237	2672	1.320	2695	182.483
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	5	0697	448	1674	6	1697	520	2674	9	2697	1.174
Navarra	0675	3	0698	194	1675	4	1698	283	2675	4	2698	514
La Rioja	0676	65	0699	4.126	1676	69	1699	4.628	2676	91	2699	11.659
Comunidad Valenciana	0677	364	0700	24.680	1677	379	1700	27.596	2677	560	2700	73.847
País Vasco	0678	2.691	0701	174.909	1678	2.842	1701	197.313	2678	4.089	2701	560.489
Total España	0679	4.710	0702	312.205	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	4.710	0705	312.205	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: 31/12/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2020				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	0,98			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: 31/12/2020
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2020			Situación cierre anual anterior 31/12/2019			Situación inicial 19/04/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente			
		0720	Nominal unitario (€) 0721	0722	1720	Nominal unitario (€) 1721	1722	2720	Nominal unitario (€) 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	28.023	267.755	9.555	32.399	309.568	9.555	100.000	955.500			
Total		0723	10.000	0724	312.255	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: 31/12/2020
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	40	0	SI	30.500	0	30.540	
ES0312273388	C	S	FIJO	0	2	12	0	SI	7.000	0	7.012	
ES0312273396	D	S	FIJO	0	3	17	0	SI	7.000	0	7.017	
ES0312273362	A	NS	FIJO	0	1,30	286	0	SI	267.755	0	268.041	
Total						0740 355	0741		0743 312.255	0744	0745 312.610	0746

	Situación actual 31/12/2020	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: 31/12/2020
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2020								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2019							
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	19.385	710.766	1.872	145.604	20.361	645.932	2.139	137.649								
ES0312273370	B	0	0	245	7.866	0	0	243	7.377								
ES0312273388	C	0	0	70	2.176	0	0	70	2.035								
ES0312273396	D	0	0	105	3.101	0	0	105	2.891								
Total		0754	19.385	0755	710.766	0756	2.292	0757	158.747	1754	20.361	1755	645.932	1756	2.557	1757	149.951

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: 31/12/2020
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 31/12/2020	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: 31/12/2020
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 31/12/2020		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	267.755	1768		2768
Entre 4 y 5 años	0769		1769	309.568	2769
Entre 5 y 10 años	0770	44.500	1770	44.500	2770
Superior a 10 años	0771		1771		1.000.000
Total	0772	312.255	1772	354.068	2772
Vida residual media ponderada (años)	0773	6,17	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: 31/12/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2020		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	20.167	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	6,46	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	85,75	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: 31/12/2020

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 31/12/2020	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: 31/12/2020

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 31/12/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 19/04/2007	Situación actual 31/12/2020	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: 31/12/2020

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 31/12/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación actual 31/12/2020	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	2.587	7006	2.517	7009	2,18	7012	1,74	7015	2,06		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	2.587	7008	2.517	7011	2,18	7014	1,74	7017	2.587.388	7018	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	2.545	7024	2.435	7027	1,73	7030	1,31	7033	1,66		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	2.545	7026	2.435	7029	1,73	7032	1,31	7035	1,66	7036	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2020		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: 31/12/2020

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	0,36	0,36	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	0,36	0,36	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.	1,25	0,36	0,36	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	20	1,94	1,87	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	1,94	1,87	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	22	1,94	1,87	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6. Y CONDICIONES FINALES
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
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	1,94	1,87	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.1 y CONDICIONES FNALES
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 (PORCENTAJE)	1	0,36	0,36	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	30,69	31,23	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: 31/12/2020

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	BSCH	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: 31/12/2020

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: 31/12/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)	Fecha cálculo										Total	
	0885	02/06/2020	02/12/2020									
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885	02/06/2020	02/12/2020									
Saldo inicial	0886	23.526	21.916									
Cobros del periodo	0887	23.279	19.948									
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-23	-22									
Pagos por derivados	0889	0	0									
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-21.916	-20.167									
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-24.867	-21.676									
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0									
Resto pagos/retenciones	0893	0	0									
Saldo disponible	0894	0	0									
Liquidación de comisión variable	0895	0	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: 31/12/2020

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