

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT CAJAMURCIA HIPOTECARIO II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8549
NIF Fondo: V84875947
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: 30/09/2017

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

S.01

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	58.202	1001	65.946
I. Activos financieros a largo plazo	0002	58.202	1002	65.946
1. Activos titulizados	0003	58.202	1003	65.946
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	47.870	1004	55.589
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	10.208	1005	9.936
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	919	1025	1.034
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-795	1027	-613
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 Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	17.011	1041	18.560
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	8.243	1043	8.986
1. Activos titulizados	0044	8.243	1044	8.986
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	7.404	1045	7.917
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	784	1046	978
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	
1.18 Bonos de 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	60
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	0	1066	1
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	68	1067	70
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	4	1068	4
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-62	1069	-44
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074		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		1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	8.768	1085	9.574
1. Tesorería	0086	8.768	1086	9.574
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	75.213	1088	84.506

S.01

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	63.955	1089	73.254
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	63.955	1094	73.254
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	57.433	1095	66.106
1.1 Series no subordinadas	0096	51.975	1096	61.111
1.2 Series subordinadas	0097	5.459	1097	4.995
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101	1.575	1101	1.575
2.1 Préstamo subordinado	0102	1.575	1102	1.575
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	0	1105	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	508	1108	825
3.1 Derivados de cobertura	0109	508	1109	825
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	4.439	1112	4.749
4.1 Garantías financieras	0113	4.439	1113	4.749
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 Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
B) PASIVO CORRIENTE	0117	11.766	1117	12.077
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	11.721	1123	11.851
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	11.665	1124	11.779
1.1 Series no subordinadas	0125	11.664	1125	10.888
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	890
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	1	1128	1
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	1131	3
2.1 Préstamo subordinado	0132		1132	1
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	3	1136	3
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	3	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	50	1139	68
3.1 Derivados de cobertura	0140	50	1140	68
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	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	1	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	45	1148	226
1. Comisiones	0149	29	1149	205
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	9	1150	8
1.2 Comisión administrador	0151	3	1151	2
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	1152	2
1.4 Comisión variable	0153	15	1153	192
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	16	1157	21
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-508	1158	-825
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-508	1160	-825
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	75.213	1162	84.506

S.02

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2017		Acumulado anterior 30/09/2016
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	153	1201	215	2201	490	3201	695
1.1 Activos titulizados	0202	153	1202	215	2202	490	3202	695
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203		3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-4	1204	-4	2204	-11	3204	-21
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1	1205	-2	2205	-3	3205	-12
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-3	1206	-2	2206	-8	3206	-9
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-50	1208	-76	2208	-163	3208	-237
A) MARGEN DE INTERESES	0209	99	1209	135	2209	316	3209	437
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210		3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212		3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215		3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216		3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-28	1217	-73	2217	-117	3217	-115
7.1 Servicios exteriores	0218	0	1218	-2	2218	-2	3218	-14
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	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	-2	2222	-1	3222	-13
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	-1	3223	-2
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-28	1224	-71	2224	-114	3224	-99
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-9	1225	-9	2225	-27	3225	-27
7.3.2 Comisión administrador	0226	-2	1226	-2	2226	-5	3226	-6
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-3	1227	-2	2227	-7	3227	-8
7.3.4 Comisión variable	0228	-15	1228	-56	2228	-74	3228	-56
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	-2	2230	0	3230	-2
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	63	1231	4	2231	-199	3231	-322
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	63	1232	4	2232	-199	3232	-322
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233		3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234	0	2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238		3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-134	1239	-66	2239	0	3239	0
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241		3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

S.03

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2017		Acumulado anterior 30/09/2016
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	2	1300	-30	2300	-293	3300	-554
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	103	1301	140	2301	315	3301	457
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	159	1302	218	2302	505	3302	713
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-1	1303	-2	2303	-4	3303	-36
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	15	1304	0	2304	-50	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-69	1305	-76	2305	-131	3305	-216
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	-5	3307	-4
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-12	1309	-12	2309	-289	3309	-160
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-9	1310	-9	2310	-27	3310	-27
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	-4	3311	-2
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-2	1312	-3	2312	-7	3312	-10
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	-251	3313	-121
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-90	1315	-158	2315	-318	3315	-851
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	
3.5 Otros pagos de explotación	0320	220	1320	-158	2320	-8	3320	-851
3.6 Otros cobros de explotación	0321	-310	1321	0	2321	-310	3321	
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-391	1322	376	2322	-513	3322	-4.751
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	-391	1325	376	2325	-513	3325	-4.751
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	1.972	1326	2.014	2326	5.886	3326	6.055
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	632	1327	1.016	2327	1.828	3327	2.303
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	156	1328	198	2328	560	3328	691
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	-3.151	1331	-2.852	2331	-8.786	3331	-13.800
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	-389	1337	346	2337	-805	3337	-5.305
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	9.157	1338	9.626	2338	9.574	3338	15.277
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	8.768	1339	9.972	2339	8.768	3339	9.972

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2017		Acumulado anterior 30/09/2016
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356		3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	41	1357	96	2357	153	3357	-115
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	41	1358	96	2358	153	3358	-115
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	50	1360	76	2360	163	3360	237
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-91	1362	-172	2362	-317	3362	-122
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364		3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365		3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366		3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367		3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368		3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369		3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2017								Situación cierre anual anterior 31/12/2016								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380	1,55	0400	0	0420	0	0440	4,14	1380	1,34	1400	0	1420	0	1440	4,07	2380	0,48	2400	0,48	2420	0	2440	0
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	1,03	0401	0	0421	0	0441	2,12	1381	2,12	1401	0	1421	0	1441	3,60	2381	0	2401	0	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 Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, 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	5	0467	1	0474	0	0481		0488	1	0495	329	0502	0	0509	330
De 1 a 3 meses	0461	2	0468	1	0475	0	0482		0489	1	0496	73	0503	0	0510	74
De 3 a 6 meses	0462	2	0469	2	0476	0	0483	0	0490	2	0497	33	0504		0511	35
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	2	0477	0	0484	0	0491	2	0498	7	0505		0512	9
De 9 a 12 meses	0464	1	0471	3	0478	0	0485	0	0492	4	0499	46	0506		0513	50
Más de 12 meses	0465	15	0472	61	0479	4	0486	10	0493	74	0500	833	0507		0514	907
Total	0466	26	0473	69	0480	4	0487	10	0494	83	0501	1.321	0508	0	1515	1.404

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	5	0522	1	0529	0	0536		0543	1	0550	329	0557	0	0564	330	0571	792	0578	792	0584	41,66
De 1 a 3 meses	0516	2	0523	1	0530	0	0537		0544	1	0551	73	0558	0	0565	74	0572	191	0579	191	0585	38,71
De 3 a 6 meses	0517	2	0524	2	0531	0	0538	0	0545	2	0552	33	0559		0566	35	0573	112	0580	112	0586	31,07
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	2	0532	0	0539	0	0546	2	0553	7	0560		0567	9	0574	108	0581	108	0587	8,21
De 9 a 12 meses	0519	1	0526	3	0533	0	0540	0	0547	4	0554	46	0561		0568	50	0575	106	0582	106	0588	47,08
Más de 12 meses	0520	15	0527	61	0534	4	0541	10	0548	74	0555	833	0562		0569	907	0576	1.914	0583	1.914	0589	47,39
Total	0521	26	0528	69	0535	4	0542	10	0549	83	0556	1.321	0563	0	0570	1.404	0577	3.222			0590	43,57

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 31/10/2006	
Inferior a 1 año	0600	267	1600	82	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	2.156	1601	1.395	2601	64
Entre 2 y 3 años	0602	450	1602	2.750	2602	135
Entre 3 y 4 años	0603	539	1603	556	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	753	1604	854	2604	813
Entre 5 y 10 años	0605	21.605	1605	24.090	2605	14.810
Superior a 10 años	0606	41.481	1606	45.800	2606	299.178
Total	0607	67.251	1607	75.525	2607	315.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	10,26	1608	10,72	2608	18,81

Antigüedad	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 31/10/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	13,46	1609	12,73	2609	2,65

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2017
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 31/10/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.398	0630	42.531	1620	1.395	1630	44.740	2620	769	2630	38.330
40% - 60%	0621	334	0631	20.841	1621	391	1631	24.868	2621	1.105	2631	86.361
60% - 80%	0622	43	0632	3.880	1622	64	1632	5.918	2622	1.778	2632	155.049
80% - 100%	0623		0633		1623		1633		2623	304	2633	35.260
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624	0	2634	0
120% - 140%	0625		0635		1625		1635		2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627	0	2637	0
Total	0628	1.775	0638	67.251	1628	1.850	1638	75.525	2628	3.956	2638	315.000
Media ponderada (%)	0639	35,04	0649		1639	36,68	1649		2639	61,85	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 31/10/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,89	1650	0,92	2650	3,98
Tipo de interés nominal máximo	0651	3,75	1651	4,50	2651	5,75
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,35	1652	0,06	2652	2,22

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 31/10/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	124	0683	5.295	1660	130	1683	6.047	2660	289	2683	25.632
Aragón	0661		0684		1661		1684		2661	0	2684	0
Asturias	0662		0685		1662		1685		2662	0	2685	0
Baleares	0663		0686		1663		1686		2663	0	2686	0
Canarias	0664		0687		1664		1687		2664	0	2687	0
Cantabria	0665		0688		1665		1688		2665	0	2688	0
Castilla-León	0666		0689		1666		1689		2666	0	2689	0
Castilla La Mancha	0667		0690		1667		1690		2667	159	2690	11.586
Cataluña	0668		0691		1668		1691		2668	0	2691	0
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	0
Extremadura	0670		0693		1670		1693		2670	0	2693	0
Galicia	0671		0694		1671		1694		2671	0	2694	0
Madrid	0672		0695		1672		1695		2672	5	2695	455
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	1.106	0697	42.224	1674	1.147	1697	47.233	2674	2.162	2697	171.600
Navarra	0675		0698		1675		1698		2675	0	2698	0
La Rioja	0676		0699		1676		1699		2676	0	2699	0
Comunidad Valenciana	0677	545	0700	19.733	1677	573	1700	22.245	2677	1.341	2700	105.727
País Vasco	0678		0701		1678		1701		2678	0	2701	0
Total España	0679	1.775	0702	67.251	1679	1.850	1702	75.525	2679	3.956	2702	315.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	1.775	0705	67.251	1682	1.850	1705	75.525	2682	3.956	2705	315.000

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2017
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 31/10/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	2,97			1710	2,80			2710	1,13		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2017			Situación cierre anual anterior 31/12/2016			Situación inicial 31/10/2006					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0312272000	A	3.031	20.996	63.638	3.031	23.754	71.999	3.031	100.000	303.100			
ES0312272018	B	81	45.872	3.716	81	49.450	4.005	81	100.000	8.100			
ES0312272026	C	38	45.872	1.743	38	49.450	1.879	38	100.000	3.800			
Total		0723	3.150	0724	69.097	1723	3.150	1724	77.884	2723	3.150	2724	315.000

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados		Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		0738	0739		
						0730	0731			0732	0733	0734	0735			0742	0736
ES0312272000	A	NS	EURIBOR 3 MESES	0,14	0	0	0	SI	63.638	0	63.638	0	63.638				
ES0312272018	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,33	0	0	0	SI	3.716	0	3.716	0	3.716				
ES0312272026	C	S	EURIBOR 3 MESES	0,56	0,23	1	0	SI	1.743	0	1.744	0	1.744				
Total						0740	1	0741		0743	69.097	0744		0745	69.098	0746	

	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 31/10/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,01	0748	0,01	0749	3,83

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

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2017								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2016							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0312272000	A	3.151	239.462	0	36.040	2.852	228.593	0	35.595								
ES0312272018	B	0	4.384	0	1.407	0	3.607	1	1.385								
ES0312272026	C	0	2.057	1	740	0	1.691	1	722								
Total		0754	3.151	0755	245.903	0756	1	0757	38.187	1754	2.852	1755	233.891	1756	2	1757	37.702

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/09/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 31/10/2006
				0762	0763	0764
ES0312272000	A	14/03/2016	SYP	A	A	AAA
ES0312272018	B	30/10/2006	FCH	A+	A+	A+
ES0312272000	A	08/06/2012	FCH	AA-	AA-	AAA
ES0312272018	B	12/02/2013	SYP	BB+	BB+	A
ES0312272026	C	27/02/2015	FCH	BB+	BB+	BBB
ES0312272026	C	28/11/2014	SYP	B-	B-	BBB

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente				
	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 31/10/2006
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	63.638	1768	77.884	2768
Entre 4 y 5 años	0769		1769	0	2769
Entre 5 y 10 años	0770	5.459	1770		2770
Superior a 10 años	0771		1771		2771
Total	0772	69.097	1772	77.884	2772
Vida residual media ponderada (años)	0773	3,63	1773	3,17	2773
					315.000
					6,09

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 31/10/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	1.411	1775	1.575	2775	1.922
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	1.575	1776	1.575	2776	1.922
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	2,04	1777	2	2777	0
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778		2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780		2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784		2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790		2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	92,10	1792	92,44	2792	96,22
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 Caja Murcia Hipotecario II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2017

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características
Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/09/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 31/10/2006	
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806

AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Permuta 1	CECABANK S.A	TRIMESTRAL	El producto, en función de los días efectivamente transcurridos y en base 360, del Importe Nocial del Contrato de Swap definido anteriormente , por el Factor de Cálculo para el Swap. El Factor de Cálculo para el Swap será la media de los EURIBOR 12 meses obtenidos en doce meses precedentes al inicio del Período de Cálculo, aplicando las ponderaciones que se indican en el Contrato de Swap.El producto, en función de los días efectivamente transcurridos y en base 360, del Importe Nocial del Contrato de Swap definido anteriormente , por el Factor de Cálculo para el Swap. El Factor de Cálculo para el Swap será la media de los EURIBOR 12 meses obtenidos en doce meses precedentes al inicio del Período de Cálculo, aplicando las ponderaciones que se indican en el	Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de los Préstamos Hipotecarios No Fallidos	Es el resultado de multiplicar el Importe Nocial del Contrato de Swap por el Tipo de Interés de Referencia establecido para cada Fecha de Pago,ajustado por un margen de -0,05% .	Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de los Préstamos Hipotecarios No Fallidos	-558	-893	-6.475	
-----------	--------------	------------	--	--	---	--	------	------	--------	--

AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

			Contrato de Swap.										
Total							0808	-558	0809	-893	0810	-6.475	

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)			Valor en libros (miles de euros)			Otras características	
	Situación actual 30/09/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 31/10/2006	Situación actual 30/09/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 31/10/2006		
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 Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	3	7002	0	7003	81	7006	85	7009	1,47	7012	1,46	7015	1,45		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	81	7008	85	7011	1,47	7014	1,46	7017	81.428	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	70	7024	64	7027	1,27	7030	0,87	7033	1,31		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	70	7026	64	7029	1,27	7032	0,87	7035	1,31	7036	FOLLETO INFORMA TIVO. NOTA DE VALORES. APARTAD O 4.9.3

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

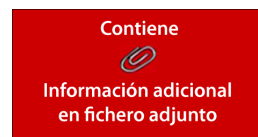
CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
d) el SALDO VIVO DE LOS ACTIVOS NO FALLIDOS CON MÁS DE 90 DÍAS DE IMPAGO sea superior al % establecido para cada ISIN del SALDO VIVO DE ACTIVOS NO FALLIDOS	1,50	0,14	0,16	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.3
d) el SALDO VIVO DE LOS ACTIVOS NO FALLIDOS CON MÁS DE 90 DÍAS DE IMPAGO sea superior al % establecido para cada ISIN del SALDO VIVO DE ACTIVOS NO FALLIDOS	1,50	0,14	0,16	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.3
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
El Saldo acumuladode los Activos Fallidos represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo Inicial a la constitución del Fondo	6,70	0,32	0,32	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.6.1
El Saldo acumuladode los Activos Fallidos represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo Inicial a la constitución del Fondo	4,60	0,32	0,32	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera superior al porcentaje recogido del Saldo Vivo de los Activos que no tengan la consideración de Activos Fallidos	1	1,47	1,40	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.2
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



S.05.5

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	1862	36	2862	Días del mes /Días año	3862	0	4862	0	5862	0	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	Caja de Ahorros de Murcia	1863	0	2863	Días del mes /Días año	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Trimestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BANCO SANTANDER, S.A.	1864	10	2864	Días del mes /Días año	3864	0	4864	0	5864	0	6864	Trimestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	N
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Banco Mare Nostrum
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo adicional 3.4.3.2

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 Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885												
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 Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

INFORME SOBRE EL CUMPLIMIENTO DE LAS POLÍTICAS DE GESTIÓN DE ACTIVOS Y DE RIESGOS