

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT HIPOTECARIO MIXTO II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 6056
NIF Fondo: V84040286
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento: 200900037
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2019

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 Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2019		Periodo anterior 31/12/2018
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001		1001	
I. Activos financieros a largo plazo	0002		1002	
1. Activos titulizados	0003		1003	
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005		1005	
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	
1.22 Activos dudosos -principal-	0025		1025	
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027		1027	
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 Hipotecario Mixto II, FTA - CTH
Denominación del compartimento: 200900037
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	11.793	1041	12.001
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	8.605	1043	8.933
1. Activos titulizados	0044	8.605	1044	8.933
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	8.519	1046	8.845
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	1	1065	1
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	6	1066	6
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	567	1067	627
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	4	1068	5
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-492	1069	-552
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082		1082	
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084		1084	
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	3.188	1085	3.068
1. Tesorería	0086	3.188	1086	3.068
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	11.793	1088	12.001

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2019		Periodo anterior 31/12/2018
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089		1089	0
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		1094	0
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095		1095	
1.1 Series no subordinadas	0096		1096	
1.2 Series subordinadas	0097		1097	
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		1101	
2.1 Préstamo subordinado	0102		1102	
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		1105	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108		1108	0
3.1 Derivados de cobertura	0109		1109	0
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 Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) PASIVO CORRIENTE	0117	11.880	1117	12.091
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	11.875	1123	12.086
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	8.729	1124	9.019
1.1 Series no subordinadas	0125	0	1125	0
1.2 Series subordinadas	0126	8.728	1126	9.017
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	2	1128	2
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	3.049	1131	2.962
2.1 Préstamo subordinado	0132	2.975	1132	2.975
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	-17	1135	-99
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	1	1136	1
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	91	1137	86
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	89	1139	92
3.1 Derivados de cobertura	0140	89	1140	92
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	7	1143	12
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	7	1145	12
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	5	1148	5
1. Comisiones	0149	0	1149	0
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	0	1150	0
1.2 Comisión administrador	0151	8	1151	8
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	64	1153	64
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-71	1155	-71
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	4	1157	4
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-87	1158	-90
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-87	1160	-90
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	11.793	1162	12.001

S.02

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2019		Acumulado anterior 31/03/2018
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	64	1201	57	2201	64	3201	57
1.1 Activos titulizados	0202	59	1202	57	2202	59	3202	57
1.2 Otros activos financieros	0203	5	1203		2203	5	3203	
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-19	1204	-21	2204	-19	3204	-21
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-14	1205	-16	2205	-14	3205	-16
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-5	1206	-5	2206	-5	3206	-5
2.3 Otros pasivos financieros	0207		1207		2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-19	1208	-21	2208	-19	3208	-21
A) MARGEN DE INTERESES	0209	26	1209	14	2209	26	3209	14
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210		1210		2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211		1211		2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212		1212		2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213		1213		2213		3213	
4.4 Otros	0214		1214		2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215		1215		2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216		2216	0	3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-4	1217	-9	2217	-4	3217	-9
7.1 Servicios exteriores	0218	-1	1218	-6	2218	-1	3218	-6
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	-6	2219	-1	3219	-6
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220		1220		2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221		1221		2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223		1223	0	2223		3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-3	1224	-3	2224	-3	3224	-3
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-2	1225	-2	2225	-2	3225	-2
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227	0	3227	0
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228		2228	0	3228	
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229		1229		2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	59	1231	55	2231	59	3231	55
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	59	1232	55	2232	59	3232	55
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233		1233		2233		3233	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234		1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235		1235		2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236		1236		2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237		1237		2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238		1238		2238		3238	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-82	1239	-60	2239	-82	3239	-60
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241		1241		2241		3241	
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

S.03

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2019		Acumulado anterior 31/03/2018
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	23	1300	13	2300	23	3300	13
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	26	1301	22	2301	26	3301	22
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	59	1302	58	2302	59	3302	58
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-14	1303	-15	2303	-14	3303	-15
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	4	1304	-4	2304	4	3304	-4
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-22	1305	-18	2305	-22	3305	-18
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	-3	1309	-2	2309	-3	3309	-2
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-2	1310	-2	2310	-2	3310	-2
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	-1	1315	-6	2315	-1	3315	-6
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	-1	1320	-25	2320	-1	3320	-25
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	19	2321	0	3321	19
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	97	1322	48	2322	97	3322	48
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulación	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	97	1325	48	2325	97	3325	48
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	8	1326	129	2326	8	3326	129
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	122	1327	173	2327	122	3327	173
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	257	1328	125	2328	257	3328	125
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	-289	1331	-379	2331	-289	3331	-379
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	120	1337	61	2337	120	3337	61
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	3.068	1338	2.980	2338	3.068	3338	2.980
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	3.188	1339	3.041	2339	3.188	3339	3.041

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2019		Acumulado anterior 31/03/2018
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350		1350		2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351		1351		2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352		1352		2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353		1353		2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354		1354		2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0355		1355		2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356		1356		2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-16	1357	66	2357	-16	3357	66
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-16	1358	66	2358	-16	3358	66
2.1.2 Efecto fiscal	0359		1359		2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	19	1360	21	2360	19	3360	21
2.3 Otras reclasificaciones	0361		1361		2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-3	1362	-87	2362	-3	3362	-87
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 periodo	0364		1364		2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365		1365		2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366		1366		2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367		1367		2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368		1368		2368		3368	
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369		1369		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 Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.A | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/03/2019								Situación cierre anual anterior 31/12/2018								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	6,24	0401	0	0421	0	0441	5,15	1381	6,62	1401	0	1421	0	1441	5,44	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 Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.A | A08663619 CAIXABANK, S.A. | 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	107	0467	25	0474	6	0481		0488	31	0495	3.292	0502	0	0509	3.323
De 1 a 3 meses	0461	2	0468	1	0475	1	0482		0489	2	0496	66	0503	0	0510	68
De 3 a 6 meses	0462		0469		0476		0483		0490		0497		0504		0511	
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	3	0477	0	0484	0	0491	4	0498	47	0505		0512	51
De 9 a 12 meses	0464	1	0471	1	0478	0	0485	0	0492	2	0499	27	0506		0513	29
Más de 12 meses	0465	8	0472	133	0479	4	0486	56	0493	194	0500	355	0507		0514	549
Total	0466	119	0473	165	0480	11	0487	57	0494	232	0501	3.787	0508	0	1515	4.019

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	107	0522	25	0529	6	0536		0543	31	0550	3.292	0557	0	0564	3.323	0571	10.120	0578	9.566	0584	32,84
De 1 a 3 meses	0516	2	0523	1	0530	1	0537		0544	2	0551	66	0558	0	0565	68	0572	157	0579	157	0585	43,18
De 3 a 6 meses	0517		0524		0531		0538		0545		0552		0559		0566		0573		0580		0586	
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	3	0532	0	0539	0	0546	4	0553	47	0560		0567	51	0574	123	0581		0587	41,53
De 9 a 12 meses	0519	1	0526	1	0533	0	0540	0	0547	2	0554	27	0561		0568	29	0575	56	0582	56	0588	51,62
Más de 12 meses	0520	8	0527	133	0534	4	0541	56	0548	194	0555	355	0562		0569	549	0576	715	0583	574	0589	76,75
Total	0521	119	0528	165	0535	11	0542	57	0549	232	0556	3.787	0563	0	0570	4.019	0577	11.170			0590	35,98

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.A | A08663619 CAIXABANK, S.A. | 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 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 29/06/2004	
Inferior a 1 año	0600	30	1600	39	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	69	1601	85	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	159	1602	72	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	349	1603	464	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	277	1604	257	2604	62
Entre 5 y 10 años	0605	3.488	1605	3.435	2605	1.990
Superior a 10 años	0606	4.715	1606	5.122	2606	123.448
Total	0607	9.086	1607	9.473	2607	125.500
Vida residual media ponderada (años)	0608	10,48	1608	10,65	2608	23,51

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 29/06/2004	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	17,46	1609	17,23	2609	2,69

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.A | A08663619 CAIXABANK, S.A. | 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 31/03/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 29/06/2004			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	209	0630	4.452	1620	208	1630	4.288	2620	87	2630	3.597
40% - 60%	0621	86	0631	3.641	1621	93	1631	3.992	2621	139	2631	7.367
60% - 80%	0622	18	0632	993	1622	21	1632	1.134	2622	436	2632	28.424
80% - 100%	0623		0633		1623	1	1633	59	2623	1.104	2633	86.112
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	313	0638	9.086	1628	323	1638	9.473	2628	1.766	2638	125.500
Media ponderada (%)	0639	41,07	0649		1639	41,77	1649		2639	82,29	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.A | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 29/06/2004	
Tipo de interés medio ponderado	0650	1,91	1650	1,81	2650	4,03
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,25	1651	4,25	2651	8
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,23	1652	0,23	2652	2,24

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.A | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/03/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 29/06/2004			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	182	0683	4.770	1660	189	1683	4.996	2660	1.282	2683	85.326
Aragón	0661	1	0684	132	1661	1	1684	135	2661	3	2684	633
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	4	0689	249	1666	4	1689	252	2666	8	2689	945
Castilla La Mancha	0667		0690		1667		1690		2667	23	2690	2.236
Cataluña	0668	89	0691	2.689	1668	90	1691	2.785	2668	313	2691	21.128
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	1	2692	56
Extremadura	0670	3	0693	66	1670	3	1693	68	2670	34	2693	2.661
Galicia	0671		0694		1671		1694		2671	0	2694	0
Madrid	0672	3	0695	107	1672	3	1695	110	2672	26	2695	3.049
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	1	2696	23
Murcia	0674		0697		1674		1697		2674	0	2697	0
Navarra	0675		0698		1675		1698		2675	1	2698	473
La Rioja	0676	29	0699	1.048	1676	31	1699	1.099	2676	68	2699	8.186
Comunidad Valenciana	0677		0700		1677		1700		2677	0	2700	0
País Vasco	0678	2	0701	25	1678	2	1701	28	2678	6	2701	784
Total España	0679	313	0702	9.086	1679	323	1702	9.473	2679	1.766	2702	125.500
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	313	0705	9.086	1682	323	1705	9.473	2682	1.766	2705	125.500

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH
Denominación del compartimento: 200900037
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2019
Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.A A08663619 CAIXABANK, S.A. A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/03/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 29/06/2004			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	10,32			1710	10,01			2710	2,29		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2019			Situación cierre anual anterior 31/12/2018			Situación inicial 29/06/2004					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0370151021	CH1	1.128	0	0	1.128	0	0	1.128	100.000	112.800			
ES0370151039	CH2	127	68.721	8.728	127	71.000	9.017	127	100.000	12.700			
Total		0723	1.255	0724	8.728	1723	1.255	1724	9.017	2723	1.255	2724	125.500

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH
Denominación del compartimento: 200900037
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/03/2019
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	0737					
ES0370151021	CH1	NS	EURIBOR 3 MESES	0,18	0	0	0	0	SI	0	0	0	0	0		
ES0370151039	CH2	S	EURIBOR 3 MESES	0,95	0,64	2	0	0	SI	8.728	0	0	8.729			
Total						0740	2	0741		0743	8.728	0744		0745	8.729	0746

	Situación actual 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 29/06/2004	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,64	0748	0,63	0749	1,12

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH
Denominación del compartimento: 200900037
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/03/2019
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2019								Situación periodo comparativo anterior 31/03/2018							
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								
ES0370151021	CH1		112.800		12.051		112.800		12.051		112.800		12.051		12.051		
ES0370151039	CH2	289	3.972	14	4.232	379	2.515	15	4.171								
Total		0754	289	0755	116.772	0756	14	0757	16.283	1754	379	1755	115.315	1756	15	1757	16.222

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2019

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 31/03/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 29/06/2004
				0762	0763	0764
ES0370151021	CH1	19/08/2014	FCH	AA+	AA+	AAA
ES0370151021	CH1	23/01/2015	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0370151039	CH2	14/07/2016	FCH	A-	A-	BBB
ES0370151039	CH2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Baa1

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2019

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 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 29/06/2004	
Inferior a 1 año	0765	8.728	1765	9.017	2765	
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769	
Entre 5 y 10 años	0770		1770		2770	112.800
Superior a 10 años	0771		1771		2771	12.700
Total	0772	8.728	1772	9.017	2772	125.500
Vida residual media ponderada (años)	0773	0	1773	0	2773	9,23

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 29/06/2004	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	2.963	1775	2.954	2775	3.263
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	2.975	1776	2.975	2776	3.263
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	33,95	1777	32,76	2777	2
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	0	1792	0	2792	89,89
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 Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

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 31/03/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 29/06/2004	
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806

AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Permuta 4	J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA	Trimestral	El Factor de Cálculo CH 2 será, en cada Fecha de Referencia, la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial de los préstamos cubiertos por el Contrato de Swap CH 2 que resetean en cada uno de los meses del año. TIPO FLOOR es la diferencia, en caso de ser positiva, entre el tipo de interés mínimo deducido el margen y la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial del citado grupo de préstamos que resetean en cada uno de los meses del año."	El Importe Nocial del Contrato de Swap CH 2 Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones Hipotecarias cuyos Préstamos Hipotecarios subyacentes estén sometidos a revisión anual de sus tipos de interés. NOCIONAL FLOOR es el saldo vivo del grupo de préstamos con el mismo mínimo de tipo de interés	Tipo de Interés de Referencia de los Bonos establecido para cada Fecha de Pago, tal y como se define en el apartado II.10.1 del presente Folleto, más un spread de 0,20%. TIPO CAP es la diferencia, en caso de ser positiva, entre la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial del citado grupo de préstamos que resetean en cada uno de los meses del año y el tipo de interés máximo deducido el margen y minorado un 1%.	El Importe Nocial del Contrato de Swap CH 2 Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones Hipotecarias cuyos Préstamos Hipotecarios subyacentes estén sometidos a revisión Semestral de sus tipos de interés. NOCIONAL CAP sera el saldo vivo del grupo de préstamos con el mismo máximo de tipo de interés	-1	-1	-1.369	
-----------	--	------------	--	--	--	--	----	----	--------	--

AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Permuta 3	J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA	Trimestral	El Factor de Cálculo CH 1 será, en cada Fecha de Referencia, la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial de los préstamos cubiertos por el Contrato de Swap CH 1 que resetean en cada uno de los meses del año. TIPO FLOOR es la diferencia, en caso de ser positiva, entre el tipo de interés mínimo deducido el margen y la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial del citado grupo de préstamos que resetean en cada uno de los meses del año.	El Importe Nocial del Contrato de Swap CH 1 Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones Hipotecarias cuyos Préstamos Hipotecarios subyacentes estén sometidos a revisión anual de sus tipos de interés. NOCIONAL FLOOR es el saldo vivo del grupo de préstamos con el mismo mínimo de tipo de interés	Tipo de Interés de Referencia de los Bonos establecido para cada Fecha de Pago, tal y como se define en el apartado II.10.1 del presente Folleto, más un spread de 0,20%. TIPO CAP es la diferencia, en caso de ser positiva, entre la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial del citado grupo de préstamos que resetean en cada uno de los meses del año y el tipo de interés máximo deducido el margen y minorado un 1%.	El Importe Nocial del Contrato de Swap CH 1 Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones Hipotecarias cuyos Préstamos Hipotecarios subyacentes estén sometidos a revisión anual de sus tipos de interés. NOCIONAL CAP sera el saldo vivo del grupo de préstamos con el mismo máximo de tipo de interés	-49	-51	-3.117	
-----------	---	------------	---	--	--	--	-----	-----	--------	--

AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Permuta 6	J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA	Trimestral			En caso de que el Tipo Índice (IRPH) sea menor que el tipo Euribor a un (1) año más cuarenta (40) puntos básicos (0,40%), la Entidad de Contrapartida abona al Fondo, en cada Fecha de Pago, la diferencia. En caso de que el Tipo Índice de un mes sea igual o superior al Euribor a un (1) año más cuarenta (40) puntos básicos (0,40%), no se devengará cantidad alguna a favor del Fondo. deducido el margen y minorado un 1%.	Saldo nominal de los Préstamos referenciados al Tipo Índice, se entenderá por Tipo Índice el IRPH publicado mensualmente por el Banco de España en su página web www.bde.es/tipos/tipos.htm .	-40	-41	-2.859			
Total							0808	-89	0809	-92	0810	-7.345

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

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 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 29/06/2004		Situación actual 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 29/06/2004			
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 Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

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 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación actual 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	199	7006	217	7009	6,24	7012	6,62	7015	6,75		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	199	7008	217	7011	6,24	7014	6,62	7017	198.915	7018	FOLLETO INFORMATIVO. CAPÍTULO V. APARTAD O V.3.4.b)
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	194	7024	212	7027	5,38	7030	5,78	7033	5,90		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	194	7026	212	7029	5,38	7032	5,78	7035	5,90	7036	FOLLETO INFORMATIVO. CAPÍTULO II. APARTAD O II.3.2.1 (b)

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

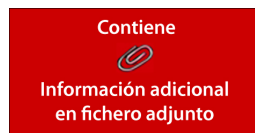
CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
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	1	6,60	7,17	FOLLETO INFORMATIVO. CAPÍTULO V. APARTADO V.3.4.b)
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



S.05.5

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

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	8	2862	Días del mes /Base 365	3862	0	4862	0	5862	0	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	CajaSol - El Monte	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	0	2864	Días del mes /Base 365	3864	0	4864	0	5864	0	6864	Trimestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH
Denominación del compartimento: 200900037
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2019

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	Banco Mare Nostrum , Bankia , Kutxabank , Caixabank
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	IV.1

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 Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

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	20/03/2019											
Saldo inicial	0886	2.954											
Cobros del periodo	0887	334											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-3											
Pagos por derivados	0889	-19											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-2.963											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-304											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0											
Resto pagos/retenciones	0893	0											
Saldo disponible	0894	0											
Liquidación de comisión variable	0895	0											

S.06

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

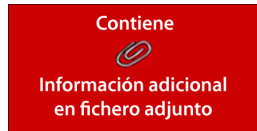
Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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