

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:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2016

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)

Derivado del proceso de Auditoría se han efectuado modificaciones en los Estados por reclasificaciones, sin que afecte a resultados

Estado S03 , reclasificación entre capitales cobrados por amortización anticipada y amortizaciones ordinarias, entre celdas 2326 a 2327
Estado S03, reclasificación entre celdas 2301 y 2321, en los cobros de los intereses de los activos titulizados

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: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	13.130	1001	19.724
I. Activos financieros a largo plazo	0002	13.130	1002	19.724
1. Activos titulizados	0003	13.130	1003	19.724
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	12.894	1005	19.465
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	0
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	800	1025	684
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-563	1027	-425
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	0
2. Derivados	0029		1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	0
3. Otros activos financieros	0032		1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	0
3.4 Otros	0036		1036	0
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	0
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	0

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: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	7.751	1041	6.785
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	4.641	1043	3.591
1. Activos titulizados	0044	4.641	1044	3.508
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	4.604	1046	3.462
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	0
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	0
1.20 Otros	0064		1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	12	1065	19
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	3	1066	5
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	67	1067	50
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	7	1068	7
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-52	1069	-35
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	0
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	83
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	0
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	83
3.4 Garantías financieras	0078		1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	0
VI. Ajustes por periodificaciones	0082		1082	0
1. Comisiones	0083		1083	0
2. Otros	0084		1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	3.110	1085	3.194
1. Tesorería	0086	3.110	1086	3.194
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	20.881	1088	26.509

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: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	17.533	1089	25.755
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	17.533	1094	25.755
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	13.160	1095	19.755
1.1 Series no subordinadas	0096	460	1096	7.055
1.2 Series subordinadas	0097	12.700	1097	12.700
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	2.763	1101	2.855
2.1 Préstamo subordinado	0102	2.975	1102	2.975
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-212	1105	-120
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	0
3. Derivados	0108	1.609	1108	3.145
3.1 Derivados de cobertura	0109	1.609	1109	3.145
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	0
4.1 Garantías financieras	0113		1113	
4.1 Otros	0114		1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	0

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: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) PASIVO CORRIENTE	0117	4.958	1117	3.899
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	0
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	4.953	1123	3.898
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	4.893	1124	3.857
1.1 Series no subordinadas	0125	4.891	1125	3.854
1.2 Series subordinadas	0126		1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	3	1128	3
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	48	1131	27
2.1 Préstamo subordinado	0132		1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	1	1136	1
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	48	1137	26
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	0
3. Derivados	0139	10	1139	13
3.1 Derivados de cobertura	0140	10	1140	13
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	1	1143	1
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	1	1144	1
4.2 Garantías financieras	0145		1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	5	1148	1
1. Comisiones	0149	0	1149	0
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	0	1150	0
1.2 Comisión administrador	0151	5	1151	3
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	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-69	1155	-67
1.7 Otras comisiones	0156		1156	0
2. Otros	0157	5	1157	1
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-1.609	1158	-3.145
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-1.609	1160	-3.145
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	0
TOTAL PASIVO	0162	20.881	1162	26.509

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: 31/12/2016

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	108	1201		2201	563	3201	826
1.1 Activos titulizados	0202	108	1202		2202	563	3202	826
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203		2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-26	1204		2204	-115	3204	-177
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-21	1205		2205	-93	3205	-148
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-5	1206		2206	-22	3206	-29
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207		2207		3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-77	1208		2208	-366	3208	-532
A) MARGEN DE INTERESES	0209	5	1209		2209	82	3209	117
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210		2210		3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211		2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212		2212		3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213		2213		3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214		2214		3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215		2215		3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216		2216		3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-9	1217		2217	-21	3217	-50
7.1 Servicios exteriores	0218	-5	1218		2218	-8	3218	-8
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219		2219	-1	3219	-2
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220		2220		3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221		2221		3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	-5	1222		2222	-7	3222	-6
7.2 Tributos	0223	0	1223		2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-3	1224		2224	-12	3224	-42
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-3	1225		2225	-10	3225	-10
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226		2226	-2	3226	-2
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227		2227	0	3227	-1
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228		2228		3228	-29
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229		2229		3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230		2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-55	1231		2231	-155	3231	-250
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-55	1232		2232	-155	3232	-250
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233		2233		3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235		2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236		2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237		2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238		2238		3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	59	1239		2239	94	3239	183
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240		2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241		2241		3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242		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: 31/12/2016

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	23	1300		2300	178	3300	2
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	28	1301		2301	-52	3301	58
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	126	1302		2302	414	3302	746
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-21	1303		2303	-94	3303	-149
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304		2304	-1	3304	56
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-77	1305		2305	-370	3305	-591
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306		2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307		2307		3307	-4
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308		2308		3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-3	1309		2309	-10	3309	-49
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-3	1310		2310	-10	3310	-10
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311		2311		3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312		2312	0	3312	-1
2.4 Comisión variable	0313	0	1313		2313		3313	-38
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314		2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-2	1315		2315	240	3315	-7
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316		2316		3316	
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317		2317		3317	
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318		2318		3318	
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319		2319		3319	
3.5 Otros pagos de explotación	0320	-2.866	1320		2320	-2.624	3320	-7
3.6 Otros cobros de explotación	0321	2.864	1321		2321	2.864	3321	
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	51	1322		2322	-262	3322	-75
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323		2323		3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324		2324		3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	51	1325		2325	-262	3325	-75
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	294	1326		2326	1.231	3326	3.229
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	451	1327		2327	3.589	3327	
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	114	1328		2328	477	3328	
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329		2329		3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330		2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-807	1331		2331	-5.559	3331	-3.304
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332		2332		3332	0
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333		2333		3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334		2334		3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335		2335		3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336		2336		3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	74	1337		2337	-84	3337	-73
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	3.036	1338		2338	3.194	3338	3.267
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	3.110	1339		2339	3.110	3339	3.194

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: 31/12/2016

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350		2350		3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351		2351		3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352		2352		3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353		2353		3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354		2354		3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0355	0	1355		2355		3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356		2356		3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	2.734	1357		2357	1.169	3357	194
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	2.734	1358		2358	1.169	3358	194
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359		2359		3359	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	77	1360		2360	366	3360	532
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361		2361		3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-2.812	1362		2362	-1.536	3362	-726
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363		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	0	1364		2364		3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365		2365		3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366		2366		3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367		2367		3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368		2368		3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369		2369		3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370		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: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.AA08663619 CAIXABANK, S.A.A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2016								Situación cierre anual anterior 31/12/2015								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	4,72	0401	0	0421	0	0441	16,35	1381	3,10	1401	0	1421	0	1441	5,27	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: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.AA08663619 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	30	0467	7	0474	2	0481		0488	9	0495	989	0502	0	0509	998
De 1 a 3 meses	0461	5	0468	2	0475	1	0482		0489	3	0496	164	0503	0	0510	167
De 3 a 6 meses	0462	2	0469	2	0476	0	0483	0	0490	2	0497	61	0504		0511	63
De 6 a 9 meses	0463		0470		0477		0484		0491		0498		0505		0512	
De 9 a 12 meses	0464	1	0471	9	0478	0	0485	1	0492	10	0499	116	0506		0513	125
Más de 12 meses	0465	12	0472	57	0479	6	0486	35	0493	98	0500	623	0507		0514	721
Total	0466	50	0473	76	0480	10	0487	36	0494	122	0501	1.953	0508	0	1515	2.074

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	30	0522	7	0529	2	0536		0543	9	0550	989	0557	0	0564	998	0571	2.641	0578	38.733	0584	37,80
De 1 a 3 meses	0516	5	0523	2	0530	1	0537		0544	3	0551	164	0558	0	0565	167	0572	376	0579	376	0585	44,35
De 3 a 6 meses	0517	2	0524	2	0531	0	0538	0	0545	2	0552	61	0559		0566	63	0573	212	0580	90	0586	29,78
De 6 a 9 meses	0518		0525		0532		0539		0546		0553		0560		0567		0574		0581		0587	
De 9 a 12 meses	0519	1	0526	9	0533	0	0540	1	0547	10	0554	116	0561		0568	125	0575	288	0582	288	0588	43,52
Más de 12 meses	0520	12	0527	57	0534	6	0541	35	0548	98	0555	623	0562		0569	721	0576	977	0583	836	0589	73,75
Total	0521	50	0528	76	0535	10	0542	36	0549	122	0556	1.953	0563	0	0570	2.074	0577	4.494			0590	46,16

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: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.AA08663619 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 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 29/06/2004	
Inferior a 1 año	0600	47	1600	22	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	136	1601	144	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	201	1602	255	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	354	1603		2603	
Entre 4 y 5 años	0604	191	1604	842	2604	62
Entre 5 y 10 años	0605	3.196	1605	3.598	2605	1.990
Superior a 10 años	0606	14.239	1606	18.800	2606	123.448
Total	0607	18.365	1607	23.661	2607	125.500
Vida residual media ponderada (años)	0608	12,33	1608	13,17	2608	23,51

Antigüedad	Situación actual 31/12/2016					
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 29/06/2004	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	15,14	1609	14,06	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: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.AA08663619 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 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				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	216	0630	4.499	1620	213	1630	4.712	2620	87	2630	3.597
40% - 60%	0621	195	0631	8.163	1621	228	1631	9.953	2621	139	2631	7.367
60% - 80%	0622	104	0632	5.644	1622	156	1632	8.937	2622	436	2632	28.424
80% - 100%	0623	1	0633	59	1623	1	1633	59	2623	1.104	2633	86.112
100% - 120%	0624		0634		1624	0	1634	0	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625		0635		1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	516	0638	18.365	1628	598	1638	23.661	2628	1.766	2638	125.500
Media ponderada (%)			0639	49,36			1639	52,91			2639	82,29

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: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.AA08663619 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 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 29/06/2004	
Tipo de interés medio ponderado	0650	2,06	1650	3,37	2650	4,03
Tipo de interés nominal máximo	0651	5	1651	5	2651	8
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,37	1652	0,58	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: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.AA08663619 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 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				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	340	0683	11.373	1660	412	1683	15.585	2660	1.282	2683	85.326
Aragón	0661	1	0684	167	1661	1	1684	183	2661	3	2684	633
Asturias	0662		0685		1662	0	1685	0	2662	0	2685	0
Baleares	0663		0686		1663	0	1686	0	2663	0	2686	0
Canarias	0664		0687		1664	0	1687	0	2664	0	2687	0
Cantabria	0665		0688		1665	0	1688	0	2665	0	2688	0
Castilla-León	0666	4	0689	288	1666	4	1689	304	2666	8	2689	945
Castilla La Mancha	0667	6	0690	215	1667	7	1690	283	2667	23	2690	2.236
Cataluña	0668	113	0691	4.099	1668	117	1691	4.629	2668	313	2691	21.128
Ceuta	0669		0692		1669	0	1692	0	2669	1	2692	56
Extremadura	0670	10	0693	395	1670	11	1693	495	2670	34	2693	2.661
Galicia	0671		0694		1671	0	1694	0	2671	0	2694	0
Madrid	0672	4	0695	219	1672	5	1695	270	2672	26	2695	3.049
Melilla	0673		0696		1673	0	1696	0	2673	1	2696	23
Murcia	0674		0697		1674	0	1697	0	2674	0	2697	0
Navarra	0675		0698		1675	0	1698	0	2675	1	2698	473
La Rioja	0676	35	0699	1.543	1676	38	1699	1.818	2676	68	2699	8.186
Comunidad Valenciana	0677		0700		1677	0	1700	0	2677	0	2700	0
País Vasco	0678	3	0701	65	1678	3	1701	94	2678	6	2701	784
Total España	0679	516	0702	18.365	1679	598	1702	23.661	2679	1.766	2702	125.500
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	516	0705	18.365	1682	598	1705	23.661	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: 31/12/2016
Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.AA08663619 CAIXABANK, S.A.A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 29/06/2004			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	7,03			1710	5,94			2710	2,29		
Sector	0711		0712		1711	0	1712	0	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: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2016			Situación cierre anual anterior 31/12/2015			Situación inicial 29/06/2004					
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			
ES0370151021	CH1	1.128	4.744	5.351	1.128	10.000	10.910	1.128	100.000	112.800			
ES0370151039	CH2	127	100.000	12.700	127	100.000	12.700	127	100.000	12.700			
Total		0723	1.255	0724	18.051	1723	1.255	1724	23.610	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: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos:

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
ES0370151021	CH1	NS	EURIBOR 3 MESES	0,18	0	0	0	0	SI	5.351	0	0	0	5.351		
ES0370151039	CH2	S	EURIBOR 3 MESES	0,95	0,65	3	0	0	SI	12.700	0	0	0	12.703		
Total						0740	3	0741	0	0743	18.051	0744	0	0745	18.053	0746

	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 29/06/2004	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,46	0748	0,60	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: 31/12/2016
Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2016								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2015							
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	807	107.449	0	12.051	3.304	101.889	26	12.050								
ES0370151039	CH2	0	0	21	4.077	0	0	124	3.985								
Total		0754	807	0755	107.449	0756	21	0757	16.128	1754	3.304	1755	101.889	1756	150	1757	16.035

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: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	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	30/06/2004	MDY	Baa1	A3	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: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente				
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 29/06/2004
Inferior a 1 año	0765		1765		2765
Entre 1 y 2 años	0766	5.351	1766	10.910	2766
Entre 2 y 3 años	0767	12.700	1767		2767
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769	12.700	2769
Entre 5 y 10 años	0770		1770		2770
Superior a 10 años	0771		1771		2771
Total	0772	18.051	1772	23.610	2772
Vida residual media ponderada (años)	0773	1,88	1773	3,18	2773
					112.800
					12.700
					125.500
					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: 31/12/2016

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 29/06/2004	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	2.975	1775	2.975	2775	3.263
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	2.835	1776	2.849	2776	3.263
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	16,48	1777	12	2777	2
1.3 Denominación de la contrapartida	0778		1778		2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781		2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782		2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784		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		2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787		2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788		1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790		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	29,64	1792	46,21	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: 31/12/2016

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características
Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 29/06/2004	
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806

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	-631	-1.099	-3.117	
-----------	---	------------	---	--	--	--	------	--------	--------	--

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	298	-719	-1.369	
-----------	--	------------	--	--	--	--	-----	------	--------	--

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 .	-690	-1.340	-2.859			
Total							0808	-1.023	0809	-3.158	0810	-7.345

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: 31/12/2016

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)			Valor en libros (miles de euros)			Otras características	
	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 29/06/2004	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	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: 31/12/2016

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Última Fecha Pago							
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	110	7006	85	7009	4,88	7012	3,10	7015	4,68		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013	0	7016			
Total Morosos					7005	110	7008	85	7011	4,88	7014	3,10	7017	4,68	7018	FOLLETO INFORMA TIVO. CAPÍTULO V. APARTAD O V.3.4.b)
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020		7021	94	7024	66	7027	3,43	7030	1,93	7033	2,86		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025		7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	94	7026	66	7029	3,43	7032	1,93	7035	2,86	7036	FOLLETO INFORMA TIVO. CAPÍTULO II. APARTAD O II.3.2.1 (b)

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Última Fecha Pago		
	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: 31/12/2016

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	5,04	4,88	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: 31/12/2016

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	1862	0	2862	Días del mes /Base 365	3862	0	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	0,002	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: 31/12/2016

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	
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: 31/12/2016

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total		
		21/03/2016	20/06/2016	20/09/2016	20/12/2016									
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885													
Saldo inicial	0886	2.849	2.743	2.745	2.806									
Cobros del periodo	0887	2.243	1.553	1.289	931									
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-4	-4	-3	-3									
Pagos por derivados	0889	-120	-91	-81	-72									
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-2.743	-2.745	-2.806	-2.835									
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-2.225	-1.456	-1.144	-828									
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0	0									
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0	0									
Saldo disponible	0894	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Liquidación de comisión variable	0895	0	5.849	0	0									5.849

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: 31/12/2016

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