

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT CAJAMURCIA HIPOTECARIO II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8549
NIF Fondo: V84875947
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2018

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

S.01

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	48.562	1001	55.448
I. Activos financieros a largo plazo	0002	48.562	1002	55.448
1. Activos titulizados	0003	48.562	1003	55.448
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	39.258	1004	45.410
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	9.074	1005	9.914
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	863	1025	764
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-633	1027	-640
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	

S.01

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	14.966	1041	16.874
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	7.280	1043	8.341
1. Activos titulizados	0044	7.274	1044	8.208
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	6.427	1045	7.366
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	757	1046	789
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	33	1065	43
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	0	1066	0
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	209	1067	56
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	3	1068	3
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-156	1069	-49
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	6	1074	132
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	6	1077	132
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	7.686	1085	8.533
1. Tesorería	0086	7.686	1086	8.533
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	63.528	1088	72.322

S.01

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	53.300	1089	60.790
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	53.300	1094	60.790
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	47.909	1095	54.834
1.1 Series no subordinadas	0096	44.292	1096	49.375
1.2 Series subordinadas	0097	3.617	1097	5.459
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101	1.575	1101	1.575
2.1 Préstamo subordinado	0102	1.575	1102	1.575
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105		1105	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	257	1108	389
3.1 Derivados de cobertura	0109	257	1109	389
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	3.558	1112	3.992
4.1 Garantías financieras	0113	3.558	1113	3.992
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

S.01

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) PASIVO CORRIENTE	0117	10.485	1117	11.921
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	10.378	1123	11.616
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	10.352	1124	11.565
1.1 Series no subordinadas	0125	9.566	1125	11.564
1.2 Series subordinadas	0126	785	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	1	1128	1
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	2	1131	8
2.1 Préstamo subordinado	0132		1132	
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	2	1136	2
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	5
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	23	1139	42
3.1 Derivados de cobertura	0140	23	1140	42
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	1
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	1
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	108	1148	305
1. Comisiones	0149	92	1149	275
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	8	1150	8
1.2 Comisión administrador	0151	1	1151	5
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	1152	2
1.4 Comisión variable	0153	137	1153	259
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-57	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	16	1157	30
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-257	1158	-389
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-257	1160	-389
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	63.528	1162	72.322

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2018		Acumulado anterior 30/09/2017
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	108	1201	153	2201	224	3201	490
1.1 Activos titulizados	0202	108	1202	153	2202	224	3202	490
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203		3203	
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-4	1204	-4	2204	-11	3204	-11
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1	1205	-1	2205	-3	3205	-3
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-3	1206	-3	2206	-8	3206	-8
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-23	1208	-50	2208	-90	3208	-163
A) MARGEN DE INTERESES	0209	81	1209	99	2209	123	3209	316
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216	0	3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-15	1217	-28	2217	-81	3217	-117
7.1 Servicios exteriores	0218	-1	1218	0	2218	-4	3218	-2
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	0	2219	-3	3219	-1
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	-1	1222	0	2222	-1	3222	-1
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-13	1224	-28	2224	-77	3224	-114
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-9	1225	-9	2225	-27	3225	-27
7.3.2 Comisión administrador	0226	-1	1226	-2	2226	-5	3226	-5
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-3	1227	-3	2227	-7	3227	-7
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	-15	2228	-37	3228	-74
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-9	1231	63	2231	-99	3231	-199
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-9	1232	63	2232	-99	3232	-199
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233		3233	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234	0	2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238		3238	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-58	1239	-134	2239	57	3239	0
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241		3241	
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

S.03

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2018		Acumulado anterior 30/09/2017
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-94	1300	2	2300	-421	3300	-293
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	76	1301	103	2301	240	3301	315
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	110	1302	159	2302	366	3302	505
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-1	1303	-1	2303	-3	3303	-4
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	27	1304	15	2304	73	3304	-50
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-58	1305	-69	2305	-182	3305	-131
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	-3	1307	0	2307	-13	3307	-5
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-21	1309	-12	2309	-202	3309	-289
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-9	1310	-9	2310	-27	3310	-27
2.2 Comisión administrador	0311	-2	1311	0	2311	-8	3311	-4
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-2	1312	-2	2312	-7	3312	-7
2.4 Comisión variable	0313	-8	1313	0	2313	-159	3313	-251
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-149	1315	-90	2315	-459	3315	-318
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	-8	1320	220	2320	-25	3320	-8
3.6 Otros cobros de explotación	0321	-141	1321	-310	2321	-434	3321	-310
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-145	1322	-391	2322	-426	3322	-513
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	-145	1325	-391	2325	-426	3325	-513
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	0	1326	1.972	2326	1.865	3326	5.886
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	465	1327	632	2327	1.659	3327	1.828
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.984	1328	156	2328	4.187	3328	560
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	-2.595	1331	-3.151	2331	-8.138	3331	-8.786
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	-239	1337	-389	2337	-847	3337	-805
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	7.925	1338	9.157	2338	8.533	3338	9.574
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	7.686	1339	8.768	2339	7.686	3339	8.768

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2018		Acumulado anterior 30/09/2017
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	12	1357	41	2357	42	3357	153
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	12	1358	41	2358	42	3358	153
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	23	1360	50	2360	90	3360	163
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-35	1362	-91	2362	-132	3362	-317
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368		3368	
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369		3369	
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2018								Situación cierre anual anterior 31/12/2017								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380	1,79	0400	0	0420	0	0440	4,65	1380	1,32	1400	0	1420	0	1440	4,32	2380	0,48	2400	0,48	2420	0	2440	0
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	2,38	0401	0	0421	0	0441	2,32	1381	1,06	1401	0	1421	0	1441	2,36	2381	0	2401	0	2421	0	2441	0
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	7	0467	1	0474	0	0481		0488	1	0495	230	0502	0	0509	232
De 1 a 3 meses	0461	1	0468	0	0475	0	0482		0489	0	0496	15	0503	0	0510	15
De 3 a 6 meses	0462	3	0469	4	0476	0	0483	0	0490	5	0497	185	0504		0511	190
De 6 a 9 meses	0463	2	0470	4	0477	0	0484	0	0491	5	0498	72	0505		0512	76
De 9 a 12 meses	0464		0471		0478		0485		0492		0499		0506		0513	
Más de 12 meses	0465	16	0472	200	0479	3	0486	25	0493	228	0500	606	0507		0514	834
Total	0466	29	0473	211	0480	3	0487	25	0494	239	0501	1.108	0508	0	1515	1.347

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	7	0522	1	0529	0	0536		0543	1	0550	230	0557	0	0564	232	0571	968	0578	968	0584	23,93
De 1 a 3 meses	0516	1	0523	0	0530	0	0537		0544	0	0551	15	0558	0	0565	15	0572	54	0579	54	0585	27,84
De 3 a 6 meses	0517	3	0524	4	0531	0	0538	0	0545	5	0552	185	0559		0566	190	0573	399	0580	399	0586	47,66
De 6 a 9 meses	0518	2	0525	4	0532	0	0539	0	0546	5	0553	72	0560		0567	76	0574	276	0581	276	0587	27,59
De 9 a 12 meses	0519		0526		0533		0540		0547		0554		0561		0568		0575		0582		0588	
Más de 12 meses	0520	16	0527	200	0534	3	0541	25	0548	228	0555	606	0562		0569	834	0576	1.887	0583	1.887	0589	44,21
Total	0521	29	0528	211	0535	3	0542	25	0549	239	0556	1.108	0563	0	0570	1.347	0577	3.585			0590	37,59

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 31/10/2006	
Inferior a 1 año	0600	657	1600	616	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	232	1601	1.468	2601	64
Entre 2 y 3 años	0602	356	1602	393	2602	135
Entre 3 y 4 años	0603	541	1603	594	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	2.286	1604	744	2604	813
Entre 5 y 10 años	0605	18.880	1605	20.637	2605	14.810
Superior a 10 años	0606	33.636	1606	39.847	2606	299.178
Total	0607	56.588	1607	64.300	2607	315.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	9,72	1608	10,10	2608	18,81

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 31/10/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	14,44	1609	13,71	2609	2,65

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 31/10/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.443	0630	42.690	1620	1.409	1630	41.928	2620	769	2630	38.330
40% - 60%	0621	175	0631	11.777	1621	303	1631	19.021	2621	1.105	2631	86.361
60% - 80%	0622	25	0632	2.122	1622	37	1632	3.350	2622	1.778	2632	155.049
80% - 100%	0623		0633		1623		1633		2623	304	2633	35.260
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624	0	2634	0
120% - 140%	0625		0635		1625		1635		2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627	0	2637	0
Total	0628	1.643	0638	56.588	1628	1.749	1638	64.300	2628	3.956	2638	315.000
Media ponderada (%)	0639	33,11	0649		1639	34,50	1649		2639	61,85	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 31/10/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,75	1650	0,85	2650	3,98
Tipo de interés nominal máximo	0651	3,50	1651	3,75	2651	5,75
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,10	1652	0,33	2652	2,22

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 31/10/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	117	0683	4.514	1660	123	1683	4.985	2660	289	2683	25.632
Aragón	0661		0684		1661		1684		2661	0	2684	0
Asturias	0662		0685		1662		1685		2662	0	2685	0
Baleares	0663		0686		1663		1686		2663	0	2686	0
Canarias	0664		0687		1664		1687		2664	0	2687	0
Cantabria	0665		0688		1665		1688		2665	0	2688	0
Castilla-León	0666		0689		1666		1689		2666	0	2689	0
Castilla La Mancha	0667		0690		1667		1690		2667	159	2690	11.586
Cataluña	0668		0691		1668		1691		2668	0	2691	0
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	0
Extremadura	0670		0693		1670		1693		2670	0	2693	0
Galicia	0671		0694		1671		1694		2671	0	2694	0
Madrid	0672		0695		1672		1695		2672	5	2695	455
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	1.032	0697	35.820	1674	1.090	1697	40.462	2674	2.162	2697	171.600
Navarra	0675		0698		1675		1698		2675	0	2698	0
La Rioja	0676		0699		1676		1699		2676	0	2699	0
Comunidad Valenciana	0677	494	0700	16.254	1677	536	1700	18.852	2677	1.341	2700	105.727
País Vasco	0678		0701		1678		1701		2678	0	2701	0
Total España	0679	1.643	0702	56.588	1679	1.749	1702	64.300	2679	3.956	2702	315.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	1.643	0705	56.588	1682	1.749	1705	64.300	2682	3.956	2705	315.000

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 31/10/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	3,24			1710	3,05			2710	1,13		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2018			Situación cierre anual anterior 31/12/2017			Situación inicial 31/10/2006					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0312272000	A	3.031	17.769	53.859	3.031	20.105	60.939	3.031	100.000	303.100			
ES0312272018	B	81	36.991	2.996	81	45.872	3.716	81	100.000	8.100			
ES0312272026	C	38	36.991	1.406	38	45.872	1.743	38	100.000	3.800			
Total		0723	3.150	0724	58.261	1723	3.150	1724	66.398	2723	3.150	2724	315.000

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas	
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados		Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas	
						0730	0731			0732	0733	0734	0735			0742
ES0312272000	A	NS	EURIBOR 3 MESES	0,14	0	0	0	0	SI	53.859	0	0	0	53.859		
ES0312272018	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,33	0	0	0	0	SI	2.996	0	0	0	2.996		
ES0312272026	C	S	EURIBOR 3 MESES	0,56	0,23	1	0	0	SI	1.406	0	0	0	1.406		
Total						0740	1	0741		0743	58.261	0744		0745	58.261	0746

	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 31/10/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,01	0748	0,01	0749	3,83

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2018
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2018								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2017							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0312272018	B	133	5.104	0	1.407	0	4.384	0	1.407	0	4.384	0	1.407	0	4.384	0	1.407
ES0312272000	A	2.399	249.241	0	36.040	3.151	239.462	0	36.040	3.151	239.462	0	36.040	3.151	239.462	0	36.040
ES0312272026	C	63	2.394	1	744	0	2.057	1	744	0	2.057	1	744	0	2.057	1	744
Total		0754	2.595	0755	256.739	0756	1	0757	38.191	1754	3.151	1755	245.903	1756	1	1757	38.187

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/09/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 31/10/2006
				0762	0763	0764
ES0312272000	A	15/02/2017	FCH	A+	AA-	AAA
ES0312272000	A	20/03/2018	SYP	AA-	A	AAA
ES0312272018	B	15/02/2017	FCH	BBB+	A+	A+
ES0312272018	B	25/07/2018	SYP	BBB	BB+	A
ES0312272026	C	12/02/2018	FCH	BBB-	BB+	BBB
ES0312272026	C	28/11/2014	SYP	B-	B-	BBB

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente				
	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 31/10/2006
Inferior a 1 año	0765		1765		2765
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766
Entre 2 y 3 años	0767	58.261	1767		2767
Entre 3 y 4 años	0768		1768	60.939	2768
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769
Entre 5 y 10 años	0770		1770	5.459	2770
Superior a 10 años	0771		1771		2771
Total	0772	58.261	1772	66.398	2772
Vida residual media ponderada (años)	0773	2,98	1773	3,49	2773
					315.000
					6,09

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 31/10/2006	
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	1.575	1775	1.567	2775	1.922
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	1.575	1776	1.575	2776	1.922
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	2,70	1777	2,36	2777	0
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	92,44	1792	91,78	2792	96,22
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características
Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/09/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 31/10/2006	
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806

AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Permuta 1	CECABANK S.A	TRIMESTRAL	El producto, en función de los días efectivamente transcurridos y en base 360, del Importe Nocial del Contrato de Swap definido anteriormente , por el Factor de Cálculo para el Swap. El Factor de Cálculo para el Swap será la media de los EURIBOR 12 meses obtenidos en doce meses precedentes al inicio del Período de Cálculo, aplicando las ponderaciones que se indican en el Contrato de Swap.El producto, en función de los días efectivamente transcurridos y en base 360, del Importe Nocial del Contrato de Swap definido anteriormente , por el Factor de Cálculo para el Swap. El Factor de Cálculo para el Swap será la media de los EURIBOR 12 meses obtenidos en doce meses precedentes al inicio del Período de Cálculo, aplicando las ponderaciones que se indican en el	Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de los Préstamos Hipotecarios No Fallidos	Es el resultado de multiplicar el Importe Nocial del Contrato de Swap por el Tipo de Interés de Referencia establecido para cada Fecha de Pago,ajustado por un margen de -0,05% .	Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de los Préstamos Hipotecarios No Fallidos	-280	-431	-6.475	
-----------	--------------	------------	--	--	---	--	------	------	--------	--

AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

			Contrato de Swap.										
Total							0808	-280	0809	-431	0810	-6.475	

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 31/10/2006		Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 31/10/2006			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/09/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación actual 30/09/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Última Fecha Pago							
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	3	7002	0	7003	237	7006	66	7009	1,89	7012	1,28	7015	1,92		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	237	7008	66	7011	1,89	7014	1,28	7017	237.409	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	224	7024	53	7027	1,39	7030	1,07	7033	1,32		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	224	7026	53	7029	1,39	7032	1,07	7035	1,32	7036	FOLLETO INFORMA TIVO. NOTA DE VALORES. APARTAD O 4.9.3

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

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

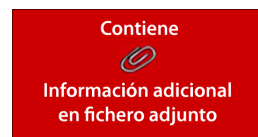
CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
d) el SALDO VIVO DE LOS ACTIVOS NO FALLIDOS CON MÁS DE 90 DÍAS DE IMPAGO sea superior al % establecido para cada ISIN del SALDO VIVO DE ACTIVOS NO FALLIDOS	1,50	0,51	0,61	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.3
d) el SALDO VIVO DE LOS ACTIVOS NO FALLIDOS CON MÁS DE 90 DÍAS DE IMPAGO sea superior al % establecido para cada ISIN del SALDO VIVO DE ACTIVOS NO FALLIDOS	1,50	0,51	0,61	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.3
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
El Saldo acumuladode los Activos Fallidos represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo Inicial a la constitución del Fondo	6,70	0,32	0,32	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.6.1
El Saldo acumuladode los Activos Fallidos represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo Inicial a la constitución del Fondo	4,60	0,32	0,32	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera superior al porcentaje recogido del Saldo Vivo de los Activos que no tengan la consideración de Activos Fallidos	1	0,51	0,61	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.2
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



S.05.5

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

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

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo											Total		
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872														
Margen de intereses	0873														
Deterioro de activos financieros (neto)	0874														
Dotaciones a provisiones (neto)	0875														
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876														
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877														
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878														
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879														
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880														
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881														
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882														
Comisión variable pagada	0883														
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884														

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

S.06

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

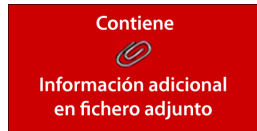
Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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