

**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: 6056  
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.  
NIF Gestora: A80732142  
Fondo Abierto: NO  
Fondo Privado: NO  
Estados agregados: NO  
Fecha: 31/03/2018

**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 Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

| BALANCE (miles de euros)                                |      | Periodo actual<br>31/03/2018 |      | Periodo anterior<br>31/12/2017 |
|---|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>ACTIVO</b>   |      |                              |      |                                |
| <b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>                           | 0001 | 36.393                       | 1001 | 35.710                         |
| <b>I. Activos financieros a largo plazo</b>             | 0002 | 36.393                       | 1002 | 35.710                         |
| 1. Activos titulizados                                  | 0003 | 36.393                       | 1003 | 35.710                         |
| 1.1 Participaciones hipotecarias                        | 0004 | 36.250                       | 1004 | 35.553                         |
| 1.2 Certificados de transmisión hipotecaria             | 0005 |                              | 1005 |                                |
| 1.3 Préstamos hipotecarios                              | 0006 |                              | 1006 |                                |
| 1.4 Cédulas hipotecarias                                | 0007 |                              | 1007 |                                |
| 1.5 Préstamos a promotores                              | 0008 |                              | 1008 |                                |
| 1.6 Préstamos a PYMES                                   | 0009 |                              | 1009 |                                |
| 1.7 Préstamos a empresas                                | 0010 |                              | 1010 |                                |
| 1.8 Préstamos corporativos                              | 0011 |                              | 1011 |                                |
| 1.9 Cédulas territoriales                               | 0012 |                              | 1012 |                                |
| 1.10 Bonos de tesorería                                 | 0013 |                              | 1013 |                                |
| 1.11 Deuda subordinada                                  | 0014 |                              | 1014 |                                |
| 1.12 Créditos AAPP                                      | 0015 |                              | 1015 |                                |
| 1.13 Préstamos consumo                                  | 0016 |                              | 1016 |                                |
| 1.14 Préstamos automoción                               | 0017 |                              | 1017 |                                |
| 1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)       | 0018 |                              | 1018 |                                |
| 1.16 Cuentas a cobrar                                   | 0019 |                              | 1019 |                                |
| 1.17 Derechos de crédito futuros                        | 0020 |                              | 1020 |                                |
| 1.18 Bonos de titulación                                | 0021 |                              | 1021 |                                |
| 1.19 Cédulas internacionalización                       | 0022 |                              | 1022 |                                |
| 1.20 Otros  | 0023 |                              | 1023 |                                |
| 1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos          | 0024 |                              | 1024 |                                |
| 1.22 Activos dudosos -principal-                        | 0025 | 347                          | 1025 | 366                            |
| 1.23 Activos dudosos -intereses y otros-                | 0026 |                              | 1026 |                                |
| 1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-) | 0027 | -205                         | 1027 | -209                           |
| 1.25 Ajustes por operaciones de cobertura               | 0028 |                              | 1028 |                                |
| 2. Derivados  | 0029 |                              | 1029 | 0                              |
| 2.1 Derivados de cobertura                              | 0030 |                              | 1030 | 0                              |
| 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 |                                |
| <b>II. Activos por impuesto diferido</b>                | 0039 |                              | 1039 |                                |
| <b>III. Otros activos no corrientes</b>                 | 0040 |                              | 1040 |                                |

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

| BALANCE (miles de euros)                                   |      | Periodo actual<br>31/03/2018 |      | Periodo anterior<br>31/12/2017 |
|--|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>                                 | 0041 | 12.738                       | 1041 | 15.301                         |
| <b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>  | 0042 |                              | 1042 |                                |
| <b>V. Activos financieros a corto plazo</b>                | 0043 | 9.499                        | 1043 | 11.801                         |
| 1. Activos titulizados                                     | 0044 | 9.498                        | 1044 | 11.801                         |
| 1.1 Participaciones hipotecarias                           | 0045 | 9.441                        | 1045 | 11.743                         |
| 1.2 Certificados de transmisión hipotecaria                | 0046 |                              | 1046 | 0                              |
| 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 | 11                           | 1065 | 12                             |
| 1.22 Intereses vencidos e impagados                        | 0066 | 3                            | 1066 | 2                              |
| 1.23 Activos dudosos -principal-                           | 0067 | 104                          | 1067 | 100                            |
| 1.24 Activos dudosos -intereses-                           | 0068 | 2                            | 1068 | 2                              |
| 1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)    | 0069 | -62                          | 1069 | -58                            |
| 1.26 Ajustes por operaciones de cobertura                  | 0070 |                              | 1070 |                                |
| 2. Derivados   | 0071 |                              | 1071 |                                |
| 2.1 Derivados de cobertura                                 | 0072 |                              | 1072 |                                |
| 2.2 Derivados de negociación                               | 0073 |                              | 1073 |                                |
| 3. Otros activos financieros                               | 0074 | 0                            | 1074 | 0                              |
| 3.1 Valores representativos de deuda                       | 0075 |                              | 1075 |                                |
| 3.2 Instrumentos de patrimonio                             | 0076 |                              | 1076 |                                |
| 3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar                      | 0077 | 0                            | 1077 | 0                              |
| 3.4 Garantías financieras                                  | 0078 |                              | 1078 |                                |
| 3.5 Otros  | 0079 |                              | 1079 |                                |
| 3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)     | 0080 |                              | 1080 |                                |
| Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía    | 0081 |                              | 1081 |                                |
| <b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>                   | 0082 |                              | 1082 |                                |
| 1. Comisiones  | 0083 |                              | 1083 |                                |
| 2. Otros   | 0084 |                              | 1084 |                                |
| <b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b> | 0085 | 3.239                        | 1085 | 3.500                          |
| 1. Tesorería   | 0086 | 3.239                        | 1086 | 3.500                          |
| 2. Otros activos líquidos equivalentes                     | 0087 |                              | 1087 |                                |
| <b>TOTAL ACTIVO</b>  | 0088 | 49.131                       | 1088 | 51.012                         |

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

| BALANCE (miles de euros)                                  |      | Periodo actual<br>31/03/2018 |      | Periodo anterior<br>31/12/2017 |
|---|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>PASIVO</b>   |      |                              |      |                                |
| <b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>                             | 0089 | 39.659                       | 1089 | 39.163                         |
| <b>I. Provisiones a largo plazo</b>                       | 0090 |                              | 1090 |                                |
| 1. Provisión garantías financieras                        | 0091 |                              | 1091 |                                |
| 2. Provisión por margen de intermediación                 | 0092 |                              | 1092 |                                |
| 3. Otras provisiones                                      | 0093 |                              | 1093 |                                |
| <b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>              | 0094 | 39.659                       | 1094 | 39.163                         |
| 1. Obligaciones y otros valores emitidos                  | 0095 | 36.459                       | 1095 | 35.770                         |
| 1.1 Series no subordinadas                                | 0096 | 19.759                       | 1096 | 19.070                         |
| 1.2 Series subordinadas                                   | 0097 | 16.700                       | 1097 | 16.700                         |
| 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 | 2.872                        | 1101 | 2.884                          |
| 2.1 Préstamo subordinado                                  | 0102 | 2.884                        | 1102 | 2.884                          |
| 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 | -11                          | 1105 |                                |
| 2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos             | 0106 |                              | 1106 |                                |
| 2.6 Ajustes por operaciones de cobertura                  | 0107 |                              | 1107 |                                |
| 3. Derivados  | 0108 | 327                          | 1108 | 509                            |
| 3.1 Derivados de cobertura                                | 0109 | 327                          | 1109 | 509                            |
| 3.2 Derivados de negociación                              | 0110 |                              | 1110 |                                |
| 3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0111 |                              | 1111 |                                |
| 4. Otros pasivos financieros                              | 0112 |                              | 1112 |                                |
| 4.1 Garantías financieras                                 | 0113 |                              | 1113 |                                |
| 4.1 Otros   | 0114 |                              | 1114 |                                |
| 4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0115 |                              | 1115 |                                |
| <b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>                 | 0116 |                              | 1116 |                                |

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

| BALANCE (miles de euros)   |      | Periodo actual<br>31/03/2018 |      | Periodo anterior<br>31/12/2017 |
|--|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>B) PASIVO CORRIENTE</b>   | 0117 | 9.799                        | 1117 | 12.358                         |
| <b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b> | 0118 |                              | 1118 |                                |
| <b>V. Provisiones a corto plazo</b>  | 0119 |                              | 1119 |                                |
| 1. Provisión garantías financieras   | 0120 |                              | 1120 |                                |
| 2. Provisión por margen de intermediación  | 0121 |                              | 1121 |                                |
| 3. Otras provisiones   | 0122 |                              | 1122 |                                |
| <b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>                                     | 0123 | 9.781                        | 1123 | 12.333                         |
| 1. Obligaciones y otros valores emitidos   | 0124 | 9.694                        | 1124 | 12.250                         |
| 1.1 Series no subordinadas   | 0125 | 9.691                        | 1125 | 12.247                         |
| 1.2 Series subordinadas  | 0126 |                              | 1126 | 0                              |
| 1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0127 |                              | 1127 |                                |
| 1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos                                    | 0128 | 3                            | 1128 | 3                              |
| 1.5 Intereses vencidos e impagados   | 0129 |                              | 1129 |                                |
| 1.6 Ajustes por operaciones de cobertura   | 0130 |                              | 1130 |                                |
| 2. Deudas con entidades de crédito   | 0131 | 5                            | 1131 | 3                              |
| 2.1 Préstamo subordinado   | 0132 |                              | 1132 | 0                              |
| 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 | 0                              |
| 2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos                                    | 0136 | 1                            | 1136 | 1                              |
| 2.6 Intereses vencidos e impagados   | 0137 | 5                            | 1137 | 3                              |
| 2.7 Ajustes por operaciones de cobertura   | 0138 |                              | 1138 |                                |
| 3. Derivados   | 0139 | 1                            | 1139 | 2                              |
| 3.1 Derivados de cobertura   | 0140 | 1                            | 1140 | 2                              |
| 3.2 Derivados de negociación   | 0141 |                              | 1141 |                                |
| 3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0142 |                              | 1142 |                                |
| 4. Otros pasivos financieros   | 0143 | 80                           | 1143 | 79                             |
| 4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar   | 0144 | 2                            | 1144 | 1                              |
| 4.2 Garantías financieras  | 0145 | 78                           | 1145 | 78                             |
| 4.3 Otros  | 0146 |                              | 1146 |                                |
| 4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0147 |                              | 1147 |                                |
| <b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>  | 0148 | 19                           | 1148 | 24                             |
| 1. Comisiones  | 0149 | 1                            | 1149 | 7                              |
| 1.1 Comisión sociedad gestora  | 0150 | 1                            | 1150 | 1                              |
| 1.2 Comisión administrador   | 0151 | 3                            | 1151 | 2                              |
| 1.3 Comisión agente financiero/pagos   | 0152 | 0                            | 1152 | 0                              |
| 1.4 Comisión variable  | 0153 | 0                            | 1153 | 7                              |
| 1.5 Otras comisiones del cedente   | 0154 |                              | 1154 |                                |
| 1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0155 | -3                           | 1155 | -4                             |
| 1.7 Otras comisiones   | 0156 |                              | 1156 |                                |
| 2. Otros   | 0157 | 18                           | 1157 | 18                             |
| <b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>       | 0158 | -327                         | 1158 | -509                           |
| <b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>                       | 0159 |                              | 1159 |                                |
| <b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>                                      | 0160 | -327                         | 1160 | -509                           |
| <b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>                 | 0161 |                              | 1161 |                                |
| <b>TOTAL PASIVO</b>  | 0162 | 49.131                       | 1162 | 51.012                         |

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

| CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)                              |      | P. corriente actual (1. trimestre) |      | P. corriente anterior (1. trimestre) |      | Acumulado actual 31/03/2018 |      | Acumulado anterior 31/03/2017 |
|--|------|------------------------------------|------|--------------------------------------|------|-----------------------------|------|-------------------------------|
| <b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>                                | 0201 | 98                                 | 1201 | 238                                  | 2201 | 98                          | 3201 | 238                           |
| 1.1 Activos titulizados  | 0202 | 98                                 | 1202 | 238                                  | 2202 | 98                          | 3202 | 238                           |
| 1.2 Otros activos financieros  | 0203 |                                    | 1203 | 0                                    | 2203 |                             | 3203 | 0                             |
| <b>2. Intereses y cargas asimilados</b>                                      | 0204 | -28                                | 1204 | -29                                  | 2204 | -28                         | 3204 | -29                           |
| 2.1 Obligaciones y otros valores emitidos                                    | 0205 | -24                                | 1205 | -24                                  | 2205 | -24                         | 3205 | -24                           |
| 2.2 Deudas con entidades de crédito  | 0206 | -4                                 | 1206 | -4                                   | 2206 | -4                          | 3206 | -4                            |
| 2.3 Otros pasivos financieros  | 0207 |                                    | 1207 |                                      | 2207 |                             | 3207 |                               |
| <b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b> | 0208 | -12                                | 1208 | -99                                  | 2208 | -12                         | 3208 | -99                           |
| <b>A) MARGEN DE INTERESES</b>  | 0209 | 58                                 | 1209 | 110                                  | 2209 | 58                          | 3209 | 110                           |
| <b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>                        | 0210 |                                    | 1210 |                                      | 2210 |                             | 3210 |                               |
| 4.1 Resultados de derivados de negociación                                   | 0211 |                                    | 1211 |                                      | 2211 |                             | 3211 |                               |
| 4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG          | 0212 |                                    | 1212 |                                      | 2212 |                             | 3212 |                               |
| 4.3 Activos financieros disponibles para la venta                            | 0213 |                                    | 1213 |                                      | 2213 |                             | 3213 |                               |
| 4.4 Otros  | 0214 |                                    | 1214 |                                      | 2214 |                             | 3214 |                               |
| <b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>                                       | 0215 |                                    | 1215 |                                      | 2215 |                             | 3215 |                               |
| <b>6. Otros ingresos de explotación</b>                                      | 0216 |                                    | 1216 |                                      | 2216 |                             | 3216 |                               |
| <b>7. Otros gastos de explotación</b>  | 0217 | -68                                | 1217 | -196                                 | 2217 | -68                         | 3217 | -196                          |
| 7.1 Servicios exteriores   | 0218 | -31                                | 1218 | -1                                   | 2218 | -31                         | 3218 | -1                            |
| 7.1.1 Servicios de profesionales independientes                              | 0219 | -25                                | 1219 | 0                                    | 2219 | -25                         | 3219 | 0                             |
| 7.1.2 Servicios bancarios y similares  | 0220 |                                    | 1220 |                                      | 2220 |                             | 3220 |                               |
| 7.1.3 Publicidad y propaganda  | 0221 |                                    | 1221 |                                      | 2221 |                             | 3221 |                               |
| 7.1.4 Otros servicios  | 0222 | -6                                 | 1222 | 0                                    | 2222 | -6                          | 3222 | 0                             |
| 7.2 Tributos   | 0223 |                                    | 1223 |                                      | 2223 |                             | 3223 |                               |
| 7.3 Otros gastos de gestión corriente  | 0224 | -37                                | 1224 | -195                                 | 2224 | -37                         | 3224 | -195                          |
| 7.3.1 Comisión sociedad gestora  | 0225 | -7                                 | 1225 | -7                                   | 2225 | -7                          | 3225 | -7                            |
| 7.3.2 Comisión administrador   | 0226 | -1                                 | 1226 | -2                                   | 2226 | -1                          | 3226 | -2                            |
| 7.3.3 Comisión agente financiero/pagos                                       | 0227 | 0                                  | 1227 | 0                                    | 2227 | 0                           | 3227 | 0                             |
| 7.3.4 Comisión variable  | 0228 | -28                                | 1228 | -186                                 | 2228 | -28                         | 3228 | -186                          |
| 7.3.5 Otras comisiones del cedente   | 0229 |                                    | 1229 |                                      | 2229 |                             | 3229 |                               |
| 7.3.6 Otros gastos   | 0230 | 0                                  | 1230 | 0                                    | 2230 | 0                           | 3230 | 0                             |
| <b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>                            | 0231 |                                    | 1231 | 85                                   | 2231 |                             | 3231 | 85                            |
| 8.1 Deterioro neto de activos titulizados                                    | 0232 |                                    | 1232 | 85                                   | 2232 |                             | 3232 | 85                            |
| 8.2 Deterioro neto de otros activos financieros                              | 0233 |                                    | 1233 |                                      | 2233 |                             | 3233 |                               |
| <b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>                                    | 0234 |                                    | 1234 |                                      | 2234 |                             | 3234 |                               |
| 9.1 Dotación provisión por garantías financieras                             | 0235 |                                    | 1235 |                                      | 2235 |                             | 3235 |                               |
| 9.2 Dotación provisión por margen de intermediación                          | 0236 |                                    | 1236 |                                      | 2236 |                             | 3236 |                               |
| 9.3 Dotación otras provisiones   | 0237 |                                    | 1237 |                                      | 2237 |                             | 3237 |                               |
| <b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>            | 0238 |                                    | 1238 |                                      | 2238 |                             | 3238 |                               |
| <b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>                               | 0239 | 11                                 | 1239 |                                      | 2239 | 11                          | 3239 |                               |
| <b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>                                       | 0240 | 0                                  | 1240 | 0                                    | 2240 | 0                           | 3240 | 0                             |
| <b>12. Impuesto sobre beneficios</b>   | 0241 |                                    | 1241 |                                      | 2241 |                             | 3241 |                               |
| <b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>  | 0242 | 0                                  | 1242 | 0                                    | 2242 | 0                           | 3242 | 0                             |

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

| ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)                                    |      | P. corriente actual (1. trimestre) |      | P. corriente anterior (1. trimestre) |      | Acumulado actual 31/03/2018 |      | Acumulado anterior 31/03/2017 |
|--|------|------------------------------------|------|--------------------------------------|------|-----------------------------|------|-------------------------------|
| <b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>                          | 0300 | -15                                | 1300 | 26                                   | 2300 | -15                         | 3300 | 26                            |
| <b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>                    | 0301 | 61                                 | 1301 | 103                                  | 2301 | 61                          | 3301 | 103                           |
| 1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados                                | 0302 | 97                                 | 1302 | 238                                  | 2302 | 97                          | 3302 | 238                           |
| 1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos              | 0303 | -22                                | 1303 | -25                                  | 2303 | -22                         | 3303 | -25                           |
| 1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura                             | 0304 | 31                                 | 1304 | -19                                  | 2304 | 31                          | 3304 | -19                           |
| 1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura                              | 0305 | -43                                | 1305 | -82                                  | 2305 | -43                         | 3305 | -82                           |
| 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 | -2                                 | 1307 | -8                                   | 2307 | -2                          | 3307 | -8                            |
| 1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)                                      | 0308 | 0                                  | 1308 | 0                                    | 2308 | 0                           | 3308 | 0                             |
| <b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>                  | 0309 | -43                                | 1309 | -77                                  | 2309 | -43                         | 3309 | -77                           |
| 2.1 Comisión sociedad gestora  | 0310 | -7                                 | 1310 | -7                                   | 2310 | -7                          | 3310 | -7                            |
| 2.2 Comisión administrador   | 0311 | 0                                  | 1311 | -3                                   | 2311 | 0                           | 3311 | -3                            |
| 2.3 Comisión agente financiero/pagos   | 0312 | 0                                  | 1312 | 0                                    | 2312 | 0                           | 3312 | 0                             |
| 2.4 Comisión variable  | 0313 | -36                                | 1313 | -66                                  | 2313 | -36                         | 3313 | -66                           |
| 2.5 Otras comisiones   | 0314 | 0                                  | 1314 | 0                                    | 2314 | 0                           | 3314 | 0                             |
| <b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>        | 0315 | -32                                | 1315 | -1                                   | 2315 | -32                         | 3315 | -1                            |
| 3.1 Pagos por garantías financieras  | 0316 | 0                                  | 1316 | 0                                    | 2316 | 0                           | 3316 | 0                             |
| 3.2 Cobros por garantías financieras   | 0317 | 0                                  | 1317 | 0                                    | 2317 | 0                           | 3317 | 0                             |
| 3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación                            | 0318 | 0                                  | 1318 | 0                                    | 2318 | 0                           | 3318 | 0                             |
| 3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación                           | 0319 | 0                                  | 1319 | 0                                    | 2319 | 0                           | 3319 | 0                             |
| 3.5 Otros pagos de explotación   | 0320 | -411                               | 1320 | -1                                   | 2320 | -411                        | 3320 | -1                            |
| 3.6 Otros cobros de explotación  | 0321 | 379                                | 1321 | 0                                    | 2321 | 379                         | 3321 | 0                             |
| <b>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>                 | 0322 | -247                               | 1322 | -308                                 | 2322 | -247                        | 3322 | -308                          |
| <b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulación</b>              | 0323 | 0                                  | 1323 | 0                                    | 2323 | 0                           | 3323 | 0                             |
| <b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>                  | 0324 | 0                                  | 1324 | 0                                    | 2324 | 0                           | 3324 | 0                             |
| <b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b> | 0325 | -247                               | 1325 | -308                                 | 2325 | -247                        | 3325 | -308                          |
| 6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados                     | 0326 | 996                                | 1326 | 1.479                                | 2326 | 996                         | 3326 | 1.479                         |
| 6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados                    | 0327 | 261                                | 1327 | 1.120                                | 2327 | 261                         | 3327 | 1.120                         |
| 6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados          | 0328 | 362                                | 1328 | 350                                  | 2328 | 362                         | 3328 | 350                           |
| 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 | -1.867                             | 1331 | -3.258                               | 2331 | -1.867                      | 3331 | -3.258                        |
| <b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>                     | 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                             |
| <b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>              | 0337 | -261                               | 1337 | -283                                 | 2337 | -261                        | 3337 | -283                          |
| Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo                                  | 0338 | 3.500                              | 1338 | 3.849                                | 2338 | 3.500                       | 3338 | 3.849                         |
| Efectivo o equivalentes al final del periodo                                     | 0339 | 3.239                              | 1339 | 3.566                                | 2339 | 3.239                       | 3339 | 3.566                         |

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

| INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)   |      | P. corriente actual (1. trimestre) |      | P. corriente anterior (1. trimestre) |      | Acumulado actual 31/03/2018 |      | Acumulado anterior 31/03/2017 |
|--|------|------------------------------------|------|--------------------------------------|------|-----------------------------|------|-------------------------------|
| <b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>  |      |                                    |      |                                      |      |                             |      |                               |
| 1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración  | 0350 |                                    | 1350 |                                      | 2350 |                             | 3350 |                               |
| 1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración   | 0351 |                                    | 1351 |                                      | 2351 |                             | 3351 |                               |
| 1.1.2 Efecto fiscal  | 0352 |                                    | 1352 |                                      | 2352 |                             | 3352 |                               |
| 1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias  | 0353 |                                    | 1353 |                                      | 2353 |                             | 3353 |                               |
| 1.3 Otras reclasificaciones  | 0354 |                                    | 1354 |                                      | 2354 |                             | 3354 |                               |
| 1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo  | 0355 |                                    | 1355 |                                      | 2355 |                             | 3355 |                               |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>                   | 0356 |                                    | 1356 |                                      | 2356 |                             | 3356 |                               |
| <b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>  |      |                                    |      |                                      |      |                             |      |                               |
| 2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración  | 0357 | 170                                | 1357 | 299                                  | 2357 | 170                         | 3357 | 299                           |
| 2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración   | 0358 | 170                                | 1358 | 299                                  | 2358 | 170                         | 3358 | 299                           |
| 2.1.2 Efecto fiscal  | 0359 |                                    | 1359 |                                      | 2359 |                             | 3359 |                               |
| 2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias  | 0360 | 12                                 | 1360 | 99                                   | 2360 | 12                          | 3360 | 99                            |
| 2.3 Otras reclasificaciones  | 0361 |                                    | 1361 |                                      | 2361 |                             | 3361 |                               |
| 2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período  | 0362 | -182                               | 1362 | -399                                 | 2362 | -182                        | 3362 | -399                          |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>  | 0363 | 0                                  | 1363 | 0                                    | 2363 | 0                           | 3363 | 0                             |
| <b>3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>   |      |                                    |      |                                      |      |                             |      |                               |
| 3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el periodo | 0364 |                                    | 1364 |                                      | 2364 |                             | 3364 |                               |
| 3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración   | 0365 |                                    | 1365 |                                      | 2365 |                             | 3365 |                               |
| 3.1.2 Efecto fiscal  | 0366 |                                    | 1366 |                                      | 2366 |                             | 3366 |                               |
| 3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias  | 0367 |                                    | 1367 |                                      | 2367 |                             | 3367 |                               |
| 3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período  | 0368 |                                    | 1368 |                                      | 2368 |                             | 3368 |                               |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>  | 0369 |                                    | 1369 |                                      | 2369 |                             | 3369 |                               |
| <b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>  | 0370 | 0                                  | 1370 | 0                                    | 2370 | 0                           | 3370 | 0                             |

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK | A14010342 BANKIA, S.A | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

| Ratios (%)                                   | Situación actual 31/03/2018 |      |                 |   |                               |   |                                 |       | 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                        | 0,98 | 0400            | 0 | 0420                          | 0 | 0440                            | 19,03 | 1380                                       | 0,98 | 1400            | 0 | 1420                          | 0 | 1440                            | 19,68 | 2380                                  | 0 | 2400            | 0 | 2420                          | 0 | 2440                            | 0 |
| Certificados de transmisión de hipoteca      | 0381                        |      | 0401            |   | 0421                          |   | 0441                            |       | 1381                                       |      | 1401            |   | 1421                          |   | 1441                            |       | 2381                                  |   | 2401            |   | 2421                          |   | 2441                            |   |
| 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 - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK | A14010342 BANKIA, S.A | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO B**

| Total Impagados (miles de euros) | Nº de activos |           | Importe impagado            |            |                                      |          |   |          |             |            | Principal pendiente no vencido |              | Otros importes |          | Deuda Total |              |
|----------------------------------|---------------|-----------|-----------------------------|------------|--------------------------------------|----------|---|----------|-------------|------------|--------------------------------|--------------|----------------|----------|-------------|--------------|
|                                  |               |           | Principal pendiente vencido |            | Intereses devengados en contabilidad |          | Intereses interrumpidos en contabilidad |          | Total       |            |                                |              |                |          |             |              |
| Hasta 1 mes                      | 0460          | 73        | 0467                        | 14         | 0474                                 | 2        | 0481                                    |          | 0488        | 16         | 0495                           | 1.789        | 0502           | 0        | 0509        | 1.805        |
| De 1 a 3 meses                   | 0461          | 10        | 0468                        | 9          | 0475                                 | 0        | 0482                                    |          | 0489        | 9          | 0496                           | 313          | 0503           | 0        | 0510        | 322          |
| De 3 a 6 meses                   | 0462          |           | 0469                        |            | 0476                                 |          | 0483                                    |          | 0490        |            | 0497                           |              | 0504           |          | 0511        |              |
| De 6 a 9 meses                   | 0463          | 2         | 0470                        | 4          | 0477                                 | 0        | 0484                                    | 0        | 0491        | 4          | 0498                           | 89           | 0505           |          | 0512        | 93           |
| De 9 a 12 meses                  | 0464          | 1         | 0471                        | 4          | 0478                                 |          | 0485                                    | 0        | 0492        | 4          | 0499                           | 48           | 0506           |          | 0513        | 53           |
| Más de 12 meses                  | 0465          | 7         | 0472                        | 96         | 0479                                 | 1        | 0486                                    | 7        | 0493        | 104        | 0500                           | 210          | 0507           |          | 0514        | 314          |
| <b>Total</b>                     | <b>0466</b>   | <b>93</b> | <b>0473</b>                 | <b>127</b> | <b>0480</b>                          | <b>4</b> | <b>0487</b>                             | <b>7</b> | <b>0494</b> | <b>138</b> | <b>0501</b>                    | <b>2.449</b> | <b>0508</b>    | <b>0</b> | <b>1515</b> | <b>2.587</b> |

| 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          | 73        | 0522                        | 14         | 0529                                 | 2        | 0536                                    |          | 0543        | 16         | 0550                           | 1.789        | 0557           | 0        | 0564        | 1.805        | 0571           | 6.616        | 0578                                 |  | 0584                  | 27,29        |
| De 1 a 3 meses                               | 0516          | 10        | 0523                        | 9          | 0530                                 | 0        | 0537                                    |          | 0544        | 9          | 0551                           | 313          | 0558           | 0        | 0565        | 322          | 0572           | 1.815        | 0579                                 |  | 0585                  | 17,75        |
| De 3 a 6 meses                               | 0517          |           | 0524                        |            | 0531                                 |          | 0538                                    |          | 0545        |            | 0552                           |              | 0559           |          | 0566        |              | 0573           |              | 0580                                 |  | 0586                  |              |
| De 6 a 9 meses                               | 0518          | 2         | 0525                        | 4          | 0532                                 | 0        | 0539                                    | 0        | 0546        | 4          | 0553                           | 89           | 0560           |          | 0567        | 93           | 0574           | 218          | 0581                                 |  | 0587                  | 42,67        |
| De 9 a 12 meses                              | 0519          | 1         | 0526                        | 4          | 0533                                 |          | 0540                                    | 0        | 0547        | 4          | 0554                           | 48           | 0561           |          | 0568        | 53           | 0575           | 133          | 0582                                 |  | 0588                  | 39,72        |
| Más de 12 meses                              | 0520          | 7         | 0527                        | 96         | 0534                                 | 1        | 0541                                    | 7        | 0548        | 104        | 0555                           | 210          | 0562           |          | 0569        | 314          | 0576           | 981          | 0583                                 |  | 0589                  | 31,98        |
| <b>Total</b>                                 | <b>0521</b>   | <b>93</b> | <b>0528</b>                 | <b>127</b> | <b>0535</b>                          | <b>4</b> | <b>0542</b>                             | <b>7</b> | <b>0549</b> | <b>138</b> | <b>0556</b>                    | <b>2.449</b> | <b>0563</b>    | <b>0</b> | <b>0570</b> | <b>2.587</b> | <b>0577</b>    | <b>9.763</b> |                                      |  | <b>0590</b>           | <b>26,50</b> |

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK | A14010342 BANKIA, S.A | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

| Vida residual de los activos titulizados (miles de euros) | Principal pendiente         |               |  |               |                              |                |
|---|-----------------------------|---------------|--|---------------|------------------------------|----------------|
|   | Situación actual 31/03/2018 |               | Situación cierre anual anterior 31/12/2017 |               | Situación inicial 29/06/2004 |                |
| Inferior a 1 año  | 0600                        | 160           | 1600                                       | 212           | 2600                         | 0              |
| Entre 1 y 2 años  | 0601                        | 305           | 1601                                       | 294           | 2601                         | 0              |
| Entre 2 y 3 años  | 0602                        | 549           | 1602                                       | 589           | 2602                         | 86             |
| Entre 3 y 4 años  | 0603                        | 1.006         | 1603                                       | 729           | 2603                         |                |
| Entre 4 y 5 años  | 0604                        | 3.073         | 1604                                       | 2.768         | 2604                         | 838            |
| Entre 5 y 10 años   | 0605                        | 18.757        | 1605                                       | 17.869        | 2605                         | 14.134         |
| Superior a 10 años  | 0606                        | 22.293        | 1606                                       | 25.303        | 2606                         | 369.442        |
| <b>Total</b>  | 0607                        | <b>46.143</b> | 1607                                       | <b>47.763</b> | 2607                         | <b>384.500</b> |
| <b>Vida residual media ponderada (años)</b>               | 0608                        | <b>10,49</b>  | 1608                                       | <b>10,67</b>  | 2608                         | <b>21,48</b>   |

| Antigüedad                        | Situación actual 31/03/2018 |       | Situación cierre anual anterior 31/12/2017 |       | Situación inicial 29/06/2004 |   |
|-----------------------------------|-----------------------------|-------|--|-------|------------------------------|---|
| Antigüedad media ponderada (años) | 0609                        | 15,64 | 1609                                       | 15,39 | 2609                         | 2 |

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK | A14010342 BANKIA, S.A | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO D**

| Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros) | Situación actual 31/03/2018 |              |                     |               | Situación cierre anual anterior 31/12/2017 |              |                     |               | 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                        | 1.150        | 0630                | 35.447        | 1620                                       | 1.151        | 1630                | 35.579        | 2620                         | 777          | 2630                | 36.127         |
| 40% - 60%   | 0621                        | 189          | 0631                | 10.696        | 1621                                       | 218          | 1631                | 12.183        | 2621                         | 1.332        | 2631                | 96.620         |
| 60% - 80%   | 0622                        |              | 0632                |               | 1622                                       |              | 1632                |               | 2622                         | 3.072        | 2632                | 251.753        |
| 80% - 100%  | 0623                        |              | 0633                |               | 1623                                       |              | 1633                |               | 2623                         | 0            | 2633                | 0              |
| 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              |
| <b>Total</b>  | 0628                        | <b>1.339</b> | 0638                | <b>46.143</b> | 1628                                       | <b>1.369</b> | 1638                | <b>47.763</b> | 2628                         | <b>5.181</b> | 2638                | <b>384.500</b> |
| <b>Media ponderada (%)</b>  | 0639                        | <b>30,55</b> | 0649                |               | 1639                                       | <b>31,10</b> | 1649                |               | 2639                         | <b>62,86</b> | 2649                |                |

S.05.1

**Denominación Fondo:** AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

**Denominación del compartimento:** 6056

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

**Estados agregados:** NO

**Fecha:** 31/03/2018

**Entidades cedentes de los activos titulizados:** A95653077 KUTXABANK | A14010342 BANKIA, S.A | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

| Tipos de interés de los activos titulizados (%) | Situación actual<br>31/03/2018 |      | Situación cierre anual anterior<br>31/12/2017 |      | Situación inicial 29/06/2004 |      |
|---|--------------------------------|------|---|------|------------------------------|------|
|   |                                |      |   |      |                              |      |
| Tipo de interés medio ponderado                 | 0650                           | 1,33 | 1650  | 1,45 | 2650                         | 3,51 |
| Tipo de interés nominal máximo                  | 0651                           | 7,50 | 1651  | 7,50 | 2651                         | 7,50 |
| Tipo de interés nominal mínimo                  | 0652                           | 0,02 | 1652  | 0,02 | 2652                         | 2,25 |

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK | A14010342 BANKIA, S.A | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO F**

| Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros) | Situación actual 31/03/2018 |              |                     |               | Situación cierre anual anterior 31/12/2017 |              |                     |               | 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                        | 516          | 0683                | 11.127        | 1660                                       | 533          | 1683                | 11.654        | 2660                         | 3.245        | 2683                | 184.466        |
| Aragón   | 0661                        | 91           | 0684                | 3.630         | 1661                                       | 92           | 1684                | 3.722         | 2661                         | 179          | 2684                | 15.709         |
| 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                        | 12           | 0688                | 467           | 1665                                       | 12           | 1688                | 477           | 2665                         | 28           | 2688                | 2.776          |
| Castilla-León  | 0666                        | 144          | 0689                | 5.824         | 1666                                       | 148          | 1689                | 6.061         | 2666                         | 329          | 2689                | 31.493         |
| Castilla La Mancha   | 0667                        | 10           | 0690                | 411           | 1667                                       | 10           | 1690                | 420           | 2667                         | 64           | 2690                | 5.774          |
| Cataluña   | 0668                        | 5            | 0691                | 162           | 1668                                       | 5            | 1691                | 165           | 2668                         | 48           | 2691                | 3.382          |
| Ceuta  | 0669                        |              | 0692                |               | 1669                                       |              | 1692                |               | 2669                         | 0            | 2692                | 0              |
| Extremadura  | 0670                        | 2            | 0693                | 80            | 1670                                       | 2            | 1693                | 83            | 2670                         | 38           | 2693                | 2.784          |
| Galicia  | 0671                        |              | 0694                |               | 1671                                       |              | 1694                |               | 2671                         | 0            | 2694                | 0              |
| Madrid   | 0672                        | 79           | 0695                | 3.902         | 1672                                       | 80           | 1695                | 4.014         | 2672                         | 226          | 2695                | 26.233         |
| Melilla  | 0673                        |              | 0696                |               | 1673                                       |              | 1696                |               | 2673                         | 3            | 2696                | 249            |
| Murcia   | 0674                        |              | 0697                |               | 1674                                       |              | 1697                |               | 2674                         | 0            | 2697                | 0              |
| Navarra  | 0675                        | 2            | 0698                | 102           | 1675                                       | 2            | 1698                | 104           | 2675                         | 4            | 2698                | 776            |
| La Rioja   | 0676                        | 126          | 0699                | 5.097         | 1676                                       | 131          | 1699                | 5.283         | 2676                         | 259          | 2699                | 29.374         |
| Comunidad Valenciana   | 0677                        | 1            | 0700                | 2             | 1677                                       | 1            | 1700                | 2             | 2677                         | 5            | 2700                | 328            |
| País Vasco   | 0678                        | 351          | 0701                | 15.339        | 1678                                       | 353          | 1701                | 15.777        | 2678                         | 753          | 2701                | 81.156         |
| <b>Total España</b>  | 0679                        | <b>1.339</b> | 0702                | <b>46.143</b> | 1679                                       | <b>1.369</b> | 1702                | <b>47.763</b> | 2679                         | <b>5.181</b> | 2702                | <b>384.500</b> |
| Otros países Unión Europea                                   | 0680                        |              | 0703                |               | 1680                                       |              | 1703                |               | 2680                         | 0            | 2703                | 0              |
| Resto  | 0681                        |              | 0704                |               | 1681                                       |              | 1704                |               | 2681                         | 0            | 2704                | 0              |
| <b>Total general</b>   | 0682                        | <b>1.339</b> | 0705                | <b>46.143</b> | 1682                                       | <b>1.369</b> | 1705                | <b>47.763</b> | 2682                         | <b>5.181</b> | 2705                | <b>384.500</b> |

|  |
|--|
| <b>S.05.1</b>  |
| <b>Denominación Fondo:</b> AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH  |
| <b>Denominación del compartimento:</b> 6056  |
| <b>Denominación de la gestora:</b> HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.   |
| <b>Estados agregados:</b> NO   |
| <b>Fecha:</b> 31/03/2018   |
| <b>Entidades cedentes de los activos titulizados:</b> A95653077 KUTXABANK   A14010342 BANKIA, S.A   A08663619 CAIXABANK, S.A.   A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. |

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

| Concentración   | Situación actual 31/03/2018 |      |      |  | Situación cierre anual anterior 31/12/2017 |      |      |  | Situación inicial 29/06/2004 |      |      |   |
|---|-----------------------------|------|------|--|--|------|------|--|------------------------------|------|------|---|
|   | Porcentaje                  |      | CNAE |  | Porcentaje                                 |      | CNAE |  | Porcentaje                   |      | CNAE |   |
| Diez primeros deudores/emisores con más concentración | 0710                        | 3,45 |      |  | 1710                                       | 3,40 |      |  | 2710                         | 0,87 |      |   |
| Sector  | 0711                        |      | 0712 |  | 1711                                       |      | 1712 |  | 2711                         | 0    | 2712 | 0 |

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

| (miles de euros) |                    | Situación actual 31/03/2018 |                              |                     | Situación cierre anual anterior 31/12/2017 |                              |                     | Situación inicial 29/06/2004 |                              |                     |       |      |         |
|------------------|--------------------|-----------------------------|------------------------------|---------------------|--|------------------------------|---------------------|------------------------------|------------------------------|---------------------|-------|------|---------|
| Serie            | Denominación serie | Nº de pasivos emitidos      |                              | Principal pendiente | Nº de pasivos emitidos                     |                              | Principal pendiente | Nº de pasivos emitidos       |                              | Principal pendiente |       |      |         |
|                  |                    | 0720                        | Nominal unitario (€)<br>0721 | 0722                | 1720                                       | Nominal unitario (€)<br>1721 | 1722                | 2720                         | Nominal unitario (€)<br>2721 | 2722                |       |      |         |
| ES0370151005     | PH1                | 3.678                       | 8.007                        | 29.450              | 3.678                                      | 8.515                        | 31.317              | 3.678                        | 100.000                      | 367.800             |       |      |         |
| ES0370151013     | PH2                | 167                         | 100.000                      | 16.700              | 167  | 100.000                      | 16.700              | 167                          | 100.000                      | 16.700              |       |      |         |
| <b>Total</b>     |                    | 0723                        | 3.845                        | 0724                | 46.150                                     | 1723                         | 3.845               | 1724                         | 48.017                       | 2723                | 3.845 | 2724 | 384.500 |

|  |
|--|
| <b>S.05.2</b>  |
| <b>Denominación Fondo:</b> AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH    |
| <b>Denominación del compartimento:</b> 6056                      |
| <b>Denominación de la gestora:</b> HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A. |
| <b>Estados agregados:</b> NO                                     |
| <b>Periodo de la declaración:</b> 31/03/2018                     |
| <b>Mercados de cotización de los valores emitidos:</b> 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                 | 0736   |                    | 0737            |                 | 0738  |   | 0739 |
| ES0370151005     | PH1                | NS                     | EURIBOR 3 MESES      | 0,17   | 0             | 0                    | 0                   |      | SI                                    | 29.450               |        | 0                  |                 | 29.450          |   |   |      |
| ES0370151013     | PH2                | S                      | EURIBOR 3 MESES      | 0,90   | 0,57          | 3                    | 0                   |      | SI                                    | 16.700               |        | 0                  |                 | 16.703          |   |   |      |
| <b>Total</b>     |                    |                        |                      |        |               | 0740                 | 3                   | 0741 |                                       | 0743                 | 46.150 | 0744               |                 | 0745            | 46.153  | 0746  |      |

|  | Situación actual 31/03/2018 |      | Situación cierre anual anterior 31/12/2017 |  | Situación inicial 29/06/2004 |      |
|--|-----------------------------|------|--|--|------------------------------|------|
| Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%) | 0747                        | 0,21 | 0748                                       |  | 0749                         | 1,20 |

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

| (miles de euros) |                    | Situación actual 31/03/2018 |         |                  |         |                   |         |                  |        | Situación periodo comparativo anterior 31/03/2017 |       |                  |         |                   |    |                  |        |
|------------------|--------------------|-----------------------------|---------|------------------|---------|-------------------|---------|------------------|--------|---|-------|------------------|---------|-------------------|----|------------------|--------|
| 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    | 1750              | 1751    | 1752             | 1753   |   |       |                  |         |                   |    |                  |        |
| ES0370151013     | PH2                | 0                           | 0       | 22               | 5.375   | 0                 | 0       | 25               | 5.280  |   |       |                  |         |                   |    |                  |        |
| ES0370151005     | PH1                | 1.867                       | 338.350 | 0                | 49.131  | 3.258             | 321.161 | 0                | 49.131 |   |       |                  |         |                   |    |                  |        |
| <b>Total</b>     |                    | 0754                        | 1.867   | 0755             | 338.350 | 0756              | 22      | 0757             | 54.505 | 1754  | 3.258 | 1755             | 321.161 | 1756              | 25 | 1757             | 54.410 |

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2018

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 31/03/2018 | Situación cierre anual anterior 31/12/2017 | Situación inicial 29/06/2004 |
|              |                    |  |  | 0762                        | 0763                                       | 0764                         |
| ES0370151005 | PH1                | 19/08/2014                                     | FCH                                    | AA+                         | AA+  | AAA                          |
| ES0370151005 | PH1                | 29/06/2004                                     | MDY                                    | Aa2                         | Aa2  | Aaa                          |
| ES0370151013 | PH2                | 20/03/2018                                     | FCH                                    | A-                          | BBB+                                       | BBB                          |
| ES0370151013 | PH2                | 13/05/2013                                     | MDY                                    | Ba3                         | Ba3  | Baa3                         |

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2018

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 31/03/2018 |               | Situación cierre anual anterior 31/12/2017 |               | Situación inicial 29/06/2004 |
| Inferior a 1 año   | 0765                        |               | 1765                                       |               | 2765                         |
| Entre 1 y 2 años   | 0766                        | 46.150        | 1766                                       | 31.317        | 2766                         |
| Entre 2 y 3 años   | 0767                        |               | 1767                                       | 16.700        | 2767                         |
| Entre 3 y 4 años   | 0768                        |               | 1768                                       |               | 2768                         |
| Entre 4 y 5 años   | 0769                        |               | 1769                                       |               | 2769                         |
| Entre 5 y 10 años  | 0770                        |               | 1770                                       |               | 2770                         |
| Superior a 10 años   | 0771                        |               | 1771                                       |               | 2771                         |
| <b>Total</b>   | <b>0772</b>                 | <b>46.150</b> | <b>1772</b>                                | <b>48.017</b> | <b>2772</b>                  |
| <b>Vida residual media ponderada (años)</b>  | <b>0773</b>                 | <b>1,57</b>   | <b>1773</b>                                | <b>1,80</b>   | <b>2773</b>                  |
|  |                             |               |  |               | <b>367.800</b>               |
|  |                             |               |  |               | <b>16.700</b>                |
|  |                             |               |  |               | <b>384.500</b>               |
|  |                             |               |  |               | <b>8,33</b>                  |

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

| Información sobre las mejoras crediticias del Fondo  | Situación actual 31/03/2018 |                    | Situación cierre anual anterior 31/12/2017 |                    | Situación inicial 29/06/2004 |       |
|--|-----------------------------|--------------------|--|--------------------|------------------------------|-------|
|  | Código                      | Valor              | Código                                     | Valor              | Código                       | Valor |
| 1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)  | 0775                        | 2.884              | 1775                                       | 2.884              | 2775                         | 2.884 |
| 1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)   | 0776                        | 2.884              | 1776                                       | 2.884              | 2776                         | 2.884 |
| 1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)               | 0777                        | 6,25               | 1777                                       | 6,01               | 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                        | 63,81              | 1792                                       | 65,22              | 2792                         | 95,66 |
| 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 - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

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 31/03/2018      | Situación cierre anual anterior 31/12/2017 | Situación inicial 29/06/2004 |                       |
| 0800                 | 0801                     | 0802                         | 0803     | 0804                                 | 0805     | 0806                             | 1806                                       | 2806                         | 3806                  |
|                      |                          |                              |          |                                      |          |                                  |  |                              |                       |

AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

|           |  |            |   |  |  |  |      |      |        |  |
|-----------|--|------------|---|--|--|--|------|------|--------|--|
| Permuta 1 | J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA | Trimestral | El Factor de Cálculo PH 1 En cada Fecha de Referencia, 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 PH 1 que resetean en cada uno de los meses del año. Las Fechas de Referencia serán los 18 de cada mes. 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 Nocional del Contrato de Swap PH 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 Nocional del Contrato de Swap PH 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 | -121 | -183 | -9.934 |  |
|-----------|--|------------|---|--|--|--|------|------|--------|--|

AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

|           |  |            |   |  |   |  |      |      |        |  |
|-----------|--|------------|---|--|---|--|------|------|--------|--|
| Permuta 2 | J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA | Trimestral | El Factor de Cálculo PH 2 En cada Fecha de Referencia, 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 PH2 que resetean en cada uno de los meses del año. Las Fechas de Referencia? serán los 18 de cada mes.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 Nocional del Contrato de Swap PH 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 Nocional del Contrato de Swap PH 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 | -129 | -180 | -6.249 |  |
|-----------|--|------------|---|--|---|--|------|------|--------|--|

**AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH**

|              |   |            |  |  |   |   |      |      |        |      |      |         |
|--------------|---|------------|--|--|---|---|------|------|--------|------|------|---------|
| Permuta 1    | J.P. MORGAN<br>INTERNATIONAL BANK<br>LIMITED, SUCURSAL EN<br>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. | 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 <a href="http://www.bde.es/tipos/tipos.htm">www.bde.es/tipos/tipos.htm</a> . | -79  | -148 | -9.934 |      |      |         |
| <b>Total</b> |   |            |  |  |   |   | 0808 | -329 | 0809   | -511 | 0810 | -26.116 |

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO B**

| GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS<br>Naturaleza riesgo cubierto | Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros) |   |                              | Valor en libros (miles de euros) |   |                              | Otras características |  |
|--|---|---|------------------------------|----------------------------------|---|------------------------------|-----------------------|--|
|  | Situación actual<br>31/03/2018                      | Situación cierre anual<br>anterior 31/12/2017 | Situación inicial 29/06/2004 | Situación actual 31/03/2018      | Situación cierre anual<br>anterior 31/12/2017 | 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                         |                       |  |
| <b>Total</b>   | 0827  | 1827  | 2827                         | 0845                             | 1845  | 2845                         | 3845                  |  |

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

**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 31/03/2018 |     | Situación cierre anual anterior 31/12/2017 |     | Situación actual 31/03/2018 |      | Situación cierre anual anterior 31/12/2017 |      |              |         | Última Fecha Pago |   |
| 1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a  | 7000         | 0  | 7002        | 90 | 7003                        | 112 | 7006                                       | 108 | 7009                        | 0,98 | 7012                                       | 0,98 | 7015         | 1,04    |                   |   |
| 2. Activos Morosos por otras razones                              |              |    |             |    | 7004                        |     | 7007                                       |     | 7010                        |      | 7013                                       |      | 7016         |         |                   |   |
| Total Morosos   |              |    |             |    | 7005                        | 112 | 7008                                       | 108 | 7011                        | 0,98 | 7014                                       | 0,98 | 7017         | 112.263 | 7018              | FOLLETO INFORMATIVO. CAPÍTULO V. APARTADO V.3.4.(a)     |
| 3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a | 7019         | 18 | 7020        | 0  | 7021                        | 98  | 7024                                       | 96  | 7027                        | 0,58 | 7030                                       | 0,56 | 7033         | 0,57    |                   |   |
| 4. Activos Fallidos por otras razones                             |              |    |             |    | 7022                        | 0   | 7025                                       | 0   | 7028                        | 0    | 7031                                       | 0    | 7034         | 0       |                   |   |
| Total Fallidos  |              |    |             |    | 7023                        | 98  | 7026                                       | 96  | 7029                        | 0,58 | 7032                                       | 0,56 | 7035         | 0,57    | 7036              | FOLLETO INFORMATIVO. CAPÍTULO II. APARTADO II.3.2.1 (a) |

| Otras ratios relevantes | Ratio                       |  |  |  | Ref. Folleto |      |
|-------------------------|-----------------------------|--|--|--|--------------|------|
|                         | Situación actual 31/03/2018 |  | Situación cierre anual anterior 31/12/2017 |  |              |      |
|                         | 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 - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

**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               |
| Diferimiento/postergamiento intereses: series | 0855   | 0859     | 1859              | 2859               |
| No Reducción del Fondo de Reserva             | 0856   | 0860     | 1860              | 2860               |
| OTROS TRIGGERS                                | 0857   | 0861     | 1861              | 2861               |

Cuadro de texto libre

**CUADRO C**

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene  
  
Información adicional  
en fichero adjunto

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

**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                          | 0 | 2862                                   | Días del mes /Base 365 | 3862    | 0,030 | 4862                    | 0 | 5862                    | 0 | 6862  | Trimestral | 7862  | S | 8862                  |  |
| Comisión administrador               | 0863          | CajaSol - El Monte            | 1863                          | 0 | 2863                                   | Días del mes /Días año | 3863    | 0,010 | 4863                    | 0 | 5863                    | 0 | 6863  | Trimestral | 7863  | S | 8863                  |  |
| Comisión del agente financiero/pagos | 0864          | BANCO SANTANDER, S.A.         | 1864                          | 0 | 2864                                   | Días del mes /Base 365 | 3864    | 0     | 4864                    | 0 | 5864                    | 0 | 6864  | Trimestral | 7864  | N | 8864                  |  |
| Otras                                | 0865          |                               | 1865                          |   | 2865                                   |                        | 3865    |       | 4865                    |   | 5865                    |   | 6865  |            | 7865  |   | 8865                  |  |

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

**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 | S  |
| 3 Otros (S/N)   | 0868 | N  |
| 3.1 Descripción   | 0869 |  |
| Contrapartida   | 0870 | Banco Mare Nostrum , Bankia ,<br>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 |  |  |
|--|------|---------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|-------|--|--|
| <b>Ingresos y gastos del periodo de cálculo</b>  | 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 - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

**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 | 20/03/2018    |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Saldo inicial  | 0886 | 2.884         |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Cobros del periodo   | 0887 | 1.948         |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable | 0888 | -8            |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Pagos por derivados  | 0889 | -12           |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Retención importe Fondo de Reserva                               | 0890 | -2.884        |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos              | 0891 | -1.890        |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Pagos por deudas con entidades de crédito                        | 0892 | -2            |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Resto pagos/retenciones  | 0893 | 0             |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Saldo disponible   | 0894 | 36            |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |
| Liquidación de comisión variable                                 | 0895 | 36            |  |  |  |  |  |  |  |  |  |       |  |

S.06

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2018

**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**