

**I. DATOS IDENTIFICATIVOS**

Denominación del Fondo: AYT CAJAMURCIA HIPOTECARIO II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS  
Número de registro del Fondo: 8549  
NIF Fondo: V84875947  
Denominación del compartimento:  
Número de registro del compartimento:  
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.  
NIF Gestora: A80732142  
Fondo Abierto: NO  
Fondo Privado: NO  
Estados agregados: NO  
Fecha: 30/06/2020

**II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA**

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

S.01

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2020		Periodo anterior 31/12/2019
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	35.679	1001	39.275
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	35.679	1002	39.275
1. Activos titulizados	0003	35.679	1003	39.275
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	28.040	1004	31.156
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	7.451	1005	7.970
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	665	1025	726
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-477	1027	-577
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0039		1039	
<b>III. Otros activos no corrientes</b>	0040		1040	

<b>S.01</b>
<b>Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/06/2020</b>

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2020		Periodo anterior 31/12/2019
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	12.126	1041	12.562
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042		1042	
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	5.770	1043	5.906
1. Activos titulizados	0044	5.770	1044	5.906
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	4.896	1045	5.121
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	768	1046	698
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	23	1065	27
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	0	1066	0
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	291	1067	284
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	3	1068	3
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-211	1069	-228
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	0	1082	0
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	0	1084	0
<b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b>	0085	6.356	1085	6.656
1. Tesorería	0086	6.356	1086	6.656
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	47.805	1088	51.837

S.01

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2020		Periodo anterior 31/12/2019
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	39.787	1089	43.294
<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	39.787	1094	43.294
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	35.329	1095	38.618
1.1 Series no subordinadas	0096	31.750	1096	34.899
1.2 Series subordinadas	0097	3.579	1097	3.719
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101	1.575	1101	1.575
2.1 Préstamo subordinado	0102	1.575	1102	1.575
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	0	1105	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	159	1108	173
3.1 Derivados de cobertura	0109	159	1109	173
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	2.723	1112	2.929
4.1 Garantías financieras	0113	2.723	1113	2.929
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 Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2020		Periodo anterior 31/12/2019
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	8.177	1117	8.715
<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	8.100	1123	8.659
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	8.081	1124	8.618
1.1 Series no subordinadas	0125	8.081	1125	8.617
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	1	1128	0
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	2	1131	5
2.1 Préstamo subordinado	0132		1132	
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	2	1136	2
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	3
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	15	1139	35
3.1 Derivados de cobertura	0140	15	1140	35
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	1	1143	1
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	1	1144	1
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	0148	77	1148	56
1. Comisiones	0149	43	1149	19
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	9	1150	9
1.2 Comisión administrador	0151	1	1151	2
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	1152	2
1.4 Comisión variable	0153	157	1153	19
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-126	1155	-14
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	34	1157	37
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158	-159	1158	-173
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159		1159	
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	-159	1160	-173
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161		1161	
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	47.805	1162	51.837

S.02

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2020		Acumulado anterior 30/06/2019
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	45	1201	98	2201	167	3201	199
1.1 Activos titulizados	0202	45	1202	98	2202	167	3202	199
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203		3203	
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-3	1204	-4	2204	-6	3204	-7
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1	1205	-1	2205	-1	3205	-2
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-3	1206	-3	2206	-5	3206	-5
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0208	-18	1208	-28	2208	-39	3208	-56
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	24	1209	66	2209	122	3209	136
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	0210	0	1210	0	2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0215	0	1215	0	2215		3215	
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0216	0	1216	0	2216		3216	
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0217	-151	1217	-66	2217	-352	3217	-161
7.1 Servicios exteriores	0218	-1	1218	-1	2218	-12	3218	-2
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	-1	2219	-2	3219	-2
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	-10	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	-1	2223	0	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-150	1224	-65	2224	-339	3224	-158
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-9	1225	-9	2225	-19	3225	-18
7.3.2 Comisión administrador	0226	-1	1226	-1	2226	-2	3226	-3
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-2	1227	-2	2227	-5	3227	-5
7.3.4 Comisión variable	0228	-137	1228	-52	2228	-313	3228	-132
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0231	1	1231	0	2231	117	3231	65
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	1	1232	0	2232	117	3232	65
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233		3233	
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	0234	0	1234	0	2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237		3237	
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0238	0	1238	0	2238		3238	
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0239	126	1239	0	2239	112	3239	-39
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0241	0	1241	0	2241		3241	
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

S.03

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2020		Acumulado anterior 30/06/2019
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	-219	1300	-301	2300	-320	3300	-388
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	47	1301	69	2301	104	3301	141
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	74	1302	99	2302	171	3302	201
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-1	1303	-1	2303	-1	3303	-2
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	25	1304	22	2304	-32	3304	47
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-49	1305	-48	2305	-27	3305	-100
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	-3	2307	-7	3307	-5
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	-165	1309	-128	2309	-203	3309	-179
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-9	1310	-9	2310	-19	3310	-18
2.2 Comisión administrador	0311	-1	1311	-1	2311	-4	3311	-3
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-2	1312	-2	2312	-5	3312	-5
2.4 Comisión variable	0313	-153	1313	-115	2313	-176	3313	-153
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	-101	1315	-242	2315	-221	3315	-349
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	-2.824	1320	-3.456	2320	-2.944	3320	-3.465
3.6 Otros cobros de explotación	0321	2.723	1321	3.214	2321	2.723	3321	3.116
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>	0322	178	1322	-263	2322	20	3322	-228
<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	178	1325	-263	2325	20	3325	-228
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	0	1326	0	2326	0	3326	0
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	477	1327	321	2327	764	3327	828
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.510	1328	1.695	2328	3.081	3328	3.503
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	-1.809	1331	-2.279	2331	-3.825	3331	-4.559
<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	-41	1337	-564	2337	-300	3337	-616
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	6.397	1338	7.462	2338	6.656	3338	7.513
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	6.356	1339	6.897	2339	6.356	3339	6.897

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2020		Acumulado anterior 30/06/2019
<b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>0356</b>	<b>0</b>	<b>1356</b>	<b>0</b>	<b>2356</b>		<b>3356</b>	
<b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-25	1357	-25	2357	-25	3357	-40
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-25	1358	-25	2358	-25	3358	-40
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	18	1360	28	2360	39	3360	56
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	6	1362	-3	2362	-14	3362	-16
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>0363</b>	<b>0</b>	<b>1363</b>	<b>0</b>	<b>2363</b>	<b>0</b>	<b>3363</b>	<b>0</b>
<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 período	0364	0	1364	0	2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368		3368	
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>0369</b>	<b>0</b>	<b>1369</b>	<b>0</b>	<b>2369</b>		<b>3369</b>	
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>0370</b>	<b>0</b>	<b>1370</b>	<b>0</b>	<b>2370</b>	<b>0</b>	<b>3370</b>	<b>0</b>



S.05.1

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2020								Situación cierre anual anterior 31/12/2019								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	2,48	0400	0	0420	0	0440	3,82	1380	2,09	1400	0	1420	0	1440	3,91	2380	0,48	2400	0,48	2420	0	2440	0
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	1,42	0401	0	0421	0	0441	3,36	1381	2,63	1401	0	1421	0	1441	2,03	2381	0	2401	0	2421	0	2441	0
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	5	0467	1	0474	0	0481		0488	1	0495	110	0502	0	0509	111
De 1 a 3 meses	0461	9	0468	4	0475	0	0482		0489	5	0496	399	0503	1	0510	404
De 3 a 6 meses	0462	2	0469	2	0476	0	0483	0	0490	2	0497	64	0504		0511	66
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	2	0477	0	0484	0	0491	2	0498	24	0505		0512	26
De 9 a 12 meses	0464	1	0471	2	0478	0	0485	0	0492	2	0499	7	0506		0513	9
Más de 12 meses	0465	19	0472	286	0479	3	0486	25	0493	314	0500	570	0507		0514	884
<b>Total</b>	<b>0466</b>	<b>37</b>	<b>0473</b>	<b>296</b>	<b>0480</b>	<b>3</b>	<b>0487</b>	<b>26</b>	<b>0494</b>	<b>325</b>	<b>0501</b>	<b>1.174</b>	<b>0508</b>	<b>1</b>	<b>1515</b>	<b>1.500</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	5	0522	1	0529	0	0536		0543	1	0550	110	0557	0	0564	111	0571	543	0578	543	0584	20,39
De 1 a 3 meses	0516	9	0523	4	0530	0	0537		0544	5	0551	399	0558	1	0565	404	0572	1.523	0579	1.523	0585	26,52
De 3 a 6 meses	0517	2	0524	2	0531	0	0538	0	0545	2	0552	64	0559		0566	66	0573	286	0580	286	0586	23,12
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	2	0532	0	0539	0	0546	2	0553	24	0560		0567	26	0574	72	0581	72	0587	36,02
De 9 a 12 meses	0519	1	0526	2	0533	0	0540	0	0547	2	0554	7	0561		0568	9	0575	47	0582	47	0588	19,75
Más de 12 meses	0520	19	0527	286	0534	3	0541	25	0548	314	0555	570	0562		0569	884	0576	2.353	0583	2.353	0589	37,56
<b>Total</b>	<b>0521</b>	<b>37</b>	<b>0528</b>	<b>296</b>	<b>0535</b>	<b>3</b>	<b>0542</b>	<b>26</b>	<b>0549</b>	<b>325</b>	<b>0556</b>	<b>1.174</b>	<b>0563</b>	<b>1</b>	<b>0570</b>	<b>1.500</b>	<b>0577</b>	<b>4.824</b>			<b>0590</b>	<b>31,09</b>

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO C**

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 31/10/2006	
Inferior a 1 año	0600	102	1600	109	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	222	1601	246	2601	64
Entre 2 y 3 años	0602	478	1602	416	2602	135
Entre 3 y 4 años	0603	8.778	1603	4.572	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	601	1604	6.187	2604	813
Entre 5 y 10 años	0605	22.266	1605	22.626	2605	14.810
Superior a 10 años	0606	9.664	1606	11.800	2606	299.178
<b>Total</b>	0607	<b>42.110</b>	1607	<b>45.955</b>	2607	<b>315.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	0608	<b>8,56</b>	1608	<b>8,90</b>	2608	<b>18,81</b>

Antigüedad	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 31/10/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	16,15	1609	15,66	2609	2,65

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO D**

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 31/10/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.198	0630	33.605	1620	1.220	1630	36.299	2620	769	2630	38.330
40% - 60%	0621	117	0631	8.240	1621	129	1631	9.196	2621	1.105	2631	86.361
60% - 80%	0622	3	0632	265	1622	5	1632	460	2622	1.778	2632	155.049
80% - 100%	0623		0633		1623		1633		2623	304	2633	35.260
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624	0	2634	0
120% - 140%	0625		0635		1625		1635		2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627	0	2637	0
<b>Total</b>	0628	<b>1.318</b>	0638	<b>42.110</b>	1628	<b>1.354</b>	1638	<b>45.955</b>	2628	<b>3.956</b>	2638	<b>315.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>	0639	<b>29,02</b>	0649		1639	<b>30,33</b>	1649		2639	<b>61,85</b>	2649	

S.05.1

**Denominación Fondo:** AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados:** NO

**Fecha:** 30/06/2020

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

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 31/10/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,69	1650	0,71	2650	3,98
Tipo de interés nominal máximo	0651	3,50	1651	3,50	2651	5,75
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,10	1652	0,10	2652	2,22

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO F**

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 31/10/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	95	0683	3.436	1660	103	1683	3.731	2660	289	2683	25.632
Aragón	0661		0684		1661		1684		2661	0	2684	0
Asturias	0662		0685		1662		1685		2662	0	2685	0
Baleares	0663		0686		1663		1686		2663	0	2686	0
Canarias	0664		0687		1664		1687		2664	0	2687	0
Cantabria	0665		0688		1665		1688		2665	0	2688	0
Castilla-León	0666		0689		1666		1689		2666	0	2689	0
Castilla La Mancha	0667		0690		1667		1690		2667	159	2690	11.586
Cataluña	0668		0691		1668		1691		2668	0	2691	0
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	0
Extremadura	0670		0693		1670		1693		2670	0	2693	0
Galicia	0671		0694		1671		1694		2671	0	2694	0
Madrid	0672		0695		1672		1695		2672	5	2695	455
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	832	0697	26.572	1674	852	1697	29.023	2674	2.162	2697	171.600
Navarra	0675		0698		1675		1698		2675	0	2698	0
La Rioja	0676		0699		1676		1699		2676	0	2699	0
Comunidad Valenciana	0677	391	0700	12.103	1677	399	1700	13.201	2677	1.341	2700	105.727
País Vasco	0678		0701		1678		1701		2678	0	2701	0
<b>Total España</b>	0679	<b>1.318</b>	0702	<b>42.110</b>	1679	<b>1.354</b>	1702	<b>45.955</b>	2679	<b>3.956</b>	2702	<b>315.000</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>1.318</b>	0705	<b>42.110</b>	1682	<b>1.354</b>	1705	<b>45.955</b>	2682	<b>3.956</b>	2705	<b>315.000</b>

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

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

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 30/06/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 31/10/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	3,79			1710	3,61			2710	1,13		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO A**

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2020			Situación cierre anual anterior 31/12/2019			Situación inicial 31/10/2006					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Principal pendiente		Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0312272000	A	3.031	13.240	40.130	3.031	14.357	43.516	3.031	100.000	303.100			
ES0312272018	B	81	27.562	2.233	81	31.256	2.532	81	100.000	8.100			
ES0312272026	C	38	27.562	1.047	38	31.256	1.188	38	100.000	3.800			
<b>Total</b>		0723	3.150	0724	43.410	1723	3.150	1724	47.235	2723	3.150	2724	315.000



S.05.2

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO B**

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado							
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739					
ES0312272000	A	NS	EURIBOR 3 MESES	0,14	0	0	0	SI	40.130	0	40.130						
ES0312272018	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,33	0	0	0	SI	2.233	0	2.233						
ES0312272026	C	S	EURIBOR 3 MESES	0,56	0,22	1	0	SI	1.047	0	1.048						
<b>Total</b>						0740	1	0741	0	0743	43.410	0744	0	0745	43.411	0746	

	Situación actual 30/06/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 31/10/2006			
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0	0748	0,01	0749	3,83

<b>S.05.2</b>
<b>Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Periodo de la declaración: 30/06/2020</b>
<b>Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF</b>

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO C**

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2020								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2019							
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								
ES0312272000	A	1.370	262.970	0	36.040	2.107	255.729	0	36.040								
ES0312272018	B	299	5.867	0	1.407	117	5.465	0	1.407								
ES0312272026	C	140	2.753	1	749	55	2.564	1	746								
<b>Total</b>		0754	1.809	0755	271.590	0756	1	0757	38.196	1754	2.279	1755	263.757	1756	1	1757	38.194

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO D**

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/06/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 31/10/2006
				0762	0763	0764
ES0312272000	A	15/02/2017	FCH	A+	A+	AAA
ES0312272000	A	20/03/2018	SYP	AA-	AA-	AAA
ES0312272018	B	15/02/2017	FCH	BBB+	BBB+	A+
ES0312272018	B	25/07/2018	SYP	BBB	BBB	A
ES0312272026	C	12/02/2018	FCH	BBB-	BBB-	BBB
ES0312272026	C	28/11/2014	SYP	B-	B-	BBB

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO E**

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente				
	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 31/10/2006
Inferior a 1 año	0765		1765	0	2765
Entre 1 y 2 años	0766	40.130	1766		2766
Entre 2 y 3 años	0767	3.280	1767		2767
Entre 3 y 4 años	0768		1768	47.235	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>43.410</b>	<b>1772</b>	<b>47.235</b>	<b>2772</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>0773</b>	<b>1,74</b>	<b>1773</b>	<b>0</b>	<b>2773</b>
					<b>315.000</b>
					<b>6,09</b>

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 31/10/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	1.575	1775	1.563	2775	1.922
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	1.575	1776	1.575	2776	1.922
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	3,63	1777	3,31	2777	0
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783	Notas Explicativas	2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	92,44	1792	92,13	2792	96,22
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

<b>S.05.3</b>
<b>Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/06/2020</b>

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO B**

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características
Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/06/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 31/10/2006	
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806

AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Permuta 1	CECABANK S.A	TRIMESTRAL	El producto, en función de los días efectivamente transcurridos y en base 360, del Importe Nocial del Contrato de Swap definido anteriormente , por el Factor de Cálculo para el Swap. El Factor de Cálculo para el Swap será la media de los EURIBOR 12 meses obtenidos en doce meses precedentes al inicio del Período de Cálculo, aplicando las ponderaciones que se indican en el Contrato de Swap.El producto, en función de los días efectivamente transcurridos y en base 360, del Importe Nocial del Contrato de Swap definido anteriormente , por el Factor de Cálculo para el Swap. El Factor de Cálculo para el Swap será la media de los EURIBOR 12 meses obtenidos en doce meses precedentes al inicio del Período de Cálculo, aplicando las ponderaciones que se indican en el	Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de los Préstamos Hipotecarios No Fallidos	Es el resultado de multiplicar el Importe Nocial del Contrato de Swap por el Tipo de Interés de Referencia establecido para cada Fecha de Pago,ajustado por un margen de -0,05% .	Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de los Préstamos Hipotecarios No Fallidos	-174	-208	-6.475	
-----------	--------------	------------	--	--	---	--	------	------	--------	--

**AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA**

			Contrato de Swap.										
<b>Total</b>							0808	-174	0809	-208	0810	-6.475	



S.05.3

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO B**

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 31/10/2006		Situación actual 30/06/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 31/10/2006			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
<b>Total</b>	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

**INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO**

**CUADRO A**

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/06/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación actual 30/06/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Última Fecha Pago							
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	3	7002	0	7003	320	7006	318	7009	2,27	7012	2,20	7015	2,27		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	320	7008	318	7011	2,27	7014	2,20	7017	319.632	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	292	7024	300	7027	1,63	7030	1,75	7033	1,63		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	292	7026	300	7029	1,63	7032	1,75	7035	1,63	7036	FOLLETO INFORMA TIVO. NOTA DE VALORES. APARTAD O 4.9.3

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Última Fecha Pago		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

**INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO**

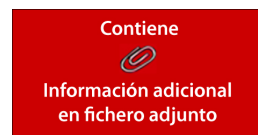
**CUADRO B**

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
<b>Amortización secuencial: series</b>	0854	0858	1858	2858
d) el SALDO VIVO DE LOS ACTIVOS NO FALLIDOS CON MÁS DE 90 DÍAS DE IMPAGO sea superior al % establecido para cada ISIN del SALDO VIVO DE ACTIVOS NO FALLIDOS	1,50	0,65	0,53	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.3
d) el SALDO VIVO DE LOS ACTIVOS NO FALLIDOS CON MÁS DE 90 DÍAS DE IMPAGO sea superior al % establecido para cada ISIN del SALDO VIVO DE ACTIVOS NO FALLIDOS	1,50	0,65	0,53	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.3
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series</b>	0855	0859	1859	2859
El Saldo acumuladode los Activos Fallidos represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo Inicial a la constitución del Fondo	6,70	0,38	0,38	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.6.1
El Saldo acumuladode los Activos Fallidos represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo Inicial a la constitución del Fondo	4,60	0,38	0,38	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.6.2
<b>No Reducción del Fondo de Reserva</b>	0856	0860	1860	2860
a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera superior al porcentaje recogido del Saldo Vivo de los Activos que no tengan la consideración de Activos Fallidos	1	2,31	2,12	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.2
<b>OTROS TRIGGERS</b>	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

**CUADRO C**

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



S.05.5

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO A**

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

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

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

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

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

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

S.06

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2020

**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**