

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8653
NIF Fondo: V84981299
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: 30/06/2022

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 Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	261.678	1001	278.018
I. Activos financieros a largo plazo	0002	261.678	1002	278.018
1. Activos titulizados	0003	261.678	1003	278.018
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	259.281	1005	275.237
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	2.398	1025	2.781
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	0	1027	0
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	

S.01

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	69.247	1041	75.537
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	44.004	1043	50.072
1. Activos titulizados	0044	44.004	1044	50.072
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	43.734	1046	49.936
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		1059	
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	219	1065	91
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	1	1066	2
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	48	1067	41
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	2	1068	3
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	0	1069	0
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082		1082	0
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084		1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	25.243	1085	25.465
1. Tesorería	0086	25.243	1086	25.465
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	330.926	1088	353.555

S.01

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	282.002	1089	301.395
I. Provisiones a largo plazo	0090		1090	
1. Provisión garantías financieras	0091		1091	
2. Provisión por margen de intermediación	0092		1092	
3. Otras provisiones	0093		1093	
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	282.002	1094	301.395
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	261.759	1095	280.730
1.1 Series no subordinadas	0096	179.559	1096	198.530
1.2 Series subordinadas	0097	82.200	1097	82.200
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	14.013	1101	11.946
2.1 Préstamo subordinado	0102	14.552	1102	15.505
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	-540	1105	-3.559
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	6.211	1108	8.698
3.1 Derivados de cobertura	0109	6.211	1109	8.698
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	20	1112	21
4.1 Garantías financieras	0113	20	1113	21
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

S.01

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
B) PASIVO CORRIENTE	0117	55.134	1117	60.858
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	
V. Provisiones a corto plazo	0119		1119	
1. Provisión garantías financieras	0120		1120	
2. Provisión por margen de intermediación	0121		1121	
3. Otras provisiones	0122		1122	
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	55.119	1123	60.811
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	54.601	1124	56.345
1.1 Series no subordinadas	0125	54.597	1125	56.345
1.2 Series subordinadas	0126		1126	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	3	1128	
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	9	1131	3.981
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	1132	3.973
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	9	1136	9
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	509	1139	485
3.1 Derivados de cobertura	0140	509	1140	485
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	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	15	1148	46
1. Comisiones	0149	15	1149	17
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	13	1150	15
1.2 Comisión administrador	0151	432	1151	927
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	1152	2
1.4 Comisión variable	0153	1.807	1153	1.807
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-2.238	1155	-2.734
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	0	1157	29
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-6.211	1158	-8.698
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-6.211	1160	-8.698
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	330.926	1162	353.555

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2022		Acumulado anterior 30/06/2021
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	733	1201	503	2201	1.934	3201	1.054
1.1 Activos titulizados	0202	733	1202	503	2202	1.934	3202	1.054
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203		3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-14	1204	-12	2204	-23	3204	-23
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-3	1205	0	2205	-3	3205	
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-11	1206	-12	2206	-20	3206	-23
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-605	1208	-642	2208	-1.976	3208	-1.301
A) MARGEN DE INTERESES	0209	114	1209	-150	2209	-65	3209	-270
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216		3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-29	1217	-32	2217	-59	3217	-65
7.1 Servicios exteriores	0218	-1	1218	-1	2218	-3	3218	-3
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	-1	1222	-1	2222	-2	3222	-1
7.2 Tributos	0223	-1	1223	-1	2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-27	1224	-31	2224	-55	3224	-61
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-16	1225	-19	2225	-33	3225	-38
7.3.2 Comisión administrador	0226	-8	1226	-9	2226	-17	3226	-19
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-2	1227	-2	2227	-5	3227	-5
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228		3228	
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	848	1231	487	2231	3.639	3231	324
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	848	1232	487	2232	3.639	3232	324
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233		3233	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234	0	2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238		3238	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-933	1239	-305	2239	-3.515	3239	11
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241		3241	
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2022		Acumulado anterior 30/06/2021
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-1.294	1300	-169	2300	-750	3300	-435
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-753	1301	-139	2301	-164	3301	-358
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	602	1302	525	2302	1.807	3302	1.096
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	0	1303	0	2303	0	3303	0
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	-176	1304	-134	2304	-308	3304	-238
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-1.171	1305	-530	2305	-1.644	3305	-1.202
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	-9	1307	0	2307	-19	3307	-14
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-532	1309	-21	2309	-552	3309	-44
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-17	1310	-19	2310	-35	3310	-39
2.2 Comisión administrador	0311	-512	1311	0	2311	-512	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-3	1312	-2	2312	-5	3312	-5
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-9	1315	-9	2315	-34	3315	-34
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	-29	1320	-31	2320	-54	3320	-55
3.6 Otros cobros de explotación	0321	20	1321	22	2321	20	3321	21
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-1.615	1322	963	2322	528	3322	-806
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	2.012	1325	963	2325	5.454	3325	-487
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	5.630	1326	5.859	2326	11.405	3326	11.852
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	5.377	1327	4.927	2327	10.031	3327	9.042
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.032	1328	629	2328	4.736	3328	1.035
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	-10.027	1331	-10.452	2331	-20.718	3331	-22.416
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-3.627	1332	0	2332	-4.926	3332	-319
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	-3.627	1334	0	2334	-4.926	3334	-319
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336	0	2336	0	3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-2.909	1337	793	2337	-222	3337	-1.241
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	28.152	1338	26.524	2338	25.465	3338	28.558
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	25.243	1339	27.317	2339	25.243	3339	27.317

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2022		Acumulado anterior 30/06/2021
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	31	1357	623	2357	512	3357	503
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	31	1358	623	2358	512	3358	503
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	605	1360	642	2360	1.976	3360	1.301
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-635	1362	-1.265	2362	-2.487	3362	-1.804
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368		3368	
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369		3369	
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2022								Situación cierre anual anterior 31/12/2021								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	4,28	0401	3	0421	39	0441	5,31	1381	5,23	1401	4	1421	11	1441	4,66	2381	0,45	2401	0,05	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 Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados:

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	43	0467	15	0474	1	0481		0488	16	0495	3.659	0502	1	0509	3.677
De 1 a 3 meses	0461	20	0468	16	0475	1	0482	0	0489	17	0496	1.710	0503	1	0510	1.728
De 3 a 6 meses	0462	8	0469	15	0476	1	0483	0	0490	16	0497	857	0504		0511	873
De 6 a 9 meses	0463	7	0470	5	0477	1	0484	0	0491	7	0498	701	0505		0512	708
De 9 a 12 meses	0464	2	0471	7	0478	0	0485	0	0492	7	0499	224	0506		0513	232
Más de 12 meses	0465	7	0472	24	0479	0	0486	1	0493	25	0500	497	0507		0514	522
Total	0466	87	0473	84	0480	3	0487	2	0494	89	0501	7.650	0508	2	1515	7.740

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	43	0522	15	0529	1	0536		0543	16	0550	3.659	0557	1	0564	3.677	0571	7.827	0578		0584	46,98
De 1 a 3 meses	0516	20	0523	16	0530	1	0537	0	0544	17	0551	1.710	0558	1	0565	1.728	0572	4.208	0579		0585	41,06
De 3 a 6 meses	0517	8	0524	15	0531	1	0538	0	0545	16	0552	857	0559		0566	873	0573	1.722	0580		0586	50,73
De 6 a 9 meses	0518	7	0525	5	0532	1	0539	0	0546	7	0553	701	0560		0567	708	0574	1.535	0581		0587	46,13
De 9 a 12 meses	0519	2	0526	7	0533	0	0540	0	0547	7	0554	224	0561		0568	232	0575	482	0582		0588	48,02
Más de 12 meses	0520	7	0527	24	0534	0	0541	1	0548	25	0555	497	0562		0569	522	0576	1.747	0583		0589	29,91
Total	0521	87	0528	84	0535	3	0542	2	0549	89	0556	7.650	0563	2	0570	7.740	0577	17.521			0590	44,18

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 06/02/2007	
Inferior a 1 año	0600	302	1600	331	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	676	1601	754	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.822	1602	1.328	2602	128
Entre 3 y 4 años	0603	2.881	1603	3.113	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	2.814	1604	3.339	2604	662
Entre 5 y 10 años	0605	39.785	1605	38.830	2605	12.036
Superior a 10 años	0606	257.181	1606	280.300	2606	1.187.174
Total	0607	305.461	1607	327.994	2607	1.200.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	15	1608	15,41	2608	28,54

Antigüedad	Situación actual 30/06/2022					
	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 06/02/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	17,35	1609	16,87	2609	2,37

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				Situación inicial 06/02/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	2.337	0630	107.041	1620	2.342	1630	108.586	2620	1.162	2630	80.377
40% - 60%	0621	1.501	0631	151.878	1621	1.556	1631	156.791	2621	1.362	2631	161.140
60% - 80%	0622	352	0632	46.542	1622	475	1632	62.617	2622	1.733	2632	249.238
80% - 100%	0623		0633		1623		1633		2623	4.191	2633	709.245
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624	0	2634	0
120% - 140%	0625		0635		1625		1635		2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627	0	2637	0
Total	0628	4.190	0638	305.461	1628	4.373	1638	327.994	2628	8.448	2638	1.200.000
Media ponderada (%)	0639	44,48	0649		1639	45,69	1649		2639	77,49	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 06/02/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,57	1650	0,51	2650	4
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,50	1651	4,50	2651	6,95
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,01	1652	0,01	2652	2,75

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				Situación inicial 06/02/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	9	0683	668	1660	9	1683	714	2660	119	2683	19.950
Aragón	0661	64	0684	5.567	1661	66	1684	5.813	2661	152	2684	24.802
Asturias	0662	8	0685	524	1662	8	1685	546	2662	9	2685	1.312
Baleares	0663	4	0686	326	1663	4	1686	337	2663	5	2686	881
Canarias	0664	1	0687	22	1664	1	1687	23	2664	1	2687	142
Cantabria	0665	1	0688	106	1665	2	1688	111	2665	15	2688	1.989
Castilla-León	0666	259	0689	16.984	1666	274	1689	18.210	2666	424	2689	50.838
Castilla La Mancha	0667	73	0690	6.205	1667	76	1690	6.643	2667	140	2690	21.455
Cataluña	0668	636	0691	53.476	1668	655	1691	56.683	2668	1.116	2691	178.944
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	0
Extremadura	0670		0693		1670		1693		2670	1	2693	55
Galicia	0671	36	0694	2.971	1671	38	1694	3.202	2671	52	2694	7.254
Madrid	0672	1.006	0695	77.304	1672	1.054	1695	83.720	2672	2.206	2695	319.173
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	7	0697	556	1674	7	1697	574	2674	11	2697	1.582
Navarra	0675	11	0698	533	1675	12	1698	556	2675	28	2698	3.337
La Rioja	0676	31	0699	2.157	1676	36	1699	2.418	2676	67	2699	9.161
Comunidad Valenciana	0677	130	0700	10.299	1677	131	1700	10.952	2677	228	2700	33.745
País Vasco	0678	1.914	0701	127.762	1678	2.000	1701	137.493	2678	3.874	2701	525.380
Total España	0679	4.190	0702	305.461	1679	4.373	1702	327.994	2679	8.448	2702	1.200.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	4.190	0705	305.461	1682	4.373	1705	327.994	2682	8.448	2705	1.200.000

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2022
Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				Situación inicial 06/02/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,81			1710	0,77			2710	0,33		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2022			Situación cierre anual anterior 31/12/2021			Situación inicial 06/02/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0370154009	A	11.178	20.948	234.156	11.178	22.801	254.875	11.178	100.000	1.117.800			
ES0370154017	B	582	100.000	58.200	582	100.000	58.200	582	100.000	58.200			
ES0370154025	C	240	100.000	24.000	240	100.000	24.000	240	100.000	24.000			
Total		0723	12.000	0724	316.356	1723	12.000	1724	337.075	2723	12.000	2724	1.200.000

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado	0738	0739					
			0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736			0737				
ES0370154009	A	NS	EURIBOR 3 MESES	0,13	0	0	0	SI	234.156	0	234.156						
ES0370154017	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,28	0	0	0	SI	58.200	0	58.200						
ES0370154025	C	S	EURIBOR 3 MESES	0,50	0,07	3	0	SI	24.000	0	24.003						
Total						0740	3	0741	0	0743	316.356	0744	0	0745	316.360	0746	

	Situación actual 30/06/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	Situación inicial 06/02/2007
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0	0748
			0749
			4,04

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2022
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2022								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2021							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0370154009	A	10.027	883.644	0	141.500	10.452	842.539	0	141.500								
ES0370154017	B	0	0	0	9.463	0	0	0	9.463								
ES0370154025	C	0	0	0	4.575	0	0	0	4.575								
Total		0754	10.027	0755	883.644	0756		0757	155.538	1754	10.452	1755	842.539	1756		1757	155.538

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2022

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 30/06/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	Situación inicial 06/02/2007
				0762	0763	0764
ES0370154009	A	10/12/2018	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0370154009	A	25/07/2018	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0370154017	B	29/07/2021	FCH	A+	A+	A
ES0370154017	B	23/03/2021	SYP	AA-	AA-	A
ES0370154025	C	24/04/2020	FCH	B-	B-	BBB
ES0370154025	C	23/03/2021	SYP	B+	B+	BBB

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2022

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 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 06/02/2007	
Inferior a 1 año	0765	0	1765	0	2765	
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	
Entre 3 y 4 años	0768	234.156	1768	254.875	2768	
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769	
Entre 5 y 10 años	0770	82.200	1770	82.200	2770	1.117.800
Superior a 10 años	0771		1771		2771	82.200
Total	0772	316.356	1772	337.075	2772	1.200.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	3,98	1773	4,76	2773	9,31

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 06/02/2007	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	14.552	1775	15.505	2775	27.600
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	14.552	1776	15.505	2776	27.600
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	4,60	1777	4,60	2777	2
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783	Notas Explicativas	2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	74,02	1792	75,61	2792	93,15
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 Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

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 30/06/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	Situación inicial 06/02/2007	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Permuta 1	BANCO SANTANDER	Trimestral	la suma de los intereses devengados, vencidos e ingresados al Fondo durante el Periodo de Liquidación que vence de los Activos, disminuida en el importe de los Intereses Corridos que, en su caso, hubiere pagado el Fondo durante el mismo Periodo de Liquidación, entre el Importe Nominal, multiplicado por 360 y dividido por los días efectivos existentes en dicho Periodo de Liquidación	Para cada uno de los Préstamos Hipotecarios sobre los que se hayan satisfecho los intereses ordinarios y de demora percibidos por el Fondo durante el Periodo de Liquidación la división entre (i) las sumas percibidas por el Fondo en concepto de intereses ordinarios y de demora en cada uno de los Préstamos Hipotecarios, entre (ii) el tipo anual de interés aplicado en el correspondiente Préstamo Hipotecario. El resultado de ese cociente será el Importe Nocional Individual de cada Préstamo Hipotecario.	Tipo de Interés de Referencia de los Bonos fijado para el correspondiente Periodo de Devengo de Intereses de los Bonos más un margen del 0,40 %	Para cada uno de los Préstamos Hipotecarios sobre los que se hayan satisfecho los intereses ordinarios y de demora percibidos por el Fondo durante el Periodo de Liquidación la división entre (i) las sumas percibidas por el Fondo en concepto de intereses ordinarios y de demora en cada uno de los Préstamos Hipotecarios, entre (ii) el tipo anual de interés aplicado en el correspondiente Préstamo Hipotecario. El resultado de ese cociente será el Importe Nocional Individual de cada Préstamo Hipotecario.	-6.719	-9.183	-89.853	
Total							0808 -6.719	0809 -9.183	0810 -89.853	

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

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 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 06/02/2007		Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 06/02/2007			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812	0	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	0	1844	0	2844	0		
Total	0827	0	1827	0	2827	0	0845		1845		2845		3845	

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

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 30/06/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	Situación actual 30/06/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	Última Fecha Pago							
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	11.537	7006	16.161	7009	4,25	7012	5,12	7015	4,34		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	11.537	7008	16.161	7011	4,25	7014	5,12	7017	11.537.330	7018	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	11.482	7024	16.116	7027	3,46	7030	4,25	7033	3,61		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	11.482	7026	16.116	7029	3,46	7032	4,25	7035	3,61	7036	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	Última Fecha Pago		
	0850	1850	2850	3850	
	0851	1851	2851	3851	
	0852	1852	2852	3852	
	0853	1853	2853	3853	

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

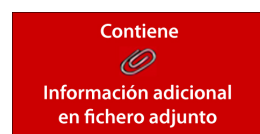
CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
Si en la Fecha de Determinación correspondiente a la Fecha de Pago en curso, el importe a que ascienda el Saldo Vivo de los Activos con morosidad que presenten más de tres (3) meses de retraso en el pago de los importes vencidos es superior al % establecido	1	4,34	4,40	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)
Si en la Fecha de Determinación correspondiente a la Fecha de Pago en curso, el importe a que ascienda el Saldo Vivo de los Activos con morosidad que presenten más de tres (3) meses de retraso en el pago de los importes vencidos es superior al % establecido	0,75	4,34	4,40	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
El valor nominal agregado de los Activos Fallidos desde la Fecha de Constitución represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del valor nominal de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo.	10,71	5,85	5,85	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6.1.B
El valor nominal agregado de los Activos Fallidos desde la Fecha de Constitución represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del valor nominal de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo.	7,12	5,85	5,85	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6.1.B
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera superior al porcentaje recogido del Saldo Vivo de los Activos que no tengan la consideración de Activos Fallidos.	1	0,84	0,76	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.1
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



S.05.5

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

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	0,020	4862	0	5862	0	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	KUTXABANK	1863	0	2863	Días del mes /Base 365	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 Kutxa Hipotecario II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2022

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	S
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	N
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Kutxabank
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo adicional 3.7.2

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo											Total	
		31/03/2022	30/06/2022											
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872													
Margen de intereses	0873	-179	114											-65
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	2.791	848											3.639
Dotaciones a provisiones (neto)	0875													0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876													0
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-30	-29											-59
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	2.582	933	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	3.515
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879													0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880	-2.582	-933											-3.515
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881													0
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Comisión variable pagada	0883													0
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884													0

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

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 Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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