

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT HIPOTECARIO MIXTO II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 6056
NIF Fondo: V84040286
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento: 6056
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2018

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	38.977	1001	35.710
I. Activos financieros a largo plazo	0002	38.977	1002	35.710
1. Activos titulizados	0003	38.977	1003	35.710
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	38.866	1004	35.553
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005		1005	
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	333	1025	366
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-222	1027	-209
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	8.525	1041	15.301
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	5.231	1043	11.801
1. Activos titulizados	0044	5.231	1044	11.801
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	5.176	1045	11.743
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046		1046	0
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	10	1065	12
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	3	1066	2
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	125	1067	100
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	2	1068	2
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-85	1069	-58
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082		1082	
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084		1084	
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	3.294	1085	3.500
1. Tesorería	0086	3.294	1086	3.500
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	47.502	1088	51.012

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	42.192	1089	39.163
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	42.192	1094	39.163
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	39.037	1095	35.770
1.1 Series no subordinadas	0096	22.337	1096	19.070
1.2 Series subordinadas	0097	16.700	1097	16.700
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101	2.884	1101	2.884
2.1 Préstamo subordinado	0102	2.884	1102	2.884
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	0	1105	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	271	1108	509
3.1 Derivados de cobertura	0109	271	1109	509
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	
4.1 Garantías financieras	0113		1113	
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) PASIVO CORRIENTE	0117	5.581	1117	12.358
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	5.556	1123	12.333
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	5.487	1124	12.250
1.1 Series no subordinadas	0125	5.484	1125	12.247
1.2 Series subordinadas	0126		1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	3	1128	3
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	3	1131	3
2.1 Préstamo subordinado	0132		1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	1	1136	1
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	3	1137	3
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	1	1139	2
3.1 Derivados de cobertura	0140	1	1140	2
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	65	1143	79
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	5	1144	1
4.2 Garantías financieras	0145	60	1145	78
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	25	1148	24
1. Comisiones	0149	12	1149	7
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	1	1150	1
1.2 Comisión administrador	0151	3	1151	2
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	8	1153	7
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	-4
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	13	1157	18
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-271	1158	-509
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-271	1160	-509
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	47.502	1162	51.012

S.02

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2018		Acumulado anterior 30/06/2017
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	109	1201	168	2201	207	3201	406
1.1 Activos titulizados	0202	91	1202	168	2202	189	3202	406
1.2 Otros activos financieros	0203	18	1203	0	2203	18	3203	
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-28	1204	-28	2204	-56	3204	-57
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-24	1205	-24	2205	-48	3205	-48
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-4	1206	-4	2206	-8	3206	-8
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-10	1208	-68	2208	-22	3208	-168
A) MARGEN DE INTERESES	0209	71	1209	71	2209	129	3209	182
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216	0	3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-16	1217	-87	2217	-84	3217	-282
7.1 Servicios exteriores	0218	4	1218	-1	2218	-28	3218	-1
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-2	1219	0	2219	-27	3219	0
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	6	1222	0	2222	-1	3222	-1
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-19	1224	-86	2224	-56	3224	-280
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-7	1225	-7	2225	-15	3225	-14
7.3.2 Comisión administrador	0226	-1	1226	-2	2226	-2	3226	-3
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227	0	3227	-1
7.3.4 Comisión variable	0228	-11	1228	-76	2228	-39	3228	-262
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	-40	1231	-101	2231	-40	3231	-16
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-40	1232	-101	2232	-40	3232	-16
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	-15	1239	116	2239	-4	3239	116
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241		3241	
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

S.03

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2018		Acumulado anterior 30/06/2017
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	42	1300	-7	2300	28	3300	19
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	55	1301	83	2301	115	3301	186
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	93	1302	179	2302	190	3302	416
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-21	1303	-24	2303	-44	3303	-49
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	31	1304	405	2304	62	3304	386
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-42	1305	-474	2305	-85	3305	-557
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	-6	1307	-3	2307	-8	3307	-10
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-12	1309	-85	2309	-55	3309	-162
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-7	1310	-7	2310	-15	3310	-15
2.2 Comisión administrador	0311	-1	1311	-1	2311	-1	3311	-4
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	-1
2.4 Comisión variable	0313	-3	1313	-76	2313	-38	3313	-142
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-1	1315	-5	2315	-32	3315	-6
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	-1	1320	-5	2320	-411	3320	-6
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	379	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	13	1322	-46	2322	-234	3322	-354
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulación	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	13	1325	-46	2325	-234	3325	-354
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	748	1326	1.452	2326	1.744	3326	2.931
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	307	1327	697	2327	568	3327	1.818
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	587	1328	322	2328	950	3328	671
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	-1.629	1331	-2.517	2331	-3.496	3331	-5.774
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332	0	2332	0	3332	0
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336	0	2336	0	3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	55	1337	-53	2337	-206	3337	-335
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	3.239	1338	3.566	2338	3.500	3338	3.849
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	3.294	1339	3.514	2339	3.294	3339	3.514

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2018		Acumulado anterior 30/06/2017
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	46	1357	2.332	2357	216	3357	2.632
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	46	1358	2.332	2358	216	3358	2.632
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	10	1360	68	2360	22	3360	168
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-56	1362	-2.401	2362	-238	3362	-2.799
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 Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2018								Situación cierre anual anterior 31/12/2017								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380	1,03	0400	0	0420	0	0440	19,03	1380	0,98	1400	0	1420	0	1440	19,68	2380	0	2400	0	2420	0	2440	0
Certificados de transmisión de hipoteca	0381		0401		0421		0441		1381		1401		1421		1441		2381		2401		2421		2441	
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH
Denominación del compartimento: 6056
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK A14010342 BANKIA, S.A A08663619 CAIXABANK, S.A. A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	68	0467	13	0474	2	0481		0488	15	0495	1.876	0502	0	0509	1.891
De 1 a 3 meses	0461	5	0468	5	0475	0	0482		0489	6	0496	241	0503	0	0510	247
De 3 a 6 meses	0462	2	0469	5	0476	0	0483	0	0490	5	0497	3	0504		0511	8
De 6 a 9 meses	0463		0470		0477		0484		0491		0498		0505		0512	
De 9 a 12 meses	0464	2	0471	5	0478	0	0485	0	0492	5	0499	87	0506		0513	93
Más de 12 meses	0465	8	0472	116	0479	1	0486	14	0493	131	0500	242	0507		0514	374
Total	0466	85	0473	144	0480	4	0487	14	0494	162	0501	2.450	0508	0	1515	2.613

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	68	0522	13	0529	2	0536		0543	15	0550	1.876	0557	0	0564	1.891	0571	6.306	0578		0584	30
De 1 a 3 meses	0516	5	0523	5	0530	0	0537		0544	6	0551	241	0558	0	0565	247	0572	979	0579		0585	25,18
De 3 a 6 meses	0517	2	0524	5	0531	0	0538	0	0545	5	0552	3	0559		0566	8	0573	290	0580		0586	2,79
De 6 a 9 meses	0518		0525		0532		0539		0546		0553		0560		0567		0574		0581		0587	
De 9 a 12 meses	0519	2	0526	5	0533	0	0540	0	0547	5	0554	87	0561		0568	93	0575	218	0582		0588	42,60
Más de 12 meses	0520	8	0527	116	0534	1	0541	14	0548	131	0555	242	0562		0569	374	0576	1.114	0583		0589	33,53
Total	0521	85	0528	144	0535	4	0542	14	0549	162	0556	2.450	0563	0	0570	2.613	0577	8.907			0590	29,33

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 29/06/2004	
Inferior a 1 año	0600	137	1600	212	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	368	1601	294	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	489	1602	589	2602	86
Entre 3 y 4 años	0603	1.316	1603	729	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	2.860	1604	2.768	2604	838
Entre 5 y 10 años	0605	19.682	1605	17.869	2605	14.134
Superior a 10 años	0606	19.649	1606	25.303	2606	369.442
Total	0607	44.500	1607	47.763	2607	384.500
Vida residual media ponderada (años)	0608	10,31	1608	10,67	2608	21,48

Antigüedad	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 29/06/2004	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	15,88	1609	15,39	2609	2

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 29/06/2004			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.132	0630	34.759	1620	1.151	1630	35.579	2620	777	2630	36.127
40% - 60%	0621	169	0631	9.741	1621	218	1631	12.183	2621	1.332	2631	96.620
60% - 80%	0622		0632		1622		1632		2622	3.072	2632	251.753
80% - 100%	0623		0633		1623		1633		2623	0	2633	0
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624	0	2634	0
120% - 140%	0625		0635		1625		1635		2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627	0	2637	0
Total	0628	1.301	0638	44.500	1628	1.369	1638	47.763	2628	5.181	2638	384.500
Media ponderada (%)	0639	30,02	0649		1639	31,10	1649		2639	62,86	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 29/06/2004	
Tipo de interés medio ponderado	0650	1,28	1650	1,45	2650	3,51
Tipo de interés nominal máximo	0651	7,50	1651	7,50	2651	7,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,02	1652	0,02	2652	2,25

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH
Denominación del compartimento: 6056
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK A14010342 BANKIA, S.A A08663619 CAIXABANK, S.A. A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 29/06/2004			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	494	0683	10.633	1660	533	1683	11.654	2660	3.245	2683	184.466
Aragón	0661	90	0684	3.526	1661	92	1684	3.722	2661	179	2684	15.709
Asturias	0662		0685		1662		1685		2662	0	2685	0
Baleares	0663		0686		1663		1686		2663	0	2686	0
Canarias	0664		0687		1664		1687		2664	0	2687	0
Cantabria	0665	12	0688	456	1665	12	1688	477	2665	28	2688	2.776
Castilla-León	0666	143	0689	5.639	1666	148	1689	6.061	2666	329	2689	31.493
Castilla La Mancha	0667	9	0690	349	1667	10	1690	420	2667	64	2690	5.774
Cataluña	0668	5	0691	158	1668	5	1691	165	2668	48	2691	3.382
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	0
Extremadura	0670	2	0693	78	1670	2	1693	83	2670	38	2693	2.784
Galicia	0671		0694		1671		1694		2671	0	2694	0
Madrid	0672	77	0695	3.795	1672	80	1695	4.014	2672	226	2695	26.233
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	3	2696	249
Murcia	0674		0697		1674		1697		2674	0	2697	0
Navarra	0675	2	0698	99	1675	2	1698	104	2675	4	2698	776
La Rioja	0676	124	0699	4.926	1676	131	1699	5.283	2676	259	2699	29.374
Comunidad Valenciana	0677	1	0700	2	1677	1	1700	2	2677	5	2700	328
País Vasco	0678	342	0701	14.841	1678	353	1701	15.777	2678	753	2701	81.156
Total España	0679	1.301	0702	44.500	1679	1.369	1702	47.763	2679	5.181	2702	384.500
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	1.301	0705	44.500	1682	1.369	1705	47.763	2682	5.181	2705	384.500

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH
Denominación del compartimento: 6056
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK A14010342 BANKIA, S.A A08663619 CAIXABANK, S.A. A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 29/06/2004			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	3,52			1710	3,40			2710	0,87		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2018			Situación cierre anual anterior 31/12/2017			Situación inicial 29/06/2004					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0370151005	PH1	3.678	7.564	27.821	3.678	8.515	31.317	3.678	100.000	367.800			
ES0370151013	PH2	167	100.000	16.700	167	100.000	16.700	167	100.000	16.700			
Total		0723	3.845	0724	44.521	1723	3.845	1724	48.017	2723	3.845	2724	384.500

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados		Intereses impagados		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		0738	0739	
						0730	0731	0732	0733		0734	0735	0742	0736			0737
ES0370151005	PH1	NS	EURIBOR 3 MESES	0,17	0	0	0	0	SI	27.821	0	0	0	27.821			
ES0370151013	PH2	S	EURIBOR 3 MESES	0,90	0,57	3	0	0	SI	16.700	0	0	0	16.703			
Total						0740	3	0741	0		0743	44.521	0744	0	0745	44.524	0746

	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 29/06/2004	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,21	0748		0749	1,20

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2018								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2017							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0370151013	PH2	0	0	21	5.396	0	0	24	5.304								
ES0370151005	PH1	1.629	339.979	0	49.131	2.517	323.677	0	49.131								
Total		0754	1.629	0755	339.979	0756	21	0757	54.527	1754	2.517	1755	323.677	1756	24	1757	54.435

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/06/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 29/06/2004
				0760	0761	0762
ES0370151005	PH1	19/08/2014	FCH	AA+	AA+	AAA
ES0370151005	PH1	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa2	Aaa
ES0370151013	PH2	20/03/2018	FCH	A-	BBB+	BBB
ES0370151013	PH2	13/05/2013	MDY	Ba3	Ba3	Baa3

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 29/06/2004	
Inferior a 1 año	0765	0	1765		2765	
Entre 1 y 2 años	0766	44.521	1766	31.317	2766	
Entre 2 y 3 años	0767		1767	16.700	2767	
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769	
Entre 5 y 10 años	0770		1770		2770	367.800
Superior a 10 años	0771		1771		2771	16.700
Total	0772	44.521	1772	48.017	2772	384.500
Vida residual media ponderada (años)	0773	1,25	1773	1,80	2773	8,33

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 29/06/2004	
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	2.884	1775	2.884	2775	2.884
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	2.884	1776	2.884	2776	2.884
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	6,48	1777	6,01	2777	0
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783	Notas Explicativas	2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	62,49	1792	65,22	2792	95,66
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH
Denominación del compartimento: 6056
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2018

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características
Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/06/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 29/06/2004	
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806

AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Permuta 1	J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA	Trimestral	El Factor de Cálculo PH 1 En cada Fecha de Referencia, media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial de los préstamos cubiertos por el Contrato de Swap PH 1 que resetean en cada uno de los meses del año. Las Fechas de Referencia serán los 18 de cada mes. TIPO FLOOR es la diferencia, en caso de ser positiva, entre el tipo de interés mínimo deducido el margen y la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial del citado grupo de préstamos que resetean en cada uno de los meses del año.	El Importe Nocial del Contrato de Swap PH 1 Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones Hipotecarias cuyos Préstamos Hipotecarios subyacentes estén sometidos a revisión anual de sus tipos de interés. NOCIONAL FLOOR es el saldo vivo del grupo de préstamos con el mismo mínimo de tipo de interés	Tipo de Interés de Referencia de los Bonos establecido para cada Fecha de Pago, tal y como se define en el apartado II.10.1 del presente Folleto, más un spread de 0,20%. TIPO CAP es la diferencia, en caso de ser positiva, entre la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial del citado grupo de préstamos que resetean en cada uno de los meses del año y el tipo de interés máximo deducido el margen y minorado un 1%.	El Importe Nocial del Contrato de Swap PH 1 Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones Hipotecarias cuyos Préstamos Hipotecarios subyacentes estén sometidos a revisión anual de sus tipos de interés. NOCIONAL CAP sera el saldo vivo del grupo de préstamos con el mismo máximo de tipo de interés	-121	-183	-9.934	
-----------	---	------------	---	--	--	--	------	------	--------	--

AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Permuta 2	J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA	Trimestral	El Factor de Cálculo PH 2 En cada Fecha de Referencia, media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial de los préstamos cubiertos por el Contrato de Swap PH2 que resetean en cada uno de los meses del año. Las Fechas de Referencia? serán los 18 de cada mes.TIPO FLOOR es la diferencia, en caso de ser positiva, entre el tipo de interés mínimo deducido el margen y la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial del citado grupo de préstamos que resetean en cada uno de los meses del año."	El Importe Nocial del Contrato de Swap PH 2 Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones Hipotecarias cuyos Préstamos Hipotecarios subyacentes estén sometidos a revisión anual de sus tipos de interés. NOCIONAL FLOOR es el saldo vivo del grupo de préstamos con el mismo mínimo de tipo de interés	Tipo de Interés de Referencia de los Bonos establecido para cada Fecha de Pago, tal y como se define en el apartado II.10.1 del presente Folleto, más un spread de 0,20% TIPO CAP es la diferencia, en caso de ser positiva, entre la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial del citado grupo de préstamos que resetean en cada uno de los meses del año y el tipo de interés máximo deducido el margen y minorado un 1%.	El Importe Nocial del Contrato de Swap PH 2 Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones Hipotecarias cuyos Préstamos Hipotecarios subyacentes estén sometidos a revisión Semestral de sus tipos de interés. NOCIONAL CAP sera el saldo vivo del grupo de préstamos con el mismo máximo de tipo de interés	-129	-180	-6.249	
-----------	--	------------	---	--	---	--	------	------	--------	--

AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Permuta 5	J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA	Trimestral			En caso de que el Tipo Índice (IRPH) sea menor que el tipo Euribor a un (1) año más cuarenta (40) puntos básicos (0,40%), la Entidad de Contrapartida abona al Fondo, en cada Fecha de Pago, la diferencia. En caso de que el Tipo Índice de un mes sea igual o superior al Euribor a un (1) año más cuarenta (40) puntos básicos (0,40%), no se devengará cantidad alguna a favor del Fondo.	Saldo notional de los Préstamos referenciados al Tipo Índice, se entenderá por ?Tipo Índice? el IRPH publicado mensualmente por el Banco de España en su página web www.bde.es/tipos/tipos.htm .	-79	-148	-9.934			
Total							0808	-329	0809	-511	0810	-26.116

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)			Valor en libros (miles de euros)			Otras características	
	Situación actual 30/06/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 29/06/2004	Situación actual 30/06/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 29/06/2004		
Préstamos hipotecarios	0811	1811	2811	0829	1829	2829	3829	
Cédulas hipotecarias	0812	1812	2812	0830	1830	2830	3830	
Préstamos a promotores	0813	1813	2813	0831	1831	2831	3831	
Préstamos a PYMES	0814	1814	2814	0832	1832	2832	3832	
Préstamos a empresas	0815	1815	2815	0833	1833	2833	3833	
Préstamos corporativos	0816	1816	2816	0834	1834	2834	3834	
Cédulas territoriales	0817	1817	2817	0835	1835	2835	3835	
Bonos de tesorería	0818	1818	2818	0836	1836	2836	3836	
Deuda subordinada	0819	1819	2819	0837	1837	2837	3837	
Créditos AAPP	0820	1820	2820	0838	1838	2838	3838	
Préstamos consumo	0821	1821	2821	0839	1839	2839	3839	
Préstamos automoción	0822	1822	2822	0840	1840	2840	3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823	1823	2823	0841	1841	2841	3841	
Cuentas a cobrar	0824	1824	2824	0842	1842	2842	3842	
Derechos de crédito futuros	0825	1825	2825	0843	1843	2843	3843	
Bonos de titulización	0826	1826	2826	0844	1844	2844		
Total	0827	1827	2827	0845	1845	2845	3845	

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	141	7006	108	7009	1,03	7012	0,98	7015	1,07		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	141	7008	108	7011	1,03	7014	0,98	7017	141.337	7018	FOLLETO INFORMATIVO. CAPÍTULO V. APARTADO V.3.4.(a)
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	126	7024	96	7027	0,69	7030	0,56	7033	0,68		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	126	7026	96	7029	0,69	7032	0,56	7035	0,68	7036	FOLLETO INFORMATIVO. CAPÍTULO II. APARTADO II.3.2.1 (a)

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	1862	0	2862	Días del mes /Base 365	3862	0,030	4862	0	5862	0	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	CajaSol - El Monte	1863	0	2863	Días del mes /Días año	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Trimestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BANCO SANTANDER, S.A.	1864	0	2864	Días del mes /Base 365	3864	0	4864	0	5864	0	6864	Trimestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH
Denominación del compartimento: 6056
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2018

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

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

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total		
		20/03/2018	20/06/2018											
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885													
Saldo inicial	0886	2.884	2.884											
Cobros del periodo	0887	1.948	1.683											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-8	-10											
Pagos por derivados	0889	-12	-10											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-2.884	-2.884											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-1.890	-1.654											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-2	-6											
Resto pagos/retenciones	0893	0	0											
Saldo disponible	0894	36	3											
Liquidación de comisión variable	0895	36	3											

S.06

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - PH

Denominación del compartimento: 6056

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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