

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:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: SI
Fecha: 30/09/2018

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	37.497	1001	35.710
I. Activos financieros a largo plazo	0002	37.497	1002	35.710
1. Activos titulizados	0003	37.497	1003	35.710
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	37.381	1004	35.553
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005		1005	0
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	338	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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	20.707	1041	28.756
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	14.431	1043	22.276
1. Activos titulizados	0044	14.425	1044	22.268
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	5.105	1045	11.743
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	9.175	1046	10.464
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	11	1065	14
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	9	1066	4
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	757	1067	701
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	7	1068	7
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-637	1069	-664
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	5	1074	8
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	5	1077	8
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	6.276	1085	6.480
1. Tesorería	0086	6.276	1086	6.480
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	58.204	1088	64.467

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	40.580	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	40.580	1094	39.163
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	37.558	1095	35.770
1.1 Series no subordinadas	0096	20.858	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	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	139	1108	509
3.1 Derivados de cobertura	0109	139	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	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) PASIVO CORRIENTE	0117	17.854	1117	26.088
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	17.829	1123	26.059
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	14.706	1124	22.816
1.1 Series no subordinadas	0125	5.361	1125	12.247
1.2 Series subordinadas	0126	9.339	1126	10.563
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	5	1128	5
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	2.965	1131	2.866
2.1 Préstamo subordinado	0132	2.975	1132	2.975
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	-96	1135	-180
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	1	1136	1
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	85	1137	70
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	95	1139	280
3.1 Derivados de cobertura	0140	95	1140	280
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	64	1143	98
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	8	1144	1
4.2 Garantías financieras	0145	56	1145	97
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	24	1148	29
1. Comisiones	0149	17	1149	7
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	1	1150	1
1.2 Comisión administrador	0151	11	1151	9
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	75	1153	71
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-71	1155	-74
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	7	1157	22
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-231	1158	-785
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-231	1160	-785
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	58.204	1162	64.467

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2018		Acumulado anterior 30/09/2017
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	143	1201	544	2201	469	3201	1.151
1.1 Activos titulizados	0202	133	1202	544	2202	427	3202	1.151
1.2 Otros activos financieros	0203	10	1203	0	2203	42	3203	
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-49	1204	-53	2204	-147	3204	-160
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-40	1205	-44	2205	-120	3205	-133
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-9	1206	-9	2206	-27	3206	-27
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-29	1208	-355	2208	-92	3208	-647
A) MARGEN DE INTERESES	0209	65	1209	136	2209	229	3209	344
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	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-59	1217	-487	2217	-156	3217	-776
7.1 Servicios exteriores	0218	-1	1218	0	2218	-37	3218	-2
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	0	2219	-36	3219	-1
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	-1	3222	-1
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-57	1224	-486	2224	-119	3224	-773
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-10	1225	-10	2225	-29	3225	-29
7.3.2 Comisión administrador	0226	-1	1226	-2	2226	-4	3226	-6
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227	-1	3227	-1
7.3.4 Comisión variable	0228	-46	1228	-474	2228	-84	3228	-736
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	
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	0	1231	550	2231	15	3231	465
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	550	2232	15	3232	465
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	-6	1239	-199	2239	-87	3239	-33
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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2018		Acumulado anterior 30/09/2017
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-6	1300	-381	2300	44	3300	-330
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	57	1301	128	2301	209	3301	354
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	130	1302	554	2302	428	3302	1.176
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-40	1303	-41	2303	-113	3303	-130
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	35	1304	24	2304	98	3304	410
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-64	1305	-401	2305	-191	3305	-1.085
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	-3	1307	-8	2307	-12	3307	-18
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-52	1309	-606	2309	-113	3309	-773
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-10	1310	-10	2310	-30	3310	-29
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	-2	2311	-2	3311	-6
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	-1	3312	-1
2.4 Comisión variable	0313	-42	1313	-594	2313	-80	3313	-737
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	-1	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-10	1315	97	2315	-52	3315	90
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	-24	1320	0	2320	-464	3320	-8
3.6 Otros cobros de explotación	0321	14	1321	97	2321	412	3321	98
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-122	1322	238	2322	-248	3322	-336
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	-122	1325	238	2325	-248	3325	-336
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	748	1326	1.645	2326	2.628	3326	5.143
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	298	1327	14.432	2327	1.291	3327	17.098
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	817	1328	630	2328	2.154	3328	1.514
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	-1.984	1331	-16.468	2331	-6.321	3331	-24.091
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	-127	1337	-143	2337	-204	3337	-666
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	6.403	1338	6.436	2338	6.480	3338	6.959
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	6.276	1339	6.293	2339	6.276	3339	6.293

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2018		Acumulado anterior 30/09/2017
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	105	1357	-2.314	2357	462	3357	1.814
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	105	1358	-2.314	2358	462	3358	1.814
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	29	1360	355	2360	92	3360	647
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-134	1362	1.959	2362	-554	3362	-2.461
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368		3368	
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369		3369	
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2018								Situación cierre anual anterior 31/12/2017								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380	1,08	0400	0	0420	0	0440	2,77	1380		1400		1420		1440		2380	0	2400	0	2420	0	2440	0
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	6,42	0401	0	0421	0	0441	5,01	1381		1401		1421		1441		2381	0	2401	0	2421	0	2441	0
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382	0	2402	0	2422	0	2442	0
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383	0	2403	0	2423	0	2443	0
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384	0	2404	0	2424	0	2444	0
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385	0	2405	0	2425	0	2445	0
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386	0	2406	0	2426	0	2446	0
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387	0	2407	0	2427	0	2447	0
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388	0	2408	0	2428	0	2448	0
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389	0	2409	0	2429	0	2449	0
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390	0	2410	0	2430	0	2450	0
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391	0	2411	0	2431	0	2451	0
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392	0	2412	0	2432	0	2452	0
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393	0	2413	0	2433	0	2453	0
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394	0	2414	0	2434	0	2454	0
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395	0	2415	0	2435	0	2455	0
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396	0	2416	0	2436	0	2456	0
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397	0	2417	0	2437	0	2457	0
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398	0	2418	0	2438	0	2458	0
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399	0	2419	0	2439	0	2459	0

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

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

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	177	0467	40	0474	9	0481	0	0488	48	0495	5.188	0502	0	0509	5.237
De 1 a 3 meses	0461	3	0468	3	0475	1	0482	0	0489	3	0496	128	0503	0	0510	131
De 3 a 6 meses	0462	3	0469	4	0476	0	0483	0	0490	4	0497	93	0504	0	0511	98
De 6 a 9 meses	0463	0	0470	0	0477	0	0484	0	0491	0	0498	0	0505	0	0512	0
De 9 a 12 meses	0464	0	0471	0	0478	0	0485	0	0492	0	0499	0	0506	0	0513	0
Más de 12 meses	0465	19	0472	263	0479	6	0486	79	0493	348	0500	735	0507	0	0514	1.082
Total	0466	202	0473	309	0480	16	0487	79	0494	404	0501	6.144	0508	0	1515	6.548

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	177	0522	40	0529	9	0536	0	0543	48	0550	5.188	0557	0	0564	5.237	0571	16.641	0578	9.477	0584	31,47
De 1 a 3 meses	0516	3	0523	3	0530	1	0537	0	0544	3	0551	128	0558	0	0565	131	0572	369	0579	157	0585	35,49
De 3 a 6 meses	0517	3	0524	4	0531	0	0538	0	0545	4	0552	93	0559	0	0566	98	0573	217	0580	56	0586	45,02
De 6 a 9 meses	0518	0	0525	0	0532	0	0539	0	0546	0	0553	0	0560	0	0567	0	0574	0	0581	0	0587	
De 9 a 12 meses	0519	0	0526	0	0533	0	0540	0	0547	0	0554	0	0561	0	0568	0	0575	0	0582	0	0588	
Más de 12 meses	0520	19	0527	263	0534	6	0541	79	0548	348	0555	735	0562	0	0569	1.082	0576	2.120	0583	647	0589	51,04
Total	0521	202	0528	309	0535	16	0542	79	0549	404	0556	6.144	0563	0	0570	6.548	0577	19.347			0590	33,84

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 29/06/2004	
Inferior a 1 año	0600	171	1600	250	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	431	1601	404	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	552	1602	741	2602	86
Entre 3 y 4 años	0603	2.086	1603	841	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	2.890	1604	3.394	2604	900
Entre 5 y 10 años	0605	23.178	1605	20.135	2605	16.124
Superior a 10 años	0606	23.447	1606	33.062	2606	492.890
Total	0607	52.755	1607	58.828	2607	510.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	10,26	1608		2608	44,99

Antigüedad	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 29/06/2004	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	16,28	1609		2609	4,69

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 29/06/2004			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.329	0630	38.278	1620	1.352	1630	39.657	2620	864	2630	39.724
40% - 60%	0621	249	0631	13.207	1621	331	1631	16.922	2621	1.471	2631	103.987
60% - 80%	0622	23	0632	1.211	1622	41	1632	2.190	2622	3.508	2632	280.177
80% - 100%	0623	1	0633	59	1623	1	1633	59	2623	1.104	2633	86.112
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	1.602	0638	52.755	1628	1.725	1638	58.828	2628	6.947	2638	510.000
Media ponderada (%)	0639	31,88	0649		1639		1649		2639	145,15	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 29/06/2004	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,99	1650		2650	7,54
Tipo de interés nominal máximo	0651	7,50	1651		2651	15,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,13	1652		2652	4,49

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 29/06/2004			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	672	0683	15.389	1660	744	1683	17.598	2660	4.527	2683	269.792
Aragón	0661	91	0684	3.575	1661	93	1684	3.876	2661	182	2684	16.342
Asturias	0662	0	0685	0	1662	0	1685	0	2662	0	2685	0
Baleares	0663	0	0686	0	1663	0	1686	0	2663	0	2686	0
Canarias	0664	0	0687	0	1664	0	1687	0	2664	0	2687	0
Cantabria	0665	12	0688	445	1665	12	1688	477	2665	28	2688	2.776
Castilla-León	0666	146	0689	5.712	1666	152	1689	6.328	2666	337	2689	32.438
Castilla La Mancha	0667	9	0690	340	1667	10	1690	420	2667	87	2690	8.010
Cataluña	0668	96	0691	3.010	1668	103	1691	3.339	2668	361	2691	24.510
Ceuta	0669	0	0692	0	1669	0	1692	0	2669	1	2692	56
Extremadura	0670	5	0693	145	1670	5	1693	159	2670	72	2693	5.445
Galicia	0671	0	0694	0	1671	0	1694	0	2671	0	2694	0
Madrid	0672	79	0695	3.792	1672	83	1695	4.136	2672	252	2695	29.282
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	4	2696	272
Murcia	0674	0	0697	0	1674	0	1697	0	2674	0	2697	0
Navarra	0675	2	0698	97	1675	2	1698	104	2675	5	2698	1.249
La Rioja	0676	152	0699	5.915	1676	164	1699	6.569	2676	327	2699	37.560
Comunidad Valenciana	0677	1	0700	2	1677	1	1700	2	2677	5	2700	328
País Vasco	0678	337	0701	14.333	1678	356	1701	15.820	2678	759	2701	81.940
Total España	0679	1.602	0702	52.755	1679	1.725	1702	58.828	2679	6.947	2702	510.000
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	1.602	0705	52.755	1682	1.725	1705	58.828	2682	6.947	2705	510.000

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 30/09/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.A A08663619 CAIXABANK, S.A. A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2018				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	2,94			1710				2710	3,16		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 30/09/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2018			Situación cierre anual anterior 31/12/2017			Situación inicial 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	7.129	26.219	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			
ES0370151021	CH1	1.128	0	0	1.128	0	0	1.128	100.000	112.800			
ES0370151039	CH2	127	73.539	9.339	127	83.177	10.563	127	100.000	12.700			
Total		0723	5.100	0724	52.259	1723	5.100	1724	58.580	2723	5.100	2724	510.000

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 30/09/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado				
			0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739	
ES0370151005	PH1	NS	EURIBOR 3 MESES	0,17	0	0	0	SI	26.219	0	26.219			
ES0370151013	PH2	S	EURIBOR 3 MESES	0,90	0,58	3	0	SI	16.700	0	16.703			
ES0370151021	CH1	NS	EURIBOR 3 MESES	0,18	0	0	0	SI	0	0	0			
ES0370151039	CH2	S	EURIBOR 3 MESES	0,95	0,63	2	0	SI	9.339	0	9.341			
Total						0740	5	0741	0743	52.259	0744	0745	52.264	0746

	Situación actual 30/09/2018		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	0,30	0748	0,27	0749	2,32

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 30/09/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2018								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2017							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0370151021	CH1		112.800		12.051		3.502		112.800	0	12.051						
ES0370151039	CH2	382	3.361	16	4.203		1.829		1.829	18	4.137						
ES0370151013	PH2	0	0	25	5.425		0		0	23	5.328						
ES0370151005	PH1	1.602	341.581	0	49.131		11.137		334.814	0	49.131						
Total		0754	1.984	0755	457.741	0756	40	0757	70.810	1754	16.468	1755	449.444	1756	41	1757	70.647

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 30/09/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/09/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 29/06/2004
				0762	0763	0764
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
ES0370151021	CH1	19/08/2014	FCH	AA+	AA+	AAA
ES0370151021	CH1	23/01/2015	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0370151039	CH2	14/07/2016	FCH	A-	A-	BBB
ES0370151039	CH2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa2	Baa1

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 30/09/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 29/06/2004	
Inferior a 1 año	0765	52.259	1765	10.563	2765	0
Entre 1 y 2 años	0766		1766	31.317	2766	0
Entre 2 y 3 años	0767		1767	16.700	2767	0
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768	0
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769	0
Entre 5 y 10 años	0770		1770		2770	480.600
Superior a 10 años	0771		1771		2771	29.400
Total	0772	52.259	1772	58.580	2772	510.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	0	1773	1,65	2773	17,56

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 29/06/2004	
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	5.829	1775	5.742	2775	6.147
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	5.829	1776	5.742	2776	6.147
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	11,20	1777	9,80	2777	1
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	0
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	0
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	0
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	0
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	N	1791	N	2791	
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	50,10	1792	53,46	2792	94,23
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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características
Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/09/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 29/06/2004	
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806

AyT Hipotecario Mixto II, FTA

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		0	-9.934	
-----------	------------------------------------------------------------	------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	---	--------	--

AyT Hipotecario Mixto II, FTA

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

AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Permuta 1	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 nominal de los Préstamos referenciados al Tipo Índice, se entenderá por ?Tipo Índice? el IRPH publicado mensualmente por el Banco de España en su página web www.bde.es/tipos/tipos.htm .		0	-9.934	
-----------	---------------------------------------------------------------------	------------	--	--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	---	--------	--

AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Permuta 3	J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA	Trimestral	El Factor de Cálculo CH 1 será, en cada Fecha de Referencia, 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 de los préstamos cubiertos por el Contrato de Swap CH 1 que resetean en cada uno de los meses del año. 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 CH 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 CH 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		0	-3.117	
-----------	------------------------------------------------------------	------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	---	--------	--

AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Permuta 4	J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA	Trimestral	El Factor de Cálculo CH 2 será, en cada Fecha de Referencia, 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 de los préstamos cubiertos por el Contrato de Swap CH 2 que resetean en cada uno de los meses del año. 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 CH 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 CH 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		0	-1.369	
-----------	------------------------------------------------------------	------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	---	--------	--

AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Permuta 6	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. deducido el margen y minorado un 1%.	Saldo nominal de los Préstamos referenciados al Tipo Índice, se entenderá por Tipo Índice el IRPH publicado mensualmente por el Banco de España en su página web www.bde.es/tipos/tipos.htm .			0		-2.859		
Total							0808		0809		0810	-33.461	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)			Valor en libros (miles de euros)			Otras características	
	Situación actual 30/09/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 29/06/2004	Situación actual 30/09/2018	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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
	Situación actual 30/09/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación actual 30/09/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación actual 30/09/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Última Fecha Pago									
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	0	7003	352	7006	205	7009	2,16	7012	1,81	7015	2,10		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	352	7008	205	7011	2,16	7014	1,81	7017	351.931	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	334	7024	194	7027	1,62	7030	1,47	7033	1,61		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	334	7026	194	7029	1,62	7032	1,47	7035	1,61	7036	FOLLETO INFORMA TIVO. CAPÍTULO II. APARTAD O II.3.2.1

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

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862		1862		2862		3862		4862		5862		6862		7862		8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864		1864		2864		3864		4864		5864		6864		7864		8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

S.06

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 30/09/2018

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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