

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT HIPOTECARIO BBK II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8431
NIF Fondo: V84734235
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2023

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 BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	141.108	1001	160.694
I. Activos financieros a largo plazo	0002	141.108	1002	160.694
1. Activos titulizados	0003	141.108	1003	159.937
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	138.401	1005	157.783
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	2.707	1025	2.153
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027		1027	0
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029	0	1029	757
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	757
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 BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	57.625	1041	51.598
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	25.735	1043	30.080
1. Activos titulizados	0044	24.048	1044	29.134
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	23.623	1046	28.936
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	298	1065	120
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	6	1066	2
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	120	1067	75
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	0	1068	1
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069		1069	0
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071	1.686	1071	946
2.1 Derivados de cobertura	0072	1.686	1072	946
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	0	1082	0
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	31.890	1085	21.517
1. Tesorería	0086	31.890	1086	21.517
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	198.733	1088	212.291

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	155.925	1089	173.640
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	155.925	1094	173.640
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	141.266	1095	160.040
1.1 Series no subordinadas	0096	59.266	1096	78.040
1.2 Series subordinadas	0097	82.000	1097	82.000
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	10.800	1101	10.800
2.1 Préstamo subordinado	0102	10.800	1102	10.800
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		1105	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	929	1108	0
3.1 Derivados de cobertura	0109	929	1109	0
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	2.930	1112	2.800
4.1 Garantías financieras	0113	2.930	1113	2.800
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 BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) PASIVO CORRIENTE	0117	43.737	1117	37.894
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	41.316	1123	37.400
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	41.046	1124	37.316
1.1 Series no subordinadas	0125	37.935	1125	36.425
1.2 Series subordinadas	0126		1126	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	3.111	1128	890
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	269	1131	85
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	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	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	269	1136	85
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137		1137	
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139		1139	
3.1 Derivados de cobertura	0140		1140	
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	1	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	1	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	2.421	1148	494
1. Comisiones	0149	2.418	1149	472
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	20	1150	9
1.2 Comisión administrador	0151	8	1151	4
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	2.391	1153	458
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155		1155	
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	3	1157	22
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-929	1158	757
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-929	1160	757
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	198.733	1162	212.291

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	2.258	1201	322	2201	4.562	3201	1.142
1.1 Activos titulizados	0202	2.258	1202	322	2202	4.370	3202	1.142
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	192	3203	
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-1.944	1204	-80	2204	-4.977	3204	-203
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.789	1205	-33	2205	-4.569	3205	-72
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-155	1206	-47	2206	-408	3206	-131
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	1.009	1208	-130	2208	2.204	3208	-382
A) MARGEN DE INTERESES	0209	1.324	1209	112	2209	1.789	3209	556
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216		3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-1.628	1217	-202	2217	-2.252	3217	-1.900
7.1 Servicios exteriores	0218	0	1218	0	2218	-3	3218	-11
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219	0	2219	-2	3219	-2
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	-1	3222	-9
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-1.627	1224	-202	2224	-2.248	3224	-1.889
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-11	1225	-14	2225	-35	3225	-42
7.3.2 Comisión administrador	0226	-5	1226	-5	2226	-14	3226	-17
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227		3227	
7.3.4 Comisión variable	0228	-1.611	1228	-183	2228	-2.199	3228	-1.831
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230		3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	304	1231	90	2231	463	3231	1.344
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	304	1232	90	2232	463	3232	1.344
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	0	1239	0	2239		3239	
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 BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	2.224	1300	-563	2300	5.878	3300	2.045
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	2.225	1301	298	2301	3.272	3301	694
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	2.225	1302	298	2302	4.188	3302	1.115
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	0	1303	0	2303	-2.348	3303	-23
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	2.693	3304	189
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	-1.230	3305	-507
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	192	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	-223	3307	-80
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	0	1309	0	2309	-301	3309	-1.533
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	0	1310	0	2310	-25	3310	-29
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	-10	3311	-12
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	0
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	-267	3313	-1.492
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	-861	2315	2.908	3315	2.884
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	-2.931	1320	-3.771	2320	-8.212	3320	-3.796
3.6 Otros cobros de explotación	0321	2.930	1321	2.910	2321	11.120	3321	6.680
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	7.569	1322	7.486	2322	7.294	3322	9.042
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	7.569	1325	7.486	2325	7.294	3325	9.042
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	3.686	1326	4.674	2326	12.063	3326	14.335
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	2.904	1327	2.320	2327	10.643	3327	9.014
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	643	1328	492	2328	1.517	3328	2.567
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	336	1329	0	2329	336	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	0	1331	0	2331	-17.264	3331	-16.874
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	9.793	1337	6.923	2337	13.173	3337	11.088
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	22.097	1338	22.321	2338	18.717	3338	18.156
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	31.890	1339	29.244	2339	31.890	3339	29.244

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
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	-160	1357	986	2357	518	3357	1.850
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-160	1358	986	2358	518	3358	1.850
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	-1.009	1360	130	2360	-2.204	3360	382
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	1.170	1362	-1.116	2362	1.686	3362	-2.232
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 BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2023								Situación cierre anual anterior 31/12/2022								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	1,71	0401	1,21	0421	29,84	0441	8,27	1381	1,18	1401	1,29	1421	44	1441	6,39	2381	0,48	2401	0,07	2421	0	2441	0
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: 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	45	0467	15	0474	3	0481		0488	18	0495	2.427	0502	3	0509	2.448
De 1 a 3 meses	0461	19	0468	10	0475	4	0482		0489	14	0496	1.223	0503	3	0510	1.240
De 3 a 6 meses	0462	17	0469	17	0476	0	0483	4	0490	21	0497	1.146	0504		0511	1.167
De 6 a 9 meses	0463	10	0470	21	0477	0	0484	1	0491	22	0498	656	0505		0512	678
De 9 a 12 meses	0464	8	0471	31	0478	0	0485	3	0492	34	0499	525	0506		0513	559
Más de 12 meses	0465	8	0472	50	0479	0	0486	3	0493	54	0500	381	0507		0514	435
Total	0466	107	0473	145	0480	6	0487	12	0494	163	0501	6.358	0508	6	1515	6.526

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	45	0522	15	0529	3	0536		0543	18	0550	2.427	0557	3	0564	2.448	0571	6.491	0578		0584	37,71
De 1 a 3 meses	0516	19	0523	10	0530	4	0537		0544	14	0551	1.223	0558	3	0565	1.240	0572	3.045	0579		0585	40,72
De 3 a 6 meses	0517	17	0524	17	0531	0	0538	4	0545	21	0552	1.146	0559		0566	1.167	0573	2.770	0580		0586	42,13
De 6 a 9 meses	0518	10	0525	21	0532	0	0539	1	0546	22	0553	656	0560		0567	678	0574	1.620	0581		0587	41,84
De 9 a 12 meses	0519	8	0526	31	0533	0	0540	3	0547	34	0554	525	0561		0568	559	0575	1.259	0582		0588	44,43
Más de 12 meses	0520	8	0527	50	0534	0	0541	3	0548	54	0555	381	0562		0569	435	0576	1.137	0583		0589	38,21
Total	0521	107	0528	145	0535	6	0542	12	0549	163	0556	6.358	0563	6	0570	6.526	0577	16.321			0590	39,99

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 06/06/2006	
Inferior a 1 año	0600	472	1600	540	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	1.232	1601	1.440	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.212	1602	1.760	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	1.659	1603	1.638	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	3.359	1604	2.174	2604	315
Entre 5 y 10 años	0605	49.900	1605	45.357	2605	250
Superior a 10 años	0606	107.017	1606	136.039	2606	999.435
Total	0607	164.851	1607	188.947	2607	1.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	10,21	1608	10,86	2608	26,79

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 06/06/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	19,32	1609	18,61	2609	2,44

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 06/06/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	2.375	0630	90.371	1620	2.393	1630	88.946	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	900	0631	73.886	1621	1.186	1631	98.696	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	5	0632	594	1622	10	1632	1.304	2622	1.686	2632	204.991
80% - 100%	0623		0633		1623		1633		2623	5.718	2633	795.009
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	3.280	0638	164.851	1628	3.589	1638	188.947	2628	7.404	2638	1.000.000
Media ponderada (%)	0639	37,25	0649		1639	39,33	1649		2639	87,63	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 06/06/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	1,91	1650	0,56	2650	3,28
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,12	1651	4,63	2651	4,84
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,49	1652	0,01	2652	2,45

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 06/06/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	6	0683	285	1660	6	1683	304	2660	44	2683	7.516
Aragón	0661	75	0684	4.559	1661	77	1684	5.022	2661	136	2684	20.708
Asturias	0662	2	0685	26	1662	2	1685	30	2662	5	2685	601
Baleares	0663	2	0686	64	1663	2	1686	70	2663	2	2686	236
Canarias	0664	1	0687	3	1664	1	1687	5	2664	2	2687	122
Cantabria	0665	253	0688	12.788	1665	281	1688	14.942	2665	621	2688	82.241
Castilla-León	0666	40	0689	1.347	1666	42	1689	1.510	2666	92	2689	8.256
Castilla La Mancha	0667	76	0690	5.136	1667	80	1690	5.891	2667	155	2690	23.652
Cataluña	0668	19	0691	895	1668	20	1691	1.033	2668	41	2691	6.780
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	0
Extremadura	0670		0693		1670		1693		2670	0	2693	0
Galicia	0671		0694		1671		1694		2671	0	2694	0
Madrid	0672	707	0695	39.912	1672	765	1695	45.364	2672	1.534	2695	223.288
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	1	0697	2	1674	1	1697	6	2674	2	2697	281
Navarra	0675	2	0698	215	1675	2	1698	225	2675	4	2698	802
La Rioja	0676	42	0699	2.586	1676	42	1699	2.765	2676	85	2699	12.224
Comunidad Valenciana	0677	98	0700	5.029	1677	104	1700	5.599	2677	215	2700	30.052
País Vasco	0678	1.956	0701	92.002	1678	2.164	1701	106.180	2678	4.466	2701	583.241
Total España	0679	3.280	0702	164.851	1679	3.589	1702	188.947	2679	7.404	2702	1.000.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	3.280	0705	164.851	1682	3.589	1705	188.947	2682	7.404	2705	1.000.000

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 06/06/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,24			1710	1,15			2710	0,54		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 06/06/2006					
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			
ES0312251004	A	9.180	10.588	97.201	9.180	12.469	114.466	9.180	100.000	918.000			
ES0312251012	B	435	100.000	43.500	435	100.000	43.500	435	100.000	43.500			
ES0312251020	C	385	100.000	38.500	385	100.000	38.500	385	100.000	38.500			
Total		0723	10.000	0724	179.201	1723	10.000	1724	196.466	2723	10.000	2724	1.000.000

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2023

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
ES0312251004	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,15	2,23	1.625	0	SI	97.201	0	98.826						
ES0312251012	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,30	2,38	756	0	SI	43.500	0	44.256						
ES0312251020	C	S	EURIBOR 6 MESES	0,65	2,73	729	0	SI	38.500	0	39.229						
Total						0740	3.111	0741	0	0743	179.201	0744	0	0745	182.312	0746	

	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 06/06/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	2,37	0748	0,07	0749	3,26

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2023						Situación periodo comparativo anterior 30/09/2022					
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			
ES0312251012	B		0		9.826			0		9.302			
ES0312251020	C		0		10.867			0		10.269			
ES0312251004	A		820.799		142.832			787.228		141.540			
Total		0754	0755 820.799	0756	0757 163.526		1754	1755 787.228	1756	1757 161.111			

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2023

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 30/09/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 06/06/2006
				0762	0763	0764
ES0312251004	A	12/12/2018	FCH	AAA	AAA	AA
ES0312251004	A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0312251012	B	04/01/2022	FCH	AAA	AAA	A
ES0312251012	B	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	A2
ES0312251020	C	02/12/2022	FCH	A	A	BB
ES0312251020	C	26/04/2021	MDY	Baa2	Baa2	B1

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2023

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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 06/06/2006
Inferior a 1 año	0765		1765		2765
Entre 1 y 2 años	0766	97.201	1766		2766
Entre 2 y 3 años	0767	0	1767	114.466	2767
Entre 3 y 4 años	0768	82.000	1768	82.000	2768
Entre 4 y 5 años	0769		1769	0	2769
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770	0	2770
Superior a 10 años	0771		1771		2771
Total	0772	179.201	1772	196.466	2772
Vida residual media ponderada (años)	0773	3,67	1773	4,18	2773
					9,27

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 06/06/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	10.800	1775	10.800	2775	21.500
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	10.800	1776	10.800	2776	21.500
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	6,03	1777	5,50	2777	2
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783	Notas Explicativas	2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	54,24	1792	58,26	2792	91,80
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	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

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 30/09/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 06/06/2006	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Permuta 1	KUTXABANK S.A.	SEMESTRAL	La suma de los intereses devengados, vencidos e ingresados al Fondo durante el Periodo de Liquidación que vence de los Activos de la Serie correspondiente, disminuida en el importe de los Intereses Corridos que, en su caso, hubiere pagado el Fondo durante el mismo Periodo de Liquidación entre (ii) el Importe Nominal, multiplicado por 360 y dividido por los días efectivos existentes en dicho Periodo de Liquidación	El Saldo Vivo de los Activos (una vez deducidos los Activos Fallidos) en la Fecha de Determinación anterior que no se encuentren con retrasos en el pago de los importes vencidos por más de noventa (90) días en la Fecha de Determinación en curso (incluidos los Activos totalmente amortizados durante el Periodo de Determinación)	Tipo de Interés de Referencia de los Bonos fijado para el correspondiente Periodo de Devengo de Intereses de los Bonos más un margen del 0,70 % .	El Saldo Vivo de los Activos (una vez deducidos los Activos Fallidos) en la Fecha de Determinación anterior que no se encuentren con retrasos en el pago de los importes vencidos por más de noventa (90) días en la Fecha de Determinación en curso (incluidos los Activos totalmente amortizados durante el Periodo de Determinación)	758	1.703	-16.816	
Total							0808 758	0809 1.703	0810 -16.816	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 06/06/2006		Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 06/06/2006			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

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 30/09/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación actual 30/09/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Última Fecha Pago							
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	1.473	7006	1.969	7009	3,58	7012	2,62	7015	6,29		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.473	7008	1.969	7011	3,58	7014	2,62	7017	1.473.214	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	1.342	7024	1.891	7027	1,26	7030	1,36	7033	1,39		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	1.342	7026	1.891	7029	1,26	7032	1,36	7035	1,39	7036	FOLLETO INFORMA TIVO. NOTA DE VALORES. APARTAD O 4.9.2.b) (iv)

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Última Fecha Pago		
	0850	1850	2850	3850	
	0851	1851	2851	3851	
	0852	1852	2852	3852	
	0853	1853	2853	3853	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

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
b) Si en dicha Fecha de Pago existan o se prevea que vayan a existir CANTIDADES DISPUESTAS DEL CRÉDITO SUBORDINADO o, en caso de Dotación del Depósito de Liquidez, éste no sea o se prevea que no va a ser igual al IMPORTE MÁXIMO DEL CRÉDITO SUBORDINADO	1	2,90	4,05	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b) (iv)
a) el Saldo Vivo de los Activos en morosidad que presenten más de tres (3) meses de retraso en el pago de importes vencidos, sea superior al % establecido para cada ISIN del Saldo Vivo de los Activos en esa misma fecha.	1	2,90	4,05	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b) (iv)
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera superior al porcentaje recogido del Saldo Vivo de los Activos que no tengan la consideración de Activos Fallidos	1	1,71	2,76	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL A LA NOTA DE VALORES. APARTADO 3.4.3.2
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



S.05.5

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

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	150	5862	0	6862	Semestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	BILBAO 48 KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA	1863	0	2863	Días del mes /Base 365	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Semestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BANCO SANTANDER, S.A.	1864	0	2864		3864	0	4864	0	5864	0	6864	Semestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total			
		31/03/2023	30/06/2023	30/09/2023	31/03/2023	30/09/2023									
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872														
Margen de intereses	0873	187	278	1.324											1.789
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	75	84	304											463
Dotaciones a provisiones (neto)	0875														0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876														0
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-18	-18	-16											-53
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	243	344	1.611	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	2.199
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879														0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880														0
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881														0
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	-243	-344	-1.611	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-2.199
Comisión variable pagada	0883		267												267
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884														

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

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 BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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