

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: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2019

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)

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	271.568	1001	292.850
I. Activos financieros a largo plazo	0002	271.568	1002	292.850
1. Activos titulizados	0003	271.568	1003	292.850
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	270.481	1005	291.901
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	3.720	1025	3.143
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-2.633	1027	-2.194
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	70.533	1041	71.067
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	32.839	1043	40.294
1. Activos titulizados	0044	32.839	1044	40.294
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	31.928	1046	39.291
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	96	1065	106
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	5	1066	4
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	2.756	1067	2.938
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	18	1068	20
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-1.964	1069	-2.064
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	37.694	1085	30.773
1. Tesorería	0086	37.694	1086	30.773
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	342.101	1088	363.916

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	295.683	1089	318.466
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	295.683	1094	318.466
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	272.449	1095	293.805
1.1 Series no subordinadas	0096	190.449	1096	211.805
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	13.820	1101	14.728
2.1 Préstamo subordinado	0102	13.820	1102	14.728
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	3.714	1108	4.213
3.1 Derivados de cobertura	0109	3.714	1109	4.213
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	5.700	1112	5.720
4.1 Garantías financieras	0113	5.700	1113	5.720
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 BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) PASIVO CORRIENTE	0117	50.131	1117	49.664
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	49.517	1123	48.957
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	49.042	1124	48.737
1.1 Series no subordinadas	0125	48.957	1125	48.705
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	85	1128	32
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	109	1131	49
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	109	1136	49
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137		1137	
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	365	1139	170
3.1 Derivados de cobertura	0140	365	1140	170
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	1	1143	1
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	1	1144	1
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	614	1148	706
1. Comisiones	0149	614	1149	685
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	36	1150	16
1.2 Comisión administrador	0151	14	1151	7
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	564	1153	662
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	0	1157	21
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-3.714	1158	-4.213
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-3.714	1160	-4.213
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	342.101	1162	363.916

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2019		Acumulado anterior 30/09/2018
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	591	1201	724	2201	1.885	3201	2.101
1.1 Activos titulizados	0202	591	1202	724	2202	1.885	3202	2.101
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-111	1204	-109	2204	-326	3204	-329
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-49	1205	-41	2205	-137	3205	-119
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-62	1206	-69	2206	-189	3206	-209
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-187	1208	-236	2208	-601	3208	-768
A) MARGEN DE INTERESES	0209	292	1209	378	2209	958	3209	1.004
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	-161	1217	-856	2217	-620	3217	-1.469
7.1 Servicios exteriores	0218	0	1218	0	2218	-2	3218	-2
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	-1
7.2 Tributos	0223	0	1223	-1	2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-161	1224	-856	2224	-617	3224	-1.466
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-21	1225	-23	2225	-63	3225	-70
7.3.2 Comisión administrador	0226	-8	1226	-9	2226	-25	3226	-28
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227	0	3227	
7.3.4 Comisión variable	0228	-132	1228	-823	2228	-529	3228	-1.368
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-131	1231	479	2231	-338	3231	465
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-131	1232	479	2232	-338	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	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

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2019		Acumulado anterior 30/09/2018
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	1.084	1300	793	2300	-363	3300	-762
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	614	1301	724	2301	1.277	3301	1.325
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	614	1302	724	2302	1.896	3302	2.124
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	0	1303	0	2303	-84	3303	-79
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	736	3304	821
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	-1.142	3305	-1.397
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	0	1307	0	2307	-129	3307	-144
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	-1.595	3309	-1.043
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	0	1310	0	2310	-43	3310	-48
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	-17	3311	-19
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	0
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	-627	3313	-975
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	-908	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	470	1315	69	2315	-44	3315	-1.045
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	-10	1320	0	2320	-44	3320	-1.114
3.6 Otros cobros de explotación	0321	480	1321	69	2321	0	3321	69
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	8.816	1322	9.661	2322	7.284	3322	9.220
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	8.816	1325	9.661	2325	7.284	3325	10.111
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	5.632	1326	5.683	2326	16.522	3326	17.279
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	2.745	1327	2.981	2327	10.287	3327	11.560
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	439	1328	997	2328	1.579	3328	2.007
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	0	1331	0	2331	-21.104	3331	-20.734
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332	0	2332	0	3332	-892
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	-892
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	9.900	1337	10.455	2337	6.921	3337	8.457
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	27.793	1338	31.643	2338	30.773	3338	33.641
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	37.694	1339	42.098	2339	37.694	3339	42.098

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2019		Acumulado anterior 30/09/2018
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	323	1357	-522	2357	-102	3357	-599
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	323	1358	-522	2358	-102	3358	-599
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	187	1360	236	2360	601	3360	768
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-510	1362	286	2362	-499	3362	-169
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: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2019								Situación cierre anual anterior 31/12/2018								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	2,10	0401	0	0421	0	0441	4,84	1381	1,80	1401	0	1421	0	1441	4,79	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: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	111	0467	36	0474	3	0481	0	0488	39	0495	8.545	0502	2	0509	8.586
De 1 a 3 meses	0461	38	0468	29	0475	2	0482		0489	31	0496	3.096	0503	1	0510	3.128
De 3 a 6 meses	0462	16	0469	25	0476	0	0483	1	0490	26	0497	1.225	0504		0511	1.251
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	2	0477		0484	0	0491	2	0498	63	0505		0512	65
De 9 a 12 meses	0464	3	0471	11	0478	0	0485	0	0492	12	0499	157	0506		0513	169
Más de 12 meses	0465	52	0472	2.718	0479	17	0486	145	0493	2.881	0500	2.274	0507		0514	5.156
Total	0466	221	0473	2.821	0480	23	0487	147	0494	2.991	0501	15.361	0508	3	1515	18.355

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	111	0522	36	0529	3	0536	0	0543	39	0550	8.545	0557	2	0564	8.586	0571	16.471	0578		0584	52,13
De 1 a 3 meses	0516	38	0523	29	0530	2	0537		0544	31	0551	3.096	0558	1	0565	3.128	0572	6.163	0579		0585	50,76
De 3 a 6 meses	0517	16	0524	25	0531	0	0538	1	0545	26	0552	1.225	0559		0566	1.251	0573	2.454	0580		0586	50,95
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	2	0532		0539	0	0546	2	0553	63	0560		0567	65	0574	125	0581		0587	52,39
De 9 a 12 meses	0519	3	0526	11	0533	0	0540	0	0547	12	0554	157	0561		0568	169	0575	377	0582		0588	44,83
Más de 12 meses	0520	52	0527	2.718	0534	17	0541	145	0548	2.881	0555	2.274	0562		0569	5.156	0576	9.249	0583		0589	55,74
Total	0521	221	0528	2.821	0535	23	0542	147	0549	2.991	0556	15.361	0563	3	0570	18.355	0577	34.839			0590	52,69

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 06/06/2006	
Inferior a 1 año	0600	202	1600	122	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	425	1601	546	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	782	1602	864	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	2.732	1603	1.172	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	5.030	1604	4.818	2604	315
Entre 5 y 10 años	0605	28.130	1605	28.301	2605	250
Superior a 10 años	0606	271.584	1606	301.450	2606	999.435
Total	0607	308.885	1607	337.272	2607	1.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	13,69	1608	14,36	2608	26,79

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 06/06/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	15,48	1609	14,75	2609	2,44

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				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	1.564	0630	53.317	1620	1.448	1630	48.790	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	2.528	0631	214.338	1621	2.395	1631	199.350	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	334	0632	40.314	1622	745	1632	87.998	2622	1.686	2632	204.991
80% - 100%	0623	6	0633	916	1623	8	1633	1.135	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	4.432	0638	308.885	1628	4.596	1638	337.272	2628	7.404	2638	1.000.000
Media ponderada (%)	0639	49,65	0649		1639	51,94	1649		2639	87,63	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 06/06/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,70	1650	0,70	2650	3,28
Tipo de interés nominal máximo	0651	3,75	1651	3,75	2651	4,84
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,12	1652	0,06	2652	2,45

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2019			Situación cierre anual anterior 31/12/2018			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	8	0683 616	1660	8	1683 642	2660	44	2683 7.516
Aragón	0661	88	0684 7.487	1661	92	1684 8.171	2661	136	2684 20.708
Asturias	0662	2	0685 49	1662	3	1685 154	2662	5	2685 601
Baleares	0663	2	0686 130	1663	2	1686 136	2663	2	2686 236
Canarias	0664	1	0687 10	1664	1	1687 11	2664	2	2687 122
Cantabria	0665	360	0688 24.860	1665	380	1688 27.289	2665	621	2688 82.241
Castilla-León	0666	54	0689 2.632	1666	55	1689 2.798	2666	92	2689 8.256
Castilla La Mancha	0667	101	0690 9.364	1667	105	1690 9.971	2667	155	2690 23.652
Cataluña	0668	26	0691 2.010	1668	28	1691 2.357	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	927	0695 72.625	1672	955	1695 78.885	2672	1.534	2695 223.288
Melilla	0673		0696	1673		1696	2673	0	2696 0
Murcia	0674	1	0697 22	1674	1	1697 26	2674	2	2697 281
Navarra	0675	3	0698 380	1675	3	1698 392	2675	4	2698 802
La Rioja	0676	53	0699 4.432	1676	53	1699 4.711	2676	85	2699 12.224
Comunidad Valenciana	0677	127	0700 9.084	1677	132	1700 10.102	2677	215	2700 30.052
País Vasco	0678	2.679	0701 175.184	1678	2.778	1701 191.628	2678	4.466	2701 583.241
Total España	0679	4.432	0702 308.885	1679	4.596	1702 337.272	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	4.432	0705 308.885	1682	4.596	1705 337.272	2682	7.404	2705 1.000.000

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2019
Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 06/06/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,94			1710	0,91			2710	0,54		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2019			Situación cierre anual anterior 31/12/2018			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	26.079	239.407	9.180	28.378	260.510	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	321.407	1723	10.000	1724	342.510	2723	10.000	2724	1.000.000

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado							
			0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738			0739		
ES0312251004	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,15	0	0	0	SI	239.407	0	239.407						
ES0312251012	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,30	0,07	13	0	SI	43.500	0	43.513						
ES0312251020	C	S	EURIBOR 6 MESES	0,65	0,42	72	0	SI	38.500	0	38.572						
Total						0740	85	0741	0	0743	321.407	0744	0	0745	321.491	0746	

	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 06/06/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,05	0748	0,05	0749	3,26

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2019
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2019				Situación periodo comparativo anterior 30/09/2018			
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
ES0312251004	A		678.593		141.513		637.112		141.513
ES0312251012	B		0		9.248		0		9.233
ES0312251020	C		0		9.945		0		9.795
Total		0754	0755 678.593	0756	0757 160.706	1754	1755 637.112	1756	1757 160.541

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2019

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 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 06/06/2006
				0762	0763	0764
ES0312251004	A	12/12/2018	FCH	AAA	AA+	AA
ES0312251004	A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0312251012	B	12/12/2018	FCH	A+	A	A
ES0312251012	B	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	A2
ES0312251020	C	12/12/2018	FCH	BBB-	BB	BB
ES0312251020	C	29/06/2018	MDY	Baa3	Baa3	B1

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2019

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 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 06/06/2006	
Inferior a 1 año	0765	0	1765	0	2765	
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	
Entre 3 y 4 años	0768	239.407	1768	260.510	2768	
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769	
Entre 5 y 10 años	0770	82.000	1770	82.000	2770	914.500
Superior a 10 años	0771		1771		2771	85.500
Total	0772	321.407	1772	342.510	2772	1.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	4,36	1773	4,35	2773	9,27

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 06/06/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	13.820	1775	14.728	2775	21.500
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	13.820	1776	14.728	2776	21.500
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	4,30	1777	4,30	2777	2
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783	Notas Explicativas	2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	74,49	1792	76,06	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	

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

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 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	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)	-4.079	-4.383	-16.816	
Total							0808 -4.079	0809 -4.383	0810 -16.816	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

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 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 06/06/2006		Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		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: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

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 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación actual 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Última Fecha Pago							
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	2.921	7006	3.105	7009	2,10	7012	1,93	7015	1,88		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	2.921	7008	3.105	7011	2,10	7014	1,93	7017	2.920.889	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	2.857	7024	2.989	7027	1,48	7030	1,26	7033	1,38		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	2.857	7026	2.989	7029	1,48	7032	1,26	7035	1,38	7036	FOLLETO INFORMA TIVO. NOTA DE VALORES. APARTAD O 4.9.2.b) (iv)

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	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: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

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
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	1,99	1,85	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b) (iv)
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 de Depósito de Liquidez, éste no sea o se prevea que no va a ser igual al IMPORTE MÁXIMO DEL CRÉDITO SUBORDINADO	1	1,99	1,85	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	0,53	0,47	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: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

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	KUTXABANK	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	

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2019

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		
		31/03/2019	30/06/2019	30/09/2019										
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872													
Margen de intereses	0873	344	322	292										958
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	-202	-5	-131										-338
Dotaciones a provisiones (neto)	0875	0												0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876													0
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-31	-31	-29										-90
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	111	286	132	0	0	0	0	0	0	0	0	0	529
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879													0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880													0
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881	-111	-286	-132										-529
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Comisión variable pagada	0883		627											627
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884													

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

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: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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