

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT HIPOTECARIO MIXTO II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 6056
NIF Fondo: V84040286
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2017

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2017		Periodo anterior 31/12/2016
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	0	1001	13.130
I. Activos financieros a largo plazo	0002	0	1002	13.130
1. Activos titulizados	0003	0	1003	13.130
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	0	1005	12.894
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	0	1025	800
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	0	1027	-563
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029	0	1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	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 Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2017		Periodo anterior 31/12/2016
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	13.455	1041	7.751
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	10.475	1043	4.641
1. Activos titulizados	0044	10.467	1044	4.641
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	10.464	1046	4.604
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	2	1065	12
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	2	1066	3
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	601	1067	67
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	5	1068	7
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-607	1069	-52
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	8	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	8	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082		1082	
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084		1084	
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	2.980	1085	3.110
1. Tesorería	0086	2.980	1086	3.110
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	13.455	1088	20.881

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2017		Periodo anterior 31/12/2016
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	0	1089	17.533
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	0	1094	17.533
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	0	1095	13.160
1.1 Series no subordinadas	0096	0	1096	460
1.2 Series subordinadas	0097	0	1097	12.700
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101	0	1101	2.763
2.1 Préstamo subordinado	0102	0	1102	2.975
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	0	1105	-212
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	0	1108	1.609
3.1 Derivados de cobertura	0109	0	1109	1.609
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

S.01
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH
Denominación del compartimento: 200900037
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2017		Periodo anterior 31/12/2016
B) PASIVO CORRIENTE	0117	13.730	1117	4.958
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	13.726	1123	4.953
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	10.566	1124	4.893
1.1 Series no subordinadas	0125	0	1125	4.891
1.2 Series subordinadas	0126	10.563	1126	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	2	1128	3
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	2.862	1131	48
2.1 Préstamo subordinado	0132	2.975	1132	
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	-180	1135	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	1	1136	1
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	67	1137	48
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	278	1139	10
3.1 Derivados de cobertura	0140	278	1140	10
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	20	1143	1
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	1
4.2 Garantías financieras	0145	19	1145	
4.3 Otros	0146		1146	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	4	1148	5
1. Comisiones	0149	0	1149	0
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	0	1150	0
1.2 Comisión administrador	0151	7	1151	5
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	64	1153	64
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-70	1155	-69
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	4	1157	5
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-275	1158	-1.609
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-275	1160	-1.609
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	13.455	1162	20.881

S.02

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2017		Acumulado anterior 31/12/2016
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	54	1201	108	2201	412	3201	563
1.1 Activos titulizados	0202	54	1202	108	2202	412	3202	563
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203		3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-22	1204	-26	2204	-96	3204	-115
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-17	1205	-21	2205	-77	3205	-93
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-5	1206	-5	2206	-19	3206	-22
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-28	1208	-77	2208	-278	3208	-366
A) MARGEN DE INTERESES	0209	4	1209	5	2209	39	3209	82
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216	0	3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-7	1217	-9	2217	-17	3217	-21
7.1 Servicios exteriores	0218	-4	1218	-5	2218	-5	3218	-8
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	0	2219	-1	3219	-1
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	-4	1222	-5	2222	-4	3222	-7
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-3	1224	-3	2224	-12	3224	-12
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-2	1225	-3	2225	-10	3225	-10
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	-2	3226	-2
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227	0	3227	0
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228	0	3228	
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	0	1231	-55	2231	9	3231	-155
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	-55	2232	9	3232	-155
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	3	1239	59	2239	-30	3239	94
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241		3241	
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

S.03

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2017		Acumulado anterior 31/12/2016
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	0	1300	23	2300	59	3300	178
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	6	1301	28	2301	56	3301	-52
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	48	1302	126	2302	418	3302	414
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-19	1303	-21	2303	-78	3303	-94
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	-4	1304	0	2304	-3	3304	-1
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-19	1305	-77	2305	-282	3305	-370
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	0	3307	
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-2	1309	-3	2309	-10	3309	-10
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-2	1310	-3	2310	-10	3310	-10
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	0
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-4	1315	-2	2315	14	3315	240
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	
3.5 Otros pagos de explotación	0320	-4	1320	-2.866	2320	-6	3320	-2.624
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	2.864	2321	19	3321	2.864
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	17	1322	51	2322	-190	3322	-262
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulación	0323	0	1323	0	2323	0	3323	
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	17	1325	51	2325	-190	3325	-262
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	194	1326	294	2326	1.029	3326	1.231
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	46	1327	451	2327	5.843	3327	3.589
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	85	1328	114	2328	425	3328	477
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	
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	-307	1331	-807	2331	-7.487	3331	-5.559
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332	0	2332	0	3332	
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336	0	2336	0	3336	
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	17	1337	74	2337	-130	3337	-84
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	2.963	1338	3.036	2338	3.110	3338	3.194
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	2.980	1339	3.110	2339	2.980	3339	3.110

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2017		Acumulado anterior 31/12/2016
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	369	1357	182	2357	1.056	3357	1.169
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	369	1358	182	2358	1.056	3358	1.169
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	28	1360	77	2360	278	3360	366
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-397	1362	-260	2362	-1.334	3362	-1.536
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368		3368	
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369		3369	
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2017								Situación cierre anual anterior 31/12/2016								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	5,44	0401	0	0421	0	0441	34,56	1381	4,72	1401	0	1421	0	1441	16,35	2381	0	2401	0	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 Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	32	0467	6	0474	2	0481		0488	8	0495	1.092	0502	0	0509	1.100
De 1 a 3 meses	0461	3	0468	4	0475	0	0482		0489	5	0496	235	0503	0	0510	240
De 3 a 6 meses	0462		0469		0476		0483		0490		0497		0504		0511	
De 6 a 9 meses	0463		0470		0477		0484		0491		0498		0505		0512	
De 9 a 12 meses	0464		0471		0478		0485		0492		0499		0506		0513	
Más de 12 meses	0465	10	0472	58	0479	5	0486	35	0493	97	0500	544	0507		0514	641
Total	0466	45	0473	68	0480	7	0487	35	0494	110	0501	1.871	0508	0	1515	1.981

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	32	0522	6	0529	2	0536		0543	8	0550	1.092	0557	0	0564	1.100	0571	2.683	0578	2.578	0584	41
De 1 a 3 meses	0516	3	0523	4	0530	0	0537		0544	5	0551	235	0558	0	0565	240	0572	627	0579	56	0585	38,30
De 3 a 6 meses	0517		0524		0531		0538		0545		0552		0559		0566		0573		0580		0586	
De 6 a 9 meses	0518		0525		0532		0539		0546		0553		0560		0567		0574		0581		0587	
De 9 a 12 meses	0519		0526		0533		0540		0547		0554		0561		0568		0575		0582		0588	
Más de 12 meses	0520	10	0527	58	0534	5	0541	35	0548	97	0555	544	0562		0569	641	0576	865	0583	724	0589	74,15
Total	0521	45	0528	68	0535	7	0542	35	0549	110	0556	1.871	0563	0	0570	1.981	0577	4.175			0590	47,46

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 29/06/2004	
Inferior a 1 año	0600	38	1600	47	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	110	1601	136	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	153	1602	201	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	113	1603	354	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	626	1604	191	2604	62
Entre 5 y 10 años	0605	2.266	1605	3.196	2605	1.990
Superior a 10 años	0606	7.759	1606	14.239	2606	123.448
Total	0607	11.065	1607	18.365	2607	125.500
Vida residual media ponderada (años)	0608	11,34	1608	12,33	2608	23,51

Antigüedad	Situación actual 31/12/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 29/06/2004	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	16,26	1609	15,14	2609	2,69

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 29/06/2004			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	201	0630	4.078	1620	216	1630	4.499	2620	87	2630	3.597
40% - 60%	0621	113	0631	4.738	1621	195	1631	8.163	2621	139	2631	7.367
60% - 80%	0622	41	0632	2.190	1622	104	1632	5.644	2622	436	2632	28.424
80% - 100%	0623	1	0633	59	1623	1	1633	59	2623	1.104	2633	86.112
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	356	0638	11.065	1628	516	1638	18.365	2628	1.766	2638	125.500
Media ponderada (%)	0639	44,02	0649		1639	49,36	1649		2639	82,29	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 29/06/2004	
Tipo de interés medio ponderado	0650	2,62	1650	2,06	2650	4,03
Tipo de interés nominal máximo	0651	5	1651	5	2651	8
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,26	1652	0,37	2652	2,24

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 29/06/2004			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	211	0683	5.943	1660	340	1683	11.373	2660	1.282	2683	85.326
Aragón	0661	1	0684	154	1661	1	1684	167	2661	3	2684	633
Asturias	0662		0685		1662		1685		2662	0	2685	0
Baleares	0663		0686		1663		1686		2663	0	2686	0
Canarias	0664		0687		1664		1687		2664	0	2687	0
Cantabria	0665		0688		1665		1688		2665	0	2688	0
Castilla-León	0666	4	0689	267	1666	4	1689	288	2666	8	2689	945
Castilla La Mancha	0667		0690		1667	6	1690	215	2667	23	2690	2.236
Cataluña	0668	98	0691	3.174	1668	113	1691	4.099	2668	313	2691	21.128
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	1	2692	56
Extremadura	0670	3	0693	76	1670	10	1693	395	2670	34	2693	2.661
Galicia	0671		0694		1671		1694		2671	0	2694	0
Madrid	0672	3	0695	122	1672	4	1695	219	2672	26	2695	3.049
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	1	2696	23
Murcia	0674		0697		1674		1697		2674	0	2697	0
Navarra	0675		0698		1675		1698		2675	1	2698	473
La Rioja	0676	33	0699	1.286	1676	35	1699	1.543	2676	68	2699	8.186
Comunidad Valenciana	0677		0700		1677		1700		2677	0	2700	0
País Vasco	0678	3	0701	43	1678	3	1701	65	2678	6	2701	784
Total España	0679	356	0702	11.065	1679	516	1702	18.365	2679	1.766	2702	125.500
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	356	0705	11.065	1682	516	1705	18.365	2682	1.766	2705	125.500

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH
Denominación del compartimento: 200900037
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2017
Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A. A14010342 BANKIA, S.A. A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 29/06/2004			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	9,07			1710	7,03			2710	2,29		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2017			Situación cierre anual anterior 31/12/2016			Situación inicial 29/06/2004					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente			
		0720	Nominal unitario (€) 0721	0722	1720	Nominal unitario (€) 1721	1722	2720	Nominal unitario (€) 2721	2722			
ES0370151021	CH1	1.128	0	0	1.128	4.744	5.351	1.128	100.000	112.800			
ES0370151039	CH2	127	83.177	10.563	127	100.000	12.700	127	100.000	12.700			
Total		0723	1.255	0724	10.563	1723	1.255	1724	18.051	2723	1.255	2724	125.500

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH
Denominación del compartimento: 200900037
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/12/2017
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		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
						0730	0731			0732	0733	0734	0735			0736	0737
ES0370151021	CH1	NS	EURIBOR 3 MESES	0,18	0	0	0	0	SI	0	0	0	0	0			
ES0370151039	CH2	S	EURIBOR 3 MESES	0,95	0,62	2	0	0	SI	10.563	0	0	10.566				
Total						0740	2	0741		0743	10.563	0744		0745	10.566	0746	

	Situación actual 31/12/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 29/06/2004	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747		0748	0,46	0749	1,12

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2017								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2016							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0370151021	CH1		112.800		12.051					807	107.449	0	12.051				
ES0370151039	CH2	307	2.137	19	4.157					0	0	21	4.077				
Total		0754	307	0755	114.937	0756	19	0757	16.208	1754	807	1755	107.449	1756	21	1757	16.128

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2017

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 31/12/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 29/06/2004
				0762	0763	0764
ES0370151021	CH1	19/08/2014	FCH	AA+	AA+	AAA
ES0370151021	CH1	23/01/2015	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0370151039	CH2	14/07/2016	FCH	A-	A-	BBB
ES0370151039	CH2	24/02/2017	MDY	Aa2	Baa1	Baa1

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2017

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 31/12/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 29/06/2004
Inferior a 1 año	0765	10.563	1765		2765
Entre 1 y 2 años	0766		1766	5.351	2766
Entre 2 y 3 años	0767		1767	12.700	2767
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769	0	2769
Entre 5 y 10 años	0770		1770		2770
Superior a 10 años	0771		1771		2771
Total	0772	10.563	1772	18.051	2772
Vida residual media ponderada (años)	0773	0,25	1773	1,88	2773
					112.800
					12.700
					125.500
					9,23

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 29/06/2004	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	2.858	1775	2.975	2775	3.263
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	2.858	1776	2.835	2776	3.263
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	27,06	1777	16,48	2777	2
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778		2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780		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		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784		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		2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790		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	0	1792	29,64	2792	89,89
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

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 31/12/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 29/06/2004	
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806

AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Permuta 4	J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA	Trimestral	El Factor de Cálculo CH 2 será, en cada Fecha de Referencia, la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial de los préstamos cubiertos por el Contrato de Swap CH 2 que resetean en cada uno de los meses del año. TIPO FLOOR es la diferencia, en caso de ser positiva, entre el tipo de interés mínimo deducido el margen y la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial del citado grupo de préstamos que resetean en cada uno de los meses del año."	El Importe Nocial del Contrato de Swap CH 2 Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones Hipotecarias cuyos Préstamos Hipotecarios subyacentes estén sometidos a revisión anual de sus tipos de interés. NOCIONAL FLOOR es el saldo vivo del grupo de préstamos con el mismo mínimo de tipo de interés	Tipo de Interés de Referencia de los Bonos establecido para cada Fecha de Pago, tal y como se define en el apartado II.10.1 del presente Folleto, más un spread de 0,20%. TIPO CAP es la diferencia, en caso de ser positiva, entre la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial del citado grupo de préstamos que resetean en cada uno de los meses del año y el tipo de interés máximo deducido el margen y minorado un 1%.	El Importe Nocial del Contrato de Swap CH 2 Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones Hipotecarias cuyos Préstamos Hipotecarios subyacentes estén sometidos a revisión Semestral de sus tipos de interés. NOCIONAL CAP sera el saldo vivo del grupo de préstamos con el mismo máximo de tipo de interés	-2	298	-1.369	
-----------	--	------------	--	--	--	--	----	-----	--------	--

AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Permuta 6	J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA	Trimestral			En caso de que el Tipo Índice (IRPH) sea menor que el tipo Euribor a un (1) año más cuarenta (40) puntos básicos (0,40%), la Entidad de Contrapartida abona al Fondo, en cada Fecha de Pago, la diferencia. En caso de que el Tipo Índice de un mes sea igual o superior al Euribor a un (1) año más cuarenta (40) puntos básicos (0,40%), no se devengará cantidad alguna a favor del Fondo. deducido el margen y minorado un 1%.	Saldo nominal de los Préstamos referenciados al Tipo Índice, se entenderá por Tipo Índice el IRPH publicado mensualmente por el Banco de España en su página web www.bde.es/tipos/tipos.htm .	-122	-690	-2.859	
-----------	---	------------	--	--	--	---	------	------	--------	--

AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Permuta 3	J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA	Trimestral	El Factor de Cálculo CH 1 será, en cada Fecha de Referencia, la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial de los préstamos cubiertos por el Contrato de Swap CH 1 que resetean en cada uno de los meses del año. TIPO FLOOR es la diferencia, en caso de ser positiva, entre el tipo de interés mínimo deducido el margen y la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial del citado grupo de préstamos que resetean en cada uno de los meses del año.	El Importe Nocial del Contrato de Swap CH 1 Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones Hipotecarias cuyos Préstamos Hipotecarios subyacentes estén sometidos a revisión anual de sus tipos de interés. NOCIONAL FLOOR es el saldo vivo del grupo de préstamos con el mismo mínimo de tipo de interés	Tipo de Interés de Referencia de los Bonos establecido para cada Fecha de Pago, tal y como se define en el apartado II.10.1 del presente Folleto, más un spread de 0,20%. TIPO CAP es la diferencia, en caso de ser positiva, entre la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial del citado grupo de préstamos que resetean en cada uno de los meses del año y el tipo de interés máximo deducido el margen y minorado un 1%.	El Importe Nocial del Contrato de Swap CH 1 Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones Hipotecarias cuyos Préstamos Hipotecarios subyacentes estén sometidos a revisión anual de sus tipos de interés. NOCIONAL CAP sera el saldo vivo del grupo de préstamos con el mismo máximo de tipo de interés	-154	-631	-3.117			
Total							0808	-278	0809	-1.023	0810	-7.345

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

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 31/12/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 29/06/2004	Situación actual 31/12/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 29/06/2004		
Préstamos hipotecarios	0811	1811	2811	0829	1829	2829	3829	
Cédulas hipotecarias	0812	1812	2812	0830	1830	2830	3830	
Préstamos a promotores	0813	1813	2813	0831	1831	2831	3831	
Préstamos a PYMES	0814	1814	2814	0832	1832	2832	3832	
Préstamos a empresas	0815	1815	2815	0833	1833	2833	3833	
Préstamos corporativos	0816	1816	2816	0834	1834	2834	3834	
Cédulas territoriales	0817	1817	2817	0835	1835	2835	3835	
Bonos de tesorería	0818	1818	2818	0836	1836	2836	3836	
Deuda subordinada	0819	1819	2819	0837	1837	2837	3837	
Créditos AAPP	0820	1820	2820	0838	1838	2838	3838	
Préstamos consumo	0821	1821	2821	0839	1839	2839	3839	
Préstamos automoción	0822	1822	2822	0840	1840	2840	3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823	1823	2823	0841	1841	2841	3841	
Cuentas a cobrar	0824	1824	2824	0842	1842	2842	3842	
Derechos de crédito futuros	0825	1825	2825	0843	1843	2843	3843	
Bonos de titulización	0826	1826	2826	0844	1844	2844		
Total	0827	1827	2827	0845	1845	2845	3845	

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

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 31/12/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación actual 31/12/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Última Fecha Pago							
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	97	7006	110	7009	5,44	7012	4,88	7015	5,39		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	97	7008	110	7011	5,44	7014	4,88	7017	97.446	7018	FOLLETO INFORMA TIVO. CAPÍTULO V. APARTAD OV.3.4.b)
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	97	7024	94	7027	5,44	7030	3,43	7033	5,39		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	97	7026	94	7029	5,44	7032	3,43	7035	5,39	7036	FOLLETO INFORMA TIVO. CAPÍTULO II. APARTAD O II.3.2.1 (b)

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

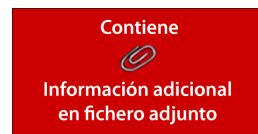
CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
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	1	5,69	5,75	FOLLETO INFORMATIVO. CAPÍTULO V. APARTADO V.3.4.b)
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



S.05.5

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

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	8	2862	Días del mes /Base 365	3862	0	4862	0	5862	0	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	CajaSol - El Monte	1863	0	2863	Días del mes /Días año	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Trimestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BANCO SANTANDER, S.A.	1864	0	2864	Días del mes /Base 365	3864	0,002	4864	0	5864	0	6864	Trimestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH
Denominación del compartimento: 200900037
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2017

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

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

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo						Total
		21/03/2017	20/06/2017	20/09/2017	20/12/2017			
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885							
Saldo inicial	0886	2.835	2.734	2.753	2.844			
Cobros del periodo	0887	1.049	880	5.575	360			
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-3	-3	-3	-3			
Pagos por derivados	0889	-67	-49	-130	-19			
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-2.734	-2.753	-2.844	-2.858			
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-1.079	-810	-5.352	-325			
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0	0			
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0	0			
Saldo disponible	0894	0	0	0	0			
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	0	0			

S.06

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA - CTH

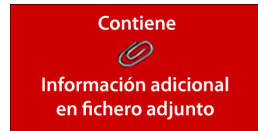
Denominación del compartimento: 200900037

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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