

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT HIPOTECARIO BBK II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8431
NIF Fondo: V84734235
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2024

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	127.180	1001	129.094
I. Activos financieros a largo plazo	0002	127.180	1002	129.094
1. Activos titulizados	0003	127.180	1003	129.094
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	125.594	1005	127.273
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	1.586	1025	1.821
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027		1027	
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	34.871	1041	48.671
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	16.437	1043	28.453
1. Activos titulizados	0044	16.334	1044	27.594
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	15.900	1046	27.149
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	327	1065	342
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	12	1066	8
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	91	1067	91
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	3	1068	2
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069		1069	
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071	104	1071	860
2.1 Derivados de cobertura	0072	104	1072	860
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	18.434	1085	20.218
1. Tesorería	0086	18.434	1086	20.218
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	162.051	1088	177.765

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	139.690	1089	142.127
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	139.690	1094	142.127
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	127.504	1095	129.218
1.1 Series no subordinadas	0096	45.504	1096	47.218
1.2 Series subordinadas	0097	82.000	1097	82.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101	10.800	1101	10.800
2.1 Préstamo subordinado	0102	10.800	1102	10.800
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105		1105	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	217	1108	1.209
3.1 Derivados de cobertura	0109	217	1109	1.209
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	1.169	1112	900
4.1 Garantías financieras	0113	1.169	1113	900
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) PASIVO CORRIENTE	0117	22.579	1117	36.847
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	22.338	1123	35.793
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	22.218	1124	35.666
1.1 Series no subordinadas	0125	21.047	1125	34.283
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	1.171	1128	1.383
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	119	1131	126
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	119	1136	126
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137		1137	
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139		1139	
3.1 Derivados de cobertura	0140		1140	
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	1	1143	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	241	1148	1.053
1. Comisiones	0149	240	1149	1.044
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	7	1150	8
1.2 Comisión administrador	0151	3	1151	3
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	969	1153	1.033
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-740	1155	
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	1	1157	9
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-217	1158	-1.209
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-217	1160	-1.209
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	162.051	1162	177.765

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2024		Acumulado anterior 30/06/2023
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	1.871	1201	1.579	2201	3.574	3201	2.304
1.1 Activos titulizados	0202	1.629	1202	1.387	2202	3.332	3202	2.112
1.2 Otros activos financieros	0203	242	1203	192	2203	242	3203	192
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-1.794	1204	-1.761	2204	-3.785	3204	-3.033
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.632	1205	-1.619	2205	-3.457	3205	-2.780
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-161	1206	-143	2206	-328	3206	-253
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-603	1208	461	2208	-149	3208	1.194
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-525	1209	278	2209	-360	3209	465
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	-18	1217	-363	2217	-176	3217	-624
7.1 Servicios exteriores	0218	-4	1218	-2	2218	-6	3218	-3
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	-1	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	-4	1222	-1	2222	-4	3222	-1
7.2 Tributos	0223	-1	1223	-1	2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-13	1224	-360	2224	-169	3224	-621
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-10	1225	-12	2225	-20	3225	-24
7.3.2 Comisión administrador	0226	-4	1226	-5	2226	-8	3226	-10
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227		3227	
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	-344	2228	-141	3228	-588
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230		3230	
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-196	1231	84	2231	-204	3231	159
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-196	1232	84	2232	-204	3232	159
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	740	1239	0	2239	740	3239	0
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: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2024		Acumulado anterior 30/06/2023
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-1.235	1300	406	2300	196	3300	3.655
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-1.499	1301	246	2301	187	3301	1.047
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	1.656	1302	1.162	2302	3.342	3302	1.963
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-3.669	1303	-2.348	2303	-3.669	3303	-2.348
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	3.945	1304	2.693	2304	3.945	3304	2.693
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-3.338	1305	-1.230	2305	-3.338	3305	-1.230
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	242	1306	192	2306	242	3306	192
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	-335	1307	-223	2307	-335	3307	-223
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-234	1309	-301	2309	-234	3309	-301
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-21	1310	-25	2310	-21	3310	-25
2.2 Comisión administrador	0311	-8	1311	-10	2311	-8	3311	-10
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	0
2.4 Comisión variable	0313	-205	1313	-267	2313	-205	3313	-267
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	498	1315	461	2315	243	3315	2.909
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	-671	1320	-5.269	2320	-1.577	3320	-5.281
3.6 Otros cobros de explotación	0321	1.169	1321	5.730	2321	1.820	3321	8.190
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-8.485	1322	-9.029	2322	-1.980	3322	-274
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	-8.485	1325	-9.029	2325	-1.980	3325	-274
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	3.248	1326	4.044	2326	6.562	3326	8.378
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	3.085	1327	2.786	2327	5.715	3327	6.805
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	270	1328	471	2328	693	3328	873
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	-139	1329	935	2329	0	3329	935
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	-14.950	1331	-17.264	2331	-14.950	3331	-17.264
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332	0	2332	0	3332	0
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336	0	2336	0	3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-9.720	1337	-8.624	2337	-1.784	3337	3.380
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	28.154	1338	30.721	2338	20.218	3338	18.717
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	18.434	1339	22.097	2339	18.434	3339	22.097

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2024		Acumulado anterior 30/06/2023
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	378	1357	1.185	2357	843	3357	678
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	378	1358	1.185	2358	843	3358	678
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	603	1360	-461	2360	149	3360	-1.194
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-982	1362	-724	2362	-992	3362	516
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368		3368	
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369		3369	
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2024								Situación cierre anual anterior 31/12/2023								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	1,17	0401	1,48	0421	21,64	0441	8,61	1381	1,22	1401	1,23	1421	25,71	1441	9,03	2381	0,48	2401	0,07	2421	0	2441	0
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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	58	0467	19	0474	7	0481		0488	26	0495	3.329	0502	5	0509	3.360
De 1 a 3 meses	0461	27	0468	20	0475	5	0482		0489	25	0496	1.753	0503	4	0510	1.783
De 3 a 6 meses	0462	5	0469	7	0476		0483	0	0490	8	0497	215	0504		0511	223
De 6 a 9 meses	0463	6	0470	16	0477	1	0484	2	0491	19	0498	443	0505		0512	462
De 9 a 12 meses	0464	6	0471	25	0478	2	0485	7	0492	35	0499	444	0506		0513	479
Más de 12 meses	0465	6	0472	42	0479	0	0486	10	0493	52	0500	484	0507		0514	537
Total	0466	108	0473	130	0480	15	0487	19	0494	165	0501	6.668	0508	9	1515	6.842

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	58	0522	19	0529	7	0536		0543	26	0550	3.329	0557	5	0564	3.360	0571	9.570	0578		0584	35,11
De 1 a 3 meses	0516	27	0523	20	0530	5	0537		0544	25	0551	1.753	0558	4	0565	1.783	0572	4.344	0579		0585	41,04
De 3 a 6 meses	0517	5	0524	7	0531		0538	0	0545	8	0552	215	0559		0566	223	0573	718	0580		0586	30,98
De 6 a 9 meses	0518	6	0525	16	0532	1	0539	2	0546	19	0553	443	0560		0567	462	0574	1.020	0581		0587	45,26
De 9 a 12 meses	0519	6	0526	25	0533	2	0540	7	0547	35	0554	444	0561		0568	479	0575	1.035	0582		0588	46,30
Más de 12 meses	0520	6	0527	42	0534	0	0541	10	0548	52	0555	484	0562		0569	537	0576	1.206	0583		0589	44,48
Total	0521	108	0528	130	0535	15	0542	19	0549	165	0556	6.668	0563	9	0570	6.842	0577	17.893			0590	38,24

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 06/06/2006	
Inferior a 1 año	0600	369	1600	479	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	799	1601	995	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.080	1602	1.331	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	2.218	1603	1.633	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	3.249	1604	3.351	2604	315
Entre 5 y 10 años	0605	58.492	1605	54.585	2605	250
Superior a 10 años	0606	76.965	1606	93.961	2606	999.435
Total	0607	143.171	1607	156.335	2607	1.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	9,56	1608	9,98	2608	26,79

Antigüedad	Situación actual 30/06/2024					
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 06/06/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	20,04	1609	19,57	2609	2,44

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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 30/06/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 06/06/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	2.313	0630	93.786	1620	2.357	1630	91.390	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	609	0631	49.256	1621	797	1631	64.810	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	1	0632	134	1622	1	1632	134	2622	1.686	2632	204.991
80% - 100%	0623		0633		1623		1633		2623	5.718	2633	795.009
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624	0	2634	0
120% - 140%	0625		0635		1625		1635		2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627	0	2637	0
Total	0628	2.923	0638	143.176	1628	3.155	1638	156.335	2628	7.404	2638	1.000.000
Media ponderada (%)	0639	35,40	0649		1639	36,54	1649		2639	87,63	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 06/06/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,88	1650	2,66	2650	3,28
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,16	1651	6,16	2651	4,84
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,56	1652	1,56	2652	2,45

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2024			Situación cierre anual anterior 31/12/2023			Situación inicial 06/06/2006					
	Nº de activos vivos	Principal pendiente		Nº de activos vivos	Principal pendiente		Nº de activos vivos	Principal pendiente				
Andalucía	0660	6	0683	269	1660	6	1683	280	2660	44	2683	7.516
Aragón	0661	67	0684	3.904	1661	71	1684	4.331	2661	136	2684	20.708
Asturias	0662		0685		1662	1	1685	23	2662	5	2685	601
Baleares	0663	2	0686	61	1663	2	1686	63	2663	2	2686	236
Canarias	0664		0687		1664	1	1687	3	2664	2	2687	122
Cantabria	0665	227	0688	11.141	1665	237	1688	11.951	2665	621	2688	82.241
Castilla-León	0666	35	0689	1.110	1666	37	1689	1.233	2666	92	2689	8.256
Castilla La Mancha	0667	73	0690	4.656	1667	77	1690	5.117	2667	155	2690	23.652
Cataluña	0668	17	0691	793	1668	18	1691	869	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	652	0695	34.556	1672	690	1695	37.661	2672	1.534	2695	223.288
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674		0697		1674	1	1697	1	2674	2	2697	281
Navarra	0675	2	0698	204	1675	2	1698	211	2675	4	2698	802
La Rioja	0676	38	0699	2.198	1676	41	1699	2.452	2676	85	2699	12.224
Comunidad Valenciana	0677	93	0700	4.553	1677	96	1700	4.873	2677	215	2700	30.052
País Vasco	0678	1.711	0701	79.726	1678	1.875	1701	87.267	2678	4.466	2701	583.241
Total España	0679	2.923	0702	143.171	1679	3.155	1702	156.335	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	2.923	0705	143.171	1682	3.155	1705	156.335	2682	7.404	2705	1.000.000

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 06/06/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,32			1710	1,24			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: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2024			Situación cierre anual anterior 31/12/2023			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	7.250	66.551	9.180	8.878	81.501	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	148.551	1723	10.000	1724	163.501	2723	10.000	2724	1.000.000

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas	
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados		Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		0738	0739	
			0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737					
ES0312251004	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,15	4,26	503		0	SI	66.551		0		67.054		
ES0312251012	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,30	4,41	341		0	SI	43.500		0		43.841		
ES0312251020	C	S	EURIBOR 6 MESES	0,65	4,76	327		0	SI	38.500		0		38.827		
Total						0740	1.171	0741		0743	148.551	0744		0745	149.722	0746

	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 06/06/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	4,43	0748	3,92	0749	3,26

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2024								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2023							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0312251012	B	0	0	975	11.666	0	0	524	9.826								
ES0312251020	C	0	0	931	12.632	0	0	532	10.867								
ES0312251004	A	14.950	851.449	1.764	146.455	17.264	820.799	1.292	142.832								
Total		0754	14.950	0755	851.449	0756	3.669	0757	170.753	1754	17.264	1755	820.799	1756	2.348	1757	163.526

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/06/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 06/06/2006
				0762	0763	0764
ES0312251004	A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0312251012	B	04/01/2022	FCH	AAA	AAA	A
ES0312251012	B	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	A2
ES0312251020	C	02/12/2022	FCH	A	A	BB
ES0312251020	C	26/04/2021	MDY	Baa2	Baa2	B1
ES0312251004	A	12/12/2018	FCH	AAA	AAA	AA

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 06/06/2006	
Inferior a 1 año	0765		1765	0	2765	
Entre 1 y 2 años	0766	66.551	1766	81.501	2766	
Entre 2 y 3 años	0767	82.000	1767	82.000	2767	
Entre 3 y 4 años	0768	0	1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769		1769	0	2769	
Entre 5 y 10 años	0770		1770		2770	914.500
Superior a 10 años	0771		1771		2771	85.500
Total	0772	148.551	1772	163.501	2772	1.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	3,09	1773	3,39	2773	9,27

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 06/06/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	10.800	1775	10.800	2775	21.500
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	10.800	1776	10.800	2776	21.500
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	7,27	1777	6,61	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	44,80	1792	49,85	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: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características				
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/06/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	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)	-114	-350	-16.816				
Total							0808	-114	0809	-350	0810	-16.816	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 06/06/2006		Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 06/06/2006			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	1.676	7006	1.522	7009	2,64	7012	2,44	7015	2,55		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.676	7008	1.522	7011	2,64	7014	2,44	7017	1.675.807	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	1.562	7024	1.419	7027	1,48	7030	1,23	7033	1,30		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	1.562	7026	1.419	7029	1,48	7032	1,23	7035	1,30	7036	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTAD O 4.9.2.b) (iv)

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
b) Si en dicha Fecha de Pago existan o se prevea que vayan a existir CANTIDADES DISPUESTAS DEL CRÉDITO SUBORDINADO o, en caso de Dotación del Depósito de Liquidez, éste no sea o se prevea que no va a ser igual al IMPORTE MÁXIMO DEL CRÉDITO SUBORDINADO	1	2,64	2,55	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b) (iv)
a) el Saldo Vivo de los Activos en morosidad que presenten más de tres (3) meses de retraso en el pago de importes vencidos, sea superior al % establecido para cada ISIN del Saldo Vivo de los Activos en esa misma fecha.	1	2,64	2,55	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b) (iv)
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera superior al porcentaje recogido del Saldo Vivo de los Activos que no tengan la consideración de Activos Fallidos	1	1,17	1,27	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

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	1862	0	2862	Días del mes /Base 365	3862	0,030	4862	150	5862	0	6862	Semestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	BILBAO 48 KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA	1863	0	2863	Días del mes /Base 365	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Semestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BANCO SANTANDER, S.A.	1864	0	2864		3864	0	4864	0	5864	0	6864	Semestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2024

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	
		31/03/2024	30/06/2024										
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872												
Margen de intereses	0873	166	-525										-360
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	-8	-196										-204
Dotaciones a provisiones (neto)	0875												0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876												0
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-16	-18										-35
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	141	-740	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-598
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879	0											0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880												0
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881	-141											-141
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	0	740	0	0	0	0	0	0	0	0	0	740
Comisión variable pagada	0883	0	205										205
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884												

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: BEKA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2024

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

S.06

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

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