

**I. DATOS IDENTIFICATIVOS**

Denominación del Fondo: AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS  
Número de registro del Fondo: 8653  
NIF Fondo: V84981299  
Denominación del compartimento:  
Número de registro del compartimento:  
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.  
NIF Gestora: A80732142  
Fondo Abierto: NO  
Fondo Privado: NO  
Estados agregados: NO  
Fecha: 30/09/2021

**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 Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	286.788	1001	320.140
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	286.788	1002	320.140
1. Activos titulizados	0003	286.788	1003	320.140
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	285.774	1005	318.127
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	5.215	1025	9.419
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-4.200	1027	-7.406
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0039		1039	
<b>III. Otros activos no corrientes</b>	0040		1040	

S.01

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	77.537	1041	78.243
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042		1042	
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	51.822	1043	49.685
1. Activos titulizados	0044	51.822	1044	49.685
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	49.110	1046	47.289
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	92	1065	150
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	1	1066	2
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	13.328	1067	10.365
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	135	1068	136
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-10.844	1069	-8.256
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	0	1084	0
<b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b>	0085	25.715	1085	28.558
1. Tesorería	0086	25.715	1086	28.558
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	364.325	1088	398.383

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	312.756	1089	348.082
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0090		1090	
1. Provisión garantías financieras	0091		1091	
2. Provisión por margen de intermediación	0092		1092	
3. Otras provisiones	0093		1093	
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0094	312.756	1094	348.082
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	289.438	1095	322.409
1.1 Series no subordinadas	0096	207.238	1096	240.209
1.2 Series subordinadas	0097	82.200	1097	82.200
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101	13.496	1101	13.321
2.1 Préstamo subordinado	0102	17.474	1102	17.474
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	-3.978	1105	-4.153
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	9.801	1108	12.328
3.1 Derivados de cobertura	0109	9.801	1109	12.328
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	21	1112	23
4.1 Garantías financieras	0113	21	1113	23
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	0116		1116	

S.01

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	61.370	1117	62.630
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0118		1118	
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	0119		1119	
1. Provisión garantías financieras	0120		1120	
2. Provisión por margen de intermediación	0121		1121	
3. Otras provisiones	0122		1122	
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	0123	61.352	1123	62.582
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	56.758	1124	57.468
1.1 Series no subordinadas	0125	56.758	1125	57.468
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		1128	0
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	4.191	1131	4.495
2.1 Préstamo subordinado	0132	4.165	1132	4.484
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	10	1136	12
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	17	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	402	1139	619
3.1 Derivados de cobertura	0140	402	1140	619
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	
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	0148	18	1148	48
1. Comisiones	0149	18	1149	19
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	15	1150	17
1.2 Comisión administrador	0151	918	1151	890
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	1152	2
1.4 Comisión variable	0153	1.807	1153	1.807
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-2.725	1155	-2.697
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	0	1157	29
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158	-9.801	1158	-12.328
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159		1159	
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	-9.801	1160	-12.328
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161		1161	
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	364.325	1162	398.383

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2021		Acumulado anterior 30/09/2020
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	429	1201	695	2201	1.483	3201	2.087
1.1 Activos titulizados	0202	429	1202	695	2202	1.483	3202	2.087
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-11	1204	-26	2204	-34	3204	-104
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	0	1205	-6	2205		3205	-30
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-11	1206	-20	2206	-34	3206	-74
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0208	-524	1208	-673	2208	-1.825	3208	-1.893
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	-107	1209	-4	2209	-376	3209	90
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	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	
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0215	0	1215	0	2215		3215	
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0216	0	1216	0	2216		3216	
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0217	-31	1217	-35	2217	-95	3217	-111
7.1 Servicios exteriores	0218	-1	1218	-1	2218	-4	3218	-9
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	-1	2219	-2	3219	-3
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	-1	2222	-1	3222	-6
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-30	1224	-33	2224	-91	3224	-101
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-18	1225	-21	2225	-56	3225	-63
7.3.2 Comisión administrador	0226	-9	1226	-10	2226	-28	3226	-31
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-3	1227	-3	2227	-7	3227	-7
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228		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
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0231	295	1231	15	2231	619	3231	274
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	295	1232	15	2232	619	3232	274
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233		3233	
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	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	
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0238	0	1238	0	2238		3238	
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0239	-158	1239	24	2239	-147	3239	-253
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0241	0	1241	0	2241		3241	
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

S.03

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2021		Acumulado anterior 30/09/2020
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	-182	1300	-6	2300	-617	3300	-5.859
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	-160	1301	19	2301	-518	3301	-5.753
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	447	1302	700	2302	1.544	3302	2.098
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	0	1303	-19	2303	0	3303	-31
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	-119	1304	180	2304	-357	3304	160
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-482	1305	-813	2305	-1.684	3305	-3.571
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	-6	1307	-29	2307	-20	3307	-4.409
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	0309	-21	1309	-23	2309	-65	3309	-72
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-19	1310	-21	2310	-57	3310	-64
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-2	1312	-2	2312	-7	3312	-7
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>	0315	-1	1315	-2	2315	-34	3315	-34
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	-22	1320	-25	2320	-77	3320	-58
3.6 Otros cobros de explotación	0321	21	1321	23	2321	42	3321	23
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>	0322	-1.420	1322	-979	2322	-2.226	3322	-9.364
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b>	0325	-1.420	1325	-459	2325	-1.907	3325	-2.525
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	5.903	1326	6.105	2326	17.755	3326	18.534
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	3.480	1327	3.543	2327	12.522	3327	8.596
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	461	1328	366	2328	1.496	3328	1.327
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-11.264	1331	-10.473	2331	-33.681	3331	-30.982
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	0332	0	1332	-520	2332	-319	3332	-6.839
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	-520	2334	-319	3334	-6.839
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
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	0337	-1.602	1337	-985	2337	-2.843	3337	-15.223
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	27.317	1338	27.393	2338	28.558	3338	41.631
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	25.715	1339	26.408	2339	25.715	3339	26.408

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2021		Acumulado anterior 30/09/2020
<b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>								
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	
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>0356</b>	<b>0</b>	<b>1356</b>	<b>0</b>	<b>2356</b>		<b>3356</b>	
<b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	199	1357	11	2357	702	3357	-2.462
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	199	1358	11	2358	702	3358	-2.462
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	524	1360	673	2360	1.825	3360	1.893
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-724	1362	-684	2362	-2.528	3362	569
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>0363</b>	<b>0</b>	<b>1363</b>	<b>0</b>	<b>2363</b>	<b>0</b>	<b>3363</b>	<b>0</b>
<b>3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>								
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	
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>0369</b>	<b>0</b>	<b>1369</b>	<b>0</b>	<b>2369</b>		<b>3369</b>	
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>0370</b>	<b>0</b>	<b>1370</b>	<b>0</b>	<b>2370</b>	<b>0</b>	<b>3370</b>	<b>0</b>



S.05.1

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2021								Situación cierre anual anterior 31/12/2020								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	5,25	0401	0	0421	0	0441	4,86	1381	5,14	1401	0	1421	0	1441	3,54	2381	0,45	2401	0,05	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 Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	51	0467	18	0474	1	0481		0488	19	0495	4.504	0502	1	0509	4.524
De 1 a 3 meses	0461	17	0468	15	0475	0	0482		0489	15	0496	1.777	0503	0	0510	1.793
De 3 a 6 meses	0462	13	0469	11	0476	1	0483	0	0490	12	0497	1.213	0504		0511	1.225
De 6 a 9 meses	0463	6	0470	22	0477		0484	0	0491	22	0498	472	0505		0512	494
De 9 a 12 meses	0464	2	0471	2	0478	0	0485	0	0492	3	0499	78	0506		0513	81
Más de 12 meses	0465	142	0472	13.293	0479	133	0486	3.617	0493	17.043	0500	3.314	0507		0514	20.356
<b>Total</b>	<b>0466</b>	<b>231</b>	<b>0473</b>	<b>13.361</b>	<b>0480</b>	<b>136</b>	<b>0487</b>	<b>3.617</b>	<b>0494</b>	<b>17.114</b>	<b>0501</b>	<b>11.357</b>	<b>0508</b>	<b>1</b>	<b>1515</b>	<b>28.473</b>

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	51	0522	18	0529	1	0536		0543	19	0550	4.504	0557	1	0564	4.524	0571	10.012	0578		0584	45,19
De 1 a 3 meses	0516	17	0523	15	0530	0	0537		0544	15	0551	1.777	0558	0	0565	1.793	0572	3.617	0579		0585	49,56
De 3 a 6 meses	0517	13	0524	11	0531	1	0538	0	0545	12	0552	1.213	0559		0566	1.225	0573	2.366	0580		0586	51,76
De 6 a 9 meses	0518	6	0525	22	0532		0539	0	0546	22	0553	472	0560		0567	494	0574	1.494	0581		0587	33,06
De 9 a 12 meses	0519	2	0526	2	0533	0	0540	0	0547	3	0554	78	0561		0568	81	0575	255	0582		0588	31,54
Más de 12 meses	0520	142	0527	13.293	0534	133	0541	3.617	0548	17.043	0555	3.314	0562		0569	20.356	0576	29.701	0583		0589	68,54
<b>Total</b>	<b>0521</b>	<b>231</b>	<b>0528</b>	<b>13.361</b>	<b>0535</b>	<b>136</b>	<b>0542</b>	<b>3.617</b>	<b>0549</b>	<b>17.114</b>	<b>0556</b>	<b>11.357</b>	<b>0563</b>	<b>1</b>	<b>0570</b>	<b>28.473</b>	<b>0577</b>	<b>47.445</b>			<b>0590</b>	<b>60,01</b>

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO C**

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 06/02/2007	
Inferior a 1 año	0600	360	1600	308	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	726	1601	684	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.322	1602	1.171	2602	128
Entre 3 y 4 años	0603	2.653	1603	1.904	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	4.043	1604	4.363	2604	662
Entre 5 y 10 años	0605	38.976	1605	36.461	2605	12.036
Superior a 10 años	0606	305.346	1606	340.309	2606	1.187.174
<b>Total</b>	0607	<b>353.427</b>	1607	<b>385.200</b>	2607	<b>1.200.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	0608	<b>15,64</b>	1608	<b>16,24</b>	2608	<b>28,54</b>

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 06/02/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	16,60	1609	15,87	2609	2,37

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO D**

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 06/02/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	2.348	0630	110.677	1620	2.221	1630	106.065	2620	1.162	2630	80.377
40% - 60%	0621	1.603	0631	159.561	1621	1.731	1631	167.852	2621	1.362	2631	161.140
60% - 80%	0622	576	0632	76.272	1622	783	1632	103.828	2622	1.733	2632	249.238
80% - 100%	0623	38	0633	6.916	1623	41	1633	7.455	2623	4.191	2633	709.245
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
<b>Total</b>	0628	<b>4.565</b>	0638	<b>353.427</b>	1628	<b>4.776</b>	1638	<b>385.200</b>	2628	<b>8.448</b>	2638	<b>1.200.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>	0639	<b>47,30</b>	0649		1639	<b>48,93</b>	1649		2639	<b>77,49</b>	2649	

S.05.1

**Denominación Fondo:** AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados:** NO

**Fecha:** 30/09/2021

**Entidades cedentes de los activos titulizados:** A95653077 KUTXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 06/02/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,54	1650	0,64	2650	4
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,50	1651	4,50	2651	6,95
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,01	1652	0,03	2652	2,75

<b>S.05.1</b>
<b>Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/09/2021</b>
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK</b>

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO F**

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 06/02/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	11	0683	1.089	1660	11	1683	1.159	2660	119	2683	19.950
Aragón	0661	84	0684	8.247	1661	86	1684	8.661	2661	152	2684	24.802
Asturias	0662	8	0685	558	1662	8	1685	590	2662	9	2685	1.312
Baleares	0663	4	0686	343	1663	4	1686	359	2663	5	2686	881
Canarias	0664	1	0687	24	1664	1	1687	26	2664	1	2687	142
Cantabria	0665	3	0688	278	1665	5	1688	315	2665	15	2688	1.989
Castilla-León	0666	279	0689	18.939	1666	287	1689	20.418	2666	424	2689	50.838
Castilla La Mancha	0667	83	0690	7.355	1667	85	1690	7.926	2667	140	2690	21.455
Cataluña	0668	680	0691	59.783	1668	710	1691	65.386	2668	1.116	2691	178.944
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	0
Extremadura	0670		0693		1670		1693		2670	1	2693	55
Galicia	0671	38	0694	3.306	1671	38	1694	3.436	2671	52	2694	7.254
Madrid	0672	1.114	0695	90.883	1672	1.160	1695	98.395	2672	2.206	2695	319.173
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	9	0697	724	1674	9	1697	751	2674	11	2697	1.582
Navarra	0675	14	0698	1.085	1675	16	1698	1.141	2675	28	2698	3.337
La Rioja	0676	38	0699	2.771	1676	41	1699	3.089	2676	67	2699	9.161
Comunidad Valenciana	0677	143	0700	12.390	1677	149	1700	13.261	2677	228	2700	33.745
País Vasco	0678	2.056	0701	145.651	1678	2.166	1701	160.288	2678	3.874	2701	525.380
<b>Total España</b>	0679	<b>4.565</b>	0702	<b>353.427</b>	1679	<b>4.776</b>	1702	<b>385.200</b>	2679	<b>8.448</b>	2702	<b>1.200.000</b>
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
<b>Total general</b>	0682	<b>4.565</b>	0705	<b>353.427</b>	1682	<b>4.776</b>	1705	<b>385.200</b>	2682	<b>8.448</b>	2705	<b>1.200.000</b>

<b>S.05.1</b>
<b>Denominación Fondo:</b> AyT Kutxa Hipotecario II, FTA
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b> HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
<b>Estados agregados:</b> NO
<b>Fecha:</b> 30/09/2021
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados:</b> A95653077 KUTXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 30/09/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 06/02/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,79			1710	0,73			2710	0,33		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO A**

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2021			Situación cierre anual anterior 31/12/2020			Situación inicial 06/02/2007					
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			
ES0370154009	A	11.178	23.618	263.997	11.178	26.631	297.677	11.178	100.000	1.117.800			
ES0370154017	B	582	100.000	58.200	582	100.000	58.200	582	100.000	58.200			
ES0370154025	C	240	100.000	24.000	240	100.000	24.000	240	100.000	24.000			
<b>Total</b>		0723	12.000	0724	346.197	1723	12.000	1724	379.877	2723	12.000	2724	1.200.000



S.05.2

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO B**

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas	
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado					
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739			
ES0370154009	A	NS	EURIBOR 3 MESES	0,13	0	0	0	SI	263.997	0	263.997				
ES0370154017	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,28	0	0	0	SI	58.200	0	58.200				
ES0370154025	C	S	EURIBOR 3 MESES	0,50	0	0	0	SI	24.000	0	24.000				
<b>Total</b>						0740		0741	0743	346.197	0744	0745	346.197	0746	

	Situación actual 30/09/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 06/02/2007
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0	0748
			0749
			4,04

<b>S.05.2</b>
<b>Denominación Fondo:</b> AyT Kutxa Hipotecario II, FTA
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b> HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
<b>Estados agregados:</b> NO
<b>Periodo de la declaración:</b> 30/09/2021
<b>Mercados de cotización de los valores emitidos:</b> AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO C**

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2021								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2020							
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
ES0370154009	A	11.264	853.803	0	141.500	10.473	810.312	0	141.500	0	810.312	4	9.463	0	810.312	15	4.571
ES0370154017	B	0	0	0	9.463	0	0	4	9.463	0	0	15	4.571	0	0	19	155.534
ES0370154025	C	0	0	0	4.575	0	0	15	4.571	0	0	19	155.534	0	0	19	155.534
<b>Total</b>		0754	11.264	0755	853.803	0756	141.500	0757	155.538	1754	10.473	1755	810.312	1756	19	1757	155.534

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO D**

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/09/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 06/02/2007
				0762	0763	0764
ES0370154009	A	10/12/2018	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0370154009	A	25/07/2018	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0370154017	B	29/07/2021	FCH	A+	A	A
ES0370154017	B	23/03/2021	SYP	AA-	A	A
ES0370154025	C	24/04/2020	FCH	B-	B-	BBB
ES0370154025	C	23/03/2021	SYP	B+	B-	BBB

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 06/02/2007	
Inferior a 1 año	0765	0	1765	0	2765	
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	
Entre 3 y 4 años	0768	263.997	1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769		1769	297.677	2769	
Entre 5 y 10 años	0770	82.200	1770	82.200	2770	1.117.800
Superior a 10 años	0771		1771		2771	82.200
<b>Total</b>	<b>0772</b>	<b>346.197</b>	<b>1772</b>	<b>379.877</b>	<b>2772</b>	<b>1.200.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>0773</b>	<b>4,21</b>	<b>1773</b>	<b>5,24</b>	<b>2773</b>	<b>9,31</b>

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 06/02/2007	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	17.474	1775	17.474	2775	27.600
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	17.474	1776	17.474	2776	27.600
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	5,05	1777	4,60	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	76,26	1792	78,36	2792	93,15
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 Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/09/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 06/02/2007	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Permuta 1	BANCO SANTANDER	Trimestral	la suma de los intereses devengados, vencidos e ingresados al Fondo durante el Periodo de Liquidación que vence de los Activos, disminuida en el importe de los Intereses Corridos que, en su caso, hubiere pagado el Fondo durante el mismo Periodo de Liquidación, entre el Importe Nominal, multiplicado por 360 y dividido por los días efectivos existentes en dicho Periodo de Liquidación	Para cada uno de los Préstamos Hipotecarios sobre los que se hayan satisfecho los intereses ordinarios y de demora percibidos por el Fondo durante el Periodo de Liquidación la división entre (i) las sumas percibidas por el Fondo en concepto de intereses ordinarios y de demora en cada uno de los Préstamos Hipotecarios, entre (ii) el tipo anual de interés aplicado en el correspondiente Préstamo Hipotecario. El resultado de ese cociente será el Importe Nocional Individual de cada Préstamo Hipotecario.	Tipo de Interés de Referencia de los Bonos fijado para el correspondiente Periodo de Devengo de Intereses de los Bonos más un margen del 0,40 %	Para cada uno de los Préstamos Hipotecarios sobre los que se hayan satisfecho los intereses ordinarios y de demora percibidos por el Fondo durante el Periodo de Liquidación la división entre (i) las sumas percibidas por el Fondo en concepto de intereses ordinarios y de demora en cada uno de los Préstamos Hipotecarios, entre (ii) el tipo anual de interés aplicado en el correspondiente Préstamo Hipotecario. El resultado de ese cociente será el Importe Nocional Individual de cada Préstamo Hipotecario.	-10.203	-12.947	-89.853	
<b>Total</b>							0808 -10.203	0809 -12.947	0810 -89.853	

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO B**

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 06/02/2007		Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 06/02/2007			
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			
<b>Total</b>	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

**INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO**

**CUADRO A**

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	17.080	7006	14.138	7009	5,32	7012	5,23	7015	5,16		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	17.080	7008	14.138	7011	5,32	7014	5,23	7017	17.079.826	7018	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	17.016	7024	14.034	7027	4,25	7030	4,06	7033	4,24		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	17.016	7026	14.034	7029	4,25	7032	4,06	7035	4,24	7036	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853



Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

**INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO**

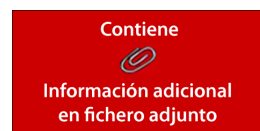
**CUADRO B**

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
<b>Amortización secuencial: series</b>	0854	0858	1858	2858
Si en la Fecha de Determinación correspondiente a la Fecha de Pago en curso, el importe a que ascienda el Saldo Vivo de los Activos con morosidad que presenten más de tres (3) meses de retraso en el pago de los importes vencidos es superior al % establecido	1	5,40	5,32	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)
Si en la Fecha de Determinación correspondiente a la Fecha de Pago en curso, el importe a que ascienda el Saldo Vivo de los Activos con morosidad que presenten más de tres (3) meses de retraso en el pago de los importes vencidos es superior al % establecido	0,75	5,40	5,32	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series</b>	0855	0859	1859	2859
El valor nominal agregado de los Activos Fallidos desde la Fecha de Constitución represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del valor nominal de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo.	10,71	5,84	5,84	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6.1.B
El valor nominal agregado de los Activos Fallidos desde la Fecha de Constitución represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del valor nominal de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo.	7,12	5,84	5,84	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6.1.B
<b>No Reducción del Fondo de Reserva</b>	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	1,04	0,93	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.1
<b>OTROS TRIGGERS</b>	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

**CUADRO C**

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



S.05.5

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

**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	0,020	4862	0	5862	0	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	KUTXABANK	1863	0	2863	Días del mes /Base 365	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Trimestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BANCO SANTANDER, S.A.	1864	10	2864	Días del mes /Días año	3864	0	4864	0	5864	0	6864	Trimestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

**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		
		31/03/2021	30/06/2021	30/09/2021											
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872														
Margen de intereses	0873	-120	-150	-107											-376
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	-163	487	295											619
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	-33	-32	-31											-95
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	-316	305	158	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	147
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879														0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880		-305	-158											-463
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881														0
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	316	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	316
Comisión variable pagada	0883														0
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884														0

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

**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 Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

**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**