

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: HT ABANCA RMBS II, FONDO DE TITULIZACION
Número de registro del Fondo: 10845
NIF Fondo: V87959078
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)

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	633.454	1001	679.935
I. Activos financieros a largo plazo	0002	633.454	1002	679.935
1. Activos titulizados	0003	633.454	1003	679.935
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	107.793	1004	116.338
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	524.231	1005	562.554
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 titulización	0021		1021	
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	2.399	1025	1.711
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-969	1027	-668
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	

S.01

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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 CORRIENTE	0041	103.346	1041	103.677
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	52.849	1043	48.323
1. Activos titulizados	0044	52.849	1044	48.323
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	8.961	1045	8.253
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	43.579	1046	39.656
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	0
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 titulización	0062		1062	
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	9	1065	25
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	218	1066	341
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	133	1067	76
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	5	1068	3
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-56	1069	-31
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
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	
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	0	1084	
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	50.496	1085	55.354
1. Tesorería	0086	50.496	1086	55.354
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	736.799	1088	783.612

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	676.862	1089	723.406
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	676.862	1094	723.406
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	516.243	1095	562.698
1.1 Series no subordinadas	0096	516.243	1096	562.698
1.2 Series subordinadas	0097		1097	
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	160.619	1101	160.708
2.1 Préstamo subordinado	0102	160.619	1102	160.708
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	0	1105	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108		1108	
3.1 Derivados de cobertura	0109		1109	
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	
4.1 Garantías financieras	0113		1113	
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

S.01
Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización
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 CORRIENTE	0117	59.938	1117	60.205
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	59.599	1123	59.491
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	59.509	1124	59.389
1.1 Series no subordinadas	0125	59.509	1125	59.389
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	0	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	90	1131	101
2.1 Préstamo subordinado	0132	59	1132	59
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	30	1136	42
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137		1137	
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139		1139	
3.1 Derivados de cobertura	0140		1140	
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	1	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	1	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	339	1148	715
1. Comisiones	0149	324	1149	677
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	17	1150	21
1.2 Comisión administrador	0151	13	1151	14
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	1152	3
1.4 Comisión variable	0153	292	1153	640
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	15	1157	37
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158		1158	
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160		1160	
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	736.799	1162	783.612

S.02

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	679	1201	1.050	2201	2.476	3201	3.302
1.1 Activos titulizados	0202	679	1202	1.050	2202	2.476	3202	3.302
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-105	1204	-274	2204	-311	3204	-740
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	0	1205	-65	2205		3205	-227
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-43	1206	-115	2206	-134	3206	-393
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-62	1207	-94	2207	-177	3207	-120
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	0	1208	0	2208		3208	
A) MARGEN DE INTERESES	0209	574	1209	777	2209	2.165	3209	2.562
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	-306	1217	-312	2217	-1.840	3217	-1.790
7.1 Servicios exteriores	0218	0	1218	-1	2218	-3	3218	-7
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	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	0	1222	0	2222	-2	3222	-4
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-305	1224	-311	2224	-1.835	3224	-1.783
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-21	1225	-22	2225	-69	3225	-54
7.3.2 Comisión administrador	0226	-13	1226	-19	2226	-53	3226	-58
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-3	1227	-3	2227	-7	3227	-8
7.3.4 Comisión variable	0228	-269	1228	-268	2228	-1.706	3228	-1.660
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	-3
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-269	1231	-465	2231	-325	3231	-772
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-269	1232	-465	2232	-325	3232	-772
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233		3233	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234	0	2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238		3238	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	0	1239	0	2239		3239	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: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	35	1300	-75	2300	32	3300	208
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	652	1301	537	2301	2.273	3301	2.589
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	759	1302	1.057	2302	2.625	3302	3.346
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	0	1303	-227	2303	0	3303	-227
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	3305	0
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	-62	1306	-94	2306	-177	3306	-120
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	-45	1307	-199	2307	-175	3307	-410
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-591	1309	-612	2309	-2.189	3309	-2.353
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-24	1310	-17	2310	-73	3310	-52
2.2 Comisión administrador	0311	-18	1311	-19	2311	-54	3311	-59
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-3	1312	-3	2312	-8	3312	-8
2.4 Comisión variable	0313	-547	1313	-573	2313	-2.055	3313	-2.234
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-26	1315	-1	2315	-53	3315	-28
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	-26	1320	-1	2320	-53	3320	-28
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-1.266	1322	-642	2322	-4.890	3322	-6.759
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	-1.237	1325	-613	2325	-4.830	3325	-6.700
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	0	1326	0	2326	0	3326	0
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	5.231	1327	3.817	2327	16.907	3327	11.821
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	8.235	1328	8.290	2328	24.599	3328	25.130
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	-14.703	1331	-12.720	2331	-46.336	3331	-43.650
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-30	1332	-30	2332	-60	3332	-59
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	-30	1334	-30	2334	-60	3334	-59
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	-1.232	1337	-718	2337	-4.858	3337	-6.551
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	51.728	1338	50.284	2338	55.354	3338	56.118
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	50.496	1339	49.567	2339	50.496	3339	49.567

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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
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	0	1357	0	2357	0	3357	0
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	0	1358	0	2358	0	3358	0
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	0	1360	0	2360	0	3360	0
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	0	1362	0	2362	0	3362	0
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: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.

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	0,37	0400	0	0420	0	0440	-64,42	1380	0	1400	0	1420	0	1440	2,87	2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	0,37	0401	0	0421	0	0441	-84,95	1381	0,25	1401	0	1421	0	1441	2,87	2381		2401		2421		2441	
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382	0	1402	0	1422	0	1442	0	2382	0	2402	0	2422	0	2442	0
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383	0	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: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización
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: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	8.542	0467	2.702	0474	217	0481		0488	2.919	0495	674.799	0502	7	0509	677.724
De 1 a 3 meses	0461	13	0468	8	0475	1	0482		0489	9	0496	1.323	0503	0	0510	1.332
De 3 a 6 meses	0462	2	0469	6	0476	1	0483	1	0490	8	0497	451	0504		0511	459
De 6 a 9 meses	0463	7	0470	16	0477	1	0484	1	0491	17	0498	632	0505		0512	650
De 9 a 12 meses	0464	4	0471	14	0478	1	0485	2	0492	17	0499	275	0506		0513	292
Más de 12 meses	0465	11	0472	97	0479	2	0486	21	0493	120	0500	1.041	0507		0514	1.161
Total	0466	8.579	0473	2.842	0480	223	0487	25	0494	3.090	0501	678.521	0508	7	1515	681.618

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	8.542	0522	2.702	0529	217	0536		0543	2.919	0550	674.799	0557	7	0564	677.724	0571	1.595.783	0578	1.595.783	0584	42,47
De 1 a 3 meses	0516	13	0523	8	0530	1	0537		0544	9	0551	1.323	0558	0	0565	1.332	0572	2.417	0579	2.417	0585	55,12
De 3 a 6 meses	0517	2	0524	6	0531	1	0538	1	0545	8	0552	451	0559		0566	459	0573	663	0580	663	0586	69,18
De 6 a 9 meses	0518	7	0525	16	0532	1	0539	1	0546	17	0553	632	0560		0567	650	0574	1.343	0581	1.343	0587	48,37
De 9 a 12 meses	0519	4	0526	14	0533	1	0540	2	0547	17	0554	275	0561		0568	292	0575	645	0582	645	0588	45,28
Más de 12 meses	0520	11	0527	97	0534	2	0541	21	0548	120	0555	1.041	0562		0569	1.161	0576	1.847	0583	1.847	0589	62,84
Total	0521	8.579	0528	2.842	0535	223	0542	25	0549	3.090	0556	678.521	0563	7	0570	681.618	0577	1.602.699			0590	42,53

S.05.1

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.

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 19/12/2017	
Inferior a 1 año	0600	424	1600	415	2600	243
Entre 1 y 2 años	0601	1.278	1601	1.245	2601	829
Entre 2 y 3 años	0602	1.892	1602	1.935	2602	1.865
Entre 3 y 4 años	0603	3.637	1603	3.196	2603	2.584
Entre 4 y 5 años	0604	4.453	1604	5.043	2604	4.317
Entre 5 y 10 años	0605	53.478	1605	53.710	2605	41.851
Superior a 10 años	0606	621.933	1606	663.044	2606	848.311
Total	0607	687.095	1607	728.588	2607	900.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	19,01	1608	19,59	2608	22

Antigüedad	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/12/2017	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	13,03	1609	12,25	2609	9,19

S.05.1
Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización
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: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.

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 19/12/2017			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	3.537	0630	156.993	1620	3.518	1630	157.367	2620	3.177	2630	150.170
40% - 60%	0621	2.761	0631	253.539	1621	2.785	1631	256.579	2621	2.813	2631	262.457
60% - 80%	0622	2.224	0632	258.416	1622	2.464	1632	289.019	2622	3.323	2632	396.606
80% - 100%	0623	133	0633	18.146	1623	189	1633	25.622	2623	651	2633	90.768
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624		2634	
120% - 140%	0625		0635		1625		1635		2625		2635	
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626		2636	
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627		2637	
Total	0628	8.655	0638	687.095	1628	8.956	1638	728.588	2628	9.964	2638	900.000
Media ponderada (%)	0639	52,96	0649		1639	54,07	1649		2639	58,63	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.

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 19/12/2017	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,51	1650	0,57	2650	
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,51	1651	4,73	2651	4,89
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,01	1652	0,02	2652	0,08

S.05.1
Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización
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: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.

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 19/12/2017			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	511	0683	45.643	1660	523	1683	47.847	2660	586	2683	58.024
Aragón	0661	94	0684	8.432	1661	97	1684	8.907	2661	106	2684	10.727
Asturias	0662	149	0685	12.366	1662	155	1685	13.097	2662	166	2685	15.926
Baleares	0663	100	0686	10.558	1663	103	1686	11.219	2663	112	2686	13.708
Canarias	0664	99	0687	8.398	1664	100	1687	8.654	2664	110	2687	10.396
Cantabria	0665	38	0688	3.541	1665	39	1688	3.815	2665	42	2688	4.696
Castilla-León	0666	417	0689	31.105	1666	432	1689	32.970	2666	479	2689	40.420
Castilla La Mancha	0667	82	0690	7.265	1667	83	1690	7.537	2667	89	2690	9.085
Cataluña	0668	995	0691	109.853	1668	1.020	1691	115.671	2668	1.128	2691	140.192
Ceuta	0669	1	0692	154	1669	1	1692	158	2669	1	2692	180
Extremadura	0670	59	0693	4.149	1670	60	1693	4.302	2670	68	2693	5.268
Galicia	0671	4.679	0694	302.255	1671	4.868	1694	322.542	2671	5.459	2694	407.755
Madrid	0672	485	0695	55.216	1672	504	1695	59.029	2672	561	2695	72.828
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673		2696	
Murcia	0674	63	0697	5.906	1674	63	1697	6.102	2674	72	2697	7.259
Navarra	0675	25	0698	2.148	1675	25	1698	2.261	2675	27	2698	2.973
La Rioja	0676	10	0699	1.198	1676	10	1699	1.226	2676	11	2699	1.347
Comunidad Valenciana	0677	700	0700	62.384	1677	722	1700	65.817	2677	787	2700	78.431
País Vasco	0678	148	0701	16.522	1678	151	1701	17.434	2678	160	2701	20.784
Total España	0679	8.655	0702	687.095	1679	8.956	1702	728.588	2679	9.964	2702	900.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680		2703	
Resto	0681		0704		1681		1704		2681		2704	
Total general	0682	8.655	0705	687.095	1682	8.956	1705	728.588	2682	9.964	2705	900.000

S.05.1
Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización
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: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 19/12/2017			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,73			1710	0,71			2710	0,65		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

S.05.2

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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 19/12/2017					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0305306005	UNICO	7.800	73.814	575.751	7.800	79.755	622.087	7.800	100.000	780.000			
Total		0723	7.800	0724	575.751	1723	7.800	1724	622.087	2723	7.800	2724	780.000

S.05.2
Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización
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		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
						0730	0731			0732	0733	0734	0735			0742	0736
ES0305306005	UNICO	NS	EURIBOR 3 MESES	0,30	0	0	0	0	SI	575.751	0	0	0	575.751			
Total						0740		0741		0743	575.751	0744		0745	575.751	0746	

	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/12/2017	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0	0748	0	0749	

S.05.2

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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 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	1750	1751	1752	1753								
ES0305306005	UNICO	14.703	204.249	0	305	12.720	145.511	227	305								
Total		0754	14.703	0755	204.249	0756		0757	305	1754	12.720	1755	145.511	1756	227	1757	305

S.05.2

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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 19/12/2017
				0762	0763	0764
ES0305306005	UNICO	20/12/2017	DBRS	AAA	AAA	
ES0305306005	UNICO	09/03/2021	FCH	AAA	AA+	
ES0305306005	UNICO	20/12/2017	SCP	AAA	AAA	

S.05.2

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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 19/12/2017	
Inferior a 1 año	0765		1765		2765	0
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769	
Entre 5 y 10 años	0770	575.751	1770	622.087	2770	780.000
Superior a 10 años	0771		1771		2771	
Total	0772	575.751	1772	622.087	2772	780.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	8,74	1773	9,13	2773	6,25

S.05.3

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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 19/12/2017	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	40.500	1775	40.500	2775	40.500
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	40.500	1776	40.500	2776	40.500
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	7,03	1777	6,51	2777	5,19
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	N
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	100	1792	100	2792	100
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: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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 19/12/2017			
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806		
Total						0808		0809		0810	

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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 19/12/2017		Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 19/12/2017			
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: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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	3	7002	0	7003	162	7006	95	7009	0,37	7012	0,25	7015	0,32		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	162	7008	95	7011	0,37	7014	0,25	7017	162.155	7018	GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	114	7024	59	7027	0,15	7030	0,10	7033	0,14		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	114	7026	59	7029	0,15	7032	0,10	7035	0,14	7036	NOTA DE VALORES 4.9.2.b

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

S.05.4

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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

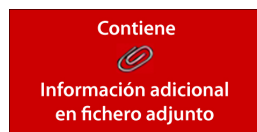
CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
a) Que el importe a que ascienda la suma del Saldo Vivo de los Activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos y que no tengan la consideración de Activos Fallidos (los ?Activos Morosos?), fuera superior al 1,5	1,50	0,22	0,19	3. ESTRUCTURA Y TESORERIA (3.4.2) pag.128 Folleto
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



S.05.5

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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	11	2862	Días del mes /Días año	3862	0,010	4862	0	5862	0	6862	Trimestral	7862		8862	
Comisión administrador	0863	ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.	1863	0	2863	Días del mes /Días año	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Trimestral	7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BANCO SANTANDER, S.A.	1864	3	2864		3864	0	4864	0	5864	0	6864	Trimestral	7864		8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización
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	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Abanca
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	

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

S.05.5

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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
		25/01/2021	26/04/2021	26/07/2021						
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885									
Saldo inicial	0886	40.500	40.500	40.500						
Cobros del periodo	0887	18.554	14.837	15.369						
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-88	-77	-78						
Pagos por derivados	0889	0	0	0						
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-40.500	-40.500	-40.500						
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-17.560	-14.074	-14.703						
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-44	-41	-41						
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0						
Saldo disponible	0894	862	645	547						
Liquidación de comisión variable	0895	862	645	547						

S.06

Denominación Fondo: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

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