

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: 30/09/2019

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

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: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	754.442	1001	786.120
I. Activos financieros a largo plazo	0002	754.442	1002	786.120
1. Activos titulizados	0003	754.442	1003	786.120
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	753.764	1004	785.325
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005		1005	
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	826	1025	797
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-148	1027	-2
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: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	99.008	1041	109.981
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	48.001	1043	52.973
1. Activos titulizados	0044	48.001	1044	52.973
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	47.509	1045	52.894
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046		1046	
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	18	1065	33
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	451	1066	34
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	26	1067	10
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	2	1068	2
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-5	1069	0
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		1082	
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084		1084	
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	51.007	1085	57.009
1. Tesorería	0086	51.007	1086	57.009
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	853.450	1088	896.101

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: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	798.084	1089	827.222
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	798.084	1094	827.222
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	637.287	1095	666.335
1.1 Series no subordinadas	0096	637.287	1096	666.335
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	160.797	1101	160.887
2.1 Préstamo subordinado	0102	160.797	1102	160.887
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: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) PASIVO CORRIENTE	0117	55.365	1117	68.879
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	54.633	1123	68.091
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	54.430	1124	67.870
1.1 Series no subordinadas	0125	54.430	1125	67.870
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	203	1131	220
2.1 Préstamo subordinado	0132	119	1132	119
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	84	1136	101
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137		1137	
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139		1139	
3.1 Derivados de cobertura	0140		1140	
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	1	1143	1
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	1	1144	1
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	732	1148	789
1. Comisiones	0149	718	1149	739
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	16	1150	16
1.2 Comisión administrador	0151	15	1151	16
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	3	1152	3
1.4 Comisión variable	0153	685	1153	704
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	14	1157	49
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	853.450	1162	896.101

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: 30/09/2019

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2019		Acumulado anterior 30/09/2018
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	1.366	1201	1.395	2201	4.050	3201	4.010
1.1 Activos titulizados	0202	1.366	1202	1.395	2202	4.050	3202	4.010
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-145	1204	-160	2204	-469	3204	-550
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	0	1205	0	2205		3205	-72
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-120	1206	-135	2206	-395	3206	-425
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-25	1207	-26	2207	-75	3207	-54
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	0	1208	0	2208		3208	
A) MARGEN DE INTERESES	0209	1.221	1209	1.235	2209	3.580	3209	3.460
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	-1.068	1217	-1.235	2217	-3.429	3217	-3.355
7.1 Servicios exteriores	0218	0	1218	0	2218	-4	3218	-2
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219	0	2219	-2	3219	-2
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	-2	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-1.068	1224	-1.235	2224	-3.425	3224	-3.353
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-21	1225	-22	2225	-64	3225	-68
7.3.2 Comisión administrador	0226	-21	1226	-22	2226	-62	3226	-66
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-3	1227	-3	2227	-8	3227	-7
7.3.4 Comisión variable	0228	-1.023	1228	-1.188	2228	-3.292	3228	-3.214
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	2
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-153	1231	0	2231	-151	3231	
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-153	1232	0	2232	-151	3232	
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	-104
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: 30/09/2019

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2019		Acumulado anterior 30/09/2018
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	44	1300	-11	2300	-325	3300	879
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	1.204	1301	1.251	2301	3.161	3301	3.617
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	1.366	1302	1.408	2302	3.648	3302	4.091
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	0	1303	0	2303	0	3303	-78
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	-25	1306	-26	2306	-75	3306	-54
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	-138	1307	-131	2307	-413	3307	-341
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-1.160	1309	-1.258	2309	-3.446	3309	-2.646
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-21	1310	-22	2310	-64	3310	-54
2.2 Comisión administrador	0311	-21	1311	-22	2311	-63	3311	-53
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-3	1312	-3	2312	-8	3312	-5
2.4 Comisión variable	0313	-1.115	1313	-1.211	2313	-3.312	3313	-2.487
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	-47
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	0	1315	-4	2315	-40	3315	-92
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	0	1320	-5	2320	-40	3320	-94
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	1	2321	0	3321	1
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	149	1322	-380	2322	-5.677	3322	6.476
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	179	1325	-350	2325	-5.587	3325	6.536
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	4.430	1327	3.857	2327	13.811	3327	13.687
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	8.562	1328	8.631	2328	23.090	3328	25.881
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	-12.813	1331	-12.838	2331	-42.488	3331	-33.033
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-30	1332	-30	2332	-89	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	-89	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	193	1337	-390	2337	-6.002	3337	7.355
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	50.814	1338	50.994	2338	57.009	3338	43.249
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	51.007	1339	50.604	2339	51.007	3339	50.604

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: 30/09/2019

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2019		Acumulado anterior 30/09/2018
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	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: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2019								Situación cierre anual anterior 31/12/2018								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381		0401		0421		0441		1381		1401		1421		1441		2381		2401		2421		2441	
Préstamos hipotecarios	0382	0,11	0402	0	0422	0	0442	2,59	1382	0,10	1402	0	1422	0	1442	2,46	2382	0	2402	0	2422	0	2442	0
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: HT Abanca RMBS II, Fondo de Titulización

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

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	9.328	0467	2.816	0474	449	0481		0488	3.265	0495	790.226	0502	15	0509	793.506
De 1 a 3 meses	0461	17	0468	8	0475	2	0482		0489	10	0496	1.303	0503	0	0510	1.313
De 3 a 6 meses	0462	1	0469	2	0476	0	0483	0	0490	3	0497	30	0504		0511	33
De 6 a 9 meses	0463	2	0470	5	0477	0	0484	1	0491	6	0498	243	0505		0512	249
De 9 a 12 meses	0464		0471		0478		0485		0492		0499		0506		0513	
Más de 12 meses	0465	4	0472	18	0479	1	0486	6	0493	26	0500	552	0507		0514	578
Total	0466	9.352	0473	2.850	0480	452	0487	7	0494	3.309	0501	792.355	0508	15	1515	795.679

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	9.328	0522	2.816	0529	449	0536		0543	3.265	0550	790.226	0557	15	0564	793.506	0571	1.743.152	0578	1.742.528	0584	45,52
De 1 a 3 meses	0516	17	0523	8	0530	2	0537		0544	10	0551	1.303	0558	0	0565	1.313	0572	3.238	0579	3.238	0585	40,55
De 3 a 6 meses	0517	1	0524	2	0531	0	0538	0	0545	3	0552	30	0559		0566	33	0573	154	0580	154	0586	21,35
De 6 a 9 meses	0518	2	0525	5	0532	0	0539	1	0546	6	0553	243	0560		0567	249	0574	319	0581	319	0587	78,10
De 9 a 12 meses	0519		0526		0533		0540		0547		0554		0561		0568		0575		0582		0588	
Más de 12 meses	0520	4	0527	18	0534	1	0541	6	0548	26	0555	552	0562		0569	578	0576	860	0583	860	0589	67,25
Total	0521	9.352	0528	2.850	0535	452	0542	7	0549	3.309	0556	792.355	0563	15	0570	795.679	0577	1.747.723			0590	45,53

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: 30/09/2019

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 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 19/12/2017	
Inferior a 1 año	0600	455	1600	259	2600	243
Entre 1 y 2 años	0601	1.042	1601	1.152	2601	829
Entre 2 y 3 años	0602	1.829	1602	1.837	2602	1.865
Entre 3 y 4 años	0603	3.105	1603	3.070	2603	2.584
Entre 4 y 5 años	0604	3.724	1604	3.340	2604	4.317
Entre 5 y 10 años	0605	48.127	1605	45.804	2605	41.851
Superior a 10 años	0606	743.843	1606	783.565	2606	848.311
Total	0607	802.125	1607	839.026	2607	900.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	20,61	1608	21,20	2608	22

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 19/12/2017	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	10,98	1609	10,23	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: 30/09/2019
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 30/09/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				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	3.386	0630	153.080	1620	3.366	1630	154.296	2620	3.177	2630	150.170
40% - 60%	0621	2.842	0631	263.202	1621	2.800	1631	261.958	2621	2.813	2631	262.457
60% - 80%	0622	2.857	0632	337.295	1622	3.047	1632	359.688	2622	3.323	2632	396.606
80% - 100%	0623	353	0633	48.548	1623	456	1633	63.083	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	9.438	0638	802.125	1628	9.669	1638	839.026	2628	9.964	2638	900.000
Media ponderada (%)	0639	55,98	0649		1639	56,96	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: 30/09/2019

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 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 19/12/2017	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,64	1650	0,66	2650	
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,89	1651	4,81	2651	4,89
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,07	1652	0,03	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: 30/09/2019
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 30/09/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				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	562	0683	52.405	1660	573	1683	54.452	2660	586	2683	58.024
Aragón	0661	100	0684	9.654	1661	104	1684	10.093	2661	106	2684	10.727
Asturias	0662	161	0685	14.341	1662	162	1685	14.889	2662	166	2685	15.926
Baleares	0663	108	0686	12.403	1663	109	1686	12.757	2663	112	2686	13.708
Canarias	0664	103	0687	9.236	1664	106	1687	9.710	2664	110	2687	10.396
Cantabria	0665	41	0688	4.285	1665	41	1688	4.423	2665	42	2688	4.696
Castilla-León	0666	458	0689	36.074	1666	466	1689	37.480	2666	479	2689	40.420
Castilla La Mancha	0667	84	0690	8.031	1667	85	1690	8.336	2667	89	2690	9.085
Cataluña	0668	1.078	0691	126.404	1668	1.104	1691	132.066	2668	1.128	2691	140.192
Ceuta	0669	1	0692	172	1669	1	1692	176	2669	1	2692	180
Extremadura	0670	64	0693	4.853	1670	67	1693	5.037	2670	68	2693	5.268
Galicia	0671	5.131	0694	358.628	1671	5.269	1694	377.071	2671	5.459	2694	407.755
Madrid	0672	533	0695	65.022	1672	546	1695	68.166	2672	561	2695	72.828
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673		2696	
Murcia	0674	67	0697	6.698	1674	69	1697	6.911	2674	72	2697	7.259
Navarra	0675	25	0698	2.469	1675	25	1698	2.560	2675	27	2698	2.973
La Rioja	0676	11	0699	1.277	1676	11	1699	1.304	2676	11	2699	1.347
Comunidad Valenciana	0677	756	0700	71.325	1677	775	1700	74.100	2677	787	2700	78.431
País Vasco	0678	155	0701	18.848	1678	156	1701	19.494	2678	160	2701	20.784
Total España	0679	9.438	0702	802.125	1679	9.669	1702	839.026	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	9.438	0705	802.125	1682	9.669	1705	839.026	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: 30/09/2019
Entidades cedentes de los activos titulizados: A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 19/12/2017			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,69			1710	0,68			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: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2019			Situación cierre anual anterior 31/12/2018			Situación inicial 19/12/2017					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0305306005	UNICO	7.800	88.682	691.717	7.800	94.129	734.205	7.800	100.000	780.000			
Total		0723	7.800	0724	691.717	1723	7.800	1724	734.205	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: 30/09/2019
Mercados de cotización de los valores emitidos:

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		0737			0738	0739
ES0305306005	UNICO	NS	EURIBOR 3 MESES	0,30	0	0	0		SI	691.717		0		691.717			
Total						0740		0741		0743	691.717	0744		0745	691.717	0746	

	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		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: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2019								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2018							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0305306005	UNICO	12.813	88.283	0	78	12.838	33.033	0	78	12.838	33.033	0	78	12.838	33.033	0	78
Total		0754	12.813	0755	88.283	0756		0757	78	1754	12.838	1755	33.033	1756		1757	78

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: 30/09/2019
Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 19/12/2017
				0762	0763	0764
ES0305306005	UNICO	20/12/2017	DBRS	AAA	AAA	
ES0305306005	UNICO	20/12/2017	FCH	AA	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: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 19/12/2017	
Inferior a 1 año	0765	0	1765	734.205	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	691.717	1770		2770	780.000
Superior a 10 años	0771	0	1771		2771	
Total	0772	691.717	1772	734.205	2772	780.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	6,98	1773	0	2773	6,25

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: 30/09/2019

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 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	5,85	1777	5,52	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: 30/09/2019

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características		
Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 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: 30/09/2019

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 19/12/2017		Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		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: 30/09/2019

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	3	7002	0	7003	35	7006	14	7009	0,11	7012	0,10	7015	0,10		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	35	7008	14	7011	0,11	7014	0,10	7017	34.615	7018	GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	9	7024	0	7027	0,02	7030	0	7033	0		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	9	7026	0	7029	0,02	7032	0	7035	0	7036	NOTA DE VALORES 4.9.2.b

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

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: 30/09/2019

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO


CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
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	0,10	0,10	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

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

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: 30/09/2019

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	1862	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	

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: 30/09/2019

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	
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: 30/09/2019

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo								Total
		25/01/2019	25/04/2019	25/07/2019						
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885									
Saldo inicial	0886	40.500	40.500	40.500						
Cobros del periodo	0887	17.747	14.550	14.140						
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-148	-147	-147						
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	-16.412	-13.263	-12.813						
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-65	-65	-65						
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0						
Saldo disponible	0894	1.122	1.074	1.115						
Liquidación de comisión variable	0895	1.122	1.074	1.115						

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: 30/09/2019

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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