

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT HIPOTECARIO MIXTO II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 6056
NIF Fondo: V84040286
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: SI
Fecha: 31/03/2020

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: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2020		Periodo anterior 31/12/2019
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001		1001	
I. Activos financieros a largo plazo	0002		1002	
1. Activos titulizados	0003		1003	
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
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 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		1025	
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027		1027	
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
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: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	46.429	1041	48.309
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	40.244	1043	41.854
1. Activos titulizados	0044	40.240	1044	41.854
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	32.850	1045	34.191
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	7.278	1046	7.503
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	7	1065	8
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	7	1066	7
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	973	1067	992
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	6	1068	6
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-880	1069	-852
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	4	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	4	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	6.185	1085	6.456
1. Tesorería	0086	6.185	1086	6.456
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	46.429	1088	48.309

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2020		Periodo anterior 31/12/2019
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089		1089	
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		1094	
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095		1095	
1.1 Series no subordinadas	0096		1096	
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		1101	
2.1 Préstamo subordinado	0102		1102	
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105		1105	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108		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: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) PASIVO CORRIENTE	0117	46.619	1117	48.508
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	46.608	1123	48.491
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	40.551	1124	42.399
1.1 Series no subordinadas	0125	16.461	1125	18.020
1.2 Series subordinadas	0126	24.086	1126	24.375
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	4	1128	4
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	5.853	1131	5.868
2.1 Préstamo subordinado	0132	5.859	1132	5.859
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	-67	1135	-56
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	1	1136	1
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	60	1137	64
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	193	1139	202
3.1 Derivados de cobertura	0140	193	1140	202
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	11	1143	23
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	1	1144	7
4.2 Garantías financieras	0145	10	1145	16
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	11	1148	17
1. Comisiones	0149	2	1149	1
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	1	1150	1
1.2 Comisión administrador	0151	11	1151	13
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	59	1153	59
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-70	1155	-71
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	9	1157	15
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-190	1158	-199
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-190	1160	-199
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	46.429	1162	48.309

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2020		Acumulado anterior 31/03/2019
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	103	1201	159	2201	103	3201	159
1.1 Activos titulizados	0202	97	1202	141	2202	97	3202	141
1.2 Otros activos financieros	0203	6	1203	18	2203	6	3203	18
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-39	1204	-48	2204	-39	3204	-48
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-31	1205	-39	2205	-31	3205	-39
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-8	1206	-9	2206	-8	3206	-9
2.3 Otros pasivos financieros	0207		1207		2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-24	1208	-29	2208	-24	3208	-29
A) MARGEN DE INTERESES	0209	39	1209	82	2209	39	3209	82
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210		1210		2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211		1211		2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212		1212		2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213		1213		2213		3213	
4.4 Otros	0214		1214		2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215		1215		2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216		1216		2216		3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-21	1217	-53	2217	-21	3217	-53
7.1 Servicios exteriores	0218	-4	1218	-2	2218	-4	3218	-2
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-4	1219	-2	2219	-4	3219	-2
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220		1220		2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221		1221		2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223		1223	0	2223		3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-17	1224	-51	2224	-17	3224	-51
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-10	1225	-10	2225	-10	3225	-10
7.3.2 Comisión administrador	0226	-1	1226	-1	2226	-1	3226	-1
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227	0	3227	0
7.3.4 Comisión variable	0228	-6	1228	-40	2228	-6	3228	-40
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229		1229		2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-28	1231	-64	2231	-28	3231	-64
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-28	1232	-64	2232	-28	3232	-64
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233		1233		2233		3233	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234		1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235		1235		2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236		1236		2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237		1237		2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238		1238		2238		3238	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	10	1239	35	2239	10	3239	35
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241		1241		2241		3241	
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2020		Acumulado anterior 31/03/2019
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-8	1300	14	2300	-8	3300	14
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	20	1301	67	2301	20	3301	67
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	93	1302	141	2302	93	3302	141
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-38	1303	-39	2303	-38	3303	-39
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	12	1304	28	2304	12	3304	28
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-37	1305	-57	2305	-37	3305	-57
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	-11	1307	-6	2307	-11	3307	-6
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-18	1309	-50	2309	-18	3309	-50
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-10	1310	-10	2310	-10	3310	-10
2.2 Comisión administrador	0311	-2	1311	0	2311	-2	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	0
2.4 Comisión variable	0313	-6	1313	-40	2313	-6	3313	-40
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-10	1315	-2	2315	-10	3315	-2
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	-14	1320	-2	2320	-14	3320	-2
3.6 Otros cobros de explotación	0321	4	1321	0	2321	4	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-262	1322	-67	2322	-262	3322	-67
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	-281	1325	-67	2325	-281	3325	-67
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	668	1326	697	2326	668	3326	697
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	206	1327	528	2327	206	3327	528
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	693	1328	789	2328	693	3328	789
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	-1.848	1331	-2.081	2331	-1.848	3331	-2.081
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	19	1332	0	2332	19	3332	0
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	19	1336	0	2336	19	3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-271	1337	-53	2337	-271	3337	-53
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	6.456	1338	6.474	2338	6.456	3338	6.474
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	6.185	1339	6.421	2339	6.185	3339	6.421

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2020		Acumulado anterior 31/03/2019
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350		1350		2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351		1351		2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352		1352		2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353		1353		2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354		1354		2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0355		1355		2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356		1356		2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-16	1357	-22	2357	-16	3357	-22
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-16	1358	-22	2358	-16	3358	-22
2.1.2 Efecto fiscal	0359		1359		2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	24	1360	29	2360	24	3360	29
2.3 Otras reclasificaciones	0361		1361		2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-9	1362	-7	2362	-9	3362	-7
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 periodo	0364		1364		2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365		1365		2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366		1366		2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367		1367		2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368		1368		2368		3368	
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369		1369		2369		3369	
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.A | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/03/2020								Situación cierre anual anterior 31/12/2019								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	1,45	0400	0	0420	0	0440	4	1380	1,37	1400	0	1420	0	1440	4,44	2380	0	2400	0	2420	0	2440	0
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	6,32	0401	0	0421	0	0441	4,60	1381	6,43	1401	0	1421	0	1441	5,59	2381	0	2401	0	2421	0	2441	0
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382	0	2402	0	2422	0	2442	0
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383	0	2403	0	2423	0	2443	0
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384	0	2404	0	2424	0	2444	0
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385	0	2405	0	2425	0	2445	0
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386	0	2406	0	2426	0	2446	0
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387	0	2407	0	2427	0	2447	0
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388	0	2408	0	2428	0	2448	0
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389	0	2409	0	2429	0	2449	0
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390	0	2410	0	2430	0	2450	0
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391	0	2411	0	2431	0	2451	0
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392	0	2412	0	2432	0	2452	0
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393	0	2413	0	2433	0	2453	0
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394	0	2414	0	2434	0	2454	0
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395	0	2415	0	2435	0	2455	0
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396	0	2416	0	2436	0	2456	0
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397	0	2417	0	2437	0	2457	0
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398	0	2418	0	2438	0	2458	0
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399	0	2419	0	2439	0	2459	0

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.A | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | 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	134	0467	32	0474	6	0481	0	0488	38	0495	3.652	0502	0	0509	3.690
De 1 a 3 meses	0461	10	0468	4	0475	1	0482	0	0489	5	0496	194	0503	0	0510	199
De 3 a 6 meses	0462	1	0469	3	0476	0	0483	0	0490	3	0497	2	0504	0	0511	6
De 6 a 9 meses	0463	2	0470	6	0477	0	0484	0	0491	6	0498	48	0505	0	0512	54
De 9 a 12 meses	0464	1	0471	3	0478	0	0485	0	0492	3	0499	18	0506	0	0513	21
Más de 12 meses	0465	18	0472	315	0479	5	0486	79	0493	399	0500	579	0507	0	0514	977
Total	0466	166	0473	362	0480	12	0487	79	0494	454	0501	4.493	0508	0	1515	4.946

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	134	0522	32	0529	6	0536	0	0543	38	0550	3.652	0557	0	0564	3.690	0571	12.577	0578	8.433	0584	29,34
De 1 a 3 meses	0516	10	0523	4	0530	1	0537	0	0544	5	0551	194	0558	0	0565	199	0572	869	0579	125	0585	22,86
De 3 a 6 meses	0517	1	0524	3	0531	0	0538	0	0545	3	0552	2	0559	0	0566	6	0573	301	0580	0	0586	1,88
De 6 a 9 meses	0518	2	0525	6	0532	0	0539	0	0546	6	0553	48	0560	0	0567	54	0574	186	0581	0	0587	28,88
De 9 a 12 meses	0519	1	0526	3	0533	0	0540	0	0547	3	0554	18	0561	0	0568	21	0575	84	0582	0	0588	25,19
Más de 12 meses	0520	18	0527	315	0534	5	0541	79	0548	399	0555	579	0562	0	0569	977	0576	1.996	0583	522	0589	48,97
Total	0521	166	0528	362	0535	12	0542	79	0549	454	0556	4.493	0563	0	0570	4.946	0577	16.013			0590	30,89

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.A | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 29/06/2004	
Inferior a 1 año	0600	157	1600	180	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	547	1601	325	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.874	1602	1.877	2602	86
Entre 3 y 4 años	0603	1.172	1603	1.604	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	1.317	1604	1.264	2604	900
Entre 5 y 10 años	0605	18.882	1605	19.691	2605	16.124
Superior a 10 años	0606	17.153	1606	17.744	2606	492.890
Total	0607	41.101	1607	42.685	2607	510.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	9,17	1608	9,34	2608	44,99

Antigüedad	Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 29/06/2004	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	17,76	1609	17,51	2609	4,69

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.A. | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/03/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 29/06/2004			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.281	0630	34.753	1620	1.281	1630	34.908	2620	864	2630	39.724
40% - 60%	0621	130	0631	5.952	1621	149	1631	7.139	2621	1.471	2631	103.987
60% - 80%	0622	6	0632	396	1622	12	1632	639	2622	3.508	2632	280.177
80% - 100%	0623	0	0633	0	1623	0	1633	0	2623	1.104	2633	86.112
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	1.417	0638	41.101	1628	1.442	1638	42.685	2628	6.947	2638	510.000
Media ponderada (%)	0639	28,65	0649		1639	29,15	1649		2639	145,15	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.A | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 29/06/2004	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,98	1650	1,02	2650	7,54
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,50	1651	4,50	2651	15,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,02	1652	0,02	2652	4,49

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.A. | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/03/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 29/06/2004			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	585	0683	11.507	1660	597	1683	11.987	2660	4.527	2683	269.792
Aragón	0661	77	0684	2.806	1661	81	1684	2.891	2661	182	2684	16.342
Asturias	0662	0	0685	0	1662	0	1685	0	2662	0	2685	0
Baleares	0663	0	0686	0	1663	0	1686	0	2663	0	2686	0
Canarias	0664	0	0687	0	1664	0	1687	0	2664	0	2687	0
Cantabria	0665	11	0688	378	1665	11	1688	387	2665	28	2688	2.776
Castilla-León	0666	125	0689	4.511	1666	128	1689	4.704	2666	337	2689	32.438
Castilla La Mancha	0667	8	0690	289	1667	9	1690	299	2667	87	2690	8.010
Cataluña	0668	85	0691	2.490	1668	86	1691	2.567	2668	361	2691	24.510
Ceuta	0669	0	0692	0	1669	0	1692	0	2669	1	2692	56
Extremadura	0670	5	0693	118	1670	5	1693	122	2670	72	2693	5.445
Galicia	0671	0	0694	0	1671	0	1694	0	2671	0	2694	0
Madrid	0672	68	0695	2.823	1672	70	1695	2.979	2672	252	2695	29.282
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	4	2696	272
Murcia	0674	0	0697	0	1674	0	1697	0	2674	0	2697	0
Navarra	0675	1	0698	82	1675	1	1698	84	2675	5	2698	1.249
La Rioja	0676	142	0699	4.635	1676	142	1699	4.835	2676	327	2699	37.560
Comunidad Valenciana	0677	0	0700	0	1677	0	1700	0	2677	5	2700	328
País Vasco	0678	310	0701	11.463	1678	312	1701	11.831	2678	759	2701	81.940
Total España	0679	1.417	0702	41.101	1679	1.442	1702	42.685	2679	6.947	2702	510.000
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	1.417	0705	41.101	1682	1.442	1705	42.685	2682	6.947	2705	510.000

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A14010342 BANKIA, S.A | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/03/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 29/06/2004			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	3,34			1710	3,29			2710	3,16		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/03/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2020			Situación cierre anual anterior 31/12/2019			Situación inicial 29/06/2004					
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			
ES0370151005	PH1	3.678	4.476	16.461	3.678	4.899	18.020	3.678	100.000	367.800			
ES0370151013	PH2	167	100.000	16.700	167	100.000	16.700	167	100.000	16.700			
ES0370151021	CH1	1.128	0	0	1.128	0	0	1.128	100.000	112.800			
ES0370151039	CH2	127	58.157	7.386	127	60.434	7.675	127	100.000	12.700			
Total		0723	5.100	0724	40.547	1723	5.100	1724	42.395	2723	5.100	2724	510.000

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/03/2020

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		0738	0739	
			0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737					
ES0370151005	PH1	NS	EURIBOR 3 MESES	0,17	0	0	0	0	SI	16.461	0	0	0	16.461		
ES0370151013	PH2	S	EURIBOR 3 MESES	0,90	0,50	3	0	0	SI	16.700	0	0	0	16.703		
ES0370151021	CH1	NS	EURIBOR 3 MESES	0,18	0	0	0	0	SI	0	0	0	0	0		
ES0370151039	CH2	S	EURIBOR 3 MESES	0,95	0,55	1	0	0	SI	7.386	0	0	0	7.387		
Total						0740	4	0741		0743	40.547	0744		0745	40.551	0746

	Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 29/06/2004	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,31	0748	0,30	0749	2,32

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/03/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2020								Situación periodo comparativo anterior 31/03/2019							
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								
ES0370151021	CH1		112.800		12.051		112.800		12.051		112.800		12.051		12.051		
ES0370151039	CH2	289	5.314	13	4.281	289	3.972	14	4.232								
ES0370151013	PH2	0	0	25	5.566	0	0	25	5.474								
ES0370151005	PH1	1.559	351.339	0	49.131	1.792	345.003	0	49.131								
Total		0754	1.848	0755	469.453	0756	38	0757	71.029	1754	2.081	1755	461.776	1756	39	1757	70.888

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/03/2020

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 31/03/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 29/06/2004
				0762	0763	0764
ES0370151005	PH1	19/08/2014	FCH	AA+	AA+	AAA
ES0370151005	PH1	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0370151013	PH2	20/03/2018	FCH	A-	A-	BBB
ES0370151013	PH2	22/11/2019	MDY	A3	A3	Baa3
ES0370151021	CH1	19/08/2014	FCH	AA+	AA+	AAA
ES0370151021	CH1	23/01/2015	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0370151039	CH2	14/07/2016	FCH	A-	A-	BBB
ES0370151039	CH2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Baa1

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Periodo de la declaración: 31/03/2020

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 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 29/06/2004	
Inferior a 1 año	0765	40.547	1765	42.395	2765	0
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	0
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	0
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768	0
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769	0
Entre 5 y 10 años	0770		1770		2770	480.600
Superior a 10 años	0771		1771		2771	29.400
Total	0772	40.547	1772	42.395	2772	510.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	0,22	1773	0	2773	17,56

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 29/06/2004	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	5.834	1775	5.850	2775	6.147
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	5.859	1776	5.859	2776	6.147
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	14,38	1777	13,70	2777	1
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	0
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	0
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	0
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	0
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	N	1791	N	2791	
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	40,59	1792	42,50	2792	94,23
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3
Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: SI
Fecha: 31/03/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características
Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 31/03/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 29/06/2004	
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806

AyT Hipotecario Mixto II, FTA

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

AyT Hipotecario Mixto II, FTA

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

AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Permuta 1	J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA	Trimestral	El Factor de Cálculo PH 1 En cada Fecha de Referencia, media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial de los préstamos cubiertos por el Contrato de Swap PH 1 que resetean en cada uno de los meses del año. Las Fechas de Referencia serán los 18 de cada mes. TIPO FLOOR es la diferencia, en caso de ser positiva, entre el tipo de interés mínimo deducido el margen y la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial del citado grupo de préstamos que resetean en cada uno de los meses del año.	El Importe Nocional del Contrato de Swap PH 1 Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones Hipotecarias cuyos Préstamos Hipotecarios subyacentes estén sometidos a revisión anual de sus tipos de interés. NOCIONAL FLOOR es el saldo vivo del grupo de préstamos con el mismo mínimo de tipo de interés	Tipo de Interés de Referencia de los Bonos establecido para cada Fecha de Pago, tal y como se define en el apartado II.10.1 del presente Folleto, más un spread de 0,20%. TIPO CAP es la diferencia, en caso de ser positiva, entre la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial del citado grupo de préstamos que resetean en cada uno de los meses del año y el tipo de interés máximo deducido el margen y minorado un 1%.	El Importe Nocional del Contrato de Swap PH 1 Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones Hipotecarias cuyos Préstamos Hipotecarios subyacentes estén sometidos a revisión anual de sus tipos de interés. NOCIONAL CAP sera el saldo vivo del grupo de préstamos con el mismo máximo de tipo de interés		0	-9.934	
-----------	---	------------	---	--	--	--	--	---	--------	--

AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Permuta 2	J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA	Trimestral	El Factor de Cálculo PH 2 En cada Fecha de Referencia, media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial de los préstamos cubiertos por el Contrato de Swap PH2 que resetean en cada uno de los meses del año. Las Fechas de Referencia? serán los 18 de cada mes.TIPO FLOOR es la diferencia, en caso de ser positiva, entre el tipo de interés mínimo deducido el margen y la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial del citado grupo de préstamos que resetean en cada uno de los meses del año."	El Importe Nocional del Contrato de Swap PH 2 Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones Hipotecarias cuyos Préstamos Hipotecarios subyacentes estén sometidos a revisión anual de sus tipos de interés. NOCIONAL FLOOR es el saldo vivo del grupo de préstamos con el mismo mínimo de tipo de interés	Tipo de Interés de Referencia de los Bonos establecido para cada Fecha de Pago, tal y como se define en el apartado II.10.1 del presente Folleto, más un spread de 0,20% TIPO CAP es la diferencia, en caso de ser positiva, entre la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial del citado grupo de préstamos que resetean en cada uno de los meses del año y el tipo de interés máximo deducido el margen y minorado un 1%.	El Importe Nocional del Contrato de Swap PH 2 Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones Hipotecarias cuyos Préstamos Hipotecarios subyacentes estén sometidos a revisión Semestral de sus tipos de interés. NOCIONAL CAP sera el saldo vivo del grupo de préstamos con el mismo máximo de tipo de interés		0	-6.249	
-----------	--	------------	---	--	---	--	--	---	--------	--

AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Permuta 1	J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA	Trimestral			En caso de que el Tipo Índice (IRPH) sea menor que el tipo Euribor a un (1) año más cuarenta (40) puntos básicos (0,40%), la Entidad de Contrapartida abona al Fondo, en cada Fecha de Pago, la diferencia. En caso de que el Tipo Índice de un mes sea igual o superior al Euribor a un (1) año más cuarenta (40) puntos básicos (0,40%), no se devengará cantidad alguna a favor del Fondo.	Saldo nominal de los Préstamos referenciados al Tipo Índice, se entenderá por ?Tipo Índice? el IRPH publicado mensualmente por el Banco de España en su página web www.bde.es/tipos/tipos.htm .		0	-9.934	
-----------	---	------------	--	--	---	---	--	---	--------	--

AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Permuta 4	J.P. MORGAN INTERNATIONAL BANK LIMITED, SUCURSAL EN ESPAÑA	Trimestral	El Factor de Cálculo CH 2 será, en cada Fecha de Referencia, la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial de los préstamos cubiertos por el Contrato de Swap CH 2 que resetean en cada uno de los meses del año. TIPO FLOOR es la diferencia, en caso de ser positiva, entre el tipo de interés mínimo deducido el margen y la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial del citado grupo de préstamos que resetean en cada uno de los meses del año."	El Importe Nocial del Contrato de Swap CH 2 Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones Hipotecarias cuyos Préstamos Hipotecarios subyacentes estén sometidos a revisión anual de sus tipos de interés. NOCIONAL FLOOR es el saldo vivo del grupo de préstamos con el mismo mínimo de tipo de interés	Tipo de Interés de Referencia de los Bonos establecido para cada Fecha de Pago, tal y como se define en el apartado II.10.1 del presente Folleto, más un spread de 0,20%. TIPO CAP es la diferencia, en caso de ser positiva, entre la media de las medias diarias mensuales de los tipos de interés Euribor 12 meses que sirven de referencia de los activos titulizados, ponderados por el porcentaje inicial del citado grupo de préstamos que resetean en cada uno de los meses del año y el tipo de interés máximo deducido el margen y minorado un 1%.	El Importe Nocial del Contrato de Swap CH 2 Saldo Nominal Pendiente de las Participaciones Hipotecarias cuyos Préstamos Hipotecarios subyacentes estén sometidos a revisión Semestral de sus tipos de interés. NOCIONAL CAP sera el saldo vivo del grupo de préstamos con el mismo máximo de tipo de interés		0	-1.369	
Total							0808	0809	0810	-33.461

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)			Valor en libros (miles de euros)			Otras características	
	Situación actual 31/03/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 29/06/2004	Situación actual 31/03/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 29/06/2004		
Préstamos hipotecarios	0811	1811	2811	0829	1829	2829	3829	
Cédulas hipotecarias	0812	1812	2812	0830	1830	2830	3830	
Préstamos a promotores	0813	1813	2813	0831	1831	2831	3831	
Préstamos a PYMES	0814	1814	2814	0832	1832	2832	3832	
Préstamos a empresas	0815	1815	2815	0833	1833	2833	3833	
Préstamos corporativos	0816	1816	2816	0834	1834	2834	3834	
Cédulas territoriales	0817	1817	2817	0835	1835	2835	3835	
Bonos de tesorería	0818	1818	2818	0836	1836	2836	3836	
Deuda subordinada	0819	1819	2819	0837	1837	2837	3837	
Créditos AAPP	0820	1820	2820	0838	1838	2838	3838	
Préstamos consumo	0821	1821	2821	0839	1839	2839	3839	
Préstamos automoción	0822	1822	2822	0840	1840	2840	3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823	1823	2823	0841	1841	2841	3841	
Cuentas a cobrar	0824	1824	2824	0842	1842	2842	3842	
Derechos de crédito futuros	0825	1825	2825	0843	1843	2843	3843	
Bonos de titulización	0826	1826	2826	0844	1844	2844		
Total	0827	1827	2827	0845	1845	2845	3845	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
	Situación actual 31/03/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación actual 31/03/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación actual 31/03/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Última Fecha Pago									
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	0	7003	411	7006	391	7009	2,44	7012	2,39	7015	2,40		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	411	7008	391	7011	2,44	7014	2,39	7017	411.304	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	395	7024	376	7027	2,20	7030	2,05	7033	2,18		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	395	7026	376	7029	2,20	7032	2,05	7035	2,18	7036	FOLLETO INFORMATIVO. CAPÍTULO II. APARTADO II.3.2.1

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/03/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Última Fecha Pago		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

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
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

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		1862		2862		3862		4862		5862		6862		7862		8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864		1864		2864		3864		4864		5864		6864		7864		8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	
3 Otros (S/N)	0868	
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: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

S.06

Denominación Fondo: AyT Hipotecario Mixto II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: SI

Fecha: 31/03/2020

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