

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8653
NIF Fondo: V84981299
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2019

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: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2019		Periodo anterior 31/12/2018
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	383.718	1001	394.440
I. Activos financieros a largo plazo	0002	383.718	1002	394.440
1. Activos titulizados	0003	383.718	1003	394.440
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	382.811	1005	394.012
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	9.443	1025	8.986
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-8.536	1027	-8.558
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 Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	93.415	1041	96.303
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	60.328	1043	60.835
1. Activos titulizados	0044	60.328	1044	60.835
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	58.694	1046	59.905
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	219	1065	215
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	2	1066	3
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	14.564	1067	14.781
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	143	1068	146
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-13.295	1069	-14.217
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	33.088	1085	35.468
1. Tesorería	0086	33.088	1086	35.468
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	477.134	1088	490.744

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2019		Periodo anterior 31/12/2018
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	420.413	1089	429.365
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	420.413	1094	429.365
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	385.170	1095	395.197
1.1 Series no subordinadas	0096	302.970	1096	312.997
1.2 Series subordinadas	0097	82.200	1097	82.200
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101	17.480	1101	16.485
2.1 Préstamo subordinado	0102	27.600	1102	27.600
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	-10.120	1105	-11.115
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	17.735	1108	17.655
3.1 Derivados de cobertura	0109	17.735	1109	17.655
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	27	1112	28
4.1 Garantías financieras	0113	27	1113	28
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 Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) PASIVO CORRIENTE	0117	74.456	1117	79.033
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	74.419	1123	78.988
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	67.971	1124	72.423
1.1 Series no subordinadas	0125	67.961	1125	72.414
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	10	1128	9
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	5.777	1131	5.744
2.1 Préstamo subordinado	0132	1.514	1132	1.514
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	27	1136	27
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	4.235	1137	4.203
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	671	1139	820
3.1 Derivados de cobertura	0140	671	1140	820
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	1
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	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	37	1148	45
1. Comisiones	0149	22	1149	23
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	20	1150	21
1.2 Comisión administrador	0151	814	1151	803
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	1152	2
1.4 Comisión variable	0153	1.807	1153	1.807
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-2.621	1155	-2.610
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	15	1157	22
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-17.735	1158	-17.655
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-17.735	1160	-17.655
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	477.134	1162	490.744

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2019		Acumulado anterior 31/03/2018
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	989	1201	1.018	2201	989	3201	1.018
1.1 Activos titulizados	0202	989	1202	1.018	2202	989	3202	1.018
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-44	1204	-41	2204	-44	3204	-41
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-11	1205	-10	2205	-11	3205	-10
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-32	1206	-31	2206	-32	3206	-31
2.3 Otros pasivos financieros	0207		1207		2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-868	1208	-907	2208	-868	3208	-907
A) MARGEN DE INTERESES	0209	77	1209	69	2209	77	3209	69
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	-39	1217	-44	2217	-39	3217	-44
7.1 Servicios exteriores	0218	-1	1218	-3	2218	-1	3218	-3
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	-1	2219	-1	3219	-1
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	-2	2222	0	3222	-2
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-38	1224	-42	2224	-38	3224	-42
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-24	1225	-26	2225	-24	3225	-26
7.3.2 Comisión administrador	0226	-12	1226	-13	2226	-12	3226	-13
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-2	1227	-2	2227	-2	3227	-2
7.3.4 Comisión variable	0228		1228		2228		3228	
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229		1229		2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230		2230	0	3230	
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	945	1231	347	2231	945	3231	347
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	945	1232	347	2232	945	3232	347
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	-983	1239	-372	2239	-983	3239	-372
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 Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2019		Acumulado anterior 31/03/2018
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-74	1300	-31	2300	-74	3300	-31
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-38	1301	14	2301	-38	3301	14
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	990	1302	1.026	2302	990	3302	1.026
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-11	1303	-10	2303	-11	3303	-10
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	122	1304	95	2304	122	3304	95
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-1.138	1305	-1.096	2305	-1.138	3305	-1.096
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	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-27	1309	-30	2309	-27	3309	-30
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-25	1310	-27	2310	-25	3310	-27
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-3	1312	-2	2312	-3	3312	-2
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-9	1315	-16	2315	-9	3315	-16
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	-37	1320	-16	2320	-37	3320	-16
3.6 Otros cobros de explotación	0321	27	1321	0	2321	27	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-2.307	1322	71	2322	-2.307	3322	71
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	-2.307	1325	71	2325	-2.307	3325	71
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	6.515	1326	6.744	2326	6.515	3326	6.744
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	5.030	1327	4.968	2327	5.030	3327	4.968
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	627	1328	1.079	2328	627	3328	1.079
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-14.479	1331	-12.721	2331	-14.479	3331	-12.721
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332	0	2332	0	3332	0
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336	0	2336	0	3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-2.381	1337	40	2337	-2.381	3337	40
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	35.468	1338	31.417	2338	35.468	3338	31.417
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	33.088	1339	31.457	2339	33.088	3339	31.457

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2019		Acumulado anterior 31/03/2018
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	-948	1357	335	2357	-948	3357	335
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-948	1358	335	2358	-948	3358	335
2.1.2 Efecto fiscal	0359		1359		2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	868	1360	907	2360	868	3360	907
2.3 Otras reclasificaciones	0361		1361		2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	80	1362	-1.242	2362	80	3362	-1.242
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 Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/03/2019								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	5,16	0401	0	0421	0	0441	3,94	1381	4,98	1401	0	1421	0	1441	3,83	2381	0,45	2401	0,05	2421	0	2441	0
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	62	0467	20	0474	1	0481	0	0488	21	0495	6.458	0502	3	0509	6.481
De 1 a 3 meses	0461	26	0468	21	0475	1	0482	0	0489	22	0496	2.693	0503	1	0510	2.717
De 3 a 6 meses	0462	13	0469	20	0476	1	0483	0	0490	21	0497	1.540	0504		0511	1.560
De 6 a 9 meses	0463	1	0470		0477	0	0484	0	0491	0	0498	57	0505		0512	58
De 9 a 12 meses	0464	4	0471	19	0478	0	0485	1	0492	20	0499	358	0506		0513	378
Más de 12 meses	0465	165	0472	14.526	0479	142	0486	4.003	0493	18.671	0500	7.488	0507		0514	26.159
Total	0466	271	0473	14.604	0480	146	0487	4.004	0494	18.754	0501	18.595	0508	4	1515	37.353

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	62	0522	20	0529	1	0536	0	0543	21	0550	6.458	0557	3	0564	6.481	0571	12.804	0578		0584	50,62
De 1 a 3 meses	0516	26	0523	21	0530	1	0537	0	0544	22	0551	2.693	0558	1	0565	2.717	0572	5.369	0579		0585	50,59
De 3 a 6 meses	0517	13	0524	20	0531	1	0538	0	0545	21	0552	1.540	0559		0566	1.560	0573	2.475	0580		0586	63,03
De 6 a 9 meses	0518	1	0525		0532	0	0539	0	0546	0	0553	57	0560		0567	58	0574	87	0581		0587	66,04
De 9 a 12 meses	0519	4	0526	19	0533	0	0540	1	0547	20	0554	358	0561		0568	378	0575	587	0582		0588	64,46
Más de 12 meses	0520	165	0527	14.526	0534	142	0541	4.003	0548	18.671	0555	7.488	0562		0569	26.159	0576	34.913	0583		0589	74,92
Total	0521	271	0528	14.604	0535	146	0542	4.004	0549	18.754	0556	18.595	0563	4	0570	37.353	0577	56.236			0590	66,42

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 06/02/2007	
Inferior a 1 año	0600	203	1600	195	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	728	1601	772	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.169	1602	1.213	2602	128
Entre 3 y 4 años	0603	1.779	1603	1.573	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	2.390	1604	2.500	2604	662
Entre 5 y 10 años	0605	26.536	1605	26.633	2605	12.036
Superior a 10 años	0606	432.707	1606	444.799	2606	1.187.174
Total	0607	465.512	1607	477.685	2607	1.200.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	17,70	1608	17,91	2608	28,54

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 06/02/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	14,17	1609	13,93	2609	2,37

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/03/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 06/02/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	2.117	0630	104.235	1620	2.102	1630	103.999	2620	1.162	2630	80.377
40% - 60%	0621	1.731	0631	165.407	1621	1.713	1631	163.124	2621	1.362	2631	161.140
60% - 80%	0622	1.338	0632	183.648	1622	1.432	1632	197.671	2622	1.733	2632	249.238
80% - 100%	0623	66	0633	12.223	1623	70	1633	12.891	2623	4.191	2633	709.245
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624	0	2634	0
120% - 140%	0625		0635		1625		1635		2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627	0	2637	0
Total	0628	5.252	0638	465.512	1628	5.317	1638	477.685	2628	8.448	2638	1.200.000
Media ponderada (%)	0639	53,26	0649		1639	53,87	1649		2639	77,49	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 06/02/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,72	1650	0,71	2650	4
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,50	1651	4,50	2651	6,95
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,06	1652	0,06	2652	2,75

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/03/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 06/02/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	11	0683	1.256	1660	12	1683	1.324	2660	119	2683	19.950
Aragón	0661	93	0684	10.420	1661	95	1684	10.720	2661	152	2684	24.802
Asturias	0662	9	0685	737	1662	9	1685	749	2662	9	2685	1.312
Baleares	0663	4	0686	395	1663	4	1686	401	2663	5	2686	881
Canarias	0664	1	0687	30	1664	1	1687	31	2664	1	2687	142
Cantabria	0665	5	0688	399	1665	5	1688	417	2665	15	2688	1.989
Castilla-León	0666	318	0689	24.251	1666	319	1689	24.607	2666	424	2689	50.838
Castilla La Mancha	0667	91	0690	9.571	1667	93	1690	9.843	2667	140	2690	21.455
Cataluña	0668	763	0691	77.563	1668	773	1691	79.125	2668	1.116	2691	178.944
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	0
Extremadura	0670		0693		1670		1693		2670	1	2693	55
Galicia	0671	38	0694	3.749	1671	38	1694	3.792	2671	52	2694	7.254
Madrid	0672	1.288	0695	120.998	1672	1.305	1695	123.969	2672	2.206	2695	319.173
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	9	0697	812	1674	9	1697	819	2674	11	2697	1.582
Navarra	0675	19	0698	1.332	1675	19	1698	1.364	2675	28	2698	3.337
La Rioja	0676	44	0699	3.636	1676	44	1699	3.703	2676	67	2699	9.161
Comunidad Valenciana	0677	159	0700	15.498	1677	160	1700	15.957	2677	228	2700	33.745
País Vasco	0678	2.400	0701	194.867	1678	2.431	1701	200.863	2678	3.874	2701	525.380
Total España	0679	5.252	0702	465.512	1679	5.317	1702	477.685	2679	8.448	2702	1.200.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	5.252	0705	465.512	1682	5.317	1705	477.685	2682	8.448	2705	1.200.000

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2019
Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/03/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 06/02/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,64			1710	0,63			2710	0,33		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2019			Situación cierre anual anterior 31/12/2018			Situación inicial 06/02/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente			
		0720	Nominal unitario (€) 0721	0722	1720	Nominal unitario (€) 1721	1722	2720	Nominal unitario (€) 2721	2722			
ES0370154009	A	11.178	33.184	370.932	11.178	34.479	385.411	11.178	100.000	1.117.800			
ES0370154017	B	582	100.000	58.200	582	100.000	58.200	582	100.000	58.200			
ES0370154025	C	240	100.000	24.000	240	100.000	24.000	240	100.000	24.000			
Total		0723	12.000	0724	453.132	1723	12.000	1724	467.611	2723	12.000	2724	1.200.000

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado							
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739					
ES0370154009	A	NS	EURIBOR 3 MESES	0,13	0	0	0	SI	370.932	0	370.932						
ES0370154017	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,28	0	0	0	SI	58.200	0	58.200						
ES0370154025	C	S	EURIBOR 3 MESES	0,50	0,19	10	0	SI	24.000	0	24.010						
Total						0740	10	0741	0	0743	453.132	0744	0	0745	453.141	0746	

	Situación actual 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 06/02/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,01	0748	0,01	0749	4,04

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/03/2019
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2019								Situación periodo comparativo anterior 31/03/2018							
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	0754	0755	0756	0757	1750	1751	1752	1753	1754	1755	1756	1757
ES0370154009	A	14.479	746.868	0	141.500	12.721	698.734	0	141.500								
ES0370154017	B	0	0	0	9.459	0	0	0	9.459								
ES0370154025	C	0	0	11	4.513	0	0	10	4.470								
Total		0754	14.479	0755	746.868	0756	11	0757	155.473	1754	12.721	1755	698.734	1756	10	1757	155.430

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 31/03/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 06/02/2007
				0762	0763	0764
ES0370154009	A	10/12/2018	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0370154009	A	25/07/2018	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0370154017	B	10/12/2018	FCH	A	A	A
ES0370154017	B	25/07/2018	SYP	A-	A-	A
ES0370154025	C	13/05/2011	FCH	CCC	CCC	BBB
ES0370154025	C	16/01/2015	SYP	CCC+	CCC+	BBB

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 06/02/2007	
Inferior a 1 año	0765	0	1765	0	2765	
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	
Entre 3 y 4 años	0768		1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769	370.932	1769		2769	
Entre 5 y 10 años	0770	82.200	1770	385.411	2770	1.117.800
Superior a 10 años	0771		1771	82.200	2771	82.200
Total	0772	453.132	1772	467.611	2772	1.200.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	5,24	1773	6,03	2773	9,31

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 06/02/2007	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	22.040	1775	21.341	2775	27.600
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	27.600	1776	27.600	2776	27.600
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	4,86	1777	4,56	2777	2
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783	Notas Explicativas	2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	81,86	1792	82,42	2792	93,15
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

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 31/03/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 06/02/2007	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Permuta 1	BANCO SANTANDER	Trimestral	la suma de los intereses devengados, vencidos e ingresados al Fondo durante el Periodo de Liquidación que vence de los Activos, disminuida en el importe de los Intereses Corridos que, en su caso, hubiere pagado el Fondo durante el mismo Periodo de Liquidación, entre el Importe Nominal, multiplicado por 360 y dividido por los días efectivos existentes en dicho Periodo de Liquidación	Para cada uno de los Préstamos Hipotecarios sobre los que se hayan satisfecho los intereses ordinarios y de demora percibidos por el Fondo durante el Periodo de Liquidación la división entre (i) las sumas percibidas por el Fondo en concepto de intereses ordinarios y de demora en cada uno de los Préstamos Hipotecarios, entre (ii) el tipo anual de interés aplicado en el correspondiente Préstamo Hipotecario. El resultado de ese cociente será el Importe Nocional Individual de cada Préstamo Hipotecario.	Tipo de Interés de Referencia de los Bonos fijado para el correspondiente Periodo de Devengo de Intereses de los Bonos más un margen del 0,40 %	Para cada uno de los Préstamos Hipotecarios sobre los que se hayan satisfecho los intereses ordinarios y de demora percibidos por el Fondo durante el Periodo de Liquidación la división entre (i) las sumas percibidas por el Fondo en concepto de intereses ordinarios y de demora en cada uno de los Préstamos Hipotecarios, entre (ii) el tipo anual de interés aplicado en el correspondiente Préstamo Hipotecario. El resultado de ese cociente será el Importe Nocional Individual de cada Préstamo Hipotecario.	-18.406	-18.474	-89.853	
Total							0808 -18.406	0809 -18.474	0810 -89.853	

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

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 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 06/02/2007		Situación actual 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 06/02/2007			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

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 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación actual 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	18.712	7006	19.009	7009	5,22	7012	5	7015	5,03		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	18.712	7008	19.009	7011	5,22	7014	5	7017	18.711.579	7018	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	18.661	7024	18.977	7027	4,69	7030	4,77	7033	4,78		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	18.661	7026	18.977	7029	4,69	7032	4,77	7035	4,78	7036	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto		
	Situación actual 31/03/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018			Última Fecha Pago
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

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
Si en la Fecha de Determinación correspondiente a la Fecha de Pago en curso, el importe a que ascienda el Saldo Vivo de los Activos con morosidad que presenten más de tres (3) meses de retraso en el pago de los importes vencidos es superior al % establecido	1	0,52	0,26	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)
Si en la Fecha de Determinación correspondiente a la Fecha de Pago en curso, el importe a que ascienda el Saldo Vivo de los Activos con morosidad que presenten más de tres (3) meses de retraso en el pago de los importes vencidos es superior al % establecido	0,75	0,52	0,26	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
El valor nominal agregado de los Activos Fallidos desde la Fecha de Constitución represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del valor nominal de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo.	10,71	5,76	5,76	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6.1.B
El valor nominal agregado de los Activos Fallidos desde la Fecha de Constitución represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del valor nominal de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo.	7,12	5,76	5,76	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6.1.B
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera superior al porcentaje recogido del Saldo Vivo de los Activos que no tengan la consideración de Activos Fallidos.	1	0,52	0,26	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.1
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



S.05.5

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

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	0	2862	Días del mes /Base 365	3862	0,020	4862	0	5862	0	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	KUTXABANK	1863	0	2863	Días del mes /Base 365	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Trimestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BANCO SANTANDER, S.A.	1864	10	2864	Días del mes /Días año	3864	0	4864	0	5864	0	6864	Trimestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2019

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	S
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	N
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Kutxabank
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo adicional 3.7.2

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)	Fecha cálculo												Total
	0872	31/03/2019											
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872	31/03/2019											
Margen de intereses	0873	77											77
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	945											945
Dotaciones a provisiones (neto)	0875												0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876												0
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-39											-39
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	983	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	983
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879												0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880	-983											-983
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881												0
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Comisión variable pagada	0883												0
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884												0

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

S.06

Denominación Fondo: AyT Kutxa Hipotecario II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2019

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