

**I. DATOS IDENTIFICATIVOS**

Denominación del Fondo: AYT GENOVA HIPOTECARIO II, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA  
Número de registro del Fondo: 4512  
NIF Fondo: V83669531  
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: 31/12/2016

**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 Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	113.032	1001	132.544
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	113.032	1002	132.544
1. Activos titulizados	0003	113.032	1003	132.544
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	113.032	1004	132.544
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005		1005	0
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	0
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	304	1025	559
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-304	1027	-559
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	0
2. Derivados	0029		1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	0
3. Otros activos financieros	0032		1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	0
3.4 Otros	0036		1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0039		1039	0
<b>III. Otros activos no corrientes</b>	0040		1040	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	30.394	1041	32.961
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042	322	1042	327
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	20.608	1043	22.649
1. Activos titulizados	0044	20.608	1044	22.649
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	20.573	1045	22.589
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046		1046	0
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	0
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	35	1065	60
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	0	1066	0
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	92	1067	149
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	2	1068	3
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-94	1069	-152
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	0
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	0
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	0
3.5 Otros	0079		1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083		1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
<b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b>	0085	9.464	1085	9.985
1. Tesorería	0086	9.464	1086	9.985
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	0
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	143.426	1088	165.505

S.01

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	123.564	1089	142.042
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0090		1090	
1. Provisión garantías financieras	0091		1091	
2. Provisión por margen de intermediación	0092		1092	
3. Otras provisiones	0093		1093	
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0094	123.564	1094	142.042
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	114.474	1095	132.551
1.1 Series no subordinadas	0096	107.606	1096	120.078
1.2 Series subordinadas	0097	6.868	1097	12.473
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	8.000	1101	8.000
2.1 Préstamo subordinado	0102	8.000	1102	8.000
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	0	1105	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	0
3. Derivados	0108	1.090	1108	1.491
3.1 Derivados de cobertura	0109	1.090	1109	1.491
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	0
4.1 Garantías financieras	0113		1113	
4.1 Otros	0114		1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	0
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	0116		1116	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	20.952	1117	24.954
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0118		1118	0
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	0119		1119	
1. Provisión garantías financieras	0120		1120	
2. Provisión por margen de intermediación	0121		1121	
3. Otras provisiones	0122		1122	
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	0123	20.925	1123	24.945
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	20.572	1124	24.415
1.1 Series no subordinadas	0125	19.337	1125	24.402
1.2 Series subordinadas	0126	1.234	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	2	1128	13
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	332	1131	445
2.1 Préstamo subordinado	0132	364	1132	606
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	-34	1135	-322
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	1	1136	2
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	159
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	0
3. Derivados	0139	11	1139	14
3.1 Derivados de cobertura	0140	11	1140	14
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	10	1143	71
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	10	1144	71
4.2 Garantías financieras	0145		1145	0
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	0
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	0148	26	1148	9
1. Comisiones	0149	7	1149	8
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	2	1150	6
1.2 Comisión administrador	0151	337	1151	322
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	5	1152	1
1.4 Comisión variable	0153		1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-337	1155	-322
1.7 Otras comisiones	0156		1156	1
2. Otros	0157	20	1157	1
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158	-1.090	1158	-1.491
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159		1159	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	-1.090	1160	-1.491
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161		1161	0
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	143.426	1162	165.505

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	159	1201		2201	800	3201	1.400
1.1 Activos titulizados	0202	159	1202		2202	800	3202	1.400
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203		2203	0	3203	0
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-25	1204		2204	-164	3204	-598
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-9	1205		2205	-111	3205	-540
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-8	1206		2206	-36	3206	-58
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-7	1207		2207	-16	3207	0
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0208	-119	1208		2208	-536	3208	-709
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	15	1209		2209	100	3209	93
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	0210	0	1210		2210		3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211		2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212		2212		3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213		2213		3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214		2214		3214	0
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0215	0	1215		2215		3215	0
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0216	0	1216		2216	0	3216	0
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0217	-50	1217		2217	-135	3217	-119
7.1 Servicios exteriores	0218	-28	1218		2218	-54	3218	-25
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219		2219	-3	3219	-1
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220		2220		3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221		2221		3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	-29	1222		2222	-52	3222	-24
7.2 Tributos	0223	-1	1223		2223	-3	3223	-19
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-21	1224		2224	-78	3224	-75
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-10	1225		2225	-39	3225	-39
7.3.2 Comisión administrador	0226	-4	1226		2226	-15	3226	-17
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-9	1227		2227	-24	3227	-19
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228		2228		3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229		2229		3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	2	1230		2230	0	3230	0
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0231	111	1231		2231	313	3231	663
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	111	1232		2232	313	3232	663
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233		2233		3233	0
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	0234	0	1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235		2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236		2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237		2237		3237	
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0238	-5	1238		2238	-5	3238	5
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0239	-71	1239		2239	-273	3239	-642
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0240	0	1240		2240	0	3240	0
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0241	0	1241		2241		3241	0
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	0242	0	1242		2242	0	3242	0

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	-26	1300		2300	-191	3300	41
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	23	1301		2301	-90	3301	137
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	162	1302		2302	768	3302	1.463
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-10	1303		2303	-122	3303	-560
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	45	1304		2304	299	3304	819
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-167	1305		2305	-839	3305	-1.585
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306		2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	-8	1307		2307	-196	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308		2308		3308	0
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	0309	-26	1309		2309	-81	3309	-53
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-10	1310		2310	-44	3310	-35
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311		2311		3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-16	1312		2312	-37	3312	-18
2.4 Comisión variable	0313	0	1313		2313		3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314		2314	0	3314	0
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>	0315	-23	1315		2315	-20	3315	-43
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316		2316		3316	
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317		2317		3317	
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318		2318		3318	
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319		2319		3319	
3.5 Otros pagos de explotación	0320	-23	1320		2320	-20	3320	-43
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321		2321	0	3321	
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>	0322	568	1322		2322	-330	3322	-1.435
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	0323	0	1323		2323		3323	0
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	0324	0	1324		2324		3324	0
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b>	0325	676	1325		2325	-89	3325	-1.504
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	2.365	1326		2326	15.558	3326	16.737
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	3.798	1327		2327	5.891	3327	7.083
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	107	1328		2328	371	3328	472
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329		2329		3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330		2330		3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-5.594	1331		2331	-21.908	3331	-25.796
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	0332	-108	1332		2332	-241	3332	69
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333		2333		3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	-108	1334		2334	-241	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335		2335		3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336		2336		3336	69
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	0337	542	1337		2337	-521	3337	-1.394
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	8.922	1338		2338	9.985	3338	11.379
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	9.464	1339		2339	9.464	3339	9.985

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
<b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350		2350		3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351		2351		3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352		2352		3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353		2353		3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354		2354		3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0355	0	1355		2355		3355	0
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>0356</b>	<b>0</b>	<b>1356</b>		<b>2356</b>		<b>3356</b>	<b>0</b>
<b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	440	1357		2357	-136	3357	-88
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	440	1358		2358	-136	3358	-88
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359		2359		3359	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	119	1360		2360	536	3360	709
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361		2361		3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-560	1362		2362	-401	3362	-621
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>0363</b>	<b>0</b>	<b>1363</b>		<b>2363</b>	<b>0</b>	<b>3363</b>	<b>0</b>
<b>3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el periodo	0364	0	1364		2364		3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365		2365		3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366		2366		3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367		2367		3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368		2368		3368	0
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>0369</b>	<b>0</b>	<b>1369</b>		<b>2369</b>		<b>3369</b>	<b>0</b>
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>0370</b>	<b>0</b>	<b>1370</b>		<b>2370</b>	<b>0</b>	<b>3370</b>	<b>0</b>

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2016								Situación cierre anual anterior 31/12/2015								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380	0,30	0400	0,20	0420	0	0440	4,21	1380	0,45	1400	0	1420	0	1440	5,85	2380	0	2400	0	2420	0	2440	0
Certificados de transmisión de hipoteca	0381		0401		0421		0441		1381		1401		1421		1441		2381		2401		2421		2441	
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 Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido	Otros importes		Deuda Total		
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	3	0467	1	0474	0	0481		0488	2	0495	241	0502	0	0509	242
De 1 a 3 meses	0461	1	0468	0	0475	0	0482		0489	0	0496	48	0503	0	0510	48
De 3 a 6 meses	0462		0469		0476		0483		0490		0497		0504		0511	
De 6 a 9 meses	0463		0470		0477		0484		0491		0498		0505		0512	
De 9 a 12 meses	0464		0471		0478		0485		0492		0499		0506		0513	
Más de 12 meses	0465	3	0472	92	0479	2	0486	12	0493	106	0500	304	0507		0514	410
<b>Total</b>	<b>0466</b>	<b>7</b>	<b>0473</b>	<b>94</b>	<b>0480</b>	<b>2</b>	<b>0487</b>	<b>12</b>	<b>0494</b>	<b>108</b>	<b>0501</b>	<b>593</b>	<b>0508</b>	<b>0</b>	<b>1515</b>	<b>701</b>

Impagados con garantía real (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido	Otros importes		Deuda Total		Valor garantía		Valor Garantía con Tasación > 2 años		% Deuda / v. Tasación		
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total													
Hasta 1 mes	0515	3	0522	1	0529	0	0536		0543	2	0550	241	0557	0	0564	242	0571	709	0578	627.126	0584	34,16
De 1 a 3 meses	0516	1	0523	0	0530	0	0537		0544	0	0551	48	0558	0	0565	48	0572	157	0579	157	0585	30,85
De 3 a 6 meses	0517		0524		0531		0538		0545		0552		0559		0566		0573		0580		0586	
De 6 a 9 meses	0518		0525		0532		0539		0546		0553		0560		0567		0574		0581		0587	
De 9 a 12 meses	0519		0526		0533		0540		0547		0554		0561		0568		0575		0582		0588	
Más de 12 meses	0520	3	0527	92	0534	2	0541	12	0548	106	0555	304	0562		0569	410	0576	887	0583	887	0589	46,21
<b>Total</b>	<b>0521</b>	<b>7</b>	<b>0528</b>	<b>94</b>	<b>0535</b>	<b>2</b>	<b>0542</b>	<b>12</b>	<b>0549</b>	<b>108</b>	<b>0556</b>	<b>593</b>	<b>0563</b>	<b>0</b>	<b>0570</b>	<b>701</b>	<b>0577</b>	<b>1.753</b>			<b>0590</b>	<b>39,96</b>

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO C**

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 22/05/2003	
Inferior a 1 año	0600	837	1600	404	2600	866
Entre 1 y 2 años	0601	766	1601	2.337	2601	32
Entre 2 y 3 años	0602	1.270	1602	1.327	2602	128
Entre 3 y 4 años	0603	2.014	1603		2603	
Entre 4 y 5 años	0604	2.786	1604	4.740	2604	1.605
Entre 5 y 10 años	0605	28.001	1605	31.960	2605	18.746
Superior a 10 años	0606	98.327	1606	115.073	2606	778.623
<b>Total</b>	0607	<b>134.001</b>	1607	<b>155.841</b>	2607	<b>800.000</b>
Vida residual media ponderada (años)	0608	<b>11,79</b>	1608	<b>12,43</b>	2608	<b>22,61</b>

Antigüedad	Situación actual 31/12/2016					
	Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 22/05/2003			
Antigüedad media ponderada (años)	0609	14,50	1609	13,50	2609	0,92

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO D**

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 22/05/2003			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	2.241	0630	97.199	1620	2.307	1630	101.830	2620	1.148	2630	99.496
40% - 60%	0621	372	0631	36.802	1621	533	1631	53.817	2621	2.134	2631	256.428
60% - 80%	0622		0632		1622	1	1632	194	2622	2.990	2632	444.076
80% - 100%	0623		0633		1623	0	1633	0	2623	0	2633	0
100% - 120%	0624		0634		1624	0	1634	0	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625		0635		1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
<b>Total</b>	0628	<b>2.613</b>	0638	<b>134.001</b>	1628	<b>2.841</b>	1638	<b>155.841</b>	2628	<b>6.272</b>	2638	<b>800.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>			0639	<b>30,84</b>			1639	<b>32,66</b>			2639	<b>60,07</b>

S.05.1

**Denominación Fondo:** AyT Génova Hipotecario II FTH

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados:** NO

**Fecha:** 31/12/2016

**Entidades cedentes de los activos titulizados:** A08663619 CAIXABANK, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 22/05/2003	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,43	1650	0,89	2650	3,98
Tipo de interés nominal máximo	0651	1,73	1651	1,76	2651	4,41
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,25	1652	0,46	2652	2,86

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO F**

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 22/05/2003			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	331	0683	13.662	1660	359	1683	15.682	2660	766	2683	77.918
Aragón	0661	72	0684	3.084	1661	81	1684	3.756	2661	181	2684	20.754
Asturias	0662	56	0685	2.427	1662	62	1685	2.860	2662	126	2685	13.532
Baleares	0663	86	0686	4.952	1663	89	1686	5.553	2663	204	2686	24.304
Canarias	0664	182	0687	9.508	1664	200	1687	11.106	2664	380	2687	44.935
Cantabria	0665	71	0688	2.858	1665	78	1688	3.287	2665	170	2688	17.484
Castilla-León	0666	89	0689	3.602	1666	99	1689	4.169	2666	219	2689	23.094
Castilla La Mancha	0667	4	0690	92	1667	4	1690	115	2667	15	2690	1.577
Cataluña	0668	257	0691	14.975	1668	277	1691	17.556	2668	578	2691	82.829
Ceuta	0669	1	0692	101	1669	1	1692	111	2669	1	2692	200
Extremadura	0670		0693		1670	0	1693	0	2670	0	2693	0
Galicia	0671	122	0694	4.696	1671	131	1694	5.458	2671	255	2694	25.771
Madrid	0672	945	0695	55.602	1672	1.031	1695	64.473	2672	2.425	2695	354.400
Melilla	0673		0696		1673	0	1696	0	2673	1	2696	126
Murcia	0674	42	0697	1.808	1674	44	1697	2.224	2674	91	2697	9.593
Navarra	0675	44	0698	1.905	1675	50	1698	2.368	2675	122	2698	15.595
La Rioja	0676	15	0699	708	1676	16	1699	829	2676	36	2699	4.476
Comunidad Valenciana	0677	181	0700	7.497	1677	192	1700	8.807	2677	414	2700	44.434
País Vasco	0678	115	0701	6.525	1678	127	1701	7.487	2678	288	2701	38.978
<b>Total España</b>	0679	<b>2.613</b>	0702	<b>134.001</b>	1679	<b>2.841</b>	1702	<b>155.841</b>	2679	<b>6.272</b>	2702	<b>800.000</b>
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
<b>Total general</b>	0682	<b>2.613</b>	0705	<b>134.001</b>	1682	<b>2.841</b>	1705	<b>155.841</b>	2682	<b>6.272</b>	2705	<b>800.000</b>

<b>S.05.1</b>
<b>Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 31/12/2016</b>
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados: A08663619 CAIXABANK, S.A.</b>

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 22/05/2003			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	2,06			1710	1,87			2710	0,73		
Sector	0711		0712		1711	0	1712	0	2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos:

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

**CUADRO A**

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2016			Situación cierre anual anterior 31/12/2015			Situación inicial 22/05/2003					
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			
ES0370139000	A	7.760	16.359	126.942	7.760	19.000	144.480	7.760	100.000	776.000			
ES0370139018	B	240	33.761	8.103	240	52.000	12.473	240	100.000	24.000			
<b>Total</b>		0723	8.000	0724	135.045	1723	8.000	1724	156.953	2723	8.000	2724	800.000

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

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	
			0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737						
ES0370139000	A	NS	EURIBOR 3 MESES	0,27	0	0	0	0	SI	126.942	0	0	0	126.942		
ES0370139018	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,75	0,45	2	0	0	SI	8.103	0	0	0	8.104		
<b>Total</b>						0740	2	0741		0743	135.045	0744		0745	135.046	0746

	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 22/05/2003	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,03	0748	0,34	0749	2,18

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2016								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2015							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0370139018	B	336	15.897	10	7.095	0	11.527	97	7.043								
ES0370139000	A	5.258	649.058	0	122.171	25.795	631.519	463	122.102								
<b>Total</b>		0754	5.594	0755	664.955	0756	10	0757	129.266	1754	25.795	1755	643.046	1756	560	1757	129.145

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

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 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 22/05/2003
				0762	0763	0764
ES0370139000		10/07/2015	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0370139000		21/12/2015	SYP	AA+	AA+	AAA
ES0370139018		14/05/2016	MDY	A3	Baa3	A2
ES0370139018		02/12/2014	SYP	BBB-	BBB-	A

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

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 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 22/05/2003
Inferior a 1 año	0765		1765		2765
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766
Entre 2 y 3 años	0767	135.045	1767	144.480	2767
Entre 3 y 4 años	0768	0	1768	12.473	2768
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769
Entre 5 y 10 años	0770		1770		2770
Superior a 10 años	0771		1771	0	2771
<b>Total</b>	<b>0772</b>	<b>135.045</b>	<b>1772</b>	<b>156.953</b>	<b>2772</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>0773</b>	<b>2,55</b>	<b>1773</b>	<b>3,08</b>	<b>2773</b>
					<b>800.000</b>
					<b>800.000</b>
					<b>13,81</b>

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 22/05/2003	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	8.000	1775	8.000	2775	13.200
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	8.000	1776	8.000	2776	13.200
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	5,92	1777	5,10	2777	1,65
1.3 Denominación de la contrapartida	0778		1778		2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781		2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782		2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784		1784		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		2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787		2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788		1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790		1790		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	94	1792	92,05	2792	97
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 Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

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 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 22/05/2003	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Permuta 1	BARCLAYS BANK PLC	TRIMESTRAL	Intereses ordinarios y de demora percibidos por el Fondo durante el Periodo de Liquidación el Importe Nominal, multiplicado por 360 y dividido por los días efectivos existentes en dicho Periodo de Liquidación	Suma de los Importes Nocionales Individuales. Importe Nocional Individual de cada Préstamo Hipotecario : se dividirán (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 de referencia aplicado en el correspondiente Préstamo Hipotecario, incrementado en un margen de 45 puntos básicos (0,45%)	Importe Nocional del Periodo de Liquidación por el tipo de interés EURIBOR a 3 meses incrementado en 43 puntos básicos (0,43%).	Suma de los Importes Nocionales Individuales. Importe Nocional Individual de cada Préstamo Hipotecario : se dividirán (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 de referencia aplicado en el correspondiente Préstamo Hipotecario, incrementado en un margen de 45 puntos básicos (0,45%)	-1.101	-1.506	-7.068	
<b>Total</b>							0808 -1.101	0809 -1.506	0810 -7.068	

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

**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 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 22/05/2003		Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 22/05/2003			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
<b>Total</b>	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

**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 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Última Fecha Pago									
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	106	7006	184	7009	0,30	7012	0,45	7015	0,49		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013	0	7016			
Total Morosos					7005	106	7008	184	7011	0,30	7014	0,45	7017	0,49	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020		7021	106	7024	184	7027	0,30	7030	0,45	7033	0,49		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025		7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	106	7026	184	7029	0,30	7032	0,45	7035	0,49	7036	FOLLETO INFORMA TIVO. CAPÍTULO II. APARTAD O II.11.3.2.4

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Última Fecha Pago		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

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

**CUADRO B**

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
<b>Amortización secuencial: series</b>	0854	0858	1858	2858
a) El importe a que asciende el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias en morosidad que presenten más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, sea superior al % establecido para cada ISIN del Saldo Vivo de los Activos en es	2	0	0	FOLLETO INFORMATIVO. CAPÍTULO II. APARTADO II.11.3.2.1
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series</b>	0855	0859	1859	2859
<b>No Reducción del Fondo de Reserva</b>	0856	0860	1860	2860
(iii) Cuando en la Fecha de Determinación correspondiente a la Fecha de Pago en curso el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera igual o superior al porcentaje recogido	1	0,49	0,49	FOLLETO INFORMATIVO. CAPÍTULO V. APARTADO V.3.4
<b>OTROS TRIGGERS</b>	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 Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

**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	30	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	BARCLAYS BANK, S.A.	1863	0	2863	Días del mes /Días año	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Trimestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	SOCIETE GENERALE	1864	5	2864		3864	0	4864	0	5864	0	6864	Trimestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

**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	
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Caixabank
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	IV.1.2

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total		
		31/03/2016	30/06/2016	30/09/2016	31/12/2016									
<b>Ingresos y gastos del periodo de cálculo</b>	0872													
Margen de intereses	0873	35	29	21	16									100
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	8	194	0	111									313
Dotaciones a provisiones (neto)	0875	0	0	0	0									0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876	0	0	0	-5									-5
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-37	-28	-19	-51									-135
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	5	195	2	71	0	0	0	0	0	0	0	0	273
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879	0	0	0	0									0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880	-5	-195	-2	-71									-273
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881	0	0	0	0									0
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Comisión variable pagada	0883	0	0	0	0									0
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884	0	0	0	0									0

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

**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 Génova Hipotecario II FTH

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

**NOTAS EXPLICATIVAS**



**INFORME DE AUDITOR**

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