

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT CAJAMURCIA HIPOTECARIO II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8549
NIF Fondo: V84875947
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)

Derivado del proceso de Auditoría se han efectuado modificaciones en los Estados por reclasificaciones, sin que afecte a resultados
Reclasificación entre las celdas 0144 y 0126 del estado S01 Balance, para el grado de subordinación de los bonos

S.01
Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA
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
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	65.946	1001	75.659
I. Activos financieros a largo plazo	0002	65.946	1002	75.659
1. Activos titulizados	0003	65.946	1003	75.659
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	55.589	1004	64.038
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	9.936	1005	11.324
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	1.034	1025	634
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-613	1027	-337
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	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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 CORRIENTE	0041	18.560	1041	26.960
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	8.986	1043	11.683
1. Activos titulizados	0044	8.986	1044	11.683
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	7.917	1045	9.838
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	978	1046	1.728
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	0	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	60	1065	86
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	1	1066	2
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	70	1067	58
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	4	1068	3
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-44	1069	-32
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	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083		1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	9.574	1085	15.277
1. Tesorería	0086	9.574	1086	15.277
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	84.506	1088	102.619

S.01

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	73.254	1089	83.837
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	73.254	1094	83.837
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	66.106	1095	75.356
1.1 Series no subordinadas	0096	61.111	1096	69.666
1.2 Series subordinadas	0097	4.995	1097	5.690
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	1.575	1101	1.575
2.1 Préstamo subordinado	0102	1.575	1102	1.575
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		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	825	1108	1.107
3.1 Derivados de cobertura	0109	825	1109	1.107
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	4.749	1112	5.799
4.1 Garantías financieras	0113	4.749	1113	
4.1 Otros	0114		1114	5.799
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	0

S.01

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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 CORRIENTE	0117	12.077	1117	19.889
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	0
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	11.851	1123	19.637
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	11.780	1124	19.577
1.1 Series no subordinadas	0125	10.888	1125	18.070
1.2 Series subordinadas	0126	890	1126	1.481
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	1	1128	26
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	3	1131	4
2.1 Préstamo subordinado	0132		1132	0
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		1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	3	1136	4
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	0
3. Derivados	0139	68	1139	56
3.1 Derivados de cobertura	0140	68	1140	56
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	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145		1145	0
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	226	1148	252
1. Comisiones	0149	205	1149	247
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	8	1150	8
1.2 Comisión administrador	0151	2	1151	2
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	1152	4
1.4 Comisión variable	0153	192	1153	233
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156		1156	0
2. Otros	0157	21	1157	5
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-825	1158	-1.107
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-825	1160	-1.107
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	0
TOTAL PASIVO	0162	84.506	1162	102.619

S.02

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	194	1201		2201	889	3201	1.314
1.1 Activos titulizados	0202	194	1202		2202	889	3202	1.314
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203		2203		3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-5	1204		2204	-26	3204	-190
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-2	1205		2205	-14	3205	-174
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-3	1206		2206	-12	3206	-16
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207		2207	0	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-68	1208	0	2208	-305	3208	-334
A) MARGEN DE INTERESES	0209	121	1209	0	2209	558	3209	790
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	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
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215		2215		3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216		2216		3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-155	1217		2217	-270	3217	-592
7.1 Servicios exteriores	0218	-22	1218		2218	-36	3218	-27
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219		2219	-2	3219	-4
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220		2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221		2221		3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	-22	1222		2222	-35	3222	-23
7.2 Tributos	0223	0	1223		2223	-2	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-132	1224		2224	-231	3224	-565
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-9	1225		2225	-36	3225	-36
7.3.2 Comisión administrador	0226	-2	1226		2226	-8	3226	-10
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-2	1227		2227	-10	3227	-6
7.3.4 Comisión variable	0228	-121	1228		2228	-177	3228	-513
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229		2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	2	1230		2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	34	1231		2231	-288	3231	-198
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	34	1232		2232	-288	3232	-198
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233		2233		3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	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	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238		2238		3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	0	1239		2239	0	3239	0
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241		2241		3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-187	1300		2300	-774	3300	1.504
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	149	1301		2301	572	3301	718
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	236	1302		2302	916	3302	1.357
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-2	1303		2303	-38	3303	-210
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	-71	1304		2304	-23	3304	15
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-6	1305		2305	-269	3305	-427
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	-9	1307		2307	-13	3307	-17
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308		2308		3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-115	1309		2309	-275	3309	-666
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-9	1310		2310	-36	3310	-36
2.2 Comisión administrador	0311	-7	1311		2311	-9	3311	-10
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-2	1312		2312	-12	3312	-6
2.4 Comisión variable	0313	-97	1313		2313	-218	3313	-614
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314		2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-221	1315		2315	-1.072	3315	1.452
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	-4.969	1320		2320	-5.820	3320	1.452
3.6 Otros cobros de explotación	0321	4.749	1321		2321	4.749	3321	
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-211	1322		2322	-4.929	3322	3.809
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323		2323		3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324		2324		3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	-211	1325		2325	-4.929	3325	3.809
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	1.993	1326		2326	8.048	3326	16.757
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	809	1327		2327	3.141	3327	
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	210	1328		2328	906	3328	
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	-3.224	1331		2331	-17.024	3331	-12.948
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332		2332		3332	0
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	0	1334		2334		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	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-398	1337		2337	-5.703	3337	5.313
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	9.972	1338		2338	15.277	3338	9.964
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	9.574	1339		2339	9.574	3339	15.277

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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
1. Activos financieros disponibles para la venta								
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
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356		2356		3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	336	1357		2357	-23	3357	79
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	336	1358		2358	-23	3358	79
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359		2359	0	3359	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	68	1360		2360	305	3360	335
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361		2361		3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-404	1362		2362	-282	3362	-414
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363		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	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
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369		2369		3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370		2370	0	3370	0

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, 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	1,34	0400	0	0420	0	0440	4,07	1380	0,77	1400	0	1420	0	1440	3,58	2380	0,48	2400	0,48	2420	0	2440	0
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	2,12	0401	0	0421	0	0441	3,60	1381	0,87	1401	0	1421	0	1441	0,53	2381	0	2401	0	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 Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, 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	11	0467	5	0474	0	0481		0488	5	0495	481	0502	0	0509	487
De 1 a 3 meses	0461	9	0468	8	0475	1	0482		0489	9	0496	417	0503	0	0510	427
De 3 a 6 meses	0462	2	0469	3	0476	0	0483	0	0490	3	0497	48	0504		0511	51
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	3	0477	0	0484	0	0491	3	0498	134	0505		0512	138
De 9 a 12 meses	0464		0471		0478		0485		0492		0499		0506		0513	
Más de 12 meses	0465	15	0472	65	0479	4	0486	11	0493	79	0500	852	0507		0514	931
Total	0466	38	0473	84	0480	5	0487	11	0494	100	0501	1.933	0508	1	1515	2.034

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	11	0522	5	0529	0	0536		0543	5	0550	481	0557	0	0564	487	0571	1.735	0578	265.114	0584	28,07
De 1 a 3 meses	0516	9	0523	8	0530	1	0537		0544	9	0551	417	0558	0	0565	427	0572	2.040	0579	2.040	0585	20,92
De 3 a 6 meses	0517	2	0524	3	0531	0	0538	0	0545	3	0552	48	0559		0566	51	0573	223	0580	223	0586	22,83
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	3	0532	0	0539	0	0546	3	0553	134	0560		0567	138	0574	211	0581	211	0587	65,17
De 9 a 12 meses	0519		0526		0533		0540		0547		0554		0561		0568		0575		0582		0588	
Más de 12 meses	0520	15	0527	65	0534	4	0541	11	0548	79	0555	852	0562		0569	931	0576	1.900	0583	1.900	0589	49,01
Total	0521	38	0528	84	0535	5	0542	11	0549	100	0556	1.933	0563	1	0570	2.034	0577	6.109			0590	33,29

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, 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 31/10/2006	
Inferior a 1 año	0600	82	1600	111	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	1.395	1601	314	2601	64
Entre 2 y 3 años	0602	2.750	1602	2.210	2602	135
Entre 3 y 4 años	0603	556	1603		2603	
Entre 4 y 5 años	0604	854	1604	4.996	2604	813
Entre 5 y 10 años	0605	24.090	1605	27.854	2605	14.810
Superior a 10 años	0606	45.800	1606	52.135	2606	299.178
Total	0607	75.525	1607	87.620	2607	315.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	10,72	1608	11,39	2608	18,81

Antigüedad	Situación actual 31/12/2016					
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 31/10/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	12,73	1609	11,74	2609	2,65

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, 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 31/10/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.395	0630	44.740	1620	1.425	1630	48.823	2620	769	2630	38.330
40% - 60%	0621	391	0631	24.868	1621	459	1631	29.716	2621	1.105	2631	86.361
60% - 80%	0622	64	0632	5.918	1622	95	1632	9.081	2622	1.778	2632	155.049
80% - 100%	0623		0633		1623	0	1633	0	2623	304	2633	35.260
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
Total	0628	1.850	0638	75.525	1628	1.979	1638	87.620	2628	3.956	2638	315.000
Media ponderada (%)			0639	36,68			1639	39,10			2639	61,85

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, 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 31/10/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,92	1650	1,41	2650	3,98
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,50	1651	4,50	2651	5,75
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,06	1652	0,16	2652	2,22

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA
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: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, 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 31/10/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	130	0683	6.047	1660	144	1683	6.954	2660	289	2683	25.632
Aragón	0661		0684		1661	0	1684	0	2661	0	2684	0
Asturias	0662		0685		1662	0	1685	0	2662	0	2685	0
Baleares	0663		0686		1663	0	1686	0	2663	0	2686	0
Canarias	0664		0687		1664	0	1687	0	2664	0	2687	0
Cantabria	0665		0688		1665	0	1688	0	2665	0	2688	0
Castilla-León	0666		0689		1666	0	1689	0	2666	0	2689	0
Castilla La Mancha	0667		0690		1667	0	1690	0	2667	159	2690	11.586
Cataluña	0668		0691		1668	0	1691	0	2668	0	2691	0
Ceuta	0669		0692		1669	0	1692	0	2669	0	2692	0
Extremadura	0670		0693		1670	0	1693	0	2670	0	2693	0
Galicia	0671		0694		1671	0	1694	0	2671	0	2694	0
Madrid	0672		0695		1672	0	1695	0	2672	5	2695	455
Melilla	0673		0696		1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	1.147	0697	47.233	1674	1.216	1697	54.696	2674	2.162	2697	171.600
Navarra	0675		0698		1675	0	1698	0	2675	0	2698	0
La Rioja	0676		0699		1676	0	1699	0	2676	0	2699	0
Comunidad Valenciana	0677	573	0700	22.245	1677	619	1700	25.970	2677	1.341	2700	105.727
País Vasco	0678		0701		1678	0	1701	0	2678	0	2701	0
Total España	0679	1.850	0702	75.525	1679	1.979	1702	87.620	2679	3.956	2702	315.000
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
Total general	0682	1.850	0705	75.525	1682	1.979	1705	87.620	2682	3.956	2705	315.000

S.05.1
Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA
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: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 31/10/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	2,80			1710	2,60			2710	1,13		
Sector	0711		0712		1711	0	1712	0	2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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 31/10/2006					
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			
ES0312272018	B	81	49.450	4.005	81	60.000	4.881	81	100.000	8.100			
ES0312272026	C	38	49.450	1.879	38	60.000	2.290	38	100.000	3.800			
ES0312272000	A	3.031	23.754	71.999	3.031	29.000	87.736	3.031	100.000	303.100			
Total		0723	3.150	0724	77.884	1723	3.150	1724	94.907	2723	3.150	2724	315.000

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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				
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739		
ES0312272018	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,33	0,04	0	0	SI	4.005	0	4.006			
ES0312272026	C	S	EURIBOR 3 MESES	0,56	0,27	1	0	SI	1.879	0	1.880			
ES0312272000	A	NS	EURIBOR 3 MESES	0,14	0	0	0	SI	71.999	0	71.999			
Total						0740	1	0741	0743	77.884	0744	0745	77.885	0746

	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 31/10/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,01	0748	0,21	0749	3,83

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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	1750	1751	1752	1753								
ES0312272000	A	2.509	231.101	0	36.040	11.970	215.364	175	35.572								
ES0312272026	C	228	1.921	1	737	312	1.509	15	715								
ES0312272018	B	487	4.095	0	1.406	666	3.218	20	1.378								
Total		0754	3.224	0755	237.116	0756	2	0757	38.183	1754	12.948	1755	220.091	1756	210	1757	37.665

S.05.2
Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA
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 31/10/2006
				0762	0763	0764
ES0312272000	A	14/03/2016	SYP	A	A-	AAA
ES0312272018	B	30/10/2006	FCH	A+	A+	A+
ES0312272018	B	12/02/2013	SYP	BB+	BB+	A
ES0312272026	C	27/02/2015	FCH	BB+	BB+	BBB
ES0312272026	C	28/11/2014	SYP	B-	B-	BBB
ES0312272000	A	08/06/2012	FCH	AA-	AA-	AAA

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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 31/10/2006
Inferior a 1 año	0765		1765		2765
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767
Entre 3 y 4 años	0768	77.884	1768		2768
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769	94.907	2769
Entre 5 y 10 años	0770		1770	0	2770
Superior a 10 años	0771		1771		315.000
Total	0772	77.884	1772	94.907	2772
Vida residual media ponderada (años)	0773	3,17	1773	4	2773
					6,09

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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 31/10/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	1.575	1775	1.575	2775	1.922
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	1.575	1776	1.575	2776	1.922
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	2	1777	1	2777	0
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	92,44	1792	92,44	2792	96,22
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 Caja Murcia Hipotecario II, FTA
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 31/10/2006	
0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806

AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

Permuta 1	CECABANK S.A	TRIMESTRAL	El producto, en función de los días efectivamente transcurridos y en base 360, del Importe Nocial del Contrato de Swap definido anteriormente , por el Factor de Cálculo para el Swap. El Factor de Cálculo para el Swap será la media de los EURIBOR 12 meses obtenidos en doce meses precedentes al inicio del Período de Cálculo, aplicando las ponderaciones que se indican en el Contrato de Swap.El producto, en función de los días efectivamente transcurridos y en base 360, del Importe Nocial del Contrato de Swap definido anteriormente , por el Factor de Cálculo para el Swap. El Factor de Cálculo para el Swap será la media de los EURIBOR 12 meses obtenidos en doce meses precedentes al inicio del Período de Cálculo, aplicando las ponderaciones que se indican en el	Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de los Préstamos Hipotecarios No Fallidos	Es el resultado de multiplicar el Importe Nocial del Contrato de Swap por el Tipo de Interés de Referencia establecido para cada Fecha de Pago,ajustado por un margen de -0,05% .	Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento de los Préstamos Hipotecarios No Fallidos	-893	-1.163	-6.475	
-----------	--------------	------------	--	--	---	--	------	--------	--------	--

AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

			Contrato de Swap.										
Total							0808	-893	0809	-1.163	0810	-6.475	

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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 31/10/2006	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 31/10/2006		
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 Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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	3	7002		7003	85	7006	71	7009	1,46	7012	0,79	7015	1,21		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013	0	7016			
Total Morosos					7005	85	7008	71	7011	1,46	7014	0,79	7017	1,21	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020		7021	64	7024	46	7027	0,87	7030	0,42	7033	0,88		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025		7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	64	7026	46	7029	0,87	7032	0,42	7035	0,88	7036	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.3

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 Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
d) el SALDO VIVO DE LOS ACTIVOS NO FALLIDOS CON MÁS DE 90 DÍAS DE IMPAGO sea superior al % establecido para cada ISIN del SALDO VIVO DE ACTIVOS NO FALLIDOS	1,50	0,34	0,60	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.3
d) el SALDO VIVO DE LOS ACTIVOS NO FALLIDOS CON MÁS DE 90 DÍAS DE IMPAGO sea superior al % establecido para cada ISIN del SALDO VIVO DE ACTIVOS NO FALLIDOS	1,50	0,34	0,60	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.3
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
El Saldo acumuladode los Activos Fallidos represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo Inicial a la constitución del Fondo	6,70	0,24	0,24	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.6.1
El Saldo acumuladode los Activos Fallidos represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo Inicial a la constitución del Fondo	6,70	0,24	0,24	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.6.1
El Saldo acumuladode los Activos Fallidos represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo Inicial a la constitución del Fondo	4,60	0,24	0,24	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.6.2
El Saldo acumuladode los Activos Fallidos represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del Saldo Inicial a la constitución del Fondo	4,60	0,24	0,24	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.6.2
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	1,22	1,48	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.2
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	1,22	1,48	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.2
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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	36	2862	Días del mes /Días año	3862	0	4862	0	5862	0	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	Caja de Ahorros de Murcia	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	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 Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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	
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	
3 Otros (S/N)	0868	
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Banco Mare Nostrum
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo adicional 3.4.3.2

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

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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 Caja Murcia Hipotecario II, FTA

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