

**I. DATOS IDENTIFICATIVOS**

Denominación del Fondo: AYT HIPOTECARIO BBK II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS  
Número de registro del Fondo: 8431  
NIF Fondo: V84734235  
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: 31/12/2017

**II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA**

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

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2017		Periodo anterior 31/12/2016
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	336.675	1001	372.674
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	336.675	1002	372.674
1. Activos titulizados	0003	336.675	1003	372.674
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	335.678	1005	372.457
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	3.549	1025	2.878
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-2.552	1027	-2.662
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0039		1039	
<b>III. Otros activos no corrientes</b>	0040		1040	

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2017		Periodo anterior 31/12/2016
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	72.123	1041	76.004
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042		1042	
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	38.482	1043	40.742
1. Activos titulizados	0044	38.482	1044	40.742
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	37.394	1046	40.243
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059		1059	
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	139	1065	160
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	6	1066	6
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	3.337	1067	4.396
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	22	1068	29
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-2.415	1069	-4.092
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	0	1084	0
<b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b>	0085	33.641	1085	35.263
1. Tesorería	0086	33.641	1086	35.263
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	408.798	1088	448.678

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2017		Periodo anterior 31/12/2016
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	365.089	1089	402.330
<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	365.089	1094	402.330
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	337.704	1095	373.070
1.1 Series no subordinadas	0096	255.704	1096	291.070
1.2 Series subordinadas	0097	82.000	1097	82.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101	16.496	1101	18.173
2.1 Préstamo subordinado	0102	16.496	1102	18.173
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105		1105	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	3.339	1108	4.717
3.1 Derivados de cobertura	0109	3.339	1109	4.717
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	7.550	1112	6.370
4.1 Garantías financieras	0113	7.550	1113	0
4.1 Otros	0114		1114	6.370
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	0116		1116	

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2017		Periodo anterior 31/12/2016
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	47.049	1117	51.064
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0118		1118	
<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	46.243	1123	50.128
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	45.947	1124	49.608
1.1 Series no subordinadas	0125	45.917	1125	49.568
1.2 Series subordinadas	0126		1126	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	30	1128	40
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	55	1131	62
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	55	1136	62
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137		1137	
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	240	1139	343
3.1 Derivados de cobertura	0140	240	1140	343
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	1	1143	115
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	1	1144	115
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	0148	806	1148	936
1. Comisiones	0149	775	1149	915
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	18	1150	20
1.2 Comisión administrador	0151	7	1151	8
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	750	1153	887
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155		1155	
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	31	1157	21
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158	-3.339	1158	-4.717
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159		1159	
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	-3.339	1160	-4.717
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161		1161	
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	408.798	1162	448.678

S.02

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2017		Acumulado anterior 31/12/2016
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	759	1201	968	2201	3.736	3201	4.373
1.1 Activos titulizados	0202	759	1202	968	2202	3.736	3202	4.373
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-115	1204	-144	2204	-496	3204	-888
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-41	1205	-59	2205	-185	3205	-518
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-74	1206	-85	2206	-311	3206	-370
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0208	-309	1208	-402	2208	-1.327	3208	-1.592
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	334	1209	422	2209	1.913	3209	1.893
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	0210	0	1210	0	2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0215	0	1215	0	2215		3215	
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0216	0	1216	0	2216		3216	0
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0217	-722	1217	-838	2217	-3.700	3217	-2.198
7.1 Servicios exteriores	0218	-22	1218	-19	2218	-23	3218	-36
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219	0	2219	-1	3219	0
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220		3220	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	-21	1222	-18	2222	-22	3222	-35
7.2 Tributos	0223	-1	1223	0	2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-700	1224	-819	2224	-3.676	3224	-2.161
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-25	1225	-27	2225	-103	3225	-113
7.3.2 Comisión administrador	0226	-10	1226	-11	2226	-41	3226	-45
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227		3227	-10
7.3.4 Comisión variable	0228	-665	1228	-782	2228	-3.532	3228	-1.993
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	1	2230	0	3230	0
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0231	388	1231	416	2231	1.787	3231	305
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	388	1232	416	2232	1.787	3232	305
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233		3233	
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	0234	0	1234	0	2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237		3237	
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0238	0	1238	0	2238		3238	
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0239	0	1239	0	2239		3239	
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0241	0	1241	0	2241		3241	
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2017		Acumulado anterior 31/12/2016
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	-2.605	1300	-586	2300	-944	3300	-1.222
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	-175	1301	-204	2301	1.821	3301	1.759
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	761	1302	972	2302	3.764	3302	4.440
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-90	1303	-146	2303	-195	3303	-672
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	948	1304	3.691	2304	1.962	3304	2.917
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-1.640	1305	-4.543	2305	-3.392	3305	-4.543
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	-154	1307	-178	2307	-319	3307	-382
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	0309	-2.529	1309	-1.027	2309	-3.816	3309	-2.006
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-51	1310	-56	2310	-105	3310	-115
2.2 Comisión administrador	0311	-21	1311	-23	2311	-42	3311	-71
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	-18
2.4 Comisión variable	0313	-2.457	1313	-949	2313	-3.669	3313	-1.803
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>	0315	99	1315	646	2315	1.051	3315	-975
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	-1	1320	0	2320	-6.499	3320	-975
3.6 Otros cobros de explotación	0321	100	1321	646	2321	7.550	3321	0
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>	0322	-9.415	1322	-8.997	2322	-678	3322	-1.433
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b>	0325	-8.592	1325	-8.165	2325	1.000	3325	379
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	5.849	1326	5.996	2326	23.504	3326	23.998
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	3.947	1327	4.275	2327	12.938	3327	13.561
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	757	1328	921	2328	3.574	3328	2.861
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-19.145	1331	-19.357	2331	-39.017	3331	-40.042
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	0332	-823	1332	-832	2332	-1.678	3332	-1.812
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	-823	1334	-832	2334	-1.678	3334	-1.812
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336	0	2336	0	3336	0
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	0337	-12.020	1337	-9.582	2337	-1.622	3337	-2.655
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	45.661	1338	44.845	2338	35.263	3338	37.918
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	33.641	1339	35.263	2339	33.641	3339	35.263

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2017		Acumulado anterior 31/12/2016
<b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>0356</b>	<b>0</b>	<b>1356</b>	<b>0</b>	<b>2356</b>		<b>3356</b>	
<b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	116	1357	620	2357	50	3357	-924
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	116	1358	620	2358	50	3358	-924
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	309	1360	402	2360	1.327	3360	1.592
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-425	1362	-1.022	2362	-1.377	3362	-668
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>0363</b>	<b>0</b>	<b>1363</b>	<b>0</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 período	0364	0	1364	0	2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368		3368	
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>0369</b>	<b>0</b>	<b>1369</b>	<b>0</b>	<b>2369</b>		<b>3369</b>	
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>0370</b>	<b>0</b>	<b>1370</b>	<b>0</b>	<b>2370</b>	<b>0</b>	<b>3370</b>	<b>0</b>

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados:

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2017								Situación cierre anual anterior 31/12/2016								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	1,81	0401	0	0421	0	0441	3,29	1381	1,73	1401	0	1421	0	1441	3,13	2381	0,48	2401	0,07	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 Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados:

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO B**

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	114	0467	35	0474	3	0481	0	0488	38	0495	9.724	0502	3	0509	9.766
De 1 a 3 meses	0461	40	0468	37	0475	3	0482		0489	40	0496	4.018	0503	2	0510	4.059
De 3 a 6 meses	0462	10	0469	22	0476	0	0483	1	0490	23	0497	1.038	0504		0511	1.062
De 6 a 9 meses	0463	3	0470	12	0477	0	0484	1	0491	13	0498	332	0505		0512	345
De 9 a 12 meses	0464	1	0471	6	0478		0485	1	0492	7	0499	156	0506		0513	163
Más de 12 meses	0465	53	0472	3.296	0479	21	0486	174	0493	3.491	0500	2.023	0507		0514	5.514
<b>Total</b>	0466	221	0473	3.409	0480	27	0487	177	0494	3.613	0501	17.291	0508	5	1515	20.909

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	114	0522	35	0529	3	0536	0	0543	38	0550	9.724	0557	3	0564	9.766	0571	17.466	0578		0584	55,91
De 1 a 3 meses	0516	40	0523	37	0530	3	0537		0544	40	0551	4.018	0558	2	0565	4.059	0572	6.708	0579		0585	60,51
De 3 a 6 meses	0517	10	0524	22	0531	0	0538	1	0545	23	0552	1.038	0559		0566	1.062	0573	1.819	0580		0586	58,37
De 6 a 9 meses	0518	3	0525	12	0532	0	0539	1	0546	13	0553	332	0560		0567	345	0574	537	0581		0587	64,38
De 9 a 12 meses	0519	1	0526	6	0533		0540	1	0547	7	0554	156	0561		0568	163	0575	223	0582		0588	72,87
Más de 12 meses	0520	53	0527	3.296	0534	21	0541	174	0548	3.491	0555	2.023	0562		0569	5.514	0576	8.582	0583		0589	64,26
<b>Total</b>	0521	221	0528	3.409	0535	27	0542	177	0549	3.613	0556	17.291	0563	5	0570	20.909	0577	35.334			0590	59,17

S.05.1

**Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA**

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 31/12/2017**

**Entidades cedentes de los activos titulizados:**

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO C**

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 06/06/2006	
Inferior a 1 año	0600	78	1600	141	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	358	1601	219	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	961	1602	481	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	1.450	1603	1.371	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	1.159	1604	1.448	2604	315
Entre 5 y 10 años	0605	30.303	1605	30.622	2605	250
Superior a 10 años	0606	345.648	1606	385.691	2606	999.435
<b>Total</b>	0607	<b>379.958</b>	1607	<b>419.975</b>	2607	<b>1.000.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	0608	<b>15,25</b>	1608	<b>16,16</b>	2608	<b>26,79</b>

Antigüedad	Situación actual 31/12/2017					
	Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 06/06/2006			
Antigüedad media ponderada (años)	0609	13,76	1609	12,78	2609	2,44

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados:

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO D**

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 06/06/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.290	0630	44.262	1620	1.065	1630	38.103	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	2.226	0631	182.343	1621	2.118	1631	171.203	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	1.285	0632	151.591	1622	1.770	1632	207.130	2622	1.686	2632	204.991
80% - 100%	0623	12	0633	1.762	1623	23	1633	3.539	2623	5.718	2633	795.009
100% - 120%	0624		0634		1624		1634		2624	0	2634	0
120% - 140%	0625		0635		1625		1635		2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626		1636		2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627		1637		2627	0	2637	0
<b>Total</b>	0628	<b>4.813</b>	0638	<b>379.958</b>	1628	<b>4.976</b>	1638	<b>419.975</b>	2628	<b>7.404</b>	2638	<b>1.000.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>	0639	<b>55,04</b>	0649		1639	<b>58,25</b>	1649		2639	<b>87,63</b>	2649	

S.05.1

**Denominación Fondo:** AyT Hipotecario BBK II, FTA

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados:** NO

**Fecha:** 31/12/2017

**Entidades cedentes de los activos titulizados:**

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 06/06/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,78	1650	0,83	2650	3,28
Tipo de interés nominal máximo	0651	3,75	1651	3,75	2651	4,84
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,16	1652	0,29	2652	2,45

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados:

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO F**

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 06/06/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	9	0683	698	1660	10	1683	955	2660	44	2683	7.516
Aragón	0661	96	0684	9.208	1661	98	1684	9.876	2661	136	2684	20.708
Asturias	0662	3	0685	165	1662	4	1685	292	2662	5	2685	601
Baleares	0663	2	0686	147	1663	2	1686	155	2663	2	2686	236
Canarias	0664	1	0687	12	1664	1	1687	14	2664	2	2687	122
Cantabria	0665	397	0688	30.652	1665	415	1688	34.057	2665	621	2688	82.241
Castilla-León	0666	56	0689	3.006	1666	58	1689	3.262	2666	92	2689	8.256
Castilla La Mancha	0667	108	0690	10.789	1667	110	1690	11.709	2667	155	2690	23.652
Cataluña	0668	29	0691	2.721	1668	31	1691	3.131	2668	41	2691	6.780
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	0
Extremadura	0670		0693		1670		1693		2670	0	2693	0
Galicia	0671		0694		1671		1694		2671	0	2694	0
Madrid	0672	1.001	0695	88.838	1672	1.045	1695	98.769	2672	1.534	2695	223.288
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	1	0697	30	1674	1	1697	35	2674	2	2697	281
Navarra	0675	3	0698	407	1675	3	1698	422	2675	4	2698	802
La Rioja	0676	53	0699	5.029	1676	54	1699	5.363	2676	85	2699	12.224
Comunidad Valenciana	0677	142	0700	11.901	1677	148	1700	13.459	2677	215	2700	30.052
País Vasco	0678	2.912	0701	216.355	1678	2.996	1701	238.475	2678	4.466	2701	583.241
<b>Total España</b>	0679	<b>4.813</b>	0702	<b>379.958</b>	1679	<b>4.976</b>	1702	<b>419.975</b>	2679	<b>7.404</b>	2702	<b>1.000.000</b>
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
<b>Total general</b>	0682	<b>4.813</b>	0705	<b>379.958</b>	1682	<b>4.976</b>	1705	<b>419.975</b>	2682	<b>7.404</b>	2705	<b>1.000.000</b>

S.05.1

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados:

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 31/12/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 06/06/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,85			1710	0,84			2710	0,54		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

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

**CUADRO A**

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2017			Situación cierre anual anterior 31/12/2016			Situación inicial 06/06/2006					
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			
ES0312251004	A	9.180	32.856	301.621	9.180	37.107	340.638	9.180	100.000	918.000			
ES0312251012	B	435	100.000	43.500	435	100.000	43.500	435	100.000	43.500			
ES0312251020	C	385	100.000	38.500	385	100.000	38.500	385	100.000	38.500			
<b>Total</b>		0723	10.000	0724	383.621	1723	10.000	1724	422.638	2723	10.000	2724	1.000.000

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

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

**CUADRO B**

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado							
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739					
ES0312251004	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,15	0	0	0	SI	301.621	0	301.621						
ES0312251012	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,30	0,03	2	0	SI	43.500	0	43.502						
ES0312251020	C	S	EURIBOR 6 MESES	0,65	0,38	28	0	SI	38.500	0	38.528						
<b>Total</b>						0740	30	0741	0	0743	383.621	0744	0	0745	383.651	0746	

	Situación actual 31/12/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 06/06/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,05	0748	0,07	0749	3,26

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2017								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2016							
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								
ES0312251004	A	19.145	616.379	0	141.513	19.357	577.362	13	141.513								
ES0312251012	B	0	0	11	9.227	0	0	35	9.196								
ES0312251020	C	0	0	78	9.722	0	0	99	9.558								
<b>Total</b>		0754	19.145	0755	616.379	0756	90	0757	160.462	1754	19.357	1755	577.362	1756	146	1757	160.268

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

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

**CUADRO D**

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 31/12/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 06/06/2006
				0762	0763	0764
ES0312251004	A	18/08/2014	FCH	AA+	AA+	AA
ES0312251004	A	23/02/2015	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0312251012	B	25/02/2011	FCH	A	A	A
ES0312251012	B	23/02/2015	MDY	Aa2	Aa2	A2
ES0312251020	C	25/02/2011	FCH	BB	BB	BB
ES0312251020	C	23/02/2015	MDY	Ba1	Ba1	B1

S.05.2

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

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

**CUADRO E**

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 06/06/2006	
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		1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769	
Entre 5 y 10 años	0770	301.621	1770	340.638	2770	914.500
Superior a 10 años	0771	82.000	1771	82.000	2771	85.500
<b>Total</b>	<b>0772</b>	<b>383.621</b>	<b>1772</b>	<b>422.638</b>	<b>2772</b>	<b>1.000.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>0773</b>	<b>7,30</b>	<b>1773</b>	<b>6,19</b>	<b>2773</b>	<b>9,27</b>

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 06/06/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	16.496	1775	18.173	2775	21.500
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	16.496	1776	18.173	2776	21.500
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	4,30	1777	4	2777	2
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778		2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780		2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	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	0	2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	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	78,62	1792	80,60	2792	91,80
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	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

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 31/12/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 06/06/2006				
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806			
Permuta 1	KUTXABANK S.A.	SEMESTRAL	La suma de los intereses devengados, vencidos e ingresados al Fondo durante el Periodo de Liquidación que vence de los Activos de la Serie correspondiente, disminuida en el importe de los Intereses Corridos que, en su caso, hubiere pagado el Fondo durante el mismo Periodo de Liquidación entre (ii) el Importe Nominal, multiplicado por 360 y dividido por los días efectivos existentes en dicho Periodo de Liquidación	El Saldo Vivo de los Activos (una vez deducidos los Activos Fallidos) en la Fecha de Determinación anterior que no se encuentren con retrasos en el pago de los importes vencidos por más de noventa (90) días en la Fecha de Determinación en curso (incluidos los Activos totalmente amortizados durante el Periodo de Determinación)	Tipo de Interés de Referencia de los Bonos fijado para el correspondiente Periodo de Devengo de Intereses de los Bonos más un margen del 0,70 % .	El Saldo Vivo de los Activos (una vez deducidos los Activos Fallidos) en la Fecha de Determinación anterior que no se encuentren con retrasos en el pago de los importes vencidos por más de noventa (90) días en la Fecha de Determinación en curso (incluidos los Activos totalmente amortizados durante el Periodo de Determinación)	-3.579	-5.059	-16.816				
<b>Total</b>							0808	-3.579	0809	-5.059	0810	-16.816	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

**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 31/12/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 06/06/2006	Situación actual 31/12/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 06/06/2006		
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	3844	
<b>Total</b>	0827	1827	2827	0845	1845	2845	3845	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

**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 31/12/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación actual 31/12/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Última Fecha Pago							
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	3.535	7006	4.638	7009	1,81	7012	1,73	7015	1,80		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	3.535	7008	4.638	7011	1,81	7014	1,73	7017	3.535.154	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	3.472	7024	4.607	7027	1,30	7030	1,60	7033	1,37		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	3.472	7026	4.607	7029	1,30	7032	1,60	7035	1,37	7036	FOLLETO INFORMA TIVO. NOTA DE VALORES. APARTAD O 4.9.2.b) (iv)

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Última Fecha Pago		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

**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
b) Si en dicha Fecha de Pago existan o se prevea que vayan a existir CANTIDADES DISPUESTAS DEL CRÉDITO SUBORDINADO o, en caso de Dotación del Depósito de Liquidez, éste no sea o se prevea que no va a ser igual al IMPORTE MÁXIMO DEL CRÉDITO SUBORDINADO	1	1,80	1,82	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b) (iv)
a) el Saldo Vivo de los Activos en morosidad que presenten más de tres (3) meses de retraso en el pago de importes vencidos, sea superior al % establecido para cada ISIN del Saldo Vivo de los Activos en esa misma fecha.	1	1,80	1,82	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b) (iv)
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series</b>	0855	0859	1859	2859
<b>No Reducción del Fondo de Reserva</b>	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	1,83	1,84	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL A LA NOTA DE VALORES. APARTADO 3.4.3.2
<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 Hipotecario BBK II, FTA**

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 31/12/2017**

**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	0,030	4862	150	5862	0	6862	Semestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	BILBAO 48 KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA	1863	0	2863	Días del mes /Base 365	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Semestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BANCO SANTANDER, S.A.	1864	0	2864		3864	0	4864	0	5864	0	6864	Semestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

<b>S.05.5</b>
<b>Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 31/12/2017</b>

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

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

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total		
		31/03/2017	30/06/2017	30/09/2017	31/12/2017									
<b>Ingresos y gastos del periodo de cálculo</b>	0872													
Margen de intereses	0873	389	374	816	334									1.913
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	82	502	816	388									1.787
Dotaciones a provisiones (neto)	0875													0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876													0
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-37	-38	-36	-57									-168
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	433	838	1.596	665	0	0	0	0	0	0	0	0	3.532
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879													0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880													0
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881	-433	-838	-1.596	-665									-3.532
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		963		2.457									3.421
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884													

S.05.5

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

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

S.06

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

**NOTAS EXPLICATIVAS**



**INFORME DE AUDITOR**

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