

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: 31/12/2021

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

S01 Balance , reclasificación importes emtre celdas 0005 y 0046
S03 EFE, reclasificacion imorte entre celdas 2314 y 2334

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2021		Periodo anterior 31/12/2020
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	189.366	1001	224.768
I. Activos financieros a largo plazo	0002	189.366	1002	224.768
1. Activos titulizados	0003	189.366	1003	224.768
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	187.903	1005	223.528
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	1.463	1025	3.606
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	0	1027	-2.365
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	
2. Derivados	0029		1029	
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	
3. Otros activos financieros	0032		1032	
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035		1035	
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	54.561	1041	57.129
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	33.195	1043	33.502
1. Activos titulizados	0044	33.188	1044	33.502
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	32.978	1046	32.723
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	38	1065	71
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	2	1066	2
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	169	1067	2.033
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	0	1068	16
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	0	1069	-1.344
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071	7	1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072	7	1072	
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	21.366	1085	23.627
1. Tesorería	0086	21.366	1086	23.627
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	243.927	1088	281.898

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2021		Periodo anterior 31/12/2020
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	205.069	1089	243.757
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	205.069	1094	243.757
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	189.565	1095	225.515
1.1 Series no subordinadas	0096	107.565	1096	143.515
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	10.800	1101	11.439
2.1 Préstamo subordinado	0102	10.800	1102	11.439
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	1.494	1108	2.813
3.1 Derivados de cobertura	0109	1.494	1109	2.813
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	3.210	1112	3.990
4.1 Garantías financieras	0113	3.210	1113	3.990
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

S.01

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) PASIVO CORRIENTE	0117	40.351	1117	40.954
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	
V. Provisiones a corto plazo	0119		1119	
1. Provisión garantías financieras	0120		1120	
2. Provisión por margen de intermediación	0121		1121	
3. Otras provisiones	0122		1122	
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	40.119	1123	40.785
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	40.089	1124	40.514
1.1 Series no subordinadas	0125	40.080	1125	40.503
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	9	1128	11
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	30	1131	32
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	30	1136	32
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137		1137	
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139		1139	239
3.1 Derivados de cobertura	0140		1140	239
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	1
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	1	1144	1
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	232	1148	168
1. Comisiones	0149	210	1149	147
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	11	1150	12
1.2 Comisión administrador	0151	4	1151	5
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	194	1153	184
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	-55
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	22	1157	22
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-1.494	1158	-2.813
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-1.494	1160	-2.813
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	243.927	1162	281.898

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2021		Acumulado anterior 31/12/2020
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	226	1201	463	2201	1.299	3201	2.030
1.1 Activos titulizados	0202	226	1202	463	2202	1.299	3202	2.030
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-53	1204	-82	2204	-219	3204	-435
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-12	1205	-34	2205	-54	3205	-218
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-41	1206	-48	2206	-166	3206	-217
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-5	1208	-387	2208	-620	3208	-545
A) MARGEN DE INTERESES	0209	169	1209	-5	2209	460	3209	1.049
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	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	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216		3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-188	1217	-47	2217	-259	3217	-1.364
7.1 Servicios exteriores	0218	-23	1218	-22	2218	-26	3218	-25
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	-1	2219	-3	3219	-3
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	-22	1222	-22	2222	-24	3222	-22
7.2 Tributos	0223	-1	1223	-1	2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-164	1224	-24	2224	-232	3224	-1.337
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-15	1225	-17	2225	-63	3225	-73
7.3.2 Comisión administrador	0226	-6	1226	-7	2226	-25	3226	-29
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227		3227	0
7.3.4 Comisión variable	0228	-143	1228	0	2228	-143	3228	-1.235
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	33	1231	-3	2231	-146	3231	260
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	33	1232	-3	2232	-146	3232	260
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233		3233	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	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	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238		3238	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-14	1239	55	2239	-55	3239	55
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241		3241	
C) RESULTADO DEL PERIODO	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: 31/12/2021

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2021		Acumulado anterior 31/12/2020
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-844	1300	-1.807	2300	-772	3300	-2.652
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-208	1301	141	2301	259	3301	1.040
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	253	1302	467	2302	1.348	3302	2.053
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-26	1303	-170	2303	-56	3303	-229
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	230	1304	833	2304	500	3304	1.371
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-583	1305	-870	2305	-1.365	3305	-1.928
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	-81	1307	-117	2307	-168	3307	-227
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-64	1309	-1.542	2309	-224	3309	-2.206
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-31	1310	-36	2310	-65	3310	-75
2.2 Comisión administrador	0311	-13	1311	-15	2311	-26	3311	-30
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	0
2.4 Comisión variable	0313	-20	1313	-751	2313	-133	3313	-2.101
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	-739	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-572	1315	-407	2315	-807	3315	-1.486
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	-3.782	1320	-7	2320	-11.677	3320	-5.476
3.6 Otros cobros de explotación	0321	3.210	1321	-400	2321	10.870	3321	3.990
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-9.882	1322	-7.949	2322	-1.490	3322	-2.889
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	-9.882	1325	-7.949	2325	-851	3325	-1.310
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	4.950	1326	5.135	2326	20.105	3326	20.954
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	2.951	1327	3.551	2327	13.787	3327	12.444
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	394	1328	556	2328	1.630	3328	2.005
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	-18.177	1331	-17.190	2331	-36.373	3331	-36.712
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332	0	2332	-639	3332	-1.579
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	-639	3334	-1.579
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336	0	2336	0	3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-10.727	1337	-9.756	2337	-2.261	3337	-5.540
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	32.093	1338	33.384	2338	23.627	3338	29.168
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	21.366	1339	23.627	2339	21.366	3339	23.627

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2021		Acumulado anterior 31/12/2020
1. Activos financieros disponibles para la venta								
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	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-19	1357	394	2357	700	3357	179
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-19	1358	394	2358	700	3358	179
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	5	1360	387	2360	620	3360	545
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	13	1362	-781	2362	-1.320	3362	-724
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el 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	
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369		3369	
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2021								Situación cierre anual anterior 31/12/2020								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	2,47	0401	2	0421	11	0441	5,74	1381	2,15	1401	0	1421	0	1441	4,54	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: 31/12/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	59	0467	19	0474	2	0481		0488	21	0495	3.717	0502	1	0509	3.738
De 1 a 3 meses	0461	11	0468	11	0475	0	0482		0489	11	0496	834	0503	0	0510	845
De 3 a 6 meses	0462	8	0469	13	0476	0	0483	0	0490	13	0497	527	0504		0511	541
De 6 a 9 meses	0463	4	0470	12	0477		0484	0	0491	12	0498	235	0505		0512	247
De 9 a 12 meses	0464	6	0471	25	0478		0485	0	0492	25	0499	521	0506		0513	546
Más de 12 meses	0465	4	0472	120	0479		0486	1	0493	121	0500	180	0507		0514	301
Total	0466	92	0473	199	0480	2	0487	2	0494	203	0501	6.014	0508	1	1515	6.218

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	59	0522	19	0529	2	0536		0543	21	0550	3.717	0557	1	0564	3.738	0571	8.843	0578		0584	42,27
De 1 a 3 meses	0516	11	0523	11	0530	0	0537		0544	11	0551	834	0558	0	0565	845	0572	1.664	0579		0585	50,80
De 3 a 6 meses	0517	8	0524	13	0531	0	0538	0	0545	13	0552	527	0559		0566	541	0573	1.221	0580		0586	44,29
De 6 a 9 meses	0518	4	0525	12	0532		0539	0	0546	12	0553	235	0560		0567	247	0574	526	0581		0587	46,99
De 9 a 12 meses	0519	6	0526	25	0533		0540	0	0547	25	0554	521	0561		0568	546	0575	1.046	0582		0588	52,15
Más de 12 meses	0520	4	0527	120	0534		0541	1	0548	121	0555	180	0562		0569	301	0576	583	0583		0589	51,62
Total	0521	92	0528	199	0535	2	0542	2	0549	203	0556	6.014	0563	1	0570	6.218	0577	13.883			0590	44,79

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: 31/12/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 06/06/2006	
Inferior a 1 año	0600	173	1600	184	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	1.482	1601	428	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	2.594	1602	2.547	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	2.560	1603	3.694	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	2.120	1604	3.441	2604	315
Entre 5 y 10 años	0605	36.532	1605	33.227	2605	250
Superior a 10 años	0606	177.052	1606	218.370	2606	999.435
Total	0607	222.513	1607	261.889	2607	1.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	11,73	1608	12,60	2608	26,79

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 06/06/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	17,65	1609	16,69	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: 31/12/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				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	2.062	0630	72.702	1620	1.773	1630	59.804	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.720	0631	144.623	1621	2.210	1631	184.462	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	42	0632	5.188	1622	131	1632	17.049	2622	1.686	2632	204.991
80% - 100%	0623		0633		1623	4	1633	575	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
Total	0628	3.824	0638	222.513	1628	4.118	1638	261.889	2628	7.404	2638	1.000.000
Media ponderada (%)	0639	42,51	0649		1639	45,87	1649		2639	87,63	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: 31/12/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 06/06/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,49	1650	0,62	2650	3,28
Tipo de interés nominal máximo	0651	3,25	1651	3,75	2651	4,84
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,01	1652	0,03	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: 31/12/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				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	6	0683	348	1660	8	1683	580	2660	44	2683	7.516
Aragón	0661	81	0684	5.888	1661	84	1684	6.588	2661	136	2684	20.708
Asturias	0662	2	0685	36	1662	2	1685	42	2662	5	2685	601
Baleares	0663	2	0686	76	1663	2	1686	83	2663	2	2686	236
Canarias	0664	1	0687	6	1664	1	1687	8	2664	2	2687	122
Cantabria	0665	298	0688	17.394	1665	333	1688	21.042	2665	621	2688	82.241
Castilla-León	0666	50	0689	1.929	1666	54	1689	2.377	2666	92	2689	8.256
Castilla La Mancha	0667	86	0690	7.054	1667	96	1690	8.300	2667	155	2690	23.652
Cataluña	0668	21	0691	1.172	1668	23	1691	1.466	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	803	0695	52.179	1672	869	1695	61.619	2672	1.534	2695	223.288
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	1	0697	11	1674	1	1697	16	2674	2	2697	281
Navarra	0675	2	0698	242	1675	3	1698	360	2675	4	2698	802
La Rioja	0676	46	0699	3.173	1676	50	1699	3.845	2676	85	2699	12.224
Comunidad Valenciana	0677	112	0700	6.840	1677	121	1700	7.881	2677	215	2700	30.052
País Vasco	0678	2.313	0701	126.164	1678	2.471	1701	147.681	2678	4.466	2701	583.241
Total España	0679	3.824	0702	222.513	1679	4.118	1702	261.889	2679	7.404	2702	1.000.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	3.824	0705	222.513	1682	4.118	1705	261.889	2682	7.404	2705	1.000.000

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: 31/12/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 06/06/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,12			1710	1,04			2710	0,54		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

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: 31/12/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2021			Situación cierre anual anterior 31/12/2020			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	16.083	147.646	9.180	20.046	184.018	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			
Total		0723	10.000	0724	229.646	1723	10.000	1724	266.018	2723	10.000	2724	1.000.000

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: 31/12/2021

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	0738	0739					
			0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736			0737				
ES0312251004	A	NS	EURIBOR 6 MESES	0,15	0	0	0	SI	147.646	0	147.646						
ES0312251012	B	S	EURIBOR 6 MESES	0,30	0	0	0	SI	43.500	0	43.500						
ES0312251020	C	S	EURIBOR 6 MESES	0,65	0,12	9	0	SI	38.500	0	38.509						
Total						0740	9	0741	0	0743	229.646	0744	0	0745	229.654	0746	

	Situación actual 31/12/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 06/06/2006			
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,02	0748	0,13	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: 31/12/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2021								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2020							
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								
ES0312251012	B	0	0	0	9.302	0	0	39	9.302								
ES0312251020	C	0	0	26	10.246	0	0	104	10.190								
ES0312251004	A	18.177	770.354	0	141.540	17.190	733.982	27	141.540								
Total		0754	18.177	0755	770.354	0756	26	0757	161.088	1754	17.190	1755	733.982	1756	170	1757	161.032

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: 31/12/2021

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 31/12/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 06/06/2006
				0762	0763	0764
ES0312251004	A	12/12/2018	FCH	AAA	AAA	AA
ES0312251004	A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0312251012	B	15/07/2021	FCH	AA-	A+	A
ES0312251012	B	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	A2
ES0312251020	C	12/12/2018	FCH	BBB-	BBB-	BB
ES0312251020	C	26/04/2021	MDY	Baa2	Baa3	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: 31/12/2021

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 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		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	147.646	1767		2767	
Entre 3 y 4 años	0768	0	1768	184.018	2768	
Entre 4 y 5 años	0769		1769	0	2769	
Entre 5 y 10 años	0770	82.000	1770	82.000	2770	914.500
Superior a 10 años	0771		1771		2771	85.500
Total	0772	229.646	1772	266.018	2772	1.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	4,72	1773	5,46	2773	9,27

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 06/06/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	10.800	1775	11.439	2775	21.500
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	10.800	1776	11.439	2776	21.500
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	4,70	1777	4,30	2777	2
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778	Notas Explicativas	2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779	Notas Explicativas	2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780	Notas Explicativas	2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	0	1781	0	2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	0	1782	0	2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783	Notas Explicativas	2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784	Notas Explicativas	2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	0	1786	0	2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	0	1787	0	2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788	Notas Explicativas	2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789	Notas Explicativas	2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790	Notas Explicativas	2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	64,29	1792	69,18	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	

S.05.3

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

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 31/12/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	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)	-1.487	-3.052	-16.816	
Total							0808 -1.487	0809 -3.052	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: 31/12/2021

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 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 06/06/2006		Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		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			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

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 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	3.425	7006	2.179	7009	2,52	7012	2,25	7015	2,51		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	3.425	7008	2.179	7011	2,52	7014	2,25	7017	3.425.334	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	3.254	7024	2.077	7027	1,71	7030	1,45	7033	1,70		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	3.254	7026	2.077	7029	1,71	7032	1,45	7035	1,70	7036	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTAD O 4.9.2.b) (iv)

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto		
	Situación actual 31/12/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020			Última Fecha Pago
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2021

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

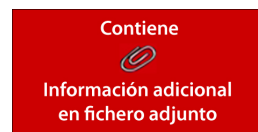
CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
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	2,34	2,36	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b) (iv)
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 de Depósito de Liquidez, éste no sea o se prevea que no va a ser igual al IMPORTE MÁXIMO DEL CRÉDITO SUBORDINADO	1	2,34	2,36	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b) (iv)
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera superior al porcentaje recogido del Saldo Vivo de los Activos que no tengan la consideración de Activos Fallidos	1	0,66	0,71	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL A LA NOTA DE VALORES. APARTADO 3.4.3.2
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



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: 31/12/2021

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	

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: 31/12/2021

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		
		31/03/2021	30/06/2021	30/09/2021	31/12/2021									
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872													
Margen de intereses	0873	97	241	-47	169									460
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	-61	-177	60	33									-146
Dotaciones a provisiones (neto)	0875		0		0									0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876		0											0
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-24	-23	-24	-45									-116
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	11	41	-11	157	0	0	0	0	0	0	0	0	198
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879													0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880	-11	-41		-14									-66
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881				-143									-143
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	0	0	11	0	0	0	0	0	0	0	0	0	11
Comisión variable pagada	0883		113		20									133
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: 31/12/2021

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: 31/12/2021

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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