

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: 31/12/2020

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
S03- Estados de flujos .Relclasificación imoportes 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: 31/12/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2020		Periodo anterior 31/12/2019
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	224.768	1001	256.084
I. Activos financieros a largo plazo	0002	224.768	1002	256.084
1. Activos titulizados	0003	224.768	1003	256.084
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	223.528	1005	255.215
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	3.606	1025	3.209
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-2.365	1027	-2.341
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	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	57.129	1041	66.520
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	33.502	1043	37.352
1. Activos titulizados	0044	33.502	1044	37.352
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	32.723	1046	36.652
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	71	1065	93
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	2	1066	3
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	2.033	1067	2.215
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	16	1068	17
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-1.344	1069	-1.628
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	23.627	1085	29.168
1. Tesorería	0086	23.627	1086	29.168
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	281.898	1088	322.604

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2020		Periodo anterior 31/12/2019
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	243.757	1089	278.748
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	243.757	1094	278.748
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	225.515	1095	256.743
1.1 Series no subordinadas	0096	143.515	1096	174.743
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	11.439	1101	13.017
2.1 Préstamo subordinado	0102	11.439	1102	13.017
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	2.813	1108	3.537
3.1 Derivados de cobertura	0109	2.813	1109	3.537
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	3.990	1112	5.450
4.1 Garantías financieras	0113	3.990	1113	5.450
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: 31/12/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) PASIVO CORRIENTE	0117	40.954	1117	47.394
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	40.785	1123	46.302
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	40.514	1124	46.010
1.1 Series no subordinadas	0125	40.503	1125	45.988
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	11	1128	22
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	32	1131	41
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	32	1136	41
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137		1137	
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	239	1139	250
3.1 Derivados de cobertura	0140	239	1140	250
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	168	1148	1.092
1. Comisiones	0149	147	1149	1.070
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	12	1150	15
1.2 Comisión administrador	0151	5	1151	6
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	184	1153	1.050
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-55	1155	
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	22	1157	22
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-2.813	1158	-3.537
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-2.813	1160	-3.537
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	281.898	1162	322.604

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2020

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2020		Acumulado anterior 31/12/2019
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	463	1201	796	2201	2.030	3201	2.682
1.1 Activos titulizados	0202	463	1202	796	2202	2.030	3202	2.682
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-82	1204	-91	2204	-435	3204	-417
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-34	1205	-34	2205	-218	3205	-171
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-48	1206	-57	2206	-217	3206	-246
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-387	1208	-287	2208	-545	3208	-888
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-5	1209	418	2209	1.049	3209	1.376
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	-47	1217	-1.046	2217	-1.364	3217	-1.666
7.1 Servicios exteriores	0218	-22	1218	-22	2218	-25	3218	-24
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	0	2219	-3	3219	-2
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	-22	3222	-22
7.2 Tributos	0223	-1	1223	-1	2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-24	1224	-1.023	2224	-1.337	3224	-1.640
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-17	1225	-20	2225	-73	3225	-82
7.3.2 Comisión administrador	0226	-7	1226	-8	2226	-29	3226	-33
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227	0	3227	0
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	-996	2228	-1.235	3228	-1.525
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-3	1231	628	2231	260	3231	289
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-3	1232	628	2232	260	3232	289
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	55	1239	0	2239	55	3239	
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

S.03

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2020

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2020		Acumulado anterior 31/12/2019
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-1.807	1300	-640	2300	-2.652	3300	-95
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	141	1301	178	2301	1.040	3301	1.455
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	467	1302	802	2302	2.053	3302	2.698
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-170	1303	-97	2303	-229	3303	-181
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	833	1304	782	2304	1.371	3304	1.518
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-870	1305	-1.184	2305	-1.928	3305	-2.326
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	-117	1307	-124	2307	-227	3307	-254
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-1.542	1309	-567	2309	-2.206	3309	-1.255
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-36	1310	-41	2310	-75	3310	-84
2.2 Comisión administrador	0311	-15	1311	-16	2311	-30	3311	-34
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	0
2.4 Comisión variable	0313	-751	1313	-510	2313	-2.101	3313	-1.137
2.5 Otras comisiones	0314	-739	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-407	1315	-251	2315	-1.486	3315	-295
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	-7	1320	-251	2320	-5.476	3320	-295
3.6 Otros cobros de explotación	0321	-400	1321	0	2321	3.990	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-7.949	1322	-7.886	2322	-2.889	3322	-1.510
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	-7.949	1325	-7.083	2325	-1.310	3325	201
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	5.135	1326	5.402	2326	20.954	3326	21.924
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	3.551	1327	5.257	2327	12.444	3327	15.544
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	556	1328	934	2328	2.005	3328	2.513
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	-17.190	1331	-18.676	2331	-36.712	3331	-39.780
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332	-803	2332	-1.579	3332	-1.711
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	-803	2334	-1.579	3334	-1.711
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	-9.756	1337	-8.526	2337	-5.540	3337	-1.605
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	33.384	1338	37.694	2338	29.168	3338	30.773
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	23.627	1339	29.168	2339	23.627	3339	29.168

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2020

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2020		Acumulado anterior 31/12/2019
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	394	1357	-111	2357	179	3357	-212
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	394	1358	-111	2358	179	3358	-212
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	387	1360	287	2360	545	3360	888
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-781	1362	-176	2362	-724	3362	-676
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: 31/12/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2020								Situación cierre anual anterior 31/12/2019								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	2,15	0401	0	0421	0	0441	4,54	1381	1,82	1401	0	1421	0	1441	4,97	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: 31/12/2020

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	76	0467	28	0474	2	0481	0	0488	30	0495	5.750	0502	1	0509	5.782
De 1 a 3 meses	0461	17	0468	14	0475	1	0482		0489	14	0496	1.345	0503	0	0510	1.360
De 3 a 6 meses	0462	11	0469	23	0476	0	0483	1	0490	24	0497	920	0504		0511	945
De 6 a 9 meses	0463	4	0470	12	0477	0	0484	0	0491	12	0498	204	0505		0512	216
De 9 a 12 meses	0464	4	0471	15	0478		0485	1	0492	16	0499	253	0506		0513	269
Más de 12 meses	0465	49	0472	1.983	0479	16	0486	128	0493	2.127	0500	2.229	0507		0514	4.355
Total	0466	161	0473	2.075	0480	19	0487	130	0494	2.223	0501	10.701	0508	2	1515	12.926

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	76	0522	28	0529	2	0536	0	0543	30	0550	5.750	0557	1	0564	5.782	0571	11.690	0578		0584	49,46
De 1 a 3 meses	0516	17	0523	14	0530	1	0537		0544	14	0551	1.345	0558	0	0565	1.360	0572	2.588	0579		0585	52,53
De 3 a 6 meses	0517	11	0524	23	0531	0	0538	1	0545	24	0552	920	0559		0566	945	0573	1.799	0580		0586	52,50
De 6 a 9 meses	0518	4	0525	12	0532	0	0539	0	0546	12	0553	204	0560		0567	216	0574	476	0581		0587	45,32
De 9 a 12 meses	0519	4	0526	15	0533		0540	1	0547	16	0554	253	0561		0568	269	0575	574	0582		0588	46,77
Más de 12 meses	0520	49	0527	1.983	0534	16	0541	128	0548	2.127	0555	2.229	0562		0569	4.355	0576	8.724	0583		0589	49,92
Total	0521	161	0528	2.075	0535	19	0542	130	0549	2.223	0556	10.701	0563	2	0570	12.926	0577	25.852			0590	50

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: 31/12/2020

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 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 06/06/2006	
Inferior a 1 año	0600	184	1600	178	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	428	1601	510	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	2.547	1602	877	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	3.694	1603	3.536	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	3.441	1604	4.867	2604	315
Entre 5 y 10 años	0605	33.227	1605	28.579	2605	250
Superior a 10 años	0606	218.370	1606	258.745	2606	999.435
Total	0607	261.889	1607	297.292	2607	1.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	12,60	1608	13,47	2608	26,79

Antigüedad	Situación actual 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 06/06/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	16,69	1609	15,72	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: 31/12/2020

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 31/12/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				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	1.773	0630	59.804	1620	1.614	1630	54.639	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	2.210	0631	184.462	1621	2.493	1631	211.178	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	131	0632	17.049	1622	247	1632	30.689	2622	1.686	2632	204.991
80% - 100%	0623	4	0633	575	1623	5	1633	787	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	4.118	0638	261.889	1628	4.359	1638	297.292	2628	7.404	2638	1.000.000
Media ponderada (%)	0639	45,87	0649		1639	48,83	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: 31/12/2020

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 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 06/06/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,62	1650	0,71	2650	3,28
Tipo de interés nominal máximo	0651	3,75	1651	3,75	2651	4,84
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,03	1652	0,04	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: 31/12/2020

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 31/12/2020			Situación cierre anual anterior 31/12/2019			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	8	0683 580	1660	8	1683 607	2660	44	2683 7.516
Aragón	0661	84	0684 6.588	1661	87	1684 7.322	2661	136	2684 20.708
Asturias	0662	2	0685 42	1662	2	1685 47	2662	5	2685 601
Baleares	0663	2	0686 83	1663	2	1686 109	2663	2	2686 236
Canarias	0664	1	0687 8	1664	1	1687 9	2664	2	2687 122
Cantabria	0665	333	0688 21.042	1665	353	1688 23.801	2665	621	2688 82.241
Castilla-León	0666	54	0689 2.377	1666	54	1689 2.575	2666	92	2689 8.256
Castilla La Mancha	0667	96	0690 8.300	1667	98	1690 9.073	2667	155	2690 23.652
Cataluña	0668	23	0691 1.466	1668	25	1691 1.846	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	869	0695 61.619	1672	907	1695 69.369	2672	1.534	2695 223.288
Melilla	0673		0696	1673		1696	2673	0	2696 0
Murcia	0674	1	0697 16	1674	1	1697 21	2674	2	2697 281
Navarra	0675	3	0698 360	1675	3	1698 376	2675	4	2698 802
La Rioja	0676	50	0699 3.845	1676	52	1699 4.211	2676	85	2699 12.224
Comunidad Valenciana	0677	121	0700 7.881	1677	126	1700 8.857	2677	215	2700 30.052
País Vasco	0678	2.471	0701 147.681	1678	2.640	1701 169.068	2678	4.466	2701 583.241
Total España	0679	4.118	0702 261.889	1679	4.359	1702 297.292	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	4.118	0705 261.889	1682	4.359	1705 297.292	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: 31/12/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 06/06/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,04			1710	0,97			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: 31/12/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2020			Situación cierre anual anterior 31/12/2019			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	20.046	184.018	9.180	24.045	220.730	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	266.018	1723	10.000	1724	302.730	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: 31/12/2020

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	184.018	0	184.018						
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	0,15	11	0	SI	38.500	0	38.511						
Total						0740	11	0741	0	0743	266.018	0744	0	0745	266.029	0746	

	Situación actual 31/12/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 06/06/2006			
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,13	0748	0,06	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: 31/12/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2020								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2019							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0312251004	A	17.190	733.982	27	141.540	18.676	697.270	0	141.513								
ES0312251012	B	0	0	39	9.302	0	0	15	9.263								
ES0312251020	C	0	0	104	10.190	0	0	82	10.027								
Total		0754	17.190	0755	733.982	0756	170	0757	161.032	1754	18.676	1755	697.270	1756	97	1757	160.803

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: 31/12/2020

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 31/12/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	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	12/12/2018	FCH	A+	A+	A
ES0312251012	B	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	A2
ES0312251020	C	12/12/2018	FCH	BBB-	BBB-	BB
ES0312251020	C	29/06/2018	MDY	Baa3	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: 31/12/2020

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 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 06/06/2006	
Inferior a 1 año	0765		1765	0	2765	
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766	
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767	
Entre 3 y 4 años	0768	184.018	1768	220.730	2768	
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769		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	266.018	1772	302.730	2772	1.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	5,46	1773	4,69	2773	9,27

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 06/06/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	11.439	1775	13.017	2775	21.500
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	11.439	1776	13.017	2776	21.500
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	4,30	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	69,18	1792	72,91	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: 31/12/2020

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 31/12/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	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)	-3.052	-3.788	-16.816				
Total							0808	-3.052	0809	-3.788	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: 31/12/2020

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 31/12/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 06/06/2006	Situación actual 31/12/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	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	

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2020

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 31/12/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación actual 31/12/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Última Fecha Pago							
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	2.179	7006	2.357	7009	2,25	7012	1,87	7015	2,23		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	2.179	7008	2.357	7011	2,25	7014	1,87	7017	2.178.615	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	2.077	7024	2.300	7027	1,45	7030	1,33	7033	1,41		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	2.077	7026	2.300	7029	1,45	7032	1,33	7035	1,41	7036	FOLLETO INFORMA TIVO. NOTA DE VALORES. APARTAD O 4.9.2.b) (iv)

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto				
	Situación actual 31/12/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	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: 31/12/2020

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
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	2,15	2,14	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	2,15	2,14	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	0,75	0,78	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: 31/12/2020

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	KUTXABANK	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: 31/12/2020

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		
		31/03/2020	30/06/2020	30/09/2020	31/12/2020									
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872													
Margen de intereses	0873	310	275	470	-5									1.049
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	78	97	87	-3									260
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	-28	-26	-27	-47									-128
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	359	345	530	-55	0	0	0	0	0	0	0	0	1.180
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879													0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880													0
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881	-359	-345	-530										-1.235
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	0	0	0	55	0	0	0	0	0	0	0	0	55
Comisión variable pagada	0883		1.349		751									2.101
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884													

Denominación Fondo: AyT Hipotecario BBK II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2020

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: 31/12/2020

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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