

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT ICO-FTVPO CAJA MURCIA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 9455
NIF Fondo: V85717593
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: 30/06/2018

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

S.01

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	42.409	1001	45.460
I. Activos financieros a largo plazo	0002	42.409	1002	45.460
1. Activos titulizados	0003	42.296	1003	45.337
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	42.190	1005	45.171
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	433	1025	514
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-326	1027	-348
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	113	1032	123
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035	113	1035	123
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 ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	16.196	1041	18.069
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	7.545	1043	8.282
1. Activos titulizados	0044	7.545	1044	8.282
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	7.441	1046	8.190
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	0	1059	0
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	72	1065	79
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	1	1066	1
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	125	1067	35
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	3	1068	3
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-96	1069	-26
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	5	1082	9
1. Comisiones	0083	5	1083	9
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	8.646	1085	9.778
1. Tesorería	0086	8.646	1086	9.778
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	58.605	1088	63.529

S.01

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	53.576	1089	55.504
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	53.576	1094	55.504
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	42.332	1095	45.354
1.1 Series no subordinadas	0096	31.291	1096	33.526
1.2 Series subordinadas	0097	11.040	1097	11.828
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	7.155	1101	7.763
2.1 Préstamo subordinado	0102	7.155	1102	7.763
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	4.089	1108	2.387
3.1 Derivados de cobertura	0109	4.089	1109	2.387
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	
4.1 Garantías financieras	0113		1113	
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 ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) PASIVO CORRIENTE	0117	9.118	1117	10.412
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	8.974	1123	10.312
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	8.791	1124	10.107
1.1 Series no subordinadas	0125	6.489	1125	7.460
1.2 Series subordinadas	0126	2.289	1126	2.632
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	13	1128	14
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	172	1131	116
2.1 Préstamo subordinado	0132	148	1132	90
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	25	1136	26
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137		1137	
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	11	1139	89
3.1 Derivados de cobertura	0140	11	1140	89
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	1
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	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	144	1148	100
1. Comisiones	0149	130	1149	80
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	4	1150	4
1.2 Comisión administrador	0151	7	1151	4
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	228	1153	228
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-108	1155	-156
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	14	1157	20
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-4.089	1158	-2.387
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-4.089	1160	-2.387
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	58.605	1162	63.529

S.02

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2018		Acumulado anterior 30/06/2017
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	217	1201	267	2201	443	3201	559
1.1 Activos titulizados	0202	217	1202	267	2202	443	3202	559
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-52	1204	-57	2204	-104	3204	-121
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-20	1205	-22	2205	-40	3205	-48
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-32	1206	-36	2206	-64	3206	-73
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-63	1208	-380	2208	-204	3208	-372
A) MARGEN DE INTERESES	0209	103	1209	-170	2209	136	3209	67
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	-18	1217	178	2217	-38	3217	-55
7.1 Servicios exteriores	0218	-6	1218	-6	2218	-12	3218	-11
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	-1	2219	-2	3219	-1
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	-5	1220	-5	2220	-9	3220	-9
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	-1	2222	-1	3222	-1
7.2 Tributos	0223	0	1223	-1	2223	0	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-13	1224	185	2224	-27	3224	-43
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-7	1225	-8	2225	-14	3225	-17
7.3.2 Comisión administrador	0226	-1	1226	-2	2226	-3	3226	-3
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227		3227	0
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	200	2228		3228	-13
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	-4	1230	-5	2230	-10	3230	-10
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	0	1231	-133	2231	-49	3231	-47
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	-133	2232	-49	3232	-47
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	-85	1239	125	2239	-48	3239	35
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 ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2018		Acumulado anterior 30/06/2017
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	21	1300	-100	2300	-57	3300	-154
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	32	1301	28	2301	-28	3301	70
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	222	1302	279	2302	450	3302	576
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-20	1303	-23	2303	-41	3303	-51
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	87	1304	99	2304	177	3304	211
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-225	1305	-291	2305	-460	3305	-590
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	-32	1307	-36	2307	-155	3307	-76
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-10	1309	-119	2309	-20	3309	-208
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-5	1310	-6	2310	-11	3310	-12
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	-2	2311	0	3311	-49
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	0
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	-107	2313	0	3313	-138
2.5 Otras comisiones	0314	-5	1314	-4	2314	-9	3314	-9
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-1	1315	-10	2315	-9	3315	-16
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	-1	1320	-10	2320	-9	3320	-20
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	5
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-212	1322	-443	2322	-1.075	3322	-487
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	19	1325	-114	2325	-615	3325	177
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	0	1326	1.238	2326	1.204	3326	2.473
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	504	1327	816	2327	926	3327	1.801
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.396	1328	180	2328	1.592	3328	409
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	-1.881	1331	-2.348	2331	-4.337	3331	-4.505
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-231	1332	-329	2332	-459	3332	-664
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	-231	1334	-329	2334	-459	3334	-664
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	-191	1337	-543	2337	-1.132	3337	-641
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	8.837	1338	10.740	2338	9.778	3338	10.838
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	8.646	1339	10.197	2339	8.646	3339	10.197

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2018		Acumulado anterior 30/06/2017
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	-2.437	1357	-511	2357	-1.906	3357	277
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-2.437	1358	-511	2358	-1.906	3358	277
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	63	1360	380	2360	204	3360	372
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	2.374	1362	132	2362	1.702	3362	-649
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

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2018								Situación cierre anual anterior 31/12/2017								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	1,11	0401	0	0421	0	0441	5,02	1381	1,02	1401	0	1421	0	1441	6,14	2381	1,83	2401	0,06	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 ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	2	0467	0	0474	0	0481		0488	0	0495	72	0502	0	0509	73
De 1 a 3 meses	0461	9	0468	5	0475	1	0482		0489	5	0496	226	0503	0	0510	232
De 3 a 6 meses	0462	1	0469	1	0476	0	0483	0	0490	1	0497	36	0504		0511	36
De 6 a 9 meses	0463		0470		0477		0484		0491		0498		0505		0512	
De 9 a 12 meses	0464		0471		0478		0485		0492		0499		0506		0513	
Más de 12 meses	0465	12	0472	124	0479	3	0486	28	0493	155	0500	397	0507		0514	552
Total	0466	24	0473	130	0480	3	0487	29	0494	162	0501	731	0508	0	1515	893

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	2	0522	0	0529	0	0536		0543	0	0550	72	0557	0	0564	73	0571	189	0578	189	0584	38,56
De 1 a 3 meses	0516	9	0523	5	0530	1	0537		0544	5	0551	226	0558	0	0565	232	0572	836	0579	836	0585	27,73
De 3 a 6 meses	0517	1	0524	1	0531	0	0538	0	0545	1	0552	36	0559		0566	36	0573	75	0580	75	0586	48,81
De 6 a 9 meses	0518		0525		0532		0539		0546		0553		0560		0567		0574		0581		0587	
De 9 a 12 meses	0519		0526		0533		0540		0547		0554		0561		0568		0575		0582		0588	
Más de 12 meses	0520	12	0527	124	0534	3	0541	28	0548	155	0555	397	0562		0569	552	0576	1.352	0583	1.352	0589	40,84
Total	0521	24	0528	130	0535	3	0542	29	0549	162	0556	731	0563	0	0570	893	0577	2.452			0590	36,44

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 25/06/2009	
Inferior a 1 año	0600		1600		2600	0
Entre 1 y 2 años	0601		1601		2601	0
Entre 2 y 3 años	0602		1602		2602	0
Entre 3 y 4 años	0603		1603		2603	
Entre 4 y 5 años	0604	56	1604		2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	43.260	1605	46.795	2605	0
Superior a 10 años	0606	6.872	1606	7.115	2606	138.000
Total	0607	50.188	1607	53.910	2607	138.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	8,65	1608	9,11	2608	17,42

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 25/06/2009	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	12,08	1609	11,59	2609	3,16

S.05.1
Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 25/06/2009			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.253	0630	36.791	1620	1.077	1630	32.020	2620	103	2630	4.533
40% - 60%	0621	324	0631	13.397	1621	532	1631	21.890	2621	264	2631	13.182
60% - 80%	0622		0632		1622		1632		2622	1.882	2632	120.285
80% - 100%	0623		0633		1623		1633		2623	0	2633	0
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	1.577	0638	50.188	1628	1.609	1638	53.910	2628	2.249	2638	138.000
Media ponderada (%)	0639	36,30	0649		1639	38,19	1649		2639	67,56	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 25/06/2009	
Tipo de interés medio ponderado	0650	1,67	1650	1,75	2650	3,70
Tipo de interés nominal máximo	0651	1,85	1651	2,93	2651	3,94
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,73	1652	1,73	2652	3,68

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 25/06/2009			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	2	0683	41	1660	2	1683	44	2660	2	2683	92
Aragón	0661		0684		1661		1684		2661	0	2684	0
Asturias	0662		0685		1662		1685		2662	0	2685	0
Baleares	0663		0686		1663		1686		2663	0	2686	0
Canarias	0664		0687		1664		1687		2664	0	2687	0
Cantabria	0665		0688		1665		1688		2665	0	2688	0
Castilla-León	0666		0689		1666		1689		2666	0	2689	0
Castilla La Mancha	0667		0690		1667		1690		2667	268	2690	16.710
Cataluña	0668		0691		1668		1691		2668	0	2691	0
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		0695		1672		1695		2672	0	2695	0
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	1.033	0697	33.288	1674	1.050	1697	35.703	2674	1.307	2697	80.572
Navarra	0675		0698		1675		1698		2675	0	2698	0
La Rioja	0676		0699		1676		1699		2676	0	2699	0
Comunidad Valenciana	0677	542	0700	16.859	1677	557	1700	18.162	2677	672	2700	40.626
País Vasco	0678		0701		1678		1701		2678	0	2701	0
Total España	0679	1.577	0702	50.188	1679	1.609	1702	53.910	2679	2.249	2702	138.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	1.577	0705	50.188	1682	1.609	1705	53.910	2682	2.249	2705	138.000

S.05.1
Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 25/06/2009			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,25			1710	1,19			2710	0,67		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2018			Situación cierre anual anterior 31/12/2017			Situación inicial 25/06/2009					
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			
ES0312287008	A(G)	1.200	31.483	37.780	1.200	34.155	40.986	1.200	100.000	120.000			
ES0312287016	B	110	74.062	8.147	110	80.347	8.838	110	100.000	11.000			
ES0312287024	C	70	74.036	5.182	70	80.318	5.622	70	100.000	7.000			
Total		0723	1.380	0724	51.109	1723	1.380	1724	55.446	2723	1.380	2724	138.000

S.05.2

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2018

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		
ES0312287008	A(G)	NS	EURIBOR 3 MESES	0,35	0,02	1	0	SI	37.780	0	37.782			
ES0312287016	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,75	0,42	6	0	SI	8.147	0	8.153			
ES0312287024	C	S	EURIBOR 3 MESES	1	0,67	6	0	SI	5.182	0	5.188			
Total						0740	13	0741	0743	51.109	0744	0745	51.123	0746

	Situación actual 30/06/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 25/06/2009
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,15	0748
			0,15
			0749
			1,60

S.05.2

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2018								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2017							
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								
ES0312287008	A(G)	1.390	82.220	2	6.361	1.736	75.708	2	6.352								
ES0312287016	B	300	2.853	9	1.084	374	1.449	10	1.045								
ES0312287024	C	191	1.818	9	842	238	924	10	803								
Total		0754	1.881	0755	86.891	0756	20	0757	8.287	1754	2.348	1755	78.081	1756	23	1757	8.201

S.05.2

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2018

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 30/06/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 25/06/2009
				0762	0763	0764
ES0312287008	A(G)	27/06/2014	FCH	AA+	AA+	AAA
ES0312287008	A(G)	29/06/2009	SYP	AAA	BBB	AAA
ES0312287016	B	27/06/2014	FCH	AA+	AA+	AA
ES0312287016	B	29/06/2009	SYP	AA+	BBB	AA+
ES0312287024	C	31/03/2016	FCH	A-	A-	A-
ES0312287024	C	29/06/2009	SYP	A	BBB	A

S.05.2

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2018

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 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 25/06/2009
Inferior a 1 año	0765	0	1765		2765
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767
Entre 3 y 4 años	0768	51.109	1768		2768
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769	55.446	2769
Entre 5 y 10 años	0770		1770		2770
Superior a 10 años	0771		1771		2771
Total	0772	51.109	1772	55.446	2772
Vida residual media ponderada (años)	0773	3,07	1773	4,27	2773
					120.000
					18.000
					138.000
					8,62

S.05.3

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 25/06/2009	
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	7.155	1775	7.763	2775	9.660
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	7.155	1776	7.763	2776	9.660
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	14	1777	14	2777	7
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	12.000	1781	12.000	2781	12.000
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	23,48	1782	21,64	2782	8,70
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	37.780	1786	40.986	2786	120.000
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	73,92	1787	73,92	2787	86,96
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	73,92	1792	73,92	2792	86,94
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 ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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 30/06/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 25/06/2009	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Permuta 1	CECABANK S.A.	TRIMESTRAL	La suma de los intereses devengados, vencidos e ingresados al Fondo durante el Periodo de Liquidación que vence de los Activos, disminuida en el importe de los Intereses Corridos que, en su caso, hubiere pagado el Fondo durante el mismo Periodo de Liquidación entre 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 Interes de Referencia de los Bonos mas el margen medio ponderado de los bonos mas un margen de 0.50%.En el supuesto de imposibilidad de obtención de la referencia de liquidación, será de aplicación el tipo de interés de referencia sustitutivo.	eE 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)	-4.100	-2.476	-3.029	
Total							0808 -4.100	0809 -2.476	0810 -3.029	

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 25/06/2009		Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 25/06/2009			
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 ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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 30/06/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación actual 30/06/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Última Fecha Pago							
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	156	7006	48	7009	1,11	7012	1,02	7015	1,32		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	156	7008	48	7011	1,11	7014	1,02	7017	156.124	7018	FOLLETO INFORMA TIVO. GLOSARIO DE DEFINICIO NES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	146	7024	40	7027	0,84	7030	0,69	7033	0,82		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	146	7026	40	7029	0,84	7032	0,69	7035	0,82	7036	FOLLETO INFORMA TIVO. NOTA DE VALORES. APARTAD O 4.9.2.b (iv)

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Última Fecha Pago		
	0850	1850	2850	3850	
	0851	1851	2851	3851	
	0852	1852	2852	3852	
	0853	1853	2853	3853	

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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
SUPUESTOS DE AMORTIZACIÓN SECUENCIAL: c) En caso de que el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) es superior al % establecido en el cuadro de triggers	1,25	1,33	1,33	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)
SUPUESTOS DE AMORTIZACIÓN SECUENCIAL: c) En caso de que el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) es superior al % establecido en el cuadro de triggers	1	0,51	0,51	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2 b
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Saldo Vivo de los Activos Fallidos acumulados represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del valor nominal de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo.	15	0,55	0,52	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6.1.B
Saldo Vivo de los Activos Fallidos acumulados represente un porcentaje superior al recogido para cada ISIN del valor nominal de los Activos en la Fecha de Constitución del Fondo.	10	0,55	0,52	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6.1.B
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
Folleto informativo	0,80	0,51	0,51	Folleto Informativo
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

S.05.5

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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	11	2862	Días del mes /Días año	3862	0,020	4862	0	5862	0	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	Caja de Ahorros de Murcia	1863	0	2863	Días del mes /Días año	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Trimestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BANCO SANTANDER, S.A.	1864	0	2864		3864	0	4864	0	5864	0	6864	Trimestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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	Banco Mare Nostrum
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo adicional 3.4.6.4

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo											Total	
		31/03/2018	30/06/2018											
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872													
Margen de intereses	0873	33	103											136
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	-49	0											-49
Dotaciones a provisiones (neto)	0875	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	-20	-18											-38
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	-37	85	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	48
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879	0												0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880	0	-85											-85
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881	0												0
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	37	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	37
Comisión variable pagada	0883	0												0
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884	0												0

S.05.5

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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 ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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