

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT ICO-FTVPO I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 9339
NIF Fondo: V85600757
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: 30/09/2017

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	100.950	1001	115.338
I. Activos financieros a largo plazo	0002	100.950	1002	115.338
1. Activos titulizados	0003	100.655	1003	114.995
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	100.313	1005	113.880
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	1.144	1025	1.779
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-802	1027	-664
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	295	1032	343
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035	295	1035	343
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 ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	34.880	1041	36.767
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	77	1042	77
V. Activos financieros a corto plazo	0043	17.515	1043	18.350
1. Activos titulizados	0044	17.515	1044	18.350
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	17.357	1046	18.057
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	82	1065	105
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	12	1066	12
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	206	1067	272
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	8	1068	9
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-150	1069	-105
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078		1078	
3.5 Otros	0079		1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	8	1082	8
1. Comisiones	0083	8	1083	8
2. Otros	0084		1084	
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	17.280	1085	18.333
1. Tesorería	0086	17.280	1086	18.333
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	135.830	1088	152.105

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	114.137	1089	130.319
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	114.137	1094	130.319
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	100.804	1095	115.241
1.1 Series no subordinadas	0096	76.904	1096	91.341
1.2 Series subordinadas	0097	23.900	1097	23.900
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	8.190	1101	8.578
2.1 Préstamo subordinado	0102	11.768	1102	11.768
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	-3.578	1105	-3.190
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	4.079	1108	5.310
3.1 Derivados de cobertura	0109	4.079	1109	5.310
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	1.064	1112	1.189
4.1 Garantías financieras	0113	1.064	1113	1.189
4.1 Otros	0114		1114	
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
B) PASIVO CORRIENTE	0117	25.772	1117	27.097
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	25.755	1123	27.069
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	21.563	1124	22.957
1.1 Series no subordinadas	0125	21.533	1125	22.921
1.2 Series subordinadas	0126		1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	30	1128	36
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	3.838	1131	3.667
2.1 Préstamo subordinado	0132	1.541	1132	1.541
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	55	1136	55
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	2.242	1137	2.070
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	342	1139	431
3.1 Derivados de cobertura	0140	342	1140	431
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	12	1143	14
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	12	1144	14
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	17	1148	28
1. Comisiones	0149	8	1149	8
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	8	1150	8
1.2 Comisión administrador	0151	154	1151	145
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152		1152	0
1.4 Comisión variable	0153		1153	
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-154	1155	-145
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	10	1157	20
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-4.079	1158	-5.310
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-4.079	1160	-5.310
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	135.830	1162	152.105

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2017		Acumulado anterior 30/09/2016
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	460	1201	909	2201	1.509	3201	2.310
1.1 Activos titulizados	0202	460	1202	909	2202	1.509	3202	2.310
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203		3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-96	1204	-116	2204	-288	3204	-441
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-38	1205	-57	2205	-117	3205	-257
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-58	1206	-59	2206	-171	3206	-184
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-390	1208	-504	2208	-1.300	3208	-1.657
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-27	1209	289	2209	-79	3209	212
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210		3210	0
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	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213		3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214		3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215		3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-45	1217	-39	2217	-136	3217	-167
7.1 Servicios exteriores	0218	-12	1218	-6	2218	-36	3218	-56
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219	-1	2219	-1	3219	-16
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	-12	1220	-12	2220	-34	3220	-35
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	7	2222	-1	3222	-5
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-33	1224	-33	2224	-99	3224	-110
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-12	1225	-13	2225	-37	3225	-40
7.3.2 Comisión administrador	0226	-3	1226	-3	2226	-10	3226	-11
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227		3227	-1
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228		3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-18	1230	-17	2230	-53	3230	-58
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-126	1231	-39	2231	-183	3231	-27
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-126	1232	-39	2232	-183	3232	-27
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233		3233	0
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	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	198	1239	-211	2239	398	3239	-18
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241		3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2017		Acumulado anterior 30/09/2016
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-113	1300	-656	2300	-195	3300	-1.485
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-48	1301	42	2301	20	3301	-94
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	449	1302	640	2302	1.532	3302	2.029
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-38	1303	-70	2303	-123	3303	-341
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	72	1304	106	2304	222	3304	451
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-531	1305	-634	2305	-1.611	3305	-2.233
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	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-24	1309	-23	2309	-67	3309	-70
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-12	1310	-11	2310	-33	3310	-34
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	-1
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	-11	1314	-12	2314	-35	3314	-35
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-42	1315	-675	2315	-148	3315	-1.321
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	
3.5 Otros pagos de explotación	0320	75	1320	-675	2320	-31	3320	-1.321
3.6 Otros cobros de explotación	0321	-117	1321	0	2321	-117	3321	
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-513	1322	-145	2322	-858	3322	-1.708
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	-513	1325	-145	2325	-858	3325	-1.708
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	2.228	1326	2.470	2326	6.689	3326	7.439
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.408	1327	1.566	2327	4.494	3327	4.703
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.197	1328	1.265	2328	3.786	3328	3.912
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	-5.347	1331	-5.446	2331	-15.826	3331	-17.762
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	0	1332	0	2332	0	3332	0
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
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	-626	1337	-801	2337	-1.052	3337	-3.193
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	17.907	1338	18.869	2338	18.333	3338	21.261
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	17.280	1339	18.068	2339	17.280	3339	18.068

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2017		Acumulado anterior 30/09/2016
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350		3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351		3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352		3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353		3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354		3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355		3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356		3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	28	1357	-3.092	2357	-69	3357	-4.755
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	28	1358	-3.092	2358	-69	3358	-4.755
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	390	1360	504	2360	1.300	3360	1.657
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-418	1362	2.588	2362	-1.231	3362	3.098
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	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365		3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366		3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367		3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368		3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369		3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A. | G46002796 CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2017								Situación cierre anual anterior 31/12/2016								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	1,13	0401	0,13	0421	0	0441	5,03	1381	1,53	1401	0,12	1421	0	1441	4,64	2381	3,13	2401	0,50	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	
Prestamos 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	

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A. | G46002796 CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT

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	237	0467	73	0474	10	0481		0488	83	0495	8.925	0502	6	0509	9.015
De 1 a 3 meses	0461	24	0468	13	0475	2	0482		0489	15	0496	717	0503	0	0510	732
De 3 a 6 meses	0462	3	0469	3	0476	0	0483	0	0490	4	0497	135	0504		0511	138
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	2	0477	0	0484	0	0491	2	0498	14	0505		0512	16
De 9 a 12 meses	0464	3	0471	4	0478	0	0485	1	0492	5	0499	70	0506		0513	75
Más de 12 meses	0465	26	0472	197	0479	7	0486	42	0493	246	0500	925	0507		0514	1.171
Total	0466	294	0473	292	0480	19	0487	43	0494	354	0501	10.785	0508	7	1515	11.147

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	237	0522	73	0529	10	0536		0543	83	0550	8.925	0557	6	0564	9.015	0571	23.792	0578	23.792	0584	37,89
De 1 a 3 meses	0516	24	0523	13	0530	2	0537		0544	15	0551	717	0558	0	0565	732	0572	2.012	0579	2.012	0585	36,38
De 3 a 6 meses	0517	3	0524	3	0531	0	0538	0	0545	4	0552	135	0559		0566	138	0573	373	0580	373	0586	37,13
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	2	0532	0	0539	0	0546	2	0553	14	0560		0567	16	0574	56	0581	56	0587	27,87
De 9 a 12 meses	0519	3	0526	4	0533	0	0540	1	0547	5	0554	70	0561		0568	75	0575	209	0582	209	0588	35,78
Más de 12 meses	0520	26	0527	197	0534	7	0541	42	0548	246	0555	925	0562		0569	1.171	0576	2.477	0583	2.477	0589	47,28
Total	0521	294	0528	292	0535	19	0542	43	0549	354	0556	10.785	0563	7	0570	11.147	0577	28.919			0590	38,54

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A. | G46002796 CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 12/03/2009	
Inferior a 1 año	0600	335	1600	431	2600	1.722
Entre 1 y 2 años	0601	783	1601	946	2601	71
Entre 2 y 3 años	0602	1.594	1602	1.195	2602	101
Entre 3 y 4 años	0603	2.517	1603	2.753	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	5.404	1604	2.798	2604	2.596
Entre 5 y 10 años	0605	70.125	1605	73.472	2605	36.064
Superior a 10 años	0606	38.262	1606	52.393	2606	286.347
Total	0607	119.020	1607	133.988	2607	326.901
Vida residual media ponderada (años)	0608	11,06	1608	11,48	2608	17,29

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 12/03/2009	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	12,37	1609	11,69	2609	4,54

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A. | G46002796 CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 12/03/2009			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	2.964	0630	68.964	1620	2.655	1630	57.180	2620	600	2630	10.898
40% - 60%	0621	902	0631	42.362	1621	1.487	1631	66.367	2621	1.354	2631	48.395
60% - 80%	0622	75	0632	7.334	1622	104	1632	10.067	2622	3.486	2632	203.771
80% - 100%	0623	1	0633	282	1623	1	1633	290	2623	638	2633	63.837
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	2	0637	79	1627	2	1637	85	2627	0	2637	0
Total	0628	3.944	0638	119.020	1628	4.249	1638	133.988	2628	6.078	2638	326.901
Media ponderada (%)	0639	40,60	0649		1639	42,47	1649		2639	69,99	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A. | G46002796 CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 12/03/2009	
Tipo de interés medio ponderado	0650	1,56	1650	1,33	2650	5
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,04	1651	4,87	2651	6,84
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,12	1652	0,18	2652	2,76

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | A08663619 CAIXABANK, S.A. | A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A. | G46002796 CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 12/03/2009			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	1.253	0683	32.172	1660	1.321	1683	36.699	2660	1.598	2683	79.971
Aragón	0661		0684		1661		1684		2661	1	2684	189
Asturias	0662	1	0685	28	1662	1	1685	35	2662	1	2685	75
Baleares	0663		0686		1663		1686		2663	1	2686	17
Canarias	0664	1	0687	13	1664	1	1687	20	2664	2	2687	443
Cantabria	0665		0688		1665		1688		2665	0	2688	0
Castilla-León	0666	1	0689	36	1666	2	1689	82	2666	3	2689	488
Castilla La Mancha	0667		0690		1667		1690		2667	0	2690	0
Cataluña	0668	7	0691	232	1668	8	1691	263	2668	15	2691	1.269
Ceuta	0669		0692		1669		1692		2669	0	2692	0
Extremadura	0670		0693		1670		1693		2670	0	2693	0
Galicia	0671	888	0694	31.983	1671	910	1694	35.712	2671	1.011	2694	73.933
Madrid	0672	1	0695	204	1672	1	1695	215	2672	4	2695	658
Melilla	0673		0696		1673		1696		2673	0	2696	0
Murcia	0674	1	0697	38	1674	1	1697	41	2674	1	2697	71
Navarra	0675	1.006	0698	35.219	1675	1.156	1698	39.270	2675	1.943	2698	114.478
La Rioja	0676		0699		1676		1699		2676	0	2699	0
Comunidad Valenciana	0677	783	0700	18.962	1677	846	1700	21.510	2677	1.494	2700	54.313
País Vasco	0678	2	0701	133	1678	2	1701	142	2678	4	2701	996
Total España	0679	3.944	0702	119.020	1679	4.249	1702	133.988	2679	6.078	2702	326.901
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681		1704		2681	0	2704	0
Total general	0682	3.944	0705	119.020	1682	4.249	1705	133.988	2682	6.078	2705	326.901

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A. | A086663619 CAIXABANK, S.A. | A70302039 ABANCA CORPORACION BANCARIA, S.A. | G46002796 CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 12/03/2009			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	2,03			1710	1,93			2710	1,12		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2017			Situación cierre anual anterior 31/12/2016			Situación inicial 12/03/2009					
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			
ES0312305016	B	229	50.000	11.450	229	50.000	11.450	229	50.000	11.450			
ES0312305024	C	249	50.000	12.450	249	50.000	12.450	249	50.000	12.450			
ES0312305008	A(G)	6.060	16.244	98.436	6.060	18.855	114.262	6.060	50.000	303.000			
Total		0723	6.538	0724	122.336	1723	6.538	1724	138.162	2723	6.538	2724	326.900

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado				
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739		
ES0312305016	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,75	0,42	10	0	SI	11.450	0	11.460			
ES0312305024	C	S	EURIBOR 3 MESES	1	0,67	17	0	SI	12.450	0	12.467			
ES0312305008	A(G)	NS	EURIBOR 3 MESES	0,35	0,02	4	0	SI	98.436	0	98.440			
Total						0740	30	0741	0743	122.336	0744	0745	122.366	0746

	Situación actual 30/09/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 12/03/2009			
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,12	0748	0,15	0749	2,08

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2017								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2016							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0312305008	A(G)	5.347	204.564	5	16.261	5.446	183.618	32	16.221								
ES0312305016	B	0	0	12	1.176	0	0	24	1.126								
ES0312305024	C	0	0	21	1.542	0	0	14	1.455								
Total		0754	5.347	0755	204.564	0756	38	0757	18.979	1754	5.446	1755	183.618	1756	70	1757	18.802

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/09/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 12/03/2009
				0762	0763	0764
ES0312305008	A(G)	23/01/2015	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0312305016	B	31/03/2017	FCH	A+	A	A
ES0312305016	B	14/05/2016	MDY	Aa2	Aa2	Aa1
ES0312305024	C	31/03/2017	FCH	A-	BBB-	BBB-
ES0312305024	C	23/05/2017	MDY	A3	Baa3	Baa3
ES0312305008	A(G)	27/06/2014	FCH	AA+	AA+	AAA

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente				
	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 12/03/2009
Inferior a 1 año	0765		1765		2765
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766
Entre 2 y 3 años	0767		1767		2767
Entre 3 y 4 años	0768	98.436	1768	114.262	2768
Entre 4 y 5 años	0769		1769	0	2769
Entre 5 y 10 años	0770	23.900	1770	23.900	2770
Superior a 10 años	0771		1771		2771
Total	0772	122.336	1772	138.162	2772
Vida residual media ponderada (años)	0773	4,47	1773	3,91	2773
					7,25

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 12/03/2009	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	11.768	1775	11.768	2775	11.768
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	11.768	1776	11.649	2776	11.768
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	9,62	1777	8	2777	3
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Notas Explicativas	1778		2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779	Notas Explicativas	1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780	Notas Explicativas	1780		2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	30.300	1781	30.300	2781	30.300
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	24,77	1782	21,93	2782	9,27
2.2 Denominación de la contrapartida	0783	Notas Explicativas	1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784	Notas Explicativas	1784		2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	98.436	1786	114.262	2786	303.000
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	80,46	1787	82,70	2787	92,69
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	Notas Explicativas	1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789	Notas Explicativas	1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790	Notas Explicativas	1790		2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	80,46	1792	82,70	2792	92,69
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/09/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 12/03/2009	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Permuta 1	CECABANK	Trimestral	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	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 Euribor, tal y como se define en el apartado 4.8 de la Nota de Valores, más el margen medio de los Bonos más un margen de diez (10) puntos básicos (0,10%). En el supuesto de imposibilidad de obtención de la referencia de liquidación, será de aplicación el tipo de interés de referencia sustitutivo.	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)	-4.421	-5.741	10.155	
Total							0808 -4.421	0809 -5.741	0810 10.155	

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)			Valor en libros (miles de euros)			Otras características	
	Situación actual 30/09/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 12/03/2009	Situación actual 30/09/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 12/03/2009		
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	

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	257	7006	485	7009	1,25	7012	1,65	7015	1,36		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	257	7008	485	7011	1,25	7014	1,65	7017	256.628	7018	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	230	7024	437	7027	0,87	7030	0,69	7033	0,81		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	230	7026	437	7029	0,87	7032	0,69	7035	0,81	7036	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

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
c)	1,25	0,51	0,35	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)
C)	1	0,51	0,35	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)
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	0,75	0,75	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	0,75	0,75	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6.1.B
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
a) Cuando el Saldo Vivo de los Activos en morosidad con más de noventa (90) días de retraso en el pago de importes vencidos, fuera superior al porcentaje recogido del Saldo Vivo de los Activos que no tengan la consideración de Activos Fallidos	1	1,45	1,24	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.1
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	1862	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 Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT	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	1864	0	2864		3864		4864		5864		6864		7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

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 , Caixa Ontinyent , Caixaabank , Abanca
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		
		31/03/2017	30/06/2017	30/09/2017											
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872														
Margen de intereses	0873	-27	-25	-26											-78
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	4	-61	-126											-183
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	-46	-45	-46											-136
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	-69	-131	-198	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-398
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879	0													0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880	0													0
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881	0													0
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	69	131	198	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	398
Comisión variable pagada	0883	0													0
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884	0													0

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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