

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: 30/09/2018

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: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	40.575	1001	45.460
I. Activos financieros a largo plazo	0002	40.575	1002	45.460
1. Activos titulizados	0003	40.466	1003	45.337
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	40.281	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	517	1025	514
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-332	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	109	1032	123
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035	109	1035	123
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignoralos 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: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	15.725	1041	18.069
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	7.403	1043	8.282
1. Activos titulizados	0044	7.395	1044	8.282
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	7.274	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	69	1065	79
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	0	1066	1
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	139	1067	35
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	3	1068	3
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-91	1069	-26
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071	2	1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072	2	1072	
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074	6	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	6	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	11	1082	9
1. Comisiones	0083	11	1083	9
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	8.311	1085	9.778
1. Tesorería	0086	8.311	1086	9.778
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	56.300	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: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	51.517	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	51.517	1094	55.504
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	40.519	1095	45.354
1.1 Series no subordinadas	0096	29.952	1096	33.526
1.2 Series subordinadas	0097	10.567	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	6.873	1101	7.763
2.1 Préstamo subordinado	0102	6.873	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	4.124	1108	2.387
3.1 Derivados de cobertura	0109	4.124	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: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) PASIVO CORRIENTE	0117	8.908	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	8.744	1123	10.312
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	8.588	1124	10.107
1.1 Series no subordinadas	0125	6.338	1125	7.460
1.2 Series subordinadas	0126	2.236	1126	2.632
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	14	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	156	1131	116
2.1 Préstamo subordinado	0132	132	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	24	1136	26
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137		1137	
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139		1139	89
3.1 Derivados de cobertura	0140		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	164	1148	100
1. Comisiones	0149	150	1149	80
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	4	1150	4
1.2 Comisión administrador	0151	8	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	-89	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	-4.124	1158	-2.387
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-4.124	1160	-2.387
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	56.300	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: 30/09/2018

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2018		Acumulado anterior 30/09/2017
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	212	1201	245	2201	655	3201	804
1.1 Activos titulizados	0202	212	1202	245	2202	655	3202	804
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-50	1204	-57	2204	-154	3204	-178
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-20	1205	-22	2205	-60	3205	-70
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-30	1206	-35	2206	-94	3206	-108
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-124	1208	-152	2208	-328	3208	-524
A) MARGEN DE INTERESES	0209	38	1209	35	2209	173	3209	102
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	-19	1217	-18	2217	-57	3217	-72
7.1 Servicios exteriores	0218	-5	1218	-5	2218	-17	3218	-16
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	-1	2219	-3	3219	-2
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	-5	1220	-5	2220	-14	3220	-14
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	-1	3222	-1
7.2 Tributos	0223	-1	1223	0	2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-13	1224	-12	2224	-39	3224	-55
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-7	1225	-6	2225	-21	3225	-23
7.3.2 Comisión administrador	0226	-1	1226	-1	2226	-4	3226	-5
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	0	2227		3227	0
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	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	-14	3230	-15
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	0	1231	0	2231	-49	3231	-47
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	0	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	-19	1239	-17	2239	-67	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	
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: 30/09/2018

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2018		Acumulado anterior 30/09/2017
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	2	1300	2	2300	-55	3300	-152
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	27	1301	18	2301	-1	3301	88
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	215	1302	248	2302	665	3302	824
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-20	1303	-23	2303	-61	3303	-74
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	84	1304	98	2304	261	3304	309
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-221	1305	-270	2305	-681	3305	-860
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	-31	1307	-35	2307	-186	3307	-111
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	-10	2309	-30	3309	-218
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-5	1310	-6	2310	-16	3310	-18
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	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	0	2313	0	3313	-138
2.5 Otras comisiones	0314	-5	1314	-5	2314	-14	3314	-14
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-15	1315	-6	2315	-24	3315	-21
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	-15	1320	-6	2320	-24	3320	-26
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	5
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-337	1322	-505	2322	-1.412	3322	-993
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulación	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	-39	1325	-279	2325	-654	3325	-102
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	0	1326	1.261	2326	1.204	3326	3.734
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	596	1327	729	2327	1.523	3327	2.529
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.381	1328	170	2328	2.972	3328	579
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	-2.016	1331	-2.439	2331	-6.353	3331	-6.945
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-298	1332	-226	2332	-757	3332	-890
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	-298	1334	-226	2334	-757	3334	-890
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	-335	1337	-504	2337	-1.467	3337	-1.145
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	8.646	1338	10.197	2338	9.778	3338	10.838
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	8.311	1339	9.694	2339	8.311	3339	9.694

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2018		Acumulado anterior 30/09/2017
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	-160	1357	79	2357	-2.065	3357	356
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-160	1358	79	2358	-2.065	3358	356
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	124	1360	152	2360	328	3360	524
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	36	1362	-231	2362	1.737	3362	-880
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: 30/09/2018

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2018								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	1,36	0401	0	0421	0	0441	4,97	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: 30/09/2018

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	8	0467	2	0474	0	0481		0488	2	0495	262	0502	0	0509	264
De 1 a 3 meses	0461	3	0468	1	0475	0	0482		0489	2	0496	89	0503	0	0510	91
De 3 a 6 meses	0462	4	0469	3	0476	0	0483	0	0490	3	0497	92	0504		0511	96
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	2	0477	0	0484	0	0491	2	0498	38	0505		0512	40
De 9 a 12 meses	0464	1	0471	3	0478	0	0485	0	0492	3	0499	53	0506		0513	57
Más de 12 meses	0465	11	0472	131	0479	2	0486	29	0493	163	0500	333	0507		0514	496
Total	0466	28	0473	142	0480	4	0487	30	0494	175	0501	867	0508	1	1515	1.043

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	8	0522	2	0529	0	0536		0543	2	0550	262	0557	0	0564	264	0571	803	0578	803	0584	32,87
De 1 a 3 meses	0516	3	0523	1	0530	0	0537		0544	2	0551	89	0558	0	0565	91	0572	247	0579	247	0585	36,67
De 3 a 6 meses	0517	4	0524	3	0531	0	0538	0	0545	3	0552	92	0559		0566	96	0573	431	0580	431	0586	22,24
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	2	0532	0	0539	0	0546	2	0553	38	0560		0567	40	0574	102	0581	102	0587	39,29
De 9 a 12 meses	0519	1	0526	3	0533	0	0540	0	0547	3	0554	53	0561		0568	57	0575	121	0582	121	0588	46,91
Más de 12 meses	0520	11	0527	131	0534	2	0541	29	0548	163	0555	333	0562		0569	496	0576	1.231	0583	1.231	0589	40,24
Total	0521	28	0528	142	0535	4	0542	30	0549	175	0556	867	0563	1	0570	1.043	0577	2.935			0590	35,53

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: 30/09/2018

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 30/09/2018		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	168	1604		2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	41.362	1605	46.795	2605	0
Superior a 10 años	0606	6.681	1606	7.115	2606	138.000
Total	0607	48.211	1607	53.910	2607	138.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	8,41	1608	9,11	2608	17,42

Antigüedad	Situación actual 30/09/2018						Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 25/06/2009	
	Antigüedad media ponderada (años)	0609		12,32		1609		11,59	2609	

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: 30/09/2018

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 30/09/2018				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	1.360	0630	39.797	1620	1.077	1630	32.020	2620	103	2630	4.533
40% - 60%	0621	199	0631	8.413	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	1.559	0638	48.211	1628	1.609	1638	53.910	2628	2.249	2638	138.000
Media ponderada (%)	0639	35,34	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: 30/09/2018

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 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 25/06/2009	
Tipo de interés medio ponderado	0650	1,68	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: 30/09/2018
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 30/09/2018				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	39	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	1.024	0697	32.093	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	533	0700	16.079	1677	557	1700	18.162	2677	672	2700	40.626
País Vasco	0678		0701		1678		1701		2678	0	2701	0
Total España	0679	1.559	0702	48.211	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	1.559	0705	48.211	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: 30/09/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2018				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	1,28			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: 30/09/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2018			Situación cierre anual anterior 31/12/2017			Situación inicial 25/06/2009					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal	Nº de pasivos emitidos		Nominal	Nº de pasivos emitidos		Nominal			
		0720	0721	unitario (€)	0722	1720	1721	unitario (€)	1722	2720	2721	2722	
		Principal pendiente		Principal pendiente		Principal pendiente		Principal pendiente		Principal pendiente			
ES0312287008	A(G)	1.200	30.241	36.290	1.200	34.155	40.986	1.200	100.000	120.000			
ES0312287016	B	110	71.140	7.825	110	80.347	8.838	110	100.000	11.000			
ES0312287024	C	70	71.115	4.978	70	80.318	5.622	70	100.000	7.000			
Total		0723	1.380	0724	49.093	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: 30/09/2018

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	0738	0739					
			0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736			0737				
ES0312287008	A(G)	NS	EURIBOR 3 MESES	0,35	0,02	2	0	SI	36.290	0	36.292						
ES0312287016	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,75	0,42	6	0	SI	7.825	0	7.831						
ES0312287024	C	S	EURIBOR 3 MESES	1	0,67	6	0	SI	4.978	0	4.984						
Total						0740	14	0741	0	0743	49.093	0744	0	0745	49.107	0746	

	Situación actual 30/09/2018	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	0,16	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: 30/09/2018
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2018								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2017							
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)	1.490	83.710	2	6.363	1.803	77.511	2	6.355								
ES0312287016	B	321	3.175	9	1.092	389	1.838	10	1.055								
ES0312287024	C	204	2.022	9	851	247	1.172	10	813								
Total		0754	2.016	0755	88.907	0756	20	0757	8.307	1754	2.439	1755	80.520	1756	23	1757	8.223

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: 30/09/2018

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 30/09/2018	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)	18/07/2018	SYP	AAA	BBB	AAA
ES0312287016	B	27/06/2014	FCH	AA+	AA+	AA
ES0312287016	B	18/07/2018	SYP	AA	BBB	AA+
ES0312287024	C	31/03/2016	FCH	A-	A-	A-
ES0312287024	C	18/07/2018	SYP	AA	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: 30/09/2018

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 30/09/2018		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	49.093	1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769		1769	55.446	2769	
Entre 5 y 10 años	0770		1770		2770	120.000
Superior a 10 años	0771		1771		2771	18.000
Total	0772	49.093	1772	55.446	2772	138.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	3,12	1773	4,27	2773	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: 30/09/2018

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 25/06/2009	
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	6.873	1775	7.763	2775	9.660
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	6.873	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	24,44	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	36.290	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: 30/09/2018

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 30/09/2018	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)	-4.122	-2.476	-3.029	
Total							0808 -4.122	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: 30/09/2018

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 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 25/06/2009		Situación actual 30/09/2018		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: 30/09/2018

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 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación actual 30/09/2018		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	172	7006	48	7009	1,36	7012	1,02	7015	1,27		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	172	7008	48	7011	1,36	7014	1,02	7017	171.708	7018	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	156	7024	40	7027	0,87	7030	0,69	7033	0,85		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	156	7026	40	7029	0,87	7032	0,69	7035	0,85	7036	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017			
	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: 30/09/2018

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	1,28	1,30	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	0,42	0,43	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	0,55	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	0,55	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.6.1.B
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
Folleto informativo	0,80	0,42	0,43	Folleto Informativo
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



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: 30/09/2018

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	

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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	30/09/2018											
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872														
Margen de intereses	0873	33	103	38											173
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	-49	0	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	-19											-57
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	-37	85	19	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	67
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879	0													0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880	0	-85	-19											-104
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	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: 30/09/2018

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: 30/09/2018

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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