

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT ICO-FTVPO CAJA VITAL KUTXA, FTA
Número de registro del Fondo: 9316
NIF Fondo: V85600781
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2017

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)

S.01

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2017		Periodo anterior 31/12/2016
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	72.251	1001	75.194
I. Activos financieros a largo plazo	0002	72.251	1002	75.194
1. Activos titulizados	0003	72.054	1003	74.985
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	71.908	1005	74.912
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	572	1025	490
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-427	1027	-417
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	197	1032	209
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035	197	1035	209
3.4 Otros	0036		1036	
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037		1037	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038		1038	
II. Activos por impuesto diferido	0039		1039	
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	

S.01

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2017		Periodo anterior 31/12/2016
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	18.075	1041	17.525
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	6.631	1043	7.027
1. Activos titulizados	0044	6.631	1044	7.027
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	6.560	1046	6.973
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	23	1065	28
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	0	1066	0
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	188	1067	177
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	0	1068	0
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-141	1069	-151
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	
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083		1083	
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	11.444	1085	10.498
1. Tesorería	0086	11.444	1086	10.498
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	90.326	1088	92.720

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2017		Periodo anterior 31/12/2016
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	82.211	1089	83.778
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	82.211	1094	83.778
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	72.111	1095	75.020
1.1 Series no subordinadas	0096	57.511	1096	60.420
1.2 Series subordinadas	0097	14.600	1097	14.600
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	
2. Deudas con entidades de crédito	0101	7.739	1101	7.724
2.1 Préstamo subordinado	0102	8.060	1102	8.060
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	-321	1105	-336
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	661	1108	865
3.1 Derivados de cobertura	0109	661	1109	865
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	1.700	1112	170
4.1 Garantías financieras	0113	1.700	1113	170
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 Vital Kutxa, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2017		Periodo anterior 31/12/2016
B) PASIVO CORRIENTE	0117	8.776	1117	9.806
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	8.755	1123	9.778
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	8.261	1124	9.298
1.1 Series no subordinadas	0125	8.222	1125	9.253
1.2 Series subordinadas	0126		1126	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	39	1128	45
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	461	1131	433
2.1 Préstamo subordinado	0132	183	1132	183
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	16	1136	16
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	262	1137	234
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	33	1139	46
3.1 Derivados de cobertura	0140	33	1140	46
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	
4. Otros pasivos financieros	0143	1	1143	1
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	1	1144	1
4.2 Garantías financieras	0145		1145	
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	21	1148	28
1. Comisiones	0149	6	1149	6
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	6	1150	6
1.2 Comisión administrador	0151	98	1151	94
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152		1152	0
1.4 Comisión variable	0153	334	1153	334
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-432	1155	-428
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	15	1157	22
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-661	1158	-865
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-661	1160	-865
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	90.326	1162	92.720

S.02

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2017		Acumulado anterior 30/06/2016
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	110	1201	159	2201	228	3201	331
1.1 Activos titulizados	0202	110	1202	159	2202	228	3202	331
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-62	1204	-90	2204	-125	3204	-207
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-48	1205	-74	2205	-97	3205	-173
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-14	1206	-16	2206	-28	3206	-34
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207		3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-28	1208	-60	2208	-51	3208	-58
A) MARGEN DE INTERESES	0209	20	1209	9	2209	52	3209	66
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		3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-20	1217	-26	2217	-42	3217	-55
7.1 Servicios exteriores	0218	-6	1218	-11	2218	-12	3218	-22
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	0	1219	0	2219	-1	3219	0
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	-5	1220	-6	2220	-11	3220	-11
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221		3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	-1	1222	-5	2222	-1	3222	-11
7.2 Tributos	0223	-1	1223	-1	2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-13	1224	-14	2224	-29	3224	-32
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-7	1225	-7	2225	-14	3225	-14
7.3.2 Comisión administrador	0226	-2	1226	-2	2226	-4	3226	-4
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	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229		3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-4	1230	-5	2230	-12	3230	-14
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	1	1231	-210	2231	1	3231	-210
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	1	1232	-210	2232	1	3232	-210
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	-1	1239	227	2239	-11	3239	199
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 Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2017		Acumulado anterior 30/06/2016
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	1.472	1300	43	2300	1.562	3300	-236
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	62	1301	61	2301	65	3301	63
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	126	1302	172	2302	233	3302	332
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-49	1303	-95	2303	-103	3303	-213
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	84	1304	140	2304	183	3304	309
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-100	1305	-156	2305	-247	3305	-365
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	-12	1309	-9	2309	-25	3309	-21
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-7	1310	-8	2310	-14	3310	-15
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	-1	2312	0	3312	-1
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	-5	1314	0	2314	-11	3314	-5
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	1.422	1315	-9	2315	1.521	3315	-278
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	-8	1320	-9	2320	-16	3320	-278
3.6 Otros cobros de explotación	0321	1.430	1321	0	2321	1.537	3321	
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	412	1322	444	2322	-616	3322	-805
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	412	1325	444	2325	-616	3325	-805
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	1.145	1326	1.190	2326	2.236	3326	2.302
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	590	1327	764	2327	945	3327	1.290
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	78	1328	79	2328	144	3328	148
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-1.401	1331	-1.589	2331	-3.940	3331	-4.545
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	1.884	1337	487	2337	946	3337	-1.041
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	9.560	1338	9.581	2338	10.498	3338	11.109
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	11.444	1339	10.068	2339	11.444	3339	10.068

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2017		Acumulado anterior 30/06/2016
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	24	1357	-111	2357	152	3357	-384
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	24	1358	-111	2358	152	3358	-384
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359		3359	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	28	1360	60	2360	51	3360	58
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361		3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-52	1362	51	2362	-203	3362	326
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

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2017								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	0,96	0401	0	0421	0	0441	3,13	1381	0,81	1401	0	1421	0	1441	3,40	2381	1,90	2401	0,39	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 Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados:

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	23	0467	7	0474	0	0481		0488	7	0495	1.982	0502	0	0509	1.989
De 1 a 3 meses	0461	3	0468	2	0475	0	0482		0489	2	0496	211	0503	0	0510	213
De 3 a 6 meses	0462	1	0469	1	0476		0483		0490	1	0497	95	0504		0511	96
De 6 a 9 meses	0463		0470		0477		0484		0491		0498		0505		0512	
De 9 a 12 meses	0464	1	0471	2	0478		0485		0492	2	0499	24	0506		0513	26
Más de 12 meses	0465	7	0472	185	0479	0	0486	7	0493	192	0500	453	0507		0514	645
Total	0466	35	0473	197	0480	1	0487	7	0494	204	0501	2.765	0508	1	1515	2.970

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	23	0522	7	0529	0	0536		0543	7	0550	1.982	0557	0	0564	1.989	0571	3.166	0578		0584	62,83
De 1 a 3 meses	0516	3	0523	2	0530	0	0537		0544	2	0551	211	0558	0	0565	213	0572	318	0579		0585	67,05
De 3 a 6 meses	0517	1	0524	1	0531		0538		0545	1	0552	95	0559		0566	96	0573	134	0580		0586	72,19
De 6 a 9 meses	0518		0525		0532		0539		0546		0553		0560		0567		0574		0581		0587	
De 9 a 12 meses	0519	1	0526	2	0533		0540		0547	2	0554	24	0561		0568	26	0575	75	0582		0588	34,74
Más de 12 meses	0520	7	0527	185	0534	0	0541	7	0548	192	0555	453	0562		0569	645	0576	996	0583		0589	64,76
Total	0521	35	0528	197	0535	1	0542	7	0549	204	0556	2.765	0563	1	0570	2.970	0577	4.688			0590	63,35

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 10/02/2009	
Inferior a 1 año	0600	50	1600	59	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	117	1601	149	2601	30
Entre 2 y 3 años	0602	167	1602	144	2602	135
Entre 3 y 4 años	0603	259	1603	260	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	745	1604	521	2604	407
Entre 5 y 10 años	0605	9.647	1605	7.303	2605	2.154
Superior a 10 años	0606	68.243	1606	74.117	2606	152.274
Total	0607	79.228	1607	82.552	2607	155.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	19,87	1608	20,20	2608	26,75

Antigüedad	Situación actual 30/06/2017					
	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 10/02/2009	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	11,43	1609	10,95	2609	3,32

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 10/02/2009			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	542	0630	15.908	1620	528	1630	15.586	2620	216	2630	8.390
40% - 60%	0621	454	0631	30.582	1621	466	1631	30.709	2621	340	2631	22.637
60% - 80%	0622	366	0632	31.227	1622	392	1632	33.955	2622	790	2632	70.747
80% - 100%	0623	14	0633	1.511	1623	22	1633	2.302	2623	517	2633	53.226
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	1.376	0638	79.228	1628	1.408	1638	82.552	2628	1.863	2638	155.000
Media ponderada (%)	0639	54,09	0649		1639	55,08	1649		2639	72,96	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 10/02/2009	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,59	1650	0,52	2650	5,47
Tipo de interés nominal máximo	0651	5,50	1651	5,50	2651	6,64
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,33	1652	0,38	2652	3,75

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2017			Situación cierre anual anterior 31/12/2016			Situación inicial 10/02/2009		
	Nº de activos vivos	Principal pendiente		Nº de activos vivos	Principal pendiente		Nº de activos vivos	Principal pendiente	
Andalucía	0660	2	0683 271	1660	2	1683 276	2660	2	2683 340
Aragón	0661	8	0684 1.094	1661	8	1684 1.115	2661	11	2684 1.769
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	6	0688 631	1665	6	1688 645	2665	8	2688 1.011
Castilla-León	0666	26	0689 2.785	1666	27	1689 2.855	2666	32	2689 4.393
Castilla La Mancha	0667	3	0690 353	1667	3	1690 358	2667	3	2690 432
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	7	0695 1.005	1672	7	1695 1.024	2672	9	2695 1.515
Melilla	0673		0696	1673		1696	2673	0	2696 0
Murcia	0674		0697	1674		1697	2674	0	2697 0
Navarra	0675	1	0698 121	1675	1	1698 123	2675	1	2698 152
La Rioja	0676	4	0699 501	1676	4	1699 513	2676	4	2699 726
Comunidad Valenciana	0677		0700	1677		1700	2677	0	2700 0
País Vasco	0678	1.319	0701 72.467	1678	1.351	1701 75.643	2678	1.793	2701 144.662
Total España	0679	1.376	0702 79.228	1679	1.409	1702 82.552	2679	1.863	2702 155.000
Otros países Unión Europea	0680		0703	1680		1703	2680	0	2703 0
Resto	0681		0704	1681		1704	2681	0	2704 0
Total general	0682	1.376	0705 79.228	1682	1.409	1705 82.552	2682	1.863	2705 155.000

S.05.1
Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2017
Entidades cedentes de los activos titulizados:

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 10/02/2009			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	2,83			1710	2,76			2710	2		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2017			Situación cierre anual anterior 31/12/2016			Situación inicial 10/02/2009					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0312304019	B	77	100.000	7.700	77	100.000	7.700	77	100.000	7.700			
ES0312304027	C	69	100.000	6.900	69	100.000	6.900	69	100.000	6.900			
ES0312304001	A(G)	1.404	46.818	65.733	1.404	49.624	69.673	1.404	100.000	140.400			
Total		0723	1.550	0724	80.333	1723	1.550	1724	84.273	2723	1.550	2724	155.000

S.05.2

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2017

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		0738	0739		
			0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737						
ES0312304019	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,75	0,42	7	0	SI	7.700	0	7.707					
ES0312304027	C	S	EURIBOR 3 MESES	1	0,67	9	0	SI	6.900	0	6.909					
ES0312304001	A(G)	NS	EURIBOR 3 MESES	0,50	0,17	23	0	SI	65.733	0	65.756					
Total						0740	39	0741		0743	80.333	0744	0745	80.372	0746	

	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 10/02/2009	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,24	0748	0,27	0749	2,57

S.05.2

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2017								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2016							
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								
ES0312304001	A(G)	1.401	74.667	29	9.661	1.589	66.913	67	9.515								
ES0312304019	B	0	0	8	811	0	0	12	774								
ES0312304027	C	0	0	12	869	0	0	16	820								
Total		0754	1.401	0755	74.667	0756	49	0757	11.341	1754	1.589	1755	66.913	1756	95	1757	11.109

S.05.2

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2017

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 30/06/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 10/02/2009
				0762	0763	0764
ES0312304001	A(G)	31/03/2017	FCH	AA+	AA	AAA
ES0312304001	A(G)	23/01/2015	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0312304019	B	27/06/2014	FCH	A+	A+	A
ES0312304019	B	14/05/2016	MDY	Aa2	Aa2	Aa1
ES0312304027	C	31/03/2017	FCH	A-	BBB-	BBB-
ES0312304027	C	14/05/2016	MDY	A1	A1	A2

S.05.2

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2017

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 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 10/02/2009	
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		1768		2768	
Entre 4 y 5 años	0769		1769		2769	
Entre 5 y 10 años	0770	65.733	1770	69.673	2770	140.400
Superior a 10 años	0771	14.600	1771	14.600	2771	14.600
Total	0772	80.333	1772	84.273	2772	155.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	9,32	1773	6,26	2773	9,87

S.05.3

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 10/02/2009	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	7.963	1775	8.060	2775	8.060
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	8.060	1776	7.907	2776	8.060
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	9,91	1777	9	2777	5
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	14.040	1781	14.040	2781	14.040
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	17,48	1782	16,66	2782	9,06
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	65.733	1786	69.673	2786	140.400
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	81,83	1787	82,68	2787	90,58
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	81,83	1792	82,68	2792	90,58
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 Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

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 30/06/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 10/02/2009				
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806			
Permuta 1	KUTXABANK	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)	"el 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 (20) puntos básicos (0,20%)."	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)	-694	-910	12.677				
Total							0808	-694	0809	-910	0810	12.677	

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

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 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 10/02/2009		Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 10/02/2009			
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 Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

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 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación actual 30/06/2017		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	195	7006	184	7009	0,96	7012	0,81	7015	0,82		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	195	7008	184	7011	0,96	7014	0,81	7017	195.085	7018	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	188	7024	178	7027	0,72	7030	0,69	7033	0,70		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	188	7026	178	7029	0,72	7032	0,69	7035	0,70	7036	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto		
	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016			Última Fecha Pago
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

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
si 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 para cada ISIN	1,25	0,83	0,97	si 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 para cada ISIN
si 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 para cada ISIN	1	0,83	0,97	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	1,25	0,83	0,97	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	0,72	0,72	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	0,72	0,72	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	0,83	0,97	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

S.05.5

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

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 Mes / Año roto	3862	0,020	4862	0	5862	0	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	Caja Vital	1863	0	2863	Días Mes / Año roto	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 Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Kutxabank
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo adicional 3.4.6.4

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo											Total		
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872														
Margen de intereses	0873														
Deterioro de activos financieros (neto)	0874														
Dotaciones a provisiones (neto)	0875														
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876														
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877														
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878														
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879														
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880														
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881														
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882														
Comisión variable pagada	0883														
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884														

S.05.5

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total		
		18/01/2017	18/04/2017											
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885													
Saldo inicial	0886	7.907	7.937											
Cobros del periodo	0887	2.783	1.588											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-7	-7											
Pagos por derivados	0889	-147	-100											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-7.937	-7.963											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-2.593	-1.450											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-5	-5											
Resto pagos/retenciones	0893	0	0											
Saldo disponible	0894	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Liquidación de comisión variable	0895	0	0											0

S.06

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Vital Kutxa, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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