

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: 31/03/2021

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: 31/03/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2021		Periodo anterior 31/12/2020
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	48.512	1001	49.707
I. Activos financieros a largo plazo	0002	48.512	1002	49.707
1. Activos titulizados	0003	48.378	1003	49.568
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	48.048	1005	49.445
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	643	1025	569
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-314	1027	-446
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	134	1032	139
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035	134	1035	139
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: 31/03/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	13.949	1041	15.102
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	
V. Activos financieros a corto plazo	0043	5.713	1043	5.702
1. Activos titulizados	0044	5.713	1044	5.702
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	5.605	1046	5.651
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	15	1065	12
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	0	1066	0
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	181	1067	179
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	0	1068	0
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-88	1069	-140
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	
2. Derivados	0071		1071	
2.1 Derivados de cobertura	0072		1072	
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	
3. Otros activos financieros	0074		1074	
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076		1076	
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077		1077	
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	8.236	1085	9.400
1. Tesorería	0086	8.236	1086	9.400
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	
TOTAL ACTIVO	0088	62.461	1088	64.809

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: 31/03/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2021		Periodo anterior 31/12/2020
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	55.734	1089	56.988
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	55.734	1094	56.988
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	48.469	1095	49.612
1.1 Series no subordinadas	0096	39.337	1096	40.265
1.2 Series subordinadas	0097	9.132	1097	9.347
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	5.629	1101	5.664
2.1 Préstamo subordinado	0102	5.729	1102	5.951
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	-100	1105	-287
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	
3. Derivados	0108	346	1108	292
3.1 Derivados de cobertura	0109	346	1109	292
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	
4. Otros pasivos financieros	0112	1.290	1112	1.420
4.1 Garantías financieras	0113	1.290	1113	1.420
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: 31/03/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) PASIVO CORRIENTE	0117	7.073	1117	8.113
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	7.054	1123	8.089
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	6.624	1124	7.618
1.1 Series no subordinadas	0125	5.371	1125	6.177
1.2 Series subordinadas	0126	1.247	1126	1.434
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	7	1128	8
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	
2. Deudas con entidades de crédito	0131	429	1131	444
2.1 Préstamo subordinado	0132	419	1132	433
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	10	1136	11
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137		1137	
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	
3. Derivados	0139	1	1139	26
3.1 Derivados de cobertura	0140	1	1140	26
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	19	1148	25
1. Comisiones	0149	4	1149	5
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	4	1150	5
1.2 Comisión administrador	0151	123	1151	122
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152		1152	
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	-457	1155	-456
1.7 Otras comisiones	0156		1156	
2. Otros	0157	15	1157	20
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-346	1158	-292
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-346	1160	-292
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	
TOTAL PASIVO	0162	62.461	1162	64.809

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: 31/03/2021

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2021		Acumulado anterior 31/03/2020
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	37	1201	55	2201	37	3201	55
1.1 Activos titulizados	0202	37	1202	55	2202	37	3202	55
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-16	1204	-37	2204	-16	3204	-37
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-9	1205	-27	2205	-9	3205	-27
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-7	1206	-10	2206	-7	3206	-10
2.3 Otros pasivos financieros	0207		1207		2207		3207	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-1	1208	19	2208	-1	3208	19
A) MARGEN DE INTERESES	0209	21	1209	37	2209	21	3209	37
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210		1210		2210		3210	
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211		1211		2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212		1212		2212		3212	
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213		1213		2213		3213	
4.4 Otros	0214		1214		2214		3214	
5. Diferencias de cambio (neto)	0215		1215		2215		3215	
6. Otros ingresos de explotación	0216		1216		2216		3216	
7. Otros gastos de explotación	0217	-19	1217	-19	2217	-19	3217	-19
7.1 Servicios exteriores	0218	-7	1218	-7	2218	-7	3218	-7
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-2	1219	-2	2219	-2	3219	-2
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	-5	1220	-5	2220	-5	3220	-5
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221		1221		2221		3221	
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223		1223		2223		3223	
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-12	1224	-11	2224	-12	3224	-11
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-5	1225	-6	2225	-5	3225	-6
7.3.2 Comisión administrador	0226	-1	1226	-2	2226	-1	3226	-2
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227		1227		2227		3227	
7.3.4 Comisión variable	0228		1228		2228		3228	
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229		1229		2229		3229	
7.3.6 Otros gastos	0230	-5	1230	-4	2230	-5	3230	-4
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	184	1231	3	2231	184	3231	3
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	184	1232	3	2232	184	3232	3
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233		1233		2233		3233	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234		1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235		1235		2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236		1236		2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237		1237		2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238		1238		2238		3238	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-186	1239	-21	2239	-186	3239	-21
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241		1241		2241		3241	
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: 31/03/2021

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2021		Acumulado anterior 31/03/2020
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-158	1300	-20	2300	-158	3300	-20
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-10	1301	-6	2301	-10	3301	-6
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	34	1302	47	2302	34	3302	47
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-10	1303	-26	2303	-10	3303	-26
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	59	2304	0	3304	59
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-26	1305	-76	2305	-26	3305	-76
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	-8	1307	-11	2307	-8	3307	-11
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-11	1309	-6	2309	-11	3309	-6
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-6	1310	-6	2310	-6	3310	-6
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312	0	2312	0	3312	0
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	-5	1314	0	2314	-5	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-137	1315	-8	2315	-137	3315	-8
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	-7	1320	-8	2320	-7	3320	-8
3.6 Otros cobros de explotación	0321	-130	1321	0	2321	-130	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-1.006	1322	-571	2322	-1.006	3322	-571
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	-770	1325	-382	2325	-770	3325	-382
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	913	1326	957	2326	913	3326	957
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	410	1327	298	2327	410	3327	298
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	43	1328	54	2328	43	3328	54
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	-2.136	1331	-1.690	2331	-2.136	3331	-1.690
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-236	1332	-189	2332	-236	3332	-189
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	-236	1334	-189	2334	-236	3334	-189
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	-1.164	1337	-591	2337	-1.164	3337	-591
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	9.400	1338	9.738	2338	9.400	3338	9.738
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	8.236	1339	9.147	2339	8.236	3339	9.147

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: 31/03/2021

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2021		Acumulado anterior 31/03/2020
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350		1350		2350		3350	
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351		1351		2351		3351	
1.1.2 Efecto fiscal	0352		1352		2352		3352	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353		1353		2353		3353	
1.3 Otras reclasificaciones	0354		1354		2354		3354	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0355		1355		2355		3355	
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356		1356		2356		3356	
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-55	1357	-16	2357	-55	3357	-16
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-55	1358	-16	2358	-55	3358	-16
2.1.2 Efecto fiscal	0359		1359		2359		3359	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	1	1360	-19	2360	1	3360	-19
2.3 Otras reclasificaciones	0361		1361		2361		3361	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	54	1362	35	2362	54	3362	35
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 periodo	0364		1364		2364		3364	
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365		1365		2365		3365	
3.1.2 Efecto fiscal	0366		1366		2366		3366	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367		1367		2367		3367	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368		1368		2368		3368	
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369		1369		2369		3369	
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	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: 31/03/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/03/2021								Situación cierre anual anterior 31/12/2020								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	1,51	0401	0	0421	0	0441	3,98	1381	1,34	1401	0	1421	0	1441	3,70	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: 31/03/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	11	0467	3	0474	0	0481		0488	3	0495	676	0502	0	0509	679
De 1 a 3 meses	0461	2	0468	1	0475	0	0482		0489	1	0496	137	0503	0	0510	138
De 3 a 6 meses	0462	1	0469	1	0476	0	0483		0490	1	0497	79	0504		0511	80
De 6 a 9 meses	0463		0470		0477		0484		0491		0498		0505		0512	
De 9 a 12 meses	0464		0471		0478		0485		0492		0499		0506		0513	
Más de 12 meses	0465	8	0472	180	0479	0	0486	7	0493	187	0500	564	0507		0514	751
Total	0466	22	0473	185	0480	0	0487	7	0494	192	0501	1.456	0508	0	1515	1.648

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	11	0522	3	0529	0	0536		0543	3	0550	676	0557	0	0564	679	0571	1.359	0578		0584	49,96
De 1 a 3 meses	0516	2	0523	1	0530	0	0537		0544	1	0551	137	0558	0	0565	138	0572	236	0579		0585	58,48
De 3 a 6 meses	0517	1	0524	1	0531	0	0538		0545	1	0552	79	0559		0566	80	0573	122	0580		0586	65,85
De 6 a 9 meses	0518		0525		0532		0539		0546		0553		0560		0567		0574		0581		0587	
De 9 a 12 meses	0519		0526		0533		0540		0547		0554		0561		0568		0575		0582		0588	
Más de 12 meses	0520	8	0527	180	0534	0	0541	7	0548	187	0555	564	0562		0569	751	0576	1.201	0583		0589	62,52
Total	0521	22	0528	185	0535	0	0542	7	0549	192	0556	1.456	0563	0	0570	1.648	0577	2.918			0590	56,48

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: 31/03/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 10/02/2009	
Inferior a 1 año	0600	83	1600	79	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	168	1601	196	2601	30
Entre 2 y 3 años	0602	255	1602	263	2602	135
Entre 3 y 4 años	0603	386	1603	340	2603	
Entre 4 y 5 años	0604	685	1604	604	2604	407
Entre 5 y 10 años	0605	7.530	1605	7.616	2605	2.154
Superior a 10 años	0606	45.370	1606	46.746	2606	152.274
Total	0607	54.478	1607	55.844	2607	155.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	17,17	1608	17,34	2608	26,75

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 10/02/2009	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	15,03	1609	14,79	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: 31/03/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/03/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				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	631	0630	17.931	1620	639	1630	17.978	2620	216	2630	8.390
40% - 60%	0621	381	0631	26.279	1621	380	1631	26.440	2621	340	2631	22.637
60% - 80%	0622	129	0632	10.144	1622	143	1632	11.200	2622	790	2632	70.747
80% - 100%	0623	1	0633	123	1623	2	1633	226	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	1.142	0638	54.478	1628	1.164	1638	55.844	2628	1.863	2638	155.000
Media ponderada (%)	0639	45,88	0649		1639	46,29	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: 31/03/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 10/02/2009	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,36	1650	0,37	2650	5,47
Tipo de interés nominal máximo	0651	1,25	1651	1,47	2651	6,64
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,02	1652	0,03	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: 31/03/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/03/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				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	233	1660	2	1683	236	2660	2	2683	340
Aragón	0661	8	0684	927	1661	8	1684	938	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	527	1665	6	1688	534	2665	8	2688	1.011
Castilla-León	0666	25	0689	2.095	1666	25	1689	2.126	2666	32	2689	4.393
Castilla La Mancha	0667	3	0690	295	1667	3	1690	300	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	844	1672	7	1695	854	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	103	1675	1	1698	105	2675	1	2698	152
La Rioja	0676	3	0699	367	1676	3	1699	370	2676	4	2699	726
Comunidad Valenciana	0677		0700		1677		1700		2677	0	2700	0
País Vasco	0678	1.087	0701	49.086	1678	1.109	1701	50.381	2678	1.793	2701	144.662
Total España	0679	1.142	0702	54.478	1679	1.164	1702	55.844	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	1.142	0705	54.478	1682	1.164	1705	55.844	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: 31/03/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: A95653077 KUTXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/03/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 10/02/2009			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	3,55			1710	3,50			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: 31/03/2021
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2021			Situación cierre anual anterior 31/12/2020			Situación inicial 10/02/2009					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Principal pendiente		Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0312304001	A(G)	1.404	31.843	44.708	1.404	33.078	46.442	1.404	100.000	140.400			
ES0312304019	B	77	71.111	5.476	77	73.869	5.688	77	100.000	7.700			
ES0312304027	C	69	71.053	4.903	69	73.808	5.093	69	100.000	6.900			
Total		0723	1.550	0724	55.086	1723	1.550	1724	57.222	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: 31/03/2021

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		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
						0730	0731			0732	0733	0734	0735			0742	0736
ES0312304001	A(G)	NS	EURIBOR 3 MESES	0,50	0	0	0	0	SI	44.708	0	0	0	44.708			
ES0312304019	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,75	0,24	2	0	0	SI	5.476	0	0	0	5.478			
ES0312304027	C	S	EURIBOR 3 MESES	1	0,49	4	0	0	SI	4.903	0	0	0	4.907			
Total						0740	7	0741		0743	55.086	0744		0745	55.093	0746	

	Situación actual 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 10/02/2009	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,07	0748	0,12	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: 31/03/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2021								Situación periodo comparativo anterior 31/03/2020							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0312304001	A(G)	1.734	95.692	0	9.984	1.372	90.460	12	9.930								
ES0312304019	B	212	2.224	3	914	168	1.584	6	893								
ES0312304027	C	190	1.997	6	1.020	150	1.424	9	987								
Total		0754	2.136	0755	99.914	0756	10	0757	11.918	1754	1.690	1755	93.467	1756	26	1757	11.810

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: 31/03/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 31/03/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 10/02/2009
				0762	0763	0764
ES0312304001	A(G)	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0312304019	B	30/10/2020	FCH	A	A	A
ES0312304019	B	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aa1
ES0312304027	C	30/10/2020	FCH	A	A	BBB-
ES0312304027	C	29/06/2018	MDY	Aa2	Aa2	A2
ES0312304001	A(G)	30/10/2020	FCH	AAA	AAA	AAA

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: 31/03/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 10/02/2009	
Inferior a 1 año	0765	55.086	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		1770	57.222	2770	140.400
Superior a 10 años	0771		1771		2771	14.600
Total	0772	55.086	1772	57.222	2772	155.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	0	1773	7,44	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: 31/03/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 10/02/2009	
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	5.729	1775	5.951	2775	8.060
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	5.729	1776	5.951	2776	8.060
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	10,40	1777	10,40	2777	5
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	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	25,49	1782	24,54	2782	9,06
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	44.708	1786	46.442	2786	140.400
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	81,16	1787	81,16	2787	90,58
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	81,16	1792	81,16	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: 31/03/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características				
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 31/03/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	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)	-347	-318	12.677				
Total							0808	-347	0809	-318	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: 31/03/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 10/02/2009		Situación actual 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		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: 31/03/2021

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación actual 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	188	7006	186	7009	1,65	7012	1,34	7015	1,34		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	188	7008	186	7011	1,65	7014	1,34	7017	188.006	7018	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020	0	7021	171	7024	178	7027	0,74	7030	1,05	7033	1,05		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	171	7026	178	7029	0,74	7032	1,05	7035	1,05	7036	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto		
	Situación actual 31/03/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Última Fecha Pago
	0850		1850		2850		3850
	0851		1851		2851		3851
	0852		1852		2852		3852
	0853		1853		2853		3853

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: 31/03/2021

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

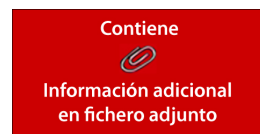
CUADRO B

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	0,78	0,29	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. 4.9.2
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	0,78	0,29	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. 4.9.2
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	0,89	0,89	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	0,89	0,89	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	0,29	0,29	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



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: 31/03/2021

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: 31/03/2021

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: 31/03/2021

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	18/01/2021											
Saldo inicial	0886	5.951											
Cobros del periodo	0887	2.244											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-6											
Pagos por derivados	0889	-65											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-5.729											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-2.146											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-249											
Resto pagos/retenciones	0893	0											
Saldo disponible	0894	0											
Liquidación de comisión variable	0895	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: 31/03/2021

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

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