

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: AYT ICO-FTVPO CAJA MURCIA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 9455
NIF Fondo: V85717593
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
NIF Gestora: A80732142
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2016

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

S.01

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	54.407	1001	57.477
I. Activos financieros a largo plazo	0002	54.407	1002	57.477
1. Activos titulizados	0003	54.264	1003	57.278
1.1 Participaciones hipotecarias	0004		1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	54.010	1005	57.255
1.3 Préstamos hipotecarios	0006		1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007		1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008		1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009		1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010		1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011		1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012		1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013		1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014		1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015		1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016		1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017		1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018		1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019		1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020		1020	0
1.18 Bonos de titulación	0021		1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022		1022	
1.20 Otros	0023		1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024		1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	519	1025	426
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026		1026	
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-265	1027	-403
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028		1028	0
2. Derivados	0029		1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030		1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031		1031	0
3. Otros activos financieros	0032	143	1032	199
3.1 Valores representativos de deuda	0033		1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034		1034	
3.3 Garantías financieras	0035	143	1035	199
3.4 Otros	0036		1036	0
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	0
III. Otros activos no corrientes	0040		1040	0

S.01

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	19.573	1041	37.143
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042		1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	8.726	1043	15.341
1. Activos titulizados	0044	8.726	1044	15.341
1.1 Participaciones hipotecarias	0045		1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	8.606	1046	15.190
1.3 Préstamos hipotecarios	0047		1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048		1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049		1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050		1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051		1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052		1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053		1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054		1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055		1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056		1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057		1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058		1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060		1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061		1061	0
1.18 Bonos de titulación	0062		1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063		1063	
1.20 Otros	0064		1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	100	1065	147
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	1	1066	2
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	35	1067	32
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	3	1068	4
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-19	1069	-34
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070		1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073		1073	0
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075		1075	0
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	0
3.5 Otros	0079		1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080		1080	
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	9	1082	7
1. Comisiones	0083	9	1083	7
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	10.838	1085	21.795
1. Tesorería	0086	10.838	1086	21.795
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087		1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	73.980	1088	94.620

S.01

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	66.985	1089	72.158
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	66.985	1094	72.158
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	54.289	1095	57.292
1.1 Series no subordinadas	0096	40.130	1096	39.292
1.2 Series subordinadas	0097	14.159	1097	18.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098		1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099		1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100		1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	9.019	1101	9.660
2.1 Préstamo subordinado	0102	9.019	1102	9.660
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103		1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104		1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105		1105	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106		1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107		1107	0
3. Derivados	0108	3.676	1108	5.206
3.1 Derivados de cobertura	0109	3.676	1109	5.206
3.2 Derivados de negociación	0110		1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111		1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112		1112	0
4.1 Garantías financieras	0113		1113	
4.1 Otros	0114		1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115		1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116		1116	0

S.01

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) PASIVO CORRIENTE	0117	10.672	1117	27.668
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118		1118	0
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	10.338	1123	27.500
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	10.155	1124	27.065
1.1 Series no subordinadas	0125	7.492	1125	27.005
1.2 Series subordinadas	0126	2.643	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127		1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	19	1128	60
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129		1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130		1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	64	1131	262
2.1 Préstamo subordinado	0132	33	1132	106
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133		1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134		1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135		1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	31	1136	37
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	119
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138		1138	0
3. Derivados	0139	118	1139	172
3.1 Derivados de cobertura	0140	118	1140	172
3.2 Derivados de negociación	0141		1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142		1142	0
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	0
4.3 Otros	0146		1146	
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147		1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	334	1148	168
1. Comisiones	0149	314	1149	165
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	4	1150	5
1.2 Comisión administrador	0151	47	1151	40
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	353	1153	353
1.5 Otras comisiones del cedente	0154		1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	-90	1155	-233
1.7 Otras comisiones	0156		1156	0
2. Otros	0157	20	1157	3
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-3.676	1158	-5.206
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159		1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-3.676	1160	-5.206
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161		1161	0
TOTAL PASIVO	0162	73.980	1162	94.620

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	303	1201		2201	1.348	3201	2.191
1.1 Activos titulizados	0202	303	1202		2202	1.348	3202	2.187
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203		2203	0	3203	4
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-68	1204		2204	-345	3204	-607
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-27	1205		2205	-172	3205	-409
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-41	1206		2206	-173	3206	-198
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207		2207		3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-192	1208		2208	-867	3208	-1.421
A) MARGEN DE INTERESES	0209	43	1209		2209	136	3209	163
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210		2210		3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211		2211		3211	
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212		2212		3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213		2213		3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214		2214		3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215		2215		3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216		2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-41	1217		2217	-145	3217	-118
7.1 Servicios exteriores	0218	-25	1218		2218	-47	3218	-40
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219		2219	-2	3219	-1
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	-4	1220		2220	-18	3220	-18
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221		2221		3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	-20	1222		2222	-27	3222	-21
7.2 Tributos	0223	0	1223		2223	-1	3223	-1
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-16	1224		2224	-97	3224	-77
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-8	1225		2225	-33	3225	-31
7.3.2 Comisión administrador	0226	-2	1226		2226	-7	3226	-9
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-1	1227		2227	-1	3227	-2
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228		2228	0	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229		2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-5	1230		2230	-56	3230	-35
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	79	1231		2231	153	3231	-278
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	79	1232		2232	153	3232	-278
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233		2233		3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234		2234		3234	
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235		2235		3235	
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236		2236		3236	
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237		2237		3237	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238		2238		3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-80	1239		2239	-143	3239	233
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240		2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241		2241		3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242		2242	0	3242	0

S.03

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	31	1300		2300	-105	3300	165
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	46	1301		2301	-36	3301	246
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	304	1302		2302	1.396	3302	2.274
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-31	1303		2303	-213	3303	-439
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	117	1304		2304	457	3304	890
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-302	1305		2305	-1.378	3305	-2.405
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306		2306	0	3306	8
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	-42	1307		2307	-298	3307	-82
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308		2308		3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-10	1309		2309	-47	3309	-49
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-6	1310		2310	-26	3310	-29
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311		2311		3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	0	1312		2312	-1	3312	-2
2.4 Comisión variable	0313	0	1313		2313		3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	-5	1314		2314	-21	3314	-18
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	-5	1315		2315	-21	3315	-32
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316		2316		3316	
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317		2317		3317	
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318		2318		3318	
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319		2319		3319	
3.5 Otros pagos de explotación	0320	-11.468	1320		2320	-11.484	3320	-32
3.6 Otros cobros de explotación	0321	11.463	1321		2321	11.463	3321	
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-710	1322		2322	-10.852	3322	9.811
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323		2323		3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324		2324		3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	-38	1325		2325	-10.139	3325	9.811
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	1.272	1326		2326	5.062	3326	5.577
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	681	1327		2327	3.842	3327	12.502
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	197	1328		2328	829	3328	1.001
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329		2329		3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330		2330		3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-2.187	1331		2331	-19.872	3331	-9.269
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-672	1332		2332	-713	3332	0
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333		2333		3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	-672	1334		2334	-713	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335		2335		3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	0	1336		2336		3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-679	1337		2337	-10.956	3337	9.976
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	11.517	1338		2338	21.795	3338	11.819
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	10.838	1339		2339	10.838	3339	21.795

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350		2350		3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351		2351		3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352		2352		3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353		2353		3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354		2354		3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0355	0	1355		2355		3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356		2356		3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	2.368	1357		2357	662	3357	317
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	2.368	1358		2358	662	3358	317
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359		2359		3359	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	192	1360		2360	867	3360	1.421
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361		2361		3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-2.561	1362		2362	-1.530	3362	-1.738
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363		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	0	1364		2364		3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365		2365		3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366		2366		3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367		2367		3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368		2368		3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369		2369		3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370		2370	0	3370	0

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2016								Situación cierre anual anterior 31/12/2015								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	0,88	0401	0	0421	0	0441	5,73	1381	0,63	1401	0	1421	0	1441	15,08	2381	1,83	2401	0,06	2421	0	2441	0
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	18	0467	4	0474	0	0481		0488	4	0495	676	0502	1	0509	681
De 1 a 3 meses	0461	6	0468	3	0475	0	0482		0489	4	0496	261	0503	0	0510	265
De 3 a 6 meses	0462	1	0469	1	0476	0	0483	0	0490	2	0497	48	0504		0511	49
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	2	0477	0	0484	0	0491	2	0498	40	0505		0512	42
De 9 a 12 meses	0464	2	0471	2	0478	0	0485	0	0492	2	0499	97	0506	0	0513	99
Más de 12 meses	0465	10	0472	30	0479	2	0486	10	0493	43	0500	385	0507		0514	427
Total	0466	38	0473	42	0480	4	0487	10	0494	56	0501	1.506	0508	2	1515	1.564

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	18	0522	4	0529	0	0536		0543	4	0550	676	0557	1	0564	681	0571	1.603	0578	156.865	0584	42,46
De 1 a 3 meses	0516	6	0523	3	0530	0	0537		0544	4	0551	261	0558	0	0565	265	0572	722	0579	722	0585	36,76
De 3 a 6 meses	0517	1	0524	1	0531	0	0538	0	0545	2	0552	48	0559		0566	49	0573	100	0580	100	0586	49,47
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	2	0532	0	0539	0	0546	2	0553	40	0560		0567	42	0574	92	0581	92	0587	45,85
De 9 a 12 meses	0519	2	0526	2	0533	0	0540	0	0547	2	0554	97	0561	0	0568	99	0575	193	0582	193	0588	51,32
Más de 12 meses	0520	10	0527	30	0534	2	0541	10	0548	43	0555	385	0562		0569	427	0576	1.109	0583	1.109	0589	38,55
Total	0521	38	0528	42	0535	4	0542	10	0549	56	0556	1.506	0563	2	0570	1.564	0577	3.818			0590	40,96

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 25/06/2009	
Inferior a 1 año	0600		1600	0	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601		1601	0	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602		1602	0	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603		1603		2603	
Entre 4 y 5 años	0604		1604	0	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	43.543	1605	20.468	2605	0
Superior a 10 años	0606	19.628	1606	52.435	2606	138.000
Total	0607	63.170	1607	72.903	2607	138.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	10,05	1608	10,99	2608	17,42

Antigüedad	Situación actual 31/12/2016					
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 25/06/2009	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	10,60	1609	9,62	2609	3,16

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 25/06/2009			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	578	0630	16.822	1620	384	1630	11.549	2620	103	2630	4.533
40% - 60%	0621	1.118	0631	46.348	1621	1.382	1631	60.056	2621	264	2631	13.182
60% - 80%	0622		0632		1622	21	1632	1.298	2622	1.882	2632	120.285
80% - 100%	0623		0633		1623	0	1633	0	2623	0	2633	0
100% - 120%	0624		0634		1624	0	1634	0	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625		0635		1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626		0636		1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627		0637		1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	1.696	0638	63.170	1628	1.787	1638	72.903	2628	2.249	2638	138.000
Media ponderada (%)			0639	42,10			1639	45,90			2639	67,56

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 25/06/2009	
Tipo de interés medio ponderado	0650	1,52	1650	2,83	2650	3,70
Tipo de interés nominal máximo	0651	2,93	1651	2,93	2651	3,94
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,85	1652	2,35	2652	3,68

S.05.1

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

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

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 25/06/2009			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	2	0683	51	1660	2	1683	57	2660	2	2683	92
Aragón	0661		0684		1661	0	1684	0	2661	0	2684	0
Asturias	0662		0685		1662	0	1685	0	2662	0	2685	0
Baleares	0663		0686		1663	0	1686	0	2663	0	2686	0
Canarias	0664		0687		1664	0	1687	0	2664	0	2687	0
Cantabria	0665		0688		1665	0	1688	0	2665	0	2688	0
Castilla-León	0666		0689		1666	0	1689	0	2666	0	2689	0
Castilla La Mancha	0667		0690		1667	0	1690	0	2667	268	2690	16.710
Cataluña	0668		0691		1668	0	1691	0	2668	0	2691	0
Ceuta	0669		0692		1669	0	1692	0	2669	0	2692	0
Extremadura	0670		0693		1670	0	1693	0	2670	0	2693	0
Galicia	0671		0694		1671	0	1694	0	2671	0	2694	0
Madrid	0672		0695		1672	0	1695	0	2672	0	2695	0
Melilla	0673		0696		1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	1.102	0697	41.557	1674	1.167	1697	48.054	2674	1.307	2697	80.572
Navarra	0675		0698		1675	0	1698	0	2675	0	2698	0
La Rioja	0676		0699		1676	0	1699	0	2676	0	2699	0
Comunidad Valenciana	0677	592	0700	21.563	1677	618	1700	24.792	2677	672	2700	40.626
País Vasco	0678		0701		1678	0	1701	0	2678	0	2701	0
Total España	0679	1.696	0702	63.170	1679	1.787	1702	72.903	2679	2.249	2702	138.000
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681		0704		1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	1.696	0705	63.170	1682	1.787	1705	72.903	2682	2.249	2705	138.000

S.05.1
Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2016
Entidades cedentes de los activos titulizados: A86104189 BANCO MARE NOSTRUM, S.A.

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 25/06/2009			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,07			1710	0,99			2710	0,67		
Sector	0711		0712		1711	0	1712	0	2711	0	2712	0

S.05.2

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2016			Situación cierre anual anterior 31/12/2015			Situación inicial 25/06/2009					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0312287016	B	110	93.357	10.269	110	100.000	11.000	110	100.000	11.000			
ES0312287024	C	70	93.324	6.533	70	100.000	7.000	70	100.000	7.000			
ES0312287008	A(G)	1.200	39.686	47.623	1.200	55.000	66.297	1.200	100.000	120.000			
Total		0723	1.380	0724	64.425	1723	1.380	1724	84.297	2723	1.380	2724	138.000

S.05.2

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos:

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			
											0730	0731	0732	0733
ES0312287016	B	S	EURIBOR 3 MESES	0,75	0,45	8	0	SI	10.269	0	10.277			
ES0312287024	C	S	EURIBOR 3 MESES	1	0,70	8	0	SI	6.533	0	6.541			
ES0312287008	A(G)	NS	EURIBOR 3 MESES	0,35	0,05	3	0	SI	47.623	0	47.626			
Total						0740	19	0741	0743	64.425	0744	0745	64.444	0746

	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 25/06/2009	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,18	0748	0,50	0749	1,60

S.05.2

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos:

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2016								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2015							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0312287008	A(G)	1.617	72.377	7	6.345	9.269	53.704	279	6.252								
ES0312287016	B	349	731	12	1.023	0	0	87	960								
ES0312287024	C	222	467	12	781	0	0	73	725								
Total		0754	2.187	0755	73.575	0756	31	0757	8.149	1754	9.269	1755	53.704	1756	439	1757	7.937

S.05.2

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos:

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 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 25/06/2009
				0762	0763	0764
ES0312287008		16/08/2013	SYP	BBB	BBB	AAA
ES0312287016		27/06/2014	FCH	AA+	AA+	AA
ES0312287016		16/08/2013	SYP	BBB	BBB	AA+
ES0312287024		31/03/2016	FCH	A-	A	A-
ES0312287024		29/06/2009	SYP	A	BBB	A
ES0312287008		27/06/2014	FCH	AA+	AA+	AAA

S.05.2

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos:

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 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 25/06/2009
Inferior a 1 año	0765		1765		2765
Entre 1 y 2 años	0766		1766		2766
Entre 2 y 3 años	0767	64.425	1767		2767
Entre 3 y 4 años	0768		1768	66.297	2768
Entre 4 y 5 años	0769		1769	18.000	2769
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770	0	2770
Superior a 10 años	0771		1771	0	2771
Total	0772	64.425	1772	84.297	2772
Vida residual media ponderada (años)	0773	2,37	1773	4,81	2773
					138.000
					18.000
					120.000
					8.62

S.05.3

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 25/06/2009	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	9.019	1775	9.660	2775	9.660
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	9.019	1776	9.564	2776	9.660
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	14	1777	11,35	2777	7
1.3 Denominación de la contrapartida	0778		1778		2778	
1.4 Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781	12.000	1781	12.000	2781	12.000
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782	18,63	1782	14,24	2782	8,70
2.2 Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784		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	47.623	1786	66.297	2786	120.000
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	73,92	1787	78,65	2787	86,96
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788		1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790		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	73,92	1792	78,65	2792	86,94
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

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 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 25/06/2009	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Permuta 1	CECABANK S.A.	TRIMESTRAL	La suma de los intereses devengados, vencidos e ingresados al Fondo durante el Periodo de Liquidación que vence de los Activos, disminuida en el importe de los Intereses Corridos que, en su caso, hubiere pagado el Fondo durante el mismo Periodo de Liquidación entre el Importe Nominal, multiplicado por 360 y dividido por los días efectivos existentes en dicho Periodo de Liquidación	El Saldo Vivo de los Activos (una vez deducidos los Activos Fallidos) en la Fecha de Determinación anterior que no se encuentren con retrasos en el pago de los importes vencidos por más de noventa (90) días en la Fecha de Determinación en curso (incluidos los Activos totalmente amortizados durante el Periodo de Determinación)	Tipo de Interes de Referencia de los Bonos mas el margen medio ponderado de los bonos mas un margen de 0.50%.En el supuesto de imposibilidad de obtención de la referencia de liquidación, será de aplicación el tipo de interés de referencia sustitutivo.	eE Saldo Vivo de los Activos (una vez deducidos los Activos Fallidos) en la Fecha de Determinación anterior que no se encuentren con retrasos en el pago de los importes vencidos por más de noventa (90) días en la Fecha de Determinación en curso (incluidos los Activos totalmente amortizados durante el Periodo de Determinación)	-3.794	-5.378	-3.029	
Total							0808 -3.794	0809 -5.378	0810 -3.029	

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

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 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 25/06/2009	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 25/06/2009		
Préstamos hipotecarios	0811	1811	2811	0829	1829	2829	3829	
Cédulas hipotecarias	0812	1812	2812	0830	1830	2830	3830	
Préstamos a promotores	0813	1813	2813	0831	1831	2831	3831	
Préstamos a PYMES	0814	1814	2814	0832	1832	2832	3832	
Préstamos a empresas	0815	1815	2815	0833	1833	2833	3833	
Préstamos corporativos	0816	1816	2816	0834	1834	2834	3834	
Cédulas territoriales	0817	1817	2817	0835	1835	2835	3835	
Bonos de tesorería	0818	1818	2818	0836	1836	2836	3836	
Deuda subordinada	0819	1819	2819	0837	1837	2837	3837	
Créditos AAPP	0820	1820	2820	0838	1838	2838	3838	
Préstamos consumo	0821	1821	2821	0839	1839	2839	3839	
Préstamos automoción	0822	1822	2822	0840	1840	2840	3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823	1823	2823	0841	1841	2841	3841	
Cuentas a cobrar	0824	1824	2824	0842	1842	2842	3842	
Derechos de crédito futuros	0825	1825	2825	0843	1843	2843	3843	
Bonos de titulización	0826	1826	2826	0844	1844	2844		
Total	0827	1827	2827	0845	1845	2845	3845	

S.05.4

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

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 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000	0	7002	90	7003	48	7006	46	7009	0,88	7012	0,62	7015	0,55		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013	0	7016			
Total Morosos					7005	48	7008	46	7011	0,88	7014	0,62	7017	0,55	7018	FOLLETO INFORMATIVO. GLOSARIO DE DEFINICIONES
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020		7021	28	7024	42	7027	0,45	7030	0,60	7033	0,90		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025		7028	0	7031	0	7034	0		
Total Fallidos					7023	28	7026	42	7029	0,45	7032	0,60	7035	0,90	7036	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto		
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015			Última Fecha Pago
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
SUPUESTOS DE AMORTIZACIÓN SECUENCIAL: c) En caso de que el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) es superior al % establecido en el cuadro de triggers	1,25	0,90	0,88	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2.b (iv)
SUPUESTOS DE AMORTIZACIÓN SECUENCIAL: c) En caso de que el porcentaje que supone el Saldo Vivo de los Activos Morosos sobre el Saldo Vivo de los Activos (deducidos los Activos Fallidos) es superior al % establecido en el cuadro de triggers	1	0,35	0,43	FOLLETO INFORMATIVO. NOTA DE VALORES. APARTADO 4.9.2 b
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	0,90	0,88	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	0,39	0,39	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.	15	0,39	0,39	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	0,39	0,39	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	0,39	0,39	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	0,80	0,90	0,88	FOLLETO INFORMATIVO. MÓDULO ADICIONAL.3.4.2.1
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	0,80	0,90	0,88	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 Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	HAYA TITULIZACION, SGFT, S.A.	1862	11	2862	Días del mes /Días año	3862	0,020	4862	0	5862	0	6862	Trimestral	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	Caja de Ahorros de Murcia	1863	0	2863	Días del mes /Días año	3863	0,010	4863	0	5863	0	6863	Trimestral	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BANCO SANTANDER, S.A.	1864	0	2864		3864	0	4864	0	5864	0	6864	Trimestral	7864	N	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total		
		31/03/2016	30/06/2016	30/09/2016	31/12/2016									
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872													
Margen de intereses	0873	42	12	39	43									136
Deterioro de activos financieros (neto)	0874	31	43	1	78									153
Dotaciones a provisiones (neto)	0875	0	0	0	0									0
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876	0	0	0	0									0
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877	-57	-29	-18	-40									-145
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878	15	26	22	81	0	0	0	0	0	0	0	0	143
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879	0	0	0	0									0
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880	-15	-26	-22	-81									-143
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881	0	0	0	0									0
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Comisión variable pagada	0883	0	0	0	0									0
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884	0	0	0	0									0

S.05.5

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

S.06

Denominación Fondo: AyT ICO-FTVPO Caja Murcia, FTA

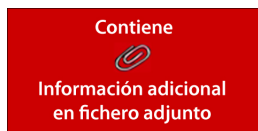
Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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