

## MADRID FTPYME II

### LIQUIDACION DEL PERIODO 22/11/13 - 24/02/14

	Euros
<b>I. Situación al 22/11/13:</b>	<b>27.517.568,21</b>
Fondo de Reserva	27.517.568,21
<b>II. Fondos recibidos del emisor</b>	<b>46.588.037,36</b>
<b>Principal:</b>	
Según calendario hasta 31/01/14:	36.870.030,73
Amort. Anticipada hasta 31/01/14:	6.699.752,17
<b>Intereses:</b>	<b>3.018.254,46</b>
<b>III. Total intereses de la reinversión:</b>	<b>32.782,10</b>
Intereses de la Cta. De Tesorería	32.782,10
<b>IV. Recursos disponibles ( I + II + III ):</b>	<b>74.138.387,67</b>
<b>V. Varios:</b>	<b>59.108,76</b>
<b>VI. Liquidación SWAP:</b>	<b>-75.031,23</b>
Cantidad a Pagar por la Parte A (BBVA) :	546.307,64
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	621.338,87
<b>VII. Pago a los Bonos:</b>	<b>45.549.000,00</b>
<b>Bonos A2 (G):</b>	
Intereses correspondientes al 24/02/14:	335.880,00
Retenciones practicadas a los bonos:	-70.520,00
Amortización correspondiente al 24/02/14:	45.213.120,00
<b>Reinversión o devolución de las retenciones (1):</b>	<b>70.520,00</b>
<b>VIII. Pago al Préstamo B</b>	<b>523.094,33</b>
Intereses correspondientes al 24/02/14:	523.094,33
Amortización correspondiente al 24/02/14:	0,00
<b>IX. Saldo disponible ( IV - V + VI - VII - VIII ):</b>	<b>27.932.153,35</b>
<b>Distribución del saldo disponible:</b>	
Fondo de Reserva previo 22/11/13:	27.517.568,21
Aportación al Fondo de Reserva	414.585,14
Intereses Crédito subordinado dispuesto	0,00
Amortización Crédito subordinado dispuesto	0,00
Intereses Préstamo para el Fondo de Reserva	0,00
Amortización del Préstamo para el Fondo de Reserva	0,00
<b>Margen de Intermediación Financiera</b>	<b>0,00</b>
<b>Fondo de Reserva a 24/02/14:</b>	<b>27.932.153,35</b>

(1) Hasta el 20/03/2014

Destinatarios: CNMV y AIAF.



**Nº: 1081/14**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.  
Orense, 69

28020 Madrid

Tel.:917020808

<http://www.tda-sgft.com>

MADRID FTPYME II(Iiq.trim)Feb14

**MADRID FTPYME II****INFORMACION A LOS INVERSORES****FECHA DE PAGO: 24 de Febrero de 2014**

Importes en euros

<b>I. BONOS A2 (G) ES0358933010</b>	<b>Sobre 4000 bonos</b>	<b>Por Bono</b>
1. Saldo inicial (28/12/2011):	400.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	57.971.680,00 €	14.492,92 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	335.880,00 €	83,97 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	45.213.120,00 €	11.303,28 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	12.758.560,00 €	3.189,64 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	3,189640%	3,189640%
<b>II. EL FONDO</b>		
Importes en euros		
<b>1. Saldo de las participaciones hipotecarias a 31/01/14:</b>		
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:		396.600.931,72 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:		4.404.636,20 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:		398.758.572,65 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:		11.926.060,58 €
<b>2. Amortización del período 31/10/13 a 31/01/14:</b>		
a) Según calendario:		36.870.030,73 €
b) Amortización anticipada hasta 31/01/14:		6.699.752,17 €
<b>3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):</b>		
a) Ultimo año:		8,85%
b) Ultimo semestre:		6,43%
c) Ultimo trimestre:		5,94%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:		1,29%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 12 meses:		1,15%
6. Porcentaje de fallidos (1):		2,90%
7. Nivel de Impago (2)		1,37%

(1) Saldo pendiente de las participaciones hipotecarias fallidas según definición del Folleto de Emisión (retraso de 12 meses y otras causas), sobre el saldo pendiente total.

(2) Importe de principal de las Participaciones Hipotecarias con morosidad superior a 90 días en la Fecha de Cobro inmediata anterior a la Fecha de Pago en curso, sobre el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias.

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF.



Nº: 1082/14

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.  
Orense, 69

28020 Madrid

Tel.: 917020808

<http://www.tda-sgft.com>

MADRID FTPYME II\Infoinver.trim\Feb14

**MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
**INFORMACION CORRESPONDIENTE AL PERÍODO: 22/11/13-24/02/14**
**I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO**

Fecha de Constitución del Fondo	23 de diciembre de 2011
Fecha Emisión Bonos	23 de diciembre de 2011
Fecha Final Amortización Pasivo: (8,60% TAA)	22 de febrero de 2017
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores	Bankia (Caja Madrid)
Agente de Pagos	B. Santander
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Moody's / Standard & Poor's
Calificación	Bonos A2 (G):(M) A3 (sf) / (S&P) AA- (sf)

**II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO**

Nombre	Bonos de Titulización MADRID FTPYME II, FTA
Serie A2 (G):	
Código ISIN	ES0358933010
Nominal en circulación total (inicial)	400.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	12.758.560,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	3.189,64 Euros
Préstamo B:	
Importe inicial	386.000.000,00 Euros
Importe vencido	0,00 Euros
Nominal pendiente de vencimiento	386.000.000,00 Euros
Nominal vencido y amortizado (pagado)	0,00 Euros
Intereses devengados en el periodo	523.094,33 Euros
Intereses devengados y no pagados	0,00 Euros

**III. INFORMACION INCLUIDA**

* Liquidación del Período: 22/11/13-24/02/14
* Flujos de Caja del Período: 22/11/13-24/02/14
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 24 de Febrero de 2014

**MADRID FTPYME II**

Fondo de Titulización de Activos

FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/11/13 - 24/02/14

	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
<b>I. INVERSIONES/FINANCIACIONES</b>		
Amortización Bonos Titulización Hip.		45.213.120,00
Amortización Participaciones Hip.	43.569.782,90	
Amortización Préstamos Subordinados		0,00
<b>II. INTERESES</b>		
Intereses pagados a los BTH		335.880,00
Intereses recibidos de los DCs	3.018.254,46	
Intereses Préstamo B		523.094,33
Intereses Ptmos. Subordinados		0,00
Intereses Inversiones Temporales	32.782,10	
<b>III. GASTOS</b>		
Comisiones y gastos periódicos:		59.108,76
Neto swap a favor de la Parte A (BBVA)		75.031,23
Margen de Intermediación Financiera		0,00
<b>Total Ingresos/Pagos</b>	<b>46.620.819,46</b>	<b>46.206.234,32</b>
Saldo inicial FR a 22/11/13	27.517.568,21	
A Inversiones Temporales (FR)		27.932.153,35
<b>Total</b>	<b>74.138.387,67</b>	<b>74.138.387,67</b>
Retenciones practicadas el 24/02/14	70.520,00	
A Inv.Temporales hasta el 20/03/2014		70.520,00

Destinatarios: CNMV; AIAF.



Nº: 1087/14

Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.: 917020808

<http://www.tda-sgft.com>

MADRID FTPYME IIFluj.trim\Feb14