

MADRID FTPYME II
LIQUIDACION DEL PERIODO 24/11/14 - 23/02/15

	Euros
I. Situación al 24/11/14:	29.318.218,91
Fondo de Reserva	29.318.218,91
II. Fondos recibidos del emisor	39.141.165,20
Principal:	
Según calendario hasta 31/01/15:	24.888.942,88
Amort. Anticipada hasta 31/01/15:	12.607.112,94
Intereses:	1.645.109,38
III. Total intereses de la reinversión:	15.644,90
Intereses de la Cta. De Tesorería	15.644,90
IV. Recursos disponibles (I + II + III):	68.475.029,01
V. Varios:	47.511,65
VI. Liquidación SWAP:	-41.885,67
Cantidad a Pagar por la Parte A (BBVA) :	265.248,23
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	307.133,90
VII. Pago al Préstamo B	38.085.937,39
Intereses correspondientes al 23/02/15:	277.071,21
Amortización correspondiente al 23/02/15:	37.808.866,18
VIII. Saldo disponible (IV - V + VI - VII):	30.299.694,30
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva previo 24/11/14:	29.318.218,91
Aportación al Fondo de Reserva	681.781,09
Intereses Crédito subordinado dispuesto	0,00
Amortización Crédito subordinado dispuesto	0,00
Intereses Préstamo para el Fondo de Reserva	299.694,30
Amortización del Préstamo para el Fondo de Reserva	0,00
Margen de Intermediación Financiera	0,00
Fondo de Reserva a 23/02/15:	30.000.000,00

Destinatarios: CNMV y AIAF.

**Nº: 854/15**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

MADRID FTPYME II\Iiq.trim\Feb15

MADRID FTPYME II**INFORMACION A LOS INVERSORES****FECHA DE PAGO: 23 de Febrero de 2015**

I. EL FONDO	Importes en euros
1. Saldo de las participaciones hipotecarias a 31/01/15:	
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:	248.603.033,66 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:	4.855.949,13 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:	249.882.970,96 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:	16.042.185,23 €
2. Amortización del período 31/10/14 a 31/01/15:	37.496.055,82 €
a) Según calendario:	24.888.942,88 €
b) Amortización anticipada hasta 31/01/15:	12.607.112,94 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):	
a) Último año:	7,23%
b) Último semestre:	10,74%
c) Último trimestre:	16,48%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:	2,33%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 12 meses:	0,78%
6. Porcentaje de fallidos (1):	6,03%
7. Nivel de Impago (2)	1,56%

(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: 855/15

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

MADRID FTPYME II\Inforver.trim\Feb15

MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL PERÍODO: 24/11/14-23/02/15

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: (7,23% TAA)	22 de mayo de 2017
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores	Bankia (Caja Madrid)
Agente de Pagos	BBVA
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Moody's / Standard & Poor's
Calificación	(M) - (sf) / (S&P) - (sf)

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

Nombre	Bonos de Titulización MADRID FTPYME II, FTA
Préstamo B:	
Importe inicial	386.000.000,00 Euros
Importe vencido	37.808.866,18 Euros
Nominal pendiente de vencimiento	249.882.970,96 Euros
Nominal vencido y amortizado (pagado)	37.808.866,18 Euros
Intereses devengados en el periodo	277.071,21 Euros
Intereses devengados y no pagados	0,00 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA

* Liquidación del Período: 24/11/14-23/02/15
* Flujos de Caja del Período: 24/11/14-23/02/15
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 23 de Febrero de 2015

MADRID FTPYME II

Fondo de Titulización de Activos

FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 24/11/14 - 23/02/15

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	Ingresos	Pagos
Amortización Participaciones Hip.	37.496.055,82	
Amortización Préstamo B		37.808.866,18
Amortización Préstamos Subordinados		0,00
II. INTERESES		
Intereses recibidos de los DCs	1.645.109,38	
Intereses Préstamo B		277.071,21
Intereses Ptmos. Subordinados		299.694,30
Intereses Inversiones Temporales	15.644,90	
III. GASTOS		
Comisiones y gastos periódicos:		47.511,65
Neto swap a favor de la Parte A (BBVA)		41.885,67
Margen de Intermediación Financiera		0,00
Total Ingresos/Pagos	39.156.810,10	38.475.029,01
Saldo inicial FR a 24/11/14	29.318.218,91	
A Inversiones Temporales (FR)		30.000.000,00
Total	68.475.029,01	68.475.029,01

Destinatarios: CNMV; AIAF.



Nº: 859/15

Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

MADRID FTPYME IIFluj.trim\Feb15