

MADRID RESIDENCIAL II - Fondo de Titulización de Activos**LIQUIDACION DEL PERIODO 22/05/14 - 22/08/14**

| | Euros |
|--|----------------------|
| I. Situación al 22/05/14: | 49.721.167,50 |
| Fondo de Reserva | 49.721.167,50 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 8.592.990,08 |
| Principal: | |
| Según calendario hasta 31/07/14: | 3.417.133,55 |
| Amort. Anticipada hasta 31/07/14: | 3.666.460,76 |
| Intereses: | 1.509.395,77 |
| III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II): | 58.314.157,58 |
| IV. Total intereses de la reinversión: | 44.501,61 |
| Intereses de la Cta. de Tesorería | 44.501,61 |
| V. Recursos disponibles (III + IV): | 58.358.659,19 |
| VI. Gastos: | 131.258,04 |
| VII. Liquidación SWAP: | 10.245,22 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo): | 661.859,58 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (BBVA): | 672.104,80 |
| VIII. Pago a los Bonos: | 8.317.440,00 |
| Bono: | |
| Intereses correspondientes al 22/08/14: | 600.916,80 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 126.175,20 |
| Amortización correspondiente al 22/08/14: | 7.716.523,20 |
| Reinversión o devolución de las retenciones: | -126.175,20 |
| IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII): | 49.920.206,37 |
| Distribución del saldo disponible: | |
| Fondo de Reserva previo (22/05/14): | 49.721.167,50 |
| Aportación al Fondo de Reserva | -120.385,13 |
| Intereses préstamo B. pagados | 319.424,00 |
| Amortización préstamo B. | 0,00 |
| Remuneración Préstamo Constitución FR | 0,00 |
| Intereses Crédito Subordinado | 0,00 |
| Amortización Préstamo Constitución FR | 0,00 |
| Amortización Crédito Subordinado | 0,00 |
| Margen de Intermediación Financiera | 0,00 |

Fondo de Reserva (22/08/14):**49.600.782,37****Destinatarios: CNMV, AIAF.****Nº: 4888/14**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.
 Orense, 69
 28020 Madrid
 Tel.:917020808
<http://www.tda-sgft.com>

MADRID RESIDENCIAL II\liq.trim\Ago14

MADRID RESIDENCIAL II

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 22 de Agosto de 2014

Importes en euros

| I. BONO A ES0358969006 | Sobre 4560 bonos | Por Bono |
|---|------------------|------------------|
| 1. Saldo inicial (1/07/2010): | 456.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 327.506.313,60 € | 71.821,56 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 600.916,80 € | 131,78 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 7.716.523,20 € | 1.692,22 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 319.789.790,40 € | 70.129,34 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 70,129340% | 70,129340% |
| II. EL FONDO | | |
| Importes en euros | | |
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/07/14: | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas: | | 463.667.427,86 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas: | | 17.261.537,07 € |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas: | | 463.789.806,23 € |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidas: | | 17.963.013,93 € |
| 2. Amortización del período 30/04/14 a 31/07/14: | | |
| a) Según calendario: | | 3.417.133,55 € |
| b) Amortización anticipada hasta 31/07/14: | | 3.666.460,76 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | |
| b) Ultimo año: | | 2,76% |
| c) Ultimo semestre: | | 2,75% |
| d) Ultimo trimestre: | | 3,08% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | | 0,75% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 12 meses: | | 0,57% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | | 3,73% |
| 7. Nivel de Impago(2): | | 1,07% |

(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: 4889/14

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 69
28020 Madrid
Tel.: 917020808

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

MADRID RESIDENCIAL II\Infoinver.trim\Ago14 (Español)

MADRID RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACIÓN CORRESPONDIENTE AL PERIODO: 22/05/14-22/08/14
I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|---|---|
| Fecha de Constitución del Fondo | 29 de junio de 2010 |
| Fecha Emisión Bonos | 29 de junio de 2010 |
| Fecha Final Amortización Pasivo: (2,76% TAA) | 22 de febrero de 2034 |
| Sociedad Gestora | Titulización de Activos, SGFT,S.A. |
| Emisores de Certificados de Transmisión de Hipoteca | Bankia (Caja Madrid) |
| Agente de Pagos | Banco Santander |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencia de Calificación | Standard & Poor's / Moody's Investors Service |
| Calificación | (M) A3 sf / (S&P) A sf |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Nombre | Bonos de Titulización MADRID RESIDENCIAL II, FTA |
|---|---|
| Serie A: | |
| Código ISIN | ES0358969006 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 456.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 319.789.790,40 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 70.129,34 Euros |
| Préstamo B: | |
| Importe Inicial | 144.000.000,00 Euros |
| Importe vencido | 0,00 Euros |
| Nominal pendiente de vencimiento | 144.000.000,00 Euros |
| Nominal vencido y amortizado (pagado) | 0,00 Euros |
| Intereses devengados en el periodo | 319.424,00 Euros |
| Intereses devengados y no pagados | 0,00 Euros |

III. INFORMACION INCLUIDA

| |
|---|
| * Liquidación del Período:22/05/14-22/08/14 |
| * Flujos de Caja del Período:22/05/14-22/08/14 |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 22 de Agosto de 2014 |

MADRID RESIDENCIAL II**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/05/14 - 22/08/14**

| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | Euros | |
|--------------------------------------|----------------------|----------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| Amortización Bonos Titulización Hip. | | 7.716.523,20 |
| Amortización Participaciones Hip. | 7.083.594,31 | |
| Amortización Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados a los BTH | | 600.916,80 |
| Intereses recibidos de las CTHs | 1.509.395,77 | |
| Intereses Ptmos. Subordinados | | 319.424,00 |
| Intereses Inversiones Temporales | 44.501,61 | |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones Periódicas: | | 131.258,04 |
| Neto SWAP | 10.245,22 | |
| Margen de Intermediación Financiera | | 0,00 |
| Total Ingresos/Pagos | 8.647.736,91 | 8.768.122,04 |
| Saldo inicial 22/05/14 | 49.721.167,50 | |
| A Inversiones Temporales | | 49.600.782,37 |
| Total | 58.368.904,41 | 58.368.904,41 |
| Retenciones practicadas el 22/08/14 | 126.175,20 | |
| Inversiones Temporales | | 126.175,20 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 4894/14**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

MADRID RESIDENCIAL II\fluj.trim\Ago14