

MADRID FTPYME II

LIQUIDACION DEL PERIODO 22/05/12 - 22/08/12

	Euros
I. Situación al 22/05/12:	30.000.000,00
Fondo de Reserva	30.000.000,00
II. Fondos recibidos del emisor	99.801.195,73
Principal:	
Según calendario hasta 31/07/12:	73.904.636,73
Amort. Anticipada hasta 31/07/12:	17.560.640,64
Intereses:	8.335.918,36
III. Total intereses de la reinversión:	202.922,21
Intereses de la Cta. De Tesorería	202.922,21
IV. Recursos disponibles (I + II + III):	130.004.117,94
V. Varios:	51.564,61
VI. Liquidación SWAP:	-931.788,94
Cantidad a Pagar por la Parte A (CAIXABANK) :	1.957.863,07
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	2.889.652,01
VII. Pago a los Bonos:	94.711.347,00
Bonos A1:	
Intereses correspondientes al 22/08/12:	502.429,20
Retenciones practicadas a los bonos:	-105.502,00
Amortización correspondiente al 22/08/12:	76.083.997,80
Bonos A2 (G):	
Intereses correspondientes al 22/08/12:	2.743.640,00
Retenciones practicadas a los bonos:	-576.160,00
Amortización correspondiente al 22/08/12:	15.381.280,00
Reinversión o devolución de las retenciones (1):	681.662,00
VIII. Pago al Préstamo B	970.661,33
Intereses correspondientes al 22/08/12:	970.661,33
Amortización correspondiente al 22/08/12:	0,00
IX. Saldo disponible (IV - V + VI - VII - VIII):	33.338.756,06
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva previo 22/05/12:	30.000.000,00
Aportación al Fondo de Reserva	0,00
Intereses Crédito subordinado dispuesto	13.191,79
Amortización Crédito subordinado dispuesto	959.622,80
Intereses Préstamo para el Fondo de Reserva	75.440,00
Amortización del Préstamo para el Fondo de Reserva	0,00
Margen de Intermediación Financiera	2.290.501,47
Fondo de Reserva a 22/08/12:	30.000.000,00

(1) Hasta el 20/09/2012

Destinatarios: Emisor; CNMV; AIAF.



Nº: 5794/12

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

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

MADRID FTPYME II/Iq.trimAgo12

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 22 de Agosto de 2012

Importes en euros		
I. BONOS A1 ES0358933002	Sobre 2140 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (28/12/2011):	214.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	76.083.997,80 €	35.553,27 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	502.429,20 €	234,78 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	76.083.997,80 €	35.553,27 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	0,000000%	0,000000%
II. BONOS A2 (G) ES0358933010	Sobre 4000 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (28/12/2011):	400.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	400.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	2.743.640,00 €	685,91 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	15.381.280,00 €	3.845,32 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	384.618.720,00 €	96.154,68 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	96,154680%	96,154680%
Importes en euros		
III. EL FONDO		
1. Saldo de las participaciones hipotecarias a 31/07/12:		
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:		767.536.631,76 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:		0,00 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:		770.618.728,87 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:		0,00 €
2. Amortización del período 30/04/2012 a 31/07/12:		
a) Según calendario:		73.904.636,73 €
b) Amortización anticipada hasta 31/07/12:		17.560.640,64 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):		
a) Ultimo año:		-
b) Ultimo semestre:		7,80%
c) Ultimo trimestre:		7,92%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:		1,07%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 11 meses:		0,16%
6. Porcentaje de fallidos (1):		0,00%
7. Nivel de Impago (2)		0,77%

(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: 5795/12

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

MADRID FTPYME II Inforver.trimAgo12

MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL PERÍODO: 22/05/12-22/08/12

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 (teórica) (5% TAA)	22 de mayo 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 A1: (M) - (sf) / (S&P) - (sf) 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 A1:	
Código ISIN	ES0358933002
Nominal en circulación total (inicial)	214.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	0,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	0,00 Euros
Serie A2 (G):	
Código ISIN	ES0358933010
Nominal en circulación total (inicial)	400.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	384.618.720,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	96.154,68 Euros

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)	
Nombre	Bonos de Titulización MADRID FTPYME II, FTA
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	970.661,33 Euros
Intereses devengados y no pagados	0,00 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA
* Liquidación del Período: 22/05/12-22/08/12
* Flujos de Caja del Período: 22/05/12-22/08/12
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 22 de Agosto de 2012

MADRID FTPYME II*Fondo de Titulización de Activos***FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/05/12 - 22/08/12**

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip. Amortización Participaciones Hip. Amortización Préstamos Subordinados	91.465.277,37	91.465.277,80 959.622,80
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH Intereses recibidos de los DCs Intereses Préstamo B Intereses Ptmos. Subordinados Intereses Inversiones Temporales	8.335.918,36 202.922,21	3.246.069,20 970.661,33 88.631,79
III. GASTOS		
Comisiones y gastos periódicos: Neto swap a favor de la Parte A (CAIXABANK) Margen de Intermediación Financiera		51.564,61 931.788,94 2.290.501,47
Total Ingresos/Pagos	100.004.117,94	100.004.117,94
Saldo inicial FR a 22/05/12 A Inversiones Temporales (FR)	30.000.000,00	30.000.000,00
Total	130.004.117,94	130.004.117,94
Retenciones practicadas el 22/08/12 A Inv.Temporales hasta el 20/09/2012	681.662,00	681.662,00

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 5800/12**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

MADRID FTPYME II\fluj.trim\Ago12