

# ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.00

## I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Número de registro del Fondo: **10064**

NIF Fondo: **V-86356474**

Denominación del compartimento:

Número de registro del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

NIF gestora: **A-80352750**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2014**

## II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA



Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: <b>MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS</b>
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: <b>TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.</b>
Estados agregados: <b>No</b>
Periodo: <b>2º Semestre</b>
Ejercicio: <b>2014</b>

<b>BALANCE</b> (miles de euros)		<b>Periodo Actual</b> 31/12/2014		<b>Periodo Anterior</b> 31/12/2013
---------------------------------	--	-------------------------------------	--	---------------------------------------

<b>ACTIVO</b>				
---------------	--	--	--	--

<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0008	176.884	1008	286.909
-------------------------------	------	---------	------	---------

<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0010	176.884	1010	286.909
1. Valores representativos de deuda	0100	0	1100	0
1.1 Bancos centrales	0101	0	1101	0
1.2 Administraciones Públicas españolas	0102	0	1102	0
1.3 Entidades de crédito	0103	0	1103	0
1.4 Otros sectores residentes	0104	0	1104	0
1.5 Administraciones Públicas no residentes	0105	0	1105	0
1.6 Otros sectores no residentes	0106	0	1106	0
1.7 Activos dudosos	0107	0	1107	0
1.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0108		1108	
1.9 Intereses y gastos devengados no vencidos	0109	0	1109	0
1.10 Ajustes por operaciones de cobertura	0110	0	1110	0
2. Derechos de crédito	0200	176.576	1200	286.583
2.1 Participaciones hipotecarias	0201	0	1201	0
2.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0202	0	1202	0
2.3 Préstamos hipotecarios	0203	0	1203	0
2.4 Cédulas Hipotecarias	0204	0	1204	0
2.5 Préstamos a promotores	0205	0	1205	0
2.6 Préstamos a PYMES	0206	168.280	1206	265.394
2.7 Préstamos a empresas	0207	5.147	1207	17.396
2.8 Préstamos Corporativos	0208	0	1208	0
2.9 Cédulas territoriales	0209	0	1209	0
2.10 Bonos de Tesorería	0210	0	1210	0
2.11 Deuda Subordinada	0211	0	1211	0
2.12 Créditos AAPP	0212	0	1212	0
2.13 Préstamos Consumo	0213	0	1213	0
2.14 Préstamos automoción	0214	0	1214	0
2.15 Cuotas de Arrendamiento financiero (leasing)	0215	0	1215	0
2.16 Cuentas a cobrar	0216	0	1216	0
2.17 Derechos de crédito futuros	0217	0	1217	0
2.18 Bonos de titulación	0218	0	1218	0
2.19 Otros	0219	0	1219	0
2.20 Activos dudosos	0220	4.152	1220	5.032
2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0221	-1.003	1221	-1.239
2.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0222	0	1222	0
2.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0223	0	1223	0
3. Derivados	0230	308	1230	326
3.1 Derivados de cobertura	0231	308	1231	326
3.2 Derivados de negociación	0232	0	1232	0
4. Otros activos financieros	0240	0	1240	0
4.1 Garantías financieras	0241	0	1241	0
4.2 Otros	0242	0	1242	0

<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0250	0	1250	0
--	------	---	------	---

<b>III. Otros activos no corrientes</b>	0260	0	1260	0
---	------	---	------	---

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: <b>MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS</b>				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: <b>TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.</b>				
Estados agregados: <b>No</b>				
Periodo: <b>2º Semestre</b>				
Ejercicio: <b>2014</b>				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2014		Periodo Anterior 31/12/2013
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0270	141.022	1270	190.805
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0280	0	1280	0
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0290	84.532	1290	126.074
1. Deudores y otras cuentas a cobrar	0300	634	1300	1.410
2. Valores representativos de deuda	0310	0	1310	0
2.1 Bancos centrales	0311	0	1311	0
2.2 Administraciones Públicas españolas	0312	0	1312	0
2.3 Entidades de crédito	0313	0	1313	0
2.4 Otros sectores residentes	0314	0	1314	0
2.5 Administraciones Públicas no residentes	0315	0	1315	0
2.6 Otros sectores no residentes	0316	0	1316	0
2.7 Activos dudosos	0317	0	1317	0
2.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0318		1318	
2.9 Intereses y gastos devengados no vencidos	0319	0	1319	0
2.10 Ajustes por operaciones de cobertura	0320	0	1320	0
2.11 Intereses vencidos e impagados	0330	0	1330	0
3. Derechos de crédito	0400	83.675	1400	124.517
3.1 Participaciones hipotecarias	0401	0	1401	0
3.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0402	0	1402	0
3.3 Préstamos hipotecarios	0403	0	1403	0
3.4 Cédulas Hipotecarias	0404	0	1404	0
3.5 Préstamos a promotores	0405	0	1405	0
3.6 Préstamos a PYMES	0406	73.839	1406	107.468
3.7 Préstamos a empresas	0407	9.544	1407	16.836
3.8 Préstamos Corporativos	0408	0	1408	0
3.9 Cédulas territoriales	0409	0	1409	0
3.10 Bonos de Tesorería	0410	0	1410	0
3.11 Deuda Subordinada	0411	0	1411	0
3.12 Créditos AAPP	0412	0	1412	0
3.13 Préstamos Consumo	0413	0	1413	0
3.14 Préstamos automoción	0414	0	1414	0
3.15 Arrendamiento financiero	0415	0	1415	0
3.16 Cuentas a cobrar	0416	0	1416	0
3.17 Derechos de crédito futuros	0417	0	1417	0
3.18 Bonos de titulización	0418	0	1418	0
3.19 Otros	0419	0	1419	0
3.20 Activos dudosos	0420	15.574	1420	12.639
3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0421	-15.811	1421	-13.126
3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0422	288	1422	441
3.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0423	0	1423	0
3.24 Intereses vencidos e impagados	0424	241	1424	259
4. Derivados	0430	221	1430	136
4.1 Derivados de cobertura	0431	221	1431	136
4.2 Derivados de negociación	0432	0	1432	0
5. Otros activos financieros	0440	2	1440	11
5.1 Garantías financieras	0441	0	1441	0
5.2 Otros	0442	2	1442	11
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0450	2	1450	1
1. Comisiones	0451	0	1451	0
2. Otros	0452	2	1452	1
<b>VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes</b>	0460	56.488	1460	64.730
1. Tesorería	0461	56.488	1461	64.730
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462	0	1462	0

TOTAL ACTIVO	0500	317.906	1500	477.714
--------------	------	---------	------	---------

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: <b>MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS</b>				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: <b>TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.</b>				
Estados agregados: <b>No</b>				
Periodo: <b>2º Semestre</b>				
Ejercicio: <b>2014</b>				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2014		Periodo Anterior 31/12/2013
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0650	317.134	1650	411.723
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0660	0	1660	0
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0700	317.134	1700	411.723
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	0	1710	0
1.1 Series no subordinadas	0711	0	1711	0
1.2 Series subordinadas	0712	0	1712	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0713		1713	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0714	0	1714	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0715	0	1715	0
2. Deudas con entidades de crédito	0720	317.134	1720	411.723
2.1 Préstamo subordinado	0721	32.495	1721	32.495
2.2 Crédito línea de liquidez	0722	0	1722	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0723	287.692	1723	386.000
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0724	-3.053	1724	-6.772
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0725	0	1725	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0726	0	1726	0
3. Derivados	0730	0	1730	0
3.1 Derivados de cobertura	0731	0	1731	0
3.2 Derivados de negociación	0732	0	1732	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0733		1733	
4. Otros pasivos financieros	0740	0	1740	0
4.1 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0741		1741	
4.2 Otros	0742	0	1742	0
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	0750	0	1750	0
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0760	537	1760	65.728
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0770	0	1770	0
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	0780	0	1780	0
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	0800	435	1800	65.623
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	0	1810	0
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	0	1820	58.111
2.1 Series no subordinadas	0821	0	1821	57.972
2.2 Series subordinadas	0822	0	1822	0
2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0823		1823	
2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0824	0	1824	139
2.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0825	0	1825	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0826	0	1826	0
3. Deudas con entidades de crédito	0830	435	1830	362
3.1 Préstamo subordinado	0831	0	1831	0
3.2 Crédito línea de liquidez	0832	0	1832	0
3.3 Otras deudas con entidades de crédito	0833	0	1833	0
3.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0834		1834	
3.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0835	125	1835	245
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836	0	1836	0
3.7 Intereses vencidos e impagados	0837	310	1837	117
4. Derivados	0840	0	1840	0
4.1 Derivados de cobertura	0841	0	1841	0
4.2 Derivados de negociación	0842	0	1842	0
4.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0843		1843	
5. Otros pasivos financieros	0850	0	1850	7.150
5.1 Importe bruto	0851	0	1851	7.150
5.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0852		1852	

<b>VII. Ajustes por periodificación</b>	0900	102	1900	105
1. Comisiones	0910	15	1910	18
1.1 Comisión sociedad gestora	0911	10	1911	11
1.2 Comisión administrador	0912	3	1912	5
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0913	2	1913	2
1.4 Comisión variable - resultados realizados	0914	0	1914	0
1.5 Comisión variable - resultados no realizados	0915	0	1915	0
1.6 Otras comisiones del cedente	0916	0	1916	0
1.7 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0917		1917	
1.8 Otras comisiones	0918	0	1918	0
2. Otros	0920	87	1920	87
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0930	235	1930	263
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0940	0	1940	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0950	235	1950	263
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0960	0	1960	0
<b>XI. Gastos de constitución en transición</b>	0970		1970	
<b>TOTAL PASIVO</b>	1000	317.906	2000	477.714

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.02

Denominación del Fondo: MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS								
Denominación del compartimento:								
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.								
Estados agregados: No								
Periodo: 2º Semestre								
Ejercicio: 2014								

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. Corriente Actual 2º semestre		P. Corriente Anterior 2º semestre		Acumulado Actual 31/12/2014		Acumulado Anterior 31/12/2013	
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0100	3.903	1100	6.493	2100	8.935	3100	15.191	
1.1 Valores representativos de deuda	0110	0	1110	0	2110	0	3110	0	
1.2 Derechos de crédito	0120	3.848	1120	6.421	2120	8.806	3120	15.038	
1.3 Otros activos financieros	0130	55	1130	72	2130	129	3130	153	
<b>2. Intereses y cargas asimiladas</b>	0200	-928	1200	-2.450	2200	-2.381	3200	-6.368	
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210		1210	-1.346	2210	-267	3210	-4.195	
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220	-928	1220	-1.104	2220	-2.114	3220	-2.173	
2.3 Otros pasivos financieros	0230		1230		2230		3230		
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0240	-10	1240	-202	2240	-46	3240	-772	
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0250	2.965	1250	3.841	2250	6.508	3250	8.051	
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	0300	1	1300	0	2300	0	3300	1	
4.1 Ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0310	0	1310	0	2310	0	3310	0	
4.2 Activos financieros disponibles para la venta	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0	
4.3 Otros	0330	1	1330	0	2330	0	3330	1	
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0400	0	1400	0	2400	0	3400	0	
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0500	0	1500	0	2500	0	3500	0	
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0600	-88	1600	-92	2600	-194	3600	-877	
7.1 Servicios exteriores	0610	-11	1610	-1	2610	-30	3610	-38	
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611	-11	1611	-1	2611	-30	3611	-38	
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0612		1612		2612		3612		
7.1.3 Publicidad y propaganda	0613		1613		2613		3613		
7.1.4 Otros servicios	0614		1614		2614		3614		
7.2 Tributos	0620	0	1620	0	2620	0	3620	0	
7.3 Otros gastos de gestión corrientes	0630	-77	1630	-91	2630	-164	3630	-839	
7.3.1 Comisión de sociedad gestora	0631	-51	1631	-51	2631	-103	3631	-103	
7.3.2 Comisión administrador	0632	-17	1632	-26	2632	-38	3632	-58	
7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos	0633	-9	1633	-9	2633	-18	3633	-18	
7.3.4 Comisión variable - resultados realizados (neto)	0634	0	1634	0	2634	0	3634	-655	
7.3.5 Comisión variables - resultados no realizados (neto)	0635	0	1635	0	2635	0	3635	0	
7.3.6 Otras comisiones del cedente	0636		1636		2636		3636		
7.3.7 Otros gastos	0637	0	1637	-5	2637	-5	3637	-5	
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0700	-2.967	1700	-8.999	2700	-2.595	3700	-9.041	
8.1 Deterioro neto de valores representativos de deuda	0710	0	1710	0	2710	0	3710	0	
8.2 Deterioro neto de derechos de crédito	0720	-2.967	1720	-8.999	2720	-2.595	3720	-9.041	
8.3 Deterioro neto de derivados	0730	0	1730	0	2730	0	3730	0	
8.4 Deterioro neto de otros activos financieros	0740	0	1740	0	2740	0	3740	0	
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	0750	0	1750	0	2750	0	3750	0	
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0800	0	1800	0	2800	0	3800	0	
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0850	89	1850	5.250	2850	-3.719	3850	1.866	
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0900	0	1900	0	2900	0	3900	0	
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0950	0	1950	0	2950	0	3950	0	
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	3000	0	4000	0	5000	0	6000	0	

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.03

Denominación del Fondo: <b>MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS</b>
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: <b>TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.</b>
Estados agregados: <b>No</b>
Periodo: <b>2º Semestre</b>
Ejercicio: <b>2014</b>

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2014		Mismo Periodo año Anterior 31/12/2013
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN</b>	8000	6.366	9000	6.762
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	8100	6.527	9100	7.600
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	8.977	9110	15.549
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-406	9120	-4.817
1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados	8130	-141	9130	-1.255
1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras	8140	138	9140	155
1.5 Intereses pagados por préstamos y créditos en entidades de crédito	8150	-2.041	9150	-2.032
1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	8160	0	9160	0
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo</b>	8200	-160	9200	-837
2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora	8210	-103	9210	-103
2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados	8220	-39	9220	-61
2.3 Comisiones pagadas al agente financiero	8230	-18	9230	-18
2.4 Comisiones variables pagadas	8240		9240	-655
2.5 Otras comisiones	8250		9250	
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo</b>	8300	-1	9300	-1
3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos	8310	0	9310	0
3.2 Pagos de provisiones	8320		9320	
3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta	8325		9325	
3.4 Otros	8330	-1	9330	-1
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION</b>	8350	-14.608	9350	-33.557
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	8400	0	9400	0
4.1 Cobros por emisión de valores de titulización	8410	0	9410	0
4.2 Pagos por emisión de valores de titulización (aseguramiento colocación)	8420		9420	
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	8500		9500	
5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito	8510		9510	
5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras	8520		9520	
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones</b>	8600	90.885	9600	-30.392
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	148.857	9610	232.873
6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados	8620	0	9620	0
6.3 Pagos por amortización de valores de titulización	8630	-57.972	9630	-263.265
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	8700	-105.493	9700	-3.165
7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos	8710	0	9710	0
7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos	8720	-105.458	9720	-3.122
7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso	8730	0	9730	0
7.4 Administraciones públicas - Pasivo	8740	0	9740	0
7.5 Otros deudores y acreedores	8750	-35	9750	-43
7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras	8770	0	9770	0
7.7 Cobros de Subvenciones	8780	0	9780	0
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	8800	-8.242	9800	-26.795
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	64.730	9900	91.525
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	56.488	9990	64.730



ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.04

Denominación del Fondo: <b>MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS</b>
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: <b>TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.</b>
Estados agregados: <b>No</b>
Periodo: <b>2º Semestre</b>
Ejercicio: <b>2014</b>

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS <i>(miles de euros)</i>		Periodo Actual 31/12/2014		Mismo Periodo año Anterior 31/12/2013
<b>1 Activos financieros disponibles para la venta</b>				
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6010	0	7010	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6020	0	7020	0
1.1.2 Efecto fiscal	6021	0	7021	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6022	0	7022	0
1.3 Otras reclasificaciones	6030	0	7030	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6040	0	7040	0
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>6100</b>	<b>0</b>	<b>7100</b>	<b>0</b>
<b>2 Cobertura de los flujos de efectivo</b>				
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6110	-74	7110	318
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6120	-74	7120	318
2.1.2 Efecto fiscal	6121	0	7121	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6122	46	7122	772
2.3 Otras reclasificaciones	6130	0	7130	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6140	28	7140	-1.090
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>6200</b>	<b>0</b>	<b>7200</b>	<b>0</b>
<b>3 Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>				
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el periodo	6310	0	7310	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6320	0	7320	0
3.1.2 Efecto fiscal	6321	0	7321	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6322	0	7322	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6330	0	7330	0
<b>Total Ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>6400</b>	<b>0</b>	<b>7400</b>	<b>0</b>
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>6500</b>	<b>0</b>	<b>7500</b>	<b>0</b>

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2014**

Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANKIA**

### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)*

Tipología de activos titulizados	Situación actual 31/12/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Situación inicial 23/12/2011			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)		
Participaciones hipotecarias	0001		0030		0060		0090		0120		0150	
Certificados de transmisión hipotecaria	0002		0031		0061		0091		0121		0151	
Préstamos hipotecarios	0003		0032		0062		0092		0122		0152	
Cédulas hipotecarias	0004		0033		0063		0093		0123		0153	
Préstamos a promotores	0005		0034		0064		0094		0124		0154	
Préstamos a PYMES	0007	3.645	0036	261.846	0066	4.729	0096	390.533	0126	7.392	0156	879.141
Préstamos a empresas	0008	17	0037	14.691	0067	28	0097	34.232	0127	54	0157	120.859
Préstamos Corporativos	0009		0038		0068		0098		0128		0158	
Cédulas territoriales	0010		0039		0069		0099		0129		0159	
Bonos de tesorería	0011		0040		0070		0100		0130		0160	
Deuda subordinada	0012		0041		0071		0101		0131		0161	
Créditos AAPP	0013		0042		0072		0102		0132		0162	
Préstamos consumo	0014		0043		0073		0103		0133		0163	
Préstamos automoción	0015		0044		0074		0104		0134		0164	
Arrendamiento financiero	0016		0045		0075		0105		0135		0165	
Cuentas a cobrar	0017		0046		0076		0106		0136		0166	
Derechos de crédito futuros	0018		0047		0077		0107		0137		0167	
Bonos de titulización	0019		0048		0078		0108		0138		0168	
Otros	0020		0049		0079		0109		0139		0169	
<b>Total</b>	<b>0021</b>	<b>3.662</b>	<b>0050</b>	<b>276.537</b>	<b>0080</b>	<b>4.757</b>	<b>0110</b>	<b>424.765</b>	<b>0140</b>	<b>7.446</b>	<b>0170</b>	<b>1.000.000</b>

(1) Entendido como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2014**

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)*

#### CUADRO B

Movimiento de la cartera de activos titulizados/Tasa de amortización anticipada	Situación actual 31/12/2014		Situación cierre anual anterior 31/12/2013	
	Código	Importe	Código	Importe
Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior	0196	-146	0206	-47
Derechos de crédito dados de baja por dación/adjudicación de bienes desde el cierre anual anterior	0197		0207	
Amortización ordinaria desde el cierre anual anterior	0200	-119.319	0210	-176.658
Amortización anticipada desde el cierre anual anterior	0201	-28.763	0211	-56.089
Total importe amortizado acumulado, incluyendo adjudicaciones y otros pagos en especie, desde el origen del Fondo	0202	-723.270	0212	-575.188
Importe de principal pendiente de amortización de los nuevos activos incorporados en el periodo (1)	0203	0	0213	0
<b>Principal pendiente cierre del periodo (2)</b>	0204	276.537	0214	424.765
<b>Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)</b>	0205	6,77	0215	8,53

(1) En fondos abiertos, importe de principal pendiente de reembolso en la fecha de presentación de la información de los nuevos activos incorporados en el periodo

(2) Importe del principal pendiente de reembolso de la totalidad de los activos (incluidas las nuevas incorporaciones del periodo) a fecha del informe

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2014**

Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANKIA**

### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

#### CUADRO C

Total Impagados (1)	Nº de activos	Importe impagado							Deuda Total			
		Principal pendiente vencido		Intereses ordinarios (2)		Total		Principal pendiente no vencido				
Hasta 1 mes	0700	149	0710	165	0720	12	0730	177	0740	6.495	0750	6.672
De 1 a 3 meses	0701	63	0711	260	0721	32	0731	292	0741	4.623	0751	4.915
De 3 a 6 meses	0703	28	0713	341	0723	23	0733	364	0743	1.592	0753	1.956
De 6 a 9 meses	0704	22	0714	151	0724	19	0734	170	0744	639	0754	809
De 9 a 12 meses	0705	25	0715	362	0725	37	0735	399	0745	789	0755	1.188
De 12 meses a 2 años	0706	89	0716	3.219	0726	265	0736	3.484	0746	2.756	0756	6.240
Más de 2 años	0708	125	0718	7.640	0728	562	0738	8.202	0748	1.893	0758	10.095
<b>Total</b>	<b>0709</b>	<b>501</b>	<b>0719</b>	<b>12.138</b>	<b>0729</b>	<b>950</b>	<b>0739</b>	<b>13.088</b>	<b>0749</b>	<b>18.787</b>	<b>0759</b>	<b>31.875</b>

(1) La distribución de los activos vencidos impagados entre los distintos tramos señalados se realizará en función de la antigüedad de la primera cuota vencida y no cobrada. Los intervalos se entenderán excluido el de inicio e incluido el final (p.e. De 1 a 3 meses, esto es: superior a 1 mes y menor o igual a 3 meses)

(2) Importe de intereses cuyo devengo, en su caso, se ha interrumpido conforme lo establecido en el apartado 12 de la norma 13ª de la Circular(p.e. De 1 a 3 meses, esto es: superior a 1 mes y menor o igual a 3 meses)

Impagados con garantía real (2)	Nº de activos	Importe impagado							Deuda Total	Valor garantía (3)	Valor Garantía con Tasación > 2 años (4)	% Deuda/v. Tasación				
		Principal pendiente vencido		Intereses ordinarios		Total		Principal pendiente no vencido								
Hasta 1 mes	0772	3	0782	1	0792	1	0802	2	0812	301	0822	303	0832	505	0842	59,99
De 1 a 3 meses	0773	1	0783	1	0793	0	0803	1	0813	65	0823	66	0833	53	0843	127,08
De 3 a 6 meses	0774	0	0784	0	0794	0	0804	0	0814	0	0824	0	0834	0	0844	0,00
De 6 a 9 meses	0775	0	0785	0	0795	0	0805	0	0815	0	0825	0	0835	0	0845	0,00
De 9 a 12 meses	0776	0	0786	0	0796	0	0806	0	0816	0	0826	0	0836	0	0846	0,00
De 12 meses a 2 años	0777	1	0787	52	0797	8	0807	60	0817	405	0827	465	0837	724	0847	64,35
Más de 2 años	0778	0	0788	0	0798	0	0808	0	0818	0	0828	0	0838	0	0848	0,00
<b>Total</b>	<b>0779</b>	<b>5</b>	<b>0789</b>	<b>54</b>	<b>0799</b>	<b>9</b>	<b>0809</b>	<b>63</b>	<b>0819</b>	<b>771</b>	<b>0829</b>	<b>834</b>	<b>0839</b>	<b>1.282</b>	<b>0849</b>	<b>65,05</b>

(2) La distribución de los activos vencidos impagados entre los distintos tramos señalados se realizará en función de la antigüedad de la primera cuota vencida y no cobrada. Los intervalos se entenderán excluido el de inicio e incluido el final (p.e. De 1 a 2 meses, estos es: superior a 1 mes y menor o igual a 2 meses)

(3) Cumplimentar con la última valoración disponible de tasación del inmueble o valor razonable de la garantía real (acciones o deuda pignoral, etc.) si el valor de las mismas se ha considerado en el momento inicial del Fondo

(4) Se incluirá el valor de las garantías que tengan una tasación superior a dos años

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.

Estados agregados: No

Periodo: 2º Semestre

Ejercicio: 2014

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

CUADRO D	Situación actual 31/12/2014						Situación cierre anual anterior 31/12/2013						Escenario inicial					
	Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)		Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)		Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)	
Participaciones hipotecarias	0850		0868		0886		0904		0922		0940		0958		0976		0994	
Certificados de transmisión de hipoteca	0851		0869		0887		0905		0923		0941		0959		0977		0995	
Préstamos hipotecarios	0852		0870		0888		0906		0924		0942		0960		0978		0996	
Cédulas Hipotecarias	0853		0871		0889		0907		0925		0943		0961		0979		0997	
Préstamos a promotores	0854		0872		0890		0908		0926		0944		0962		0980		0998	
Préstamos a PYMES	0855	7,53	0873	0,07	0891	0,00	0909	4,52	0927	0,01	0945	0,00	0963	0,00	0981	0,00	0999	0,00
Préstamos a empresas	0856	0,00	0874	0,00	0892	0,00	0910	0,00	0928	0,00	0946	0,00	0964	0,00	0982	0,00	1000	0,00
Préstamos Corporativos	0857		0875		0893		0911		0929		0947		0965		0983		1001	
Cédulas Territoriales	1066		1084		1102		1120		1138		1156		1174		1192		1210	
Bonos de Tesorería	0858		0876		0894		0912		0930		0948		0966		0984		1002	
Deuda subordinada	0859		0877		0895		0913		0931		0949		0967		0985		1003	
Créditos AAPP	0860		0878		0896		0914		0932		0950		0968		0986		1004	
Préstamos Consumo	0861		0879		0897		0915		0933		0951		0969		0987		1005	
Préstamos automoción	0862		0880		0898		0916		0934		0952		0970		0988		1006	
Cuotas arrendamiento financiero	0863		0881		0899		0917		0935		0953		0971		0989		1007	
Cuentas a cobrar	0864		0882		0900		0918		0936		0954		0972		0990		1008	
Derechos de crédito futuros	0865		0883		0901		0919		0937		0955		0973		0991		1009	
Bonos de titulización	0866		0884		0902		0920		0938		0956		0974		0992		1010	
Otros	0867		0885		0903		0921		0939		0957		0975		0993		1011	

(1) Estos ratios se referirán exclusivamente a la cartera de activos cedidos al Fondo (presentados en el balance en la partida de "derechos de crédito") y se expresaran en términos porcentuales

(A) Determinada por el cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos a la fecha de presentación de la información, y el principal pendiente (sin incluir intereses, e incluyendo principales impagados) del total activos dados de alta en el balance a la fecha de presentación de la información. La clasificación como dudosos se realizará con arreglo a lo previsto en las Normas 13ª y 23ª

(B) Determinada por el cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos a la fecha de presentación de la información, y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en el balance a la fecha de presentación de la información más el principal de los activos clasificados como fallidos. Se considerará la definición de fallidos recogida en la Circular (no necesariamente coincidentes con la definición de la escritura o folleto, recogidas en el estado 5.4)

(D) Determinada por el cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo periodo del año anterior y el importe de principal de activos clasificados como fallidos al cierre del mismo periodo del año anterior

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2014**

Entidades cedentes de los activos titulizados: **BANKIA**

### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)*

CUADRO E Vida residual de los activos cedidos al Fondo (1)	Situación actual 31/12/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Situación inicial 23/12/2011			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente			Nº de activos vivos	Principal pendiente			Nº de activos vivos	Principal pendiente		
Inferior a 1 año	1300	1.426	1310	28.663	1320	890	1330	21.255	1340	881	1350	81.497
Entre 1 y 2 años	1301	729	1311	43.881	1321	1.483	1331	67.598	1341	1.059	1351	108.307
Entre 2 y 3 años	1302	410	1312	29.528	1322	790	1332	76.875	1342	973	1352	95.405
Entre 3 y 5 años	1303	387	1313	41.922	1323	748	1333	81.991	1343	2.726	1353	334.217
Entre 5 y 10 años	1304	595	1314	106.407	1324	708	1334	129.341	1344	1.359	1354	241.811
Superior a 10 años	1305	115	1315	26.135	1325	138	1335	47.705	1345	448	1355	138.762
<b>Total</b>	1306	3.662	1316	276.536	1326	4.757	1336	424.765	1346	7.446	1356	999.999
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	1307	5,16			1327	5,16			1347	5,22		

(1) Los intervalos se entenderán excluido el inicio del mismo e incluido el final (p.e. Entre 1 y 2 años: superior a 1 año y menor o igual a 2 años)

Antigüedad	Situación actual 31/12/2014		Situación cierre anual anterior 31/12/2013		Situación inicial 23/12/2011	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	5,51	0632	4,33	0634	2,03

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2014**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)*

CUADRO A		Situación actual 31/12/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Escenario inicial 23/12/2011			
		Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente
Serie (2)		0001	0002	0003	0004	0005	0006	0007	0008	0009	0070	0080	0090
ES0358933002	Bono A1	2.140	0	0	0,00	2.140	0	0	0,00	2.140	100	214.000	0,39
ES0358933010	Bono A2 (G)	4.000	0	0	0,00	4.000	14	57.972	0,02	4.000	100	400.000	1,46
<b>Total</b>		8006	6.140	8025	0	8045	6.140	8065	57.972	8085	6.140	8105	614.000

(1) Importes en años. En caso de ser estimado se indicará en las notas explicativas las hipótesis de estimación

(2) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2014**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)*

Serie (1)		Denominación serie	Grado de subordinación (2)	Índice de referencia (3)	Margen (4)	Tipo aplicado	Intereses				Principal pendiente		Corrección de valor por repercusión de pérdidas						
							Base de cálculo de intereses	Días Acumulados (5)	Intereses Acumulados (6)	Intereses impagados	Principal no vencido	Principal impagado			Total pendiente				
			9950	9960	9970	9980	9990	9991	9993	9997	9994	9995	9998	9995					
ES0358933002	Bono A1	NS		EURIBOR 3 m	1,90	0,00	360	37	0	0	0	0	0	0					
ES0358933010	Bono A2 (G)	NS		EURIBOR 3 m	2,00	0,00	360	37	0	0	0	0	0	0					
<b>Total</b>									9228	0	9105	0	9085	0	9095	0	9115	0	9227

(1) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

(2) La gestora deberá indicar si la serie es subordinada o no subordinada (S=Subordinada; NS=No subordinada)

(3) La gestora deberá cumplimentar el índice de referencia que corresponda en cada caso (EURIBOR un año, EURIBOR a tres meses...). En el caso de tipos fijos esta columna se cumplimentará con el término "fijo"

(4) En el caso de tipos fijos esta columna no se cumplimentará

(5) Días acumulados desde la última fecha de pago

(6) Intereses acumulados desde la última fecha de pago



## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2014**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)*

CUADRO C			Situación actual 31/12/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013			
			Amortización principal		Intereses		Amortización principal		Intereses	
Serie (1)	Denominación serie	Fecha final (2)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)
		7290	7300	7310	7320	7330	7340	7350	7360	7370
ES0358933002	Bono A1	22-08-2012	0	214.000	0	2.798	0	214.000	0	2.798
ES0358933010	Bono A2 (G)	22-05-2014	57.972	400.000	406	15.280	263.265	342.028	4.817	14.874
<b>Total</b>			7305	57.972	7315	614.000	7325	406	7335	18.078
							7345	263.265	7355	556.028
									7365	4.817
									7375	17.672

(1) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

(2) Entendiendo como fecha final aquella que de acuerdo con la documentación contractual determine la extinción del Fondo, siempre que no se haya producido previamente una causa de liquidación anticipada

(3) Total de pagos realizados desde el último cierre anual

(4) Total de pagos realizados desde la fecha de constitución del Fondo

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Período: **2º Semestre**

Ejercicio: **2014**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

#### CUADRO D

Serie (1)	Denominación serie	Calificación				
		Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Situación actual	Situación anual cierre anterior	Situación inicial
		3310	3330	3350	3360	3370
ES0358933002	Bono A1	02-07-2012	MDY	A3	A3	Aaa
ES0358933002	Bono A1	11-10-2012	SYP	AA-	AA-	AAA
ES0358933010	Bono A2 (G)	17-03-2014	MDY	A1	A3	Aaa
ES0358933010	Bono A2 (G)	11-10-2012	SYP	AA-	AA-	AAA

(1) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

(2) La gestora deberá cumplimentar la calificación crediticia otorgada por cada agencia de rating, cuya denominación también deberá ser cumplimentada, para serie - MDY para Moody's; SYP para Standard & Poors; FCH para Fitch; DBRS para Dominion Bond Rating Service -

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.3

Denominación del Fondo: <b>MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS</b> Denominación del compartimento: Denominación de la gestora: <b>TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.</b> Estados agregados: <b>No</b> Periodo: <b>2º Semestre</b> Ejercicio: <b>2014</b>
---

<b>INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS</b> <i>(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)</i>		Situación actual 31/12/2014		Situación cierre anual anterior 31/12/2013
1. Importe del Fondo de Reserva	0010	29.318	1010	27.518
2. Porcentaje que representa el Fondo de Reserva, u otras mejoras equivalentes, sobre el total de activos titulizados	0020	10,60	1020	6,48
3. Exceso de spread (%) (1)	0040		1040	0,60
4. Permuta financiera de intereses (S/N)	0050	Si	1050	Si
5. Permuta financiera de tipos de cambio (S/N)	0070	No	1070	No
6. Otras permutas financieras (S/N)	0080	No	1080	No
7. Importe disponible de la línea/s de liquidez (2)	0090	0	1090	0
8. Subordinación de series (S/N)	0110	No	1110	No
9. Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total de bonos (3)	0120		1120	100,00
10. Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales	0150	0	1150	57.972
11. Porcentaje que representa el aval sobre el total de los pasivos emitidos	0160		1160	100,00
12. Importe máximo de riesgo cubierto por derivados de crédito u otras garantías financieras adquiridas	0170	0	1170	0
13. Otros (S/N) (4)	0180	Si	1180	Si
(1) Diferencial existente entre los tipos de interés medios ponderados percibidos de la cartera de activos titulizados conforme se establece en el Cuadro 5.5.E y el tipo de interés medio de los pasivos emitidos cuya finalidad ha sido la adquisición de los activos (2) Se incluirá el importe total disponible de las distintas líneas de liquidez en caso de que haya más de una (3) Entendiendo como no subordinadas aquellas series que en la fecha se encuentren, respecto a las demás, en una posición anterior para el cobro de capital conforme al orden de prelación de pagos (4) La gestora deberá incluir una descripción de dichas mejoras crediticias en las notas explicativas en caso de que las consideren relevantes				

<b>Información sobre contrapartes de las mejoras crediticias</b>		NIF		Denominación
Contraparte del Fondo de Reserva u otras mejores equivalentes (5)	0200		1210	Caja Madrid
Permutas financieras de tipos de interés	0210		1220	BBVA
Permutas financieras de tipos de cambio	0220		1230	N/A
Otras permutas financieras	0230		1240	N/A
Contraparte de la Línea de Liquidez	0240		1250	N/A
Entidad Avalista	0250		1260	Ministerio de Economía
Contraparte del derivado de crédito	0260		1270	N/A

(5) Si el Fondo de Reserva se ha constituido a través de títulos emitidos y se desconoce el titular de esos títulos no se cumplimentará

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.4

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **2º Semestre**  
 Ejercicio: **2014**

**CIRCUNSTANCIAS ESPECÍFICAS ESTABLECIDAS CONTRACTUALMENTE EN EL FONDO**

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

Concepto (1)	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio (2)				Ref. Folleto		
	0100	0200	0300	0400	Situación actual	Periodo anterior	Situación actual	Periodo anterior	Situación actual	Periodo anterior	Última Fecha Pago				
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	0010		0030	90	0100	3.757	0200	5.059	0300	0,01	0400	0,02	1120	0,01	
2. Activos Morosos por otras razones					0110		0210		0310		0410		1130		
<b>Total Morosos</b>					0120	3.757	0220	5.059	0320	0,01	0420	0,02	1140	0,01	1280
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	0050	12	0060		0130	15.832	0230	15.521	0330	0,06	0430	0,05	1050	0,05	
4. Activos Fallidos por otras razones					0140	0	0240	0	0340	0,00	0440	0,00	1160	0,00	
<b>Total Fallidos</b>					0150	15.832	0250	15.521	0350	0,06	0450	0,05	1200	0,05	1290

(1) En caso de existir definiciones adicionales a las recogidas en la presente tabla (moros cualificadas, fallidos subjetivos, etc) respecto a las que se establezca algún trigger se indicarán en la tabla de Otros ratios relevantes, indicando el nombre del ratio

(2) Los ratios se corresponden al importe total de activos fallidos o morosos entre el saldo vivo de los activos cedidos al fondo según se defina en la documentación contractual. En la columna Ref. Folleto se indicará el epígrafe o capítulo del folleto en el que el concepto esté definido

Otros ratios relevantes	Ratio (2)				Ref. Folleto
	Situación actual	periodo anterior	Última Fecha Pago		
N/A	0160	0260	0360	0460	

TRIGGERS (3)	Límite	% Actual	Última Fecha Pago		Ref. Folleto		
			Pago				
<b>Amortización secuencial: series (4)</b>	0500	0520	0540	0560			
Bono A2 (G) ES0358933010	77,20	100,00	100,00		4.9.4 Nota de Valores		
Bono A2 (G) ES0358933010	1,50	1,44	1,23		4.9.4 Nota de Valores		
Bono A2 (G) ES0358933010	10,00	26,07	28,77		4.9.4 Nota de Valores		
Bono A2 (G) ES0358933010	2,50	1,84	1,81		4.9.3 Nota de Valores		
Bono A1 ES0358933002	2,50	1,84	1,81		4.9.3 Nota de Valores		
Bono A1 ES0358933002	77,20	100,00	100,00		4.9.4 Nota de Valores		
Bono A1 ES0358933002	1,50	1,44	1,23		4.9.4 Nota de Valores		
Bono A1 ES0358933002	10,00	26,07	28,77		4.9.4 Nota de Valores		
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series (5)</b>	0506	0526	0546	0566			
Bono A2 (G) ES0358933010	6,50	1,58	1,55		3.4.6.2. Modulo Adicional		
<b>No Reducción del Fondo de Reserva (6)</b>	0512	0532	0,00	0552	0,00	0572	3.4.2.2. Modulo Adicional

OTROS TRIGGERS (3)		0513		0523		0553		0573
N/A								

(3) En caso de existir triggers adicionales a los recogidos en la presente tabla se indicarán su nombre o concepto debajo de OTROS TRIGGERS. Si los triggers recogidos expresamente en la tabla no están previstos en el Fondo, no se cumplimentarán

(4) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto al modo de amortización (prorrata/secuencial) de algunas de las series se indicarán las series afectadas indicando su ISIN, y en su defecto el nombre, el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

(5) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto al diferimiento o postergamiento de intereses de algunas de las series se indicarán las series afectadas indicando su ISIN o nombre, el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

(6) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto a la no reducción del fondo de reserva se indicará el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

--

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2014**

### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)*

CUADRO A Distribución geográfica de activos titulizados	Situación actual 31/12/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Situación inicial 23/12/2011			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)	
Andalucía	0400	312	0426	21.344	0452	377	0478	31.558	0504	565	0530	60.440
Aragón	0401	51	0427	4.466	0453	67	0479	6.516	0505	98	0531	13.094
Asturias	0402	27	0428	3.894	0454	43	0480	5.702	0506	63	0532	10.530
Baleares	0403	55	0429	2.955	0455	70	0481	6.779	0507	101	0533	28.086
Canarias	0404	32	0430	4.328	0456	47	0482	6.564	0508	84	0534	21.207
Cantabria	0405	27	0431	991	0457	36	0483	1.976	0509	57	0535	3.789
Castilla-León	0406	155	0432	21.793	0458	191	0484	27.150	0510	288	0536	45.627
Castilla La Mancha	0407	524	0433	25.444	0459	669	0485	36.071	0511	956	0537	66.420
Cataluña	0408	460	0434	35.498	0460	614	0486	60.880	0512	1.003	0538	157.435
Ceuta	0409	10	0435	138	0461	12	0487	226	0513	17	0539	635
Extremadura	0410	53	0436	10.578	0462	63	0488	15.076	0514	108	0540	36.568
Galicia	0411	94	0437	7.272	0463	126	0489	13.916	0515	194	0541	41.393
Madrid	0412	1.278	0438	80.708	0464	1.736	0490	126.200	0516	2.891	0542	339.083
Meilla	0413	0	0439	0	0465	0	0491	0	0517	0	0543	0
Murcia	0414	81	0440	7.646	0466	109	0492	13.179	0518	161	0544	27.624
Navarra	0415	107	0441	7.555	0467	111	0493	10.268	0519	130	0545	17.754
La Rioja	0416	19	0442	1.744	0468	20	0494	2.191	0520	32	0546	4.238
Comunidad Valenciana	0417	324	0443	33.004	0469	398	0495	50.889	0521	601	0547	105.934
País Vasco	0418	53	0444	7.179	0470	68	0496	9.626	0522	97	0548	20.145
<b>Total España</b>	0419	3.662	0445	276.537	0471	4.757	0497	424.767	0523	7.446	0549	1.000.002
Otros países Unión europea	0420	0	0446	0	0472	0	0498	0	0524	0	0550	0
Resto	0422	0	0448	0	0474	0	0500	0	0526	0	0552	0
<b>Total general</b>	0425	3.662	0450	276.537	0475	4.757	0501	424.767	0527	7.446	0553	1.000.002

(1) Entendiendo como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2014**

### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)*

#### CUADRO B

Divisa/Activos titulizados	Situación actual 31/12/2014						Situación cierre anual anterior 31/12/2013						Situación inicial 23/12/2011					
	Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)	
Euro - EUR	0571	3.662	0577	276.537	0583	276.537	0600	4.757	0606	424.765	0611	424.765	0620	7.446	0626	1.000.000	0631	1.000.000
EEUU Dólar - USD	0572	0	0578	0	0584	0	0601	0	0607	0	0612	0	0621	0	0627	0	0632	0
Japón Yen - JPY	0573	0	0579	0	0585	0	0602	0	0608	0	0613	0	0622	0	0628	0	0633	0
Reino Unido Libra - GBP	0574	0	0580	0	0586	0	0603	0	0609	0	0614	0	0623	0	0629	0	0634	0
Otras	0575	0			0587	0	0604	0			0615	0	0624	0			0635	0
<b>Total</b>	0576	3.662			0588	276.537	0605	4.757			0616	424.765	0625	7.446			0636	1.000.000

(1) Entendiendo como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2014**

### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)*

#### CUADRO C

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (1)	Situación actual 31/12/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Situación inicial 23/12/2011			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	1100	10	1110	1.783	1120	5	1130	1.545	1140	0	1150	0
40% - 60%	1101	46	1111	12.942	1121	38	1131	7.607	1141	0	1151	0
60% - 80%	1102	27	1112	4.617	1122	39	1132	12.475	1142	61	1152	23.654
80% - 100%	1103	9	1113	1.274	1123	12	1133	1.354	1143	29	1153	4.292
100% - 120%	1104	1	1114	82	1124	3	1134	581	1144	7	1154	1.338
120% - 140%	1105	2	1115	221	1125	1	1135	73	1145	4	1155	837
140% - 160%	1106	0	1116	0	1126	1	1136	182	1146	1	1156	116
superior al 160%	1107	3	1117	1.208	1127	3	1137	1.255	1147	5	1157	1.625
<b>Total</b>	<b>1108</b>	<b>98</b>	<b>1118</b>	<b>22.127</b>	<b>1128</b>	<b>102</b>	<b>1138</b>	<b>25.072</b>	<b>1148</b>	<b>107</b>	<b>1158</b>	<b>31.862</b>
<b>Media ponderada (%)</b>			<b>1119</b>	<b>68,59</b>			<b>1139</b>	<b>73,66</b>			<b>1159</b>	<b>85,74</b>

(1) Distribución según el valor de la razón entre el importe pendiente de amortizar de los préstamos con garantía real y la última valoración disponible de tasación de los inmuebles hipotecados, o valor razonable de otras garantías reales, siempre que el valor de las mismas se haya considerado en el momento inicial del Fondo, expresada en porcentaje



## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **2º Semestre**  
 Ejercicio: **2014**

### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)*

#### CUADRO D

Rendimiento índice del periodo	Número de activos		Principal Pendiente		Margen ponderado s/ índice de referencia		Tipo de interés medio ponderado (2)	
	vivos							
Índice de referencia (1)	1400		1410		1420		1430	
TIPO FIJO	1.131		31.809		0,00		5,39	
EURIBOR	2.530		244.724		1,18		2,15	
CECA	1		4		2,00		7,01	
<b>Total</b>	<b>1405</b>	<b>3.662</b>	<b>1415</b>	<b>276.537</b>	<b>1425</b>	<b>1,04</b>	<b>1435</b>	<b>2,52</b>

(1) La gestora deberá cumplimentar el índice de referencia que corresponda en cada caso (EURIBOR un año, LIBRO, etc.)

(2) En el caso de tipos fijos no se cumplimentará la columna de margen ponderado y se indicará el tipo de interés medio ponderado de los activos a tipo fijo en la columna "tipo de interés medio ponderado"

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2014**

### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)*

CUADRO E Tipo de interés nominal	Situación actual 31/12/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Situación inicial 23/12/2011			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior al 1%	1500	143	1521	13.732	1542	144	1563	17.123	1584	172	1605	3.512
1% - 1,49%	1501	477	1522	76.961	1543	563	1564	95.156	1585	16	1606	4.467
1,5% - 1,99%	1502	260	1523	45.422	1544	343	1565	63.596	1586	202	1607	26.126
2% - 2,49%	1503	226	1524	32.313	1545	315	1566	45.783	1587	156	1608	41.278
2,5% - 2,99%	1504	528	1525	26.914	1546	751	1567	48.504	1588	606	1609	144.874
3% - 3,49%	1505	41	1526	2.465	1547	60	1568	8.865	1589	565	1610	121.969
3,5% - 3,99%	1506	538	1527	29.256	1548	727	1569	46.361	1590	731	1611	114.103
4% - 4,49%	1507	357	1528	15.405	1549	452	1570	27.567	1591	1.067	1612	117.257
4,5% - 4,99%	1508	210	1529	7.696	1550	320	1571	20.746	1592	472	1613	85.998
5% - 5,49%	1509	236	1530	10.981	1551	287	1572	19.964	1593	1.279	1614	119.968
5,5% - 5,99%	1510	272	1531	6.620	1552	312	1573	10.776	1594	888	1615	95.494
6% - 6,49%	1511	127	1532	3.318	1553	170	1574	11.427	1595	594	1616	72.234
6,5% - 6,99%	1512	100	1533	2.210	1554	130	1575	3.518	1596	364	1617	34.545
7% - 7,49%	1513	76	1534	1.460	1555	96	1576	2.889	1597	203	1618	11.515
7,5% - 7,99%	1514	34	1535	1.205	1556	41	1577	1.661	1598	61	1619	4.955
8% - 8,49%	1515	29	1536	370	1557	34	1578	556	1599	50	1620	1.166
8,5% - 8,99%	1516	6	1537	195	1558	7	1579	244	1600	13	1621	450
9% - 9,49%	1517	0	1538	0	1559	1	1580	7	1601	2	1622	27
9,5% - 9,99%	1518	0	1539	0	1560	0	1581	0	1602	1	1623	8
Superior al 10%	1519	2	1540	14	1561	4	1582	24	1603	4	1624	53
<b>Total</b>	<b>1520</b>	<b>3.662</b>	<b>1541</b>	<b>276.537</b>	<b>1562</b>	<b>4.757</b>	<b>1583</b>	<b>424.767</b>	<b>1604</b>	<b>7.446</b>	<b>1625</b>	<b>999.999</b>
<b>Tipo de interés medio ponderado de los activos(%)</b>			<b>9542</b>	<b>2,52</b>			<b>9584</b>	<b>2,81</b>			<b>1626</b>	<b>4,27</b>
<b>Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%)</b>			<b>9543</b>	<b>0,00</b>			<b>9585</b>	<b>2,21</b>			<b>1627</b>	<b>3,17</b>

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **2º Semestre**  
 Ejercicio: **2014**

### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

Concentración	Situación actual 31/12/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Situación inicial 23/12/2011			
	Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	2000	11,64			2030	10,94			2060	8,40		
Sector: (1)	2010	18,29	2020	35	2040	14,47	2050	35	2070	9,84	2080	35

(1) Indíquese denominación del sector con mayor concentración

(2) Incluir código CNAE con dos niveles de agregación

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **2º Semestre**  
 Ejercicio: **2014**

### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

*(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)*

#### CUADRO G

Divisa/Pasivos emitidos por el fondo	Situación actual 31/12/2014						Situación inicial 23/12/2011					
	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros		Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros	
Euro - EUR	3000	6.140	3060	0	3110	0	3170	6.140	3230	614.000	3250	614.000
EEUU Dólar - USDR	3010	0	3070	0	3120	0	3180	0	3240	0	3260	0
Japón Yen - JPY	3020	0	3080	0	3130	0	3190	0	3250	0	3270	0
Reino Unido Libra - GBP	3030	0	3090	0	3140	0	3200	0	3260	0	3280	0
Otras	3040	0			3150	0	3210	0			3290	0
<b>Total</b>	<b>3050</b>	<b>6.140</b>			<b>3160</b>	<b>0</b>	<b>3220</b>	<b>6.140</b>			<b>3300</b>	<b>614.000</b>

# ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.06

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
Denominación del compartimento:  
Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
Estados agregados: **No**  
Periodo: **2º Semestre**  
Ejercicio: **2014**

## NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene  
Información adicional  
en fichero adjunto

## INFORME DE AUDITOR

N/A