

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.00

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

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

Número de registro del Fondo: **9836**

NIF Fondo: **V-86100104**

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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

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: MADRID FTPYME I, 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: 1er Semestre
Ejercicio: 2011

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2011		Periodo Anterior 31/12/2010
---------------------------------	--	-------------------------------------	--	---------------------------------------

ACTIVO				
---------------	--	--	--	--

A) ACTIVO NO CORRIENTE	0008	817.944	1008	938.750
-------------------------------	------	---------	------	---------

I. Activos financieros a largo plazo	0010	817.944	1010	938.750
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	766.692	1200	881.269
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	704.948	1206	810.181
2.7 Préstamos a empresas	0207	59.883	1207	71.088
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 titulización	0218	0	1218	0
2.19 Otros	0219	0	1219	0
2.20 Activos dudosos	0220	1.861	1220	0
2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0221		1221	
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	51.252	1230	57.481
3.1 Derivados de cobertura	0231	51.252	1231	57.481
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

II. Activos por impuesto diferido	0250	0	1250	0
--	------	---	------	---

III. Otros activos no corrientes	0260	0	1260	0
---	------	---	------	---

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: MADRID FTPYME I, 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: 1er Semestre				
Ejercicio: 2011				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2011		Periodo Anterior 31/12/2010
B) ACTIVO CORRIENTE	0270	439.576	1270	420.229
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0280	0	1280	0
V. Activos financieros a corto plazo	0290	232.877	1290	247.513
1. Deudores y otras cuentas a cobrar	0300	2.669	1300	4.426
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	228.284	1400	241.206
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	199.417	1406	213.043
3.7 Préstamos a empresas	0407	26.517	1407	27.356
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	877	1420	0
3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0421		1421	
3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0422	1.259	1422	807
3.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0423	0	1423	0
3.24 Intereses vencidos e impagados	0424	214	1424	0
4. Derivados	0430	1.671	1430	1.844
4.1 Derivados de cobertura	0431	1.671	1431	1.844
4.2 Derivados de negociación	0432	0	1432	0
5. Otros activos financieros	0440	253	1440	37
5.1 Garantías financieras	0441	0	1441	0
5.2 Otros	0442	253	1442	37
VI. Ajustes por periodificaciones	0450	0	1450	1
1. Comisiones	0451	0	1451	0
2. Otros	0452	0	1452	1
VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes	0460	206.699	1460	172.715
1. Tesorería	0461	206.699	1461	172.715
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462	0	1462	0

TOTAL ACTIVO	0500	1.257.520	1500	1.358.979
--------------	------	-----------	------	-----------

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: MADRID FTPYME I, 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: 1er Semestre				
Ejercicio: 2011				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2011		Periodo Anterior 31/12/2010
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0650	975.102	1650	1.057.915
I. Provisiones a largo plazo	0660	0	1660	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0700	975.102	1700	1.057.915
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	525.119	1710	609.601
1.1 Series no subordinadas	0711	0	1711	609.601
1.2 Series subordinadas	0712	525.119	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	449.983	1720	448.314
2.1 Préstamo subordinado	0721	165.720	1721	163.820
2.2 Crédito línea de liquidez	0722	0	1722	1.700
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0723	285.000	1723	285.000
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0724	-737	1724	-2.206
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
III. Pasivos por impuesto diferido	0750	0	1750	0
B) PASIVO CORRIENTE	0760	230.471	1760	241.380
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0770	0	1770	0
V. Provisiones a corto plazo	0780	0	1780	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0800	230.398	1800	241.228
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	0	1810	0
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	229.407	1820	241.033
2.1 Series no subordinadas	0821	71.929	1821	240.399
2.2 Series subordinadas	0822	154.881	1822	0
2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0823		1823	
2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0824	2.597	1824	634
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	991	1830	195
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	991	1835	195
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836	0	1836	0
3.7 Intereses vencidos e impagados	0837	0	1837	0
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	0
5.1 Importe bruto	0851	0	1851	0
5.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0852		1852	

VII. Ajustes por periodificación	0900	73	1900	152
1. Comisiones	0910	71	1910	152
1.1 Comisión sociedad gestora	0911	12	1911	145
1.2 Comisión administrador	0912	11	1912	5
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0913	5	1913	2
1.4 Comisión variable - resultados realizados	0914	43	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	2	1920	0
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0930	51.947	1930	59.684
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0940	0	1940	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0950	51.947	1950	59.684
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0960	0	1960	0
XI. Gastos de constitución en transición	0970		1970	
TOTAL PASIVO	1000	1.257.520	2000	1.358.979

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.02

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME I, 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: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2011**

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. Corriente Actual 2º semestre		P. Corriente Anterior 2º semestre		Acumulado Actual 30/06/2011		Acumulado Anterior 30/06/2010
1. Intereses y rendimientos asimilados	0100		1100		2100	23.358	3100	
1.1 Valores representativos de deuda	0110		1110		2110	0	3110	
1.2 Derechos de crédito	0120		1120		2120	13.493	3120	
1.3 Otros activos financieros	0130		1130		2130	9.866	3130	
2. Intereses y cargas asimiladas	0200		1200		2200	-15.784	3200	
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210		1210		2210	-11.803	3210	
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220		1220		2220	-3.981	3220	
2.3 Otros pasivos financieros	0230		1230		2230		3230	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0240		1240		2240	0	3240	
A) MARGEN DE INTERESES	0250		1250		2250	7.574	3250	
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0300		1300		2300	-2	3300	
4.1 Ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0310		1310		2310	0	3310	
4.2 Activos financieros disponibles para la venta	0320		1320		2320	0	3320	
4.3 Otros	0330		1330		2330	-2	3330	
5. Diferencias de cambio (neto)	0400		1400		2400	0	3400	
6. Otros ingresos de explotación	0500		1500		2500	0	3500	
7. Otros gastos de explotación	0600		1600		2600	-6.103	3600	
7.1 Servicios exteriores	0610		1610		2610	-515	3610	
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611		1611		2611	-515	3611	
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		1620		2620	0	3620	
7.3 Otros gastos de gestión corrientes	0630		1630		2630	-5.588	3630	
7.3.1 Comisión de sociedad gestora	0631		1631		2631	-61	3631	
7.3.2 Comisión administrador	0632		1632		2632	-55	3632	
7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos	0633		1633		2633	-27	3633	
7.3.4 Comisión variable - resultados realizados	0634		1634		2634	-5.407	3634	
7.3.5 Comisión variables - resultados no realizados	0635		1635		2635	0	3635	
7.3.6 Otras comisiones del cedente	0636		1636		2636		3636	
7.3.7 Otros gastos	0637		1637		2637	-38	3637	
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0700		1700		2700	0	3700	
8.1 Deterioro neto de valores representativos de deuda	0710		1710		2710	0	3710	
8.2 Deterioro neto de derechos de crédito	0720		1720		2720	0	3720	
8.3 Deterioro neto de derivados	0730		1730		2730	0	3730	
8.4 Deterioro neto de otros activos financieros	0740		1740		2740	0	3740	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0750		1750		2750	0	3750	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0800		1800		2800	0	3800	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0850		1850		2850	-1.469	3850	
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0900		1900		2900	0	3900	
12. Impuesto sobre beneficios	0950		1950		2950	0	3950	
C) RESULTADO DEL PERIODO	3000		4000		5000	0	6000	

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.03

Denominación del Fondo: MADRID FTPYME I, 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: 1er Semestre
Ejercicio: 2011

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2011		Mismo Periodo año Anterior 30/06/2010
A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN	8000	4.244	9000	
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	8100	8.073	9100	0
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	12.784	9110	0
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-9.841	9120	
1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados	8130	7.617	9130	0
1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras	8140	697	9140	0
1.5 Intereses pagados por préstamos y créditos en entidades de crédito	8150	-3.184	9150	
1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	8160	0	9160	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo	8200	-5.630	9200	
2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora	8210	-193	9210	
2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados	8220	-49	9220	
2.3 Comisiones pagadas al agente financiero	8230	-24	9230	
2.4 Comisiones variables pagadas	8240	-5.364	9240	
2.5 Otras comisiones	8250		9250	
3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo	8300	1.801	9300	
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	1.801	9330	
B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION	8350	29.740	9350	0
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	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	
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	8500		9500	
5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito	8510		9510	
5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras	8520		9520	
6. Flujos de caja netos por amortizaciones	8600	30.094	9600	0
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	128.165	9610	0
6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados	8620	0	9620	0
6.3 Pagos por amortización de valores de titulización	8630	-98.071	9630	
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	8700	-354	9700	0
7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos	8710	2.967	9710	0
7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos	8720	-2.767	9720	
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	-554	9750	0
7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras	8770	0	9770	0
7.7 Cobros de Subvenciones	8780	0	9780	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	8800	33.984	9800	
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	172.715	9900	
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	206.699	9990	0

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.04

Denominación del Fondo: MADRID FTPYME I, 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: 1er Semestre Ejercicio: 2011

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS <i>(miles de euros)</i>		Periodo Actual 30/06/2011	Mismo Periodo año Anterior 30/06/2010
---	--	------------------------------	---

1 Activos financieros disponibles para la venta			
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6010	0	7010
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6020	0	7020
1.1.2 Efecto fiscal	6021	0	7021
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6022	0	7022
1.3 Otras reclasificaciones	6030	0	7030
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6040	0	7040
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	6100	0	7100

2 Cobertura de los flujos de efectivo			
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6110	1.215	7110
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6120	1.215	7120
2.1.2 Efecto fiscal	6121	0	7121
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6122	-8.952	7122
2.3 Otras reclasificaciones	6130	0	7130
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6140	7.737	7140
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	6200	0	7200

3 Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos			
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el periodo	6310	0	7310
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6320	0	7320
3.1.2 Efecto fiscal	6321	0	7321
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6322	0	7322
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6330	0	7330
Total Ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	6400	0	7400

TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	6500	0	7500
---	-------------	----------	-------------

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME I, 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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID

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 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 16/12/2010			
	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	9.507	0036	907.102	0066	10.073	0096	1.023.224	0126	10.130	0156	1.035.548
Préstamos a empresas	0008	30	0037	86.400	0067	32	0097	98.443	0127	32	0157	99.452
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	
Total	0021	9.537	0050	993.502	0080	10.105	0110	1.121.667	0140	10.162	0170	1.135.000

(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 I, 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: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2011**
 Entidades cedentes de los activos titulizados: CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID

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 30/06/2011		Situación cierre anual anterior 31/12/2010	
Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior	0196		0206	
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	-109.692	0210	-9.401
Amortización anticipada desde el cierre anual anterior	0201	-18.473	0211	-3.932
Total importe amortizado acumulado, incluyendo adjudicaciones y otros pagos en especie, desde el origen del Fondo	0202	-141.498	0212	-13.333
Importe de principal pendiente de amortización de los nuevos activos incorporados en el periodo (1)	0203	0	0213	1.135.000
Principal pendiente cierre del periodo (2)	0204	993.502	0214	1.121.667
Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)	0205	3,36	0215	4,08

(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 I, 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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID

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							Principal pendiente no vencido	Deuda Total		
		Principal pendiente vencido		Intereses ordinarios (2)		Total						
Hasta 1 mes	0700	542	0710	800	0720	95	0730	895	0740	36.668	0750	37.563
De 1 a 3 meses	0701	167	0711	798	0721	99	0731	897	0741	21.077	0751	21.974
De 3 a 6 meses	0703	41	0713	190	0723	23	0733	213	0743	1.829	0753	2.042
De 6 a 9 meses	0704	14	0714	88	0724	12	0734	100	0744	612	0754	712
De 9 a 12 meses	0705	0	0715	0	0725	0	0735	0	0745	0	0755	0
De 12 meses a 2 años	0706	0	0716	0	0726	0	0736	0	0746	0	0756	0
Más de 2 años	0708	0	0718	0	0728	0	0738	0	0748	0	0758	0
Total	0709	764	0719	1.876	0729	229	0739	2.105	0749	60.186	0759	62.291

(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	60	0782	104	0792	33	0802	137	0812	15.129	0822	15.266	0832	27.303	0842	55,91		
De 1 a 3 meses	0773	16	0783	32	0793	12	0803	44	0813	2.937	0823	2.981	0833	5.687	0843	52,44		
De 3 a 6 meses	0774	3	0784	14	0794	7	0804	21	0814	685	0824	706	0834	1.173	1854	1.173	0844	60,22
De 6 a 9 meses	0775	1	0785	6	0795	2	0805	8	0815	134	0825	142	0835	236	1855	236	0845	59,74
De 9 a 12 meses	0776	0	0786	0	0796	0	0806	0	0816	0	0826	0	0836	0	1856	0	0846	0,00
De 12 meses a 2 años	0777	0	0787	0	0797	0	0807	0	0817	0	0827	0	0837	0	1857	0	0847	0,00
Más de 2 años	0778	0	0788	0	0798	0	0808	0	0818	0	0828	0	0838	0	1858	0	0848	0,00
Total	0779	80	0789	156	0799	54	0809	210	0819	18.885	0829	19.095	0839	34.399			0849	55,51

(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 pignoradas, 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 I, 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: 1er Semestre

Ejercicio: 2011

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

CUADRO D	Situación actual 30/06/2011						Situación cierre anual anterior 31/12/2010						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	0886	0904	0922	0940	0958	0976	0994								
Certificados de transmisión de hipoteca	0851	0869	0887	0887	0905	0923	0941	0959	0977	0995								
Préstamos hipotecarios	0852	0870	0888	0888	0906	0924	0942	0960	0978	0996								
Cédulas Hipotecarias	0853	0871	0889	0889	0907	0925	0943	0961	0979	0997								
Préstamos a promotores	0854	0872	0890	0890	0908	0926	0944	0962	0980	0998								
Préstamos a PYMES	0855	0,30 0873	0,00 0891	0,00 0891	0909	0,00 0927	0,00 0945	0,00 0963	0,00 0981	0,00 0999	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Préstamos a empresas	0856	0,00 0874	0,00 0892	0,00 0892	0910	0,00 0928	0,00 0946	0,00 0964	0,00 0982	0,00 1000	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Préstamos Corporativos	0857	0875	0893	0893	0911	0929	0947	0965	0983	1001								
Cédulas Territoriales	1066	1084	1102	1102	1120	1138	1156	1174	1192	1210								
Bonos de Tesorería	0858	0876	0894	0894	0912	0930	0948	0966	0984	1002								
Deuda subordinada	0859	0877	0895	0895	0913	0931	0949	0967	0985	1003								
Créditos AAPP	0860	0878	0896	0896	0914	0932	0950	0968	0986	1004								
Préstamos Consumo	0861	0879	0897	0897	0915	0933	0951	0969	0987	1005								
Préstamos automoción	0862	0880	0898	0898	0916	0934	0952	0970	0988	1006								
Cuotas arrendamiento financiero	0863	0881	0899	0899	0917	0935	0953	0971	0989	1007								
Cuentas a cobrar	0864	0882	0900	0900	0918	0936	0954	0972	0990	1008								
Derechos de crédito futuros	0865	0883	0901	0901	0919	0937	0955	0973	0991	1009								
Bonos de titulización	0866	0884	0902	0902	0920	0938	0956	0974	0992	1010								
Otros	0867	0885	0903	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 expresarán 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 período del año anterior y el importe de principal de activos clasificados como fallidos al cierre del mismo período del año anterior

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME I, 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: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2011**
 Entidades cedentes de los activos titulizados: CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID

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 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 16/12/2010			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente			Nº de activos vivos	Principal pendiente			Nº de activos vivos	Principal pendiente		
Inferior a 1 año	1300	1.194	1310	22.183	1320	626	1330	16.150	1340	649	1350	16.997
Entre 1 y 2 años	1301	1.942	1311	87.553	1321	1.906	1331	70.652	1341	1.912	1351	72.863
Entre 2 y 3 años	1302	1.705	1312	103.616	1322	1.893	1332	139.646	1342	1.903	1352	142.422
Entre 3 y 5 años	1303	2.254	1313	232.335	1323	2.895	1333	272.221	1343	2.904	1353	274.706
Entre 5 y 10 años	1304	1.533	1314	268.573	1324	1.828	1334	315.818	1344	1.834	1354	319.320
Superior a 10 años	1305	909	1315	279.243	1325	957	1335	307.180	1345	960	1355	308.692
Total	1306	9.537	1316	993.503	1326	10.105	1336	1.121.667	1346	10.162	1356	1.135.000
Vida residual media ponderada (años)	1307	7,09			1327	7,22			1347	7,19		

(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 30/06/2011		Situación cierre anual anterior 31/12/2010		Situación inicial 16/12/2010	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	2,89	0632	2,41	0634	2,33

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME I, 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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

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 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Escenario inicial 16/12/2010			
		Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)		
Serie (2)		0001	0002	0003	0004	0005	0006	0007	0008	0009	0070	0080	0090
ES0358932004	Bono A1	1.700	42	71.929	0,48	1.700	100	170.000	0,82	1.700	100	170.000	0,82
ES0358932012	Bono A2 (G)	6.800	100	680.000	2,27	6.800	100	680.000	4,18	6.800	100	680.000	4,18
Total		8006	8.500	8025	751.929	8045	8.500	8065	850.000	8085	8.500	8105	850.000

(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 I, 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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

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					
ES0358932004	Bono A1	NS		EURIBOR 3 m	1,25	2,68	360	38	204	0	71.929	0	72.133						
ES0358932012	Bono A2 (G)	S		EURIBOR 3 m	1,90	3,33	360	38	2.393	0	680.000	0	682.393						
Total									9228	2.597	9105	0	9085	751.929	9095	0	9115	754.526	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 I, 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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

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 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010			
			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
ES0358932004	Bono A1	22-02-2043	98.071	98.071	1.428	1.428	0	0	0	0
ES0358932012	Bono A2 (G)	22-02-2043	0	0	8.412	8.412	0	0	0	0
Total			7305	98.071	7315	98.071	7325	9.840	7335	9.840
							7345	0	7355	0
									7365	0
										7375
										0

(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 I, 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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

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
ES0358932004	Bono A1	14-12-2010	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0358932004	Bono A1	14-06-2011	SYP	AA-	AAA	AAA
ES0358932012	Bono A2 (G)	14-12-2010	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0358932012	Bono A2 (G)	14-06-2011	SYP	AA-	AAA	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 -

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.3

Denominación del Fondo: MADRID FTPYME I, 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: 1er Semestre Ejercicio: 2011

INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS <i>(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)</i>		Situación actual 30/06/2011		Situación cierre anual anterior 31/12/2010
---	--	--	--	---

1. Importe del Fondo de Reserva	0010	161.170	1010	161.170
2. Porcentaje que representa el Fondo de Reserva, u otras mejoras equivalentes, sobre el total de activos titulizados	0020	16,22	1020	14,37
3. Exceso de spread (%) (1)	0040	-0,49	1040	-0,29
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	
8. Subordinación de series (S/N)	0110	Si	1110	No
9. Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total de bonos (3)	0120	9,57	1120	100,00
10. Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales	0150	680.000	1150	680.000
11. Porcentaje que representa el aval sobre el total de los pasivos emitidos	0160	90,43	1160	80,00
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

Información sobre contrapartes de las mejoras crediticias		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	N/A
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 I, 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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

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		
					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	2.791	0200	0	0300	0,00	0400	0,00	1120	0,00	
2. Activos Morosos por otras razones					0110		0210		0310		0410		1130		
Total Morosos					0120	2.791	0220	0	0320	0,00	0420	0,00	1140	0,00	1280
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	0050	12	0060		0130	0	0230	0	0330	0,00	0430	0,00	1050	0,00	
4. Activos Fallidos por otras razones					0140		0240		0340		0440		1160		
Total Fallidos					0150	0	0250	0	0350	0,00	0450	0,00	1200	0,00	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		
Amortización secuencial: series (4)	0500	0520	0540	0560	
Bono A2 (G) ES0358932012	1,50	0,27	0,17		4.9.4 Nota de Valores
Bono A2 (G) ES0358932012	10,00	87,53	91,36		4.9.4 Nota de Valores
Bono A2 (G) ES0358932012	25,00	0,00	0,00		4.9.3 Nota de Valores
Bono A2 (G) ES0358932012	50,22	37,90	34,98		4.9.4 Nota de Valores
Diferimiento/postergamiento intereses: series (5)	0506	0526	0546	0566	
Bono A2 (G) ES0358932012	6,50	0,00	0,00		3.4.6.2. Modulo Adicional
No Reducción del Fondo de Reserva (6)	0512	0532	0552	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 I, 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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

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 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 16/12/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)	
Andalucía	0400	782	0426	73.200	0452	824	0478	82.366	0504	825	0530	83.023
Aragón	0401	131	0427	17.754	0453	136	0479	19.497	0505	137	0531	19.654
Asturias	0402	79	0428	12.955	0454	83	0480	14.079	0506	83	0532	14.133
Baleares	0403	108	0429	12.727	0455	116	0481	13.777	0507	116	0533	13.879
Canarias	0404	98	0430	8.409	0456	104	0482	9.161	0508	104	0534	9.226
Cantabria	0405	111	0431	4.428	0457	127	0483	5.422	0509	128	0535	5.639
Castilla-León	0406	300	0432	34.457	0458	318	0484	41.157	0510	319	0536	42.547
Castilla La Mancha	0407	1.073	0433	83.004	0459	1.147	0485	95.680	0511	1.154	0537	96.485
Cataluña	0408	1.093	0434	121.954	0460	1.154	0486	138.075	0512	1.161	0538	139.710
Ceuta	0409	41	0435	4.771	0461	41	0487	5.113	0513	42	0539	5.195
Extremadura	0410	68	0436	9.291	0462	72	0488	10.439	0514	72	0540	10.478
Galicia	0411	245	0437	34.756	0463	259	0489	38.884	0515	260	0541	39.212
Madrid	0412	4.438	0438	404.200	0464	4.712	0490	457.678	0516	4.743	0542	463.433
Meilla	0413	0	0439	0	0465	0	0491	0	0517	0	0543	0
Murcia	0414	105	0440	16.007	0466	107	0492	17.998	0518	107	0544	18.230
Navarra	0415	53	0441	16.773	0467	54	0493	17.665	0519	54	0545	17.763
La Rioja	0416	38	0442	5.222	0468	40	0494	5.820	0520	40	0546	5.856
Comunidad Valenciana	0417	659	0443	111.522	0469	692	0495	124.023	0521	696	0547	125.430
País Vasco	0418	115	0444	22.074	0470	119	0496	24.831	0522	121	0548	25.106
Total España	0419	9.537	0445	993.504	0471	10.105	0497	1.121.665	0523	10.162	0549	1.134.999
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
Total general	0425	9.537	0450	993.504	0475	10.105	0501	1.121.665	0527	10.162	0553	1.134.999

(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 I, 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: 1er Semestre
 Ejercicio: 2011

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

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

Divisa/Activos titulizados	Situación actual 30/06/2011						Situación cierre anual anterior 31/12/2010						Situación inicial 16/12/2010					
	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	9.537	0577	993.502	0583	993.502	0600	10.105	0606	1.121.667	0611	1.121.667	0620	10.162	0626	1.135.000	0631	1.135.000
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
Total	0576	9.537			0588	993.502	0605	10.105			0616	1.121.667	0625	10.162			0636	1.135.000

(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 I, 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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

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 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 16/12/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	1100	188	1110	33.629	1120	181	1130	34.547	1140	181	1150	34.362
40% - 60%	1101	319	1111	90.088	1121	203	1131	55.655	1141	187	1151	51.881
60% - 80%	1102	325	1112	101.003	1122	446	1132	141.958	1142	464	1152	146.897
80% - 100%	1103	21	1113	5.780	1123	31	1133	10.085	1143	32	1153	10.582
100% - 120%	1104	4	1114	598	1124	5	1134	1.100	1144	5	1154	1.106
120% - 140%	1105	1	1115	505	1125	3	1135	820	1145	3	1155	828
140% - 160%	1106	1	1116	849	1126	1	1136	872	1146	1	1156	876
superior al 160%	1107	4	1117	3.338	1127	4	1137	3.434	1147	4	1157	3.443
Total	1108	863	1118	235.790	1128	874	1138	248.471	1148	877	1158	249.975
Media ponderada (%)			1119	61,69			1139	63,80			1159	64,07

(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 I, 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: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2011**

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	
MIBOR		1		12		0,25		1,36
TIPO ICO		559		35.774		1,50		3,28
IRPH		17		574		0,89		3,74
EURIBOR		7.464		869.921		0,87		2,24
TIPO FIJO		1.482		86.911		0,00		4,60
CECA		14		311		0,69		5,45
Total	1405	9.537	1415	993.503	1425	0,82	1435	2,49

(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 I, 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: 1er Semestre
 Ejercicio: 2011

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 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 16/12/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior al 1%	1500	84	1521	3.527	1542	98	1563	7.908	1584	98	1605	7.952
1% - 1,49%	1501	65	1522	45.889	1543	90	1564	61.432	1585	91	1606	62.046
1,5% - 1,99%	1502	2.690	1523	321.305	1544	3.194	1565	429.171	1586	3.211	1607	435.265
2% - 2,49%	1503	1.747	1524	316.510	1545	1.620	1566	292.679	1587	1.630	1608	294.850
2,5% - 2,99%	1504	1.095	1525	97.462	1546	1.178	1567	105.601	1588	1.185	1609	106.891
3% - 3,49%	1505	1.282	1526	84.853	1547	1.455	1568	90.686	1589	1.463	1610	91.721
3,5% - 3,99%	1506	831	1527	53.699	1548	642	1569	50.583	1590	642	1611	50.928
4% - 4,49%	1507	423	1528	22.153	1549	493	1570	25.124	1591	498	1612	25.421
4,5% - 4,99%	1508	312	1529	11.172	1550	265	1571	11.337	1592	265	1613	11.445
5% - 5,49%	1509	207	1530	15.791	1551	222	1572	19.002	1593	223	1614	19.050
5,5% - 5,99%	1510	279	1531	9.708	1552	289	1573	11.550	1594	290	1615	11.753
6% - 6,49%	1511	190	1532	4.743	1553	197	1574	6.820	1595	199	1616	7.332
6,5% - 6,99%	1512	212	1533	4.942	1554	234	1575	7.444	1596	236	1617	7.867
7% - 7,49%	1513	30	1534	481	1555	29	1576	631	1597	31	1618	720
7,5% - 7,99%	1514	19	1535	405	1556	23	1577	579	1598	23	1619	583
8% - 8,49%	1515	60	1536	694	1557	65	1578	925	1599	66	1620	977
8,5% - 8,99%	1516	5	1537	85	1558	5	1579	96	1600	5	1621	97
9% - 9,49%	1517	5	1538	77	1559	5	1580	91	1601	5	1622	92
9,5% - 9,99%	1518	0	1539	0	1560	0	1581	0	1602	0	1623	0
Superior al 10%	1519	1	1540	7	1561	1	1582	9	1603	1	1624	9
Total	1520	9.537	1541	993.503	1562	10.105	1583	1.121.668	1604	10.162	1625	1.134.999
Tipo de interés medio ponderado de los activos(%)			9542	2,49			9584	2,40			1626	2,40
Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%)			9543	2,97			9585				1627	

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME I, 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: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2011**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

CUADRO F Concentración	Situación actual 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 16/12/2010			
	Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	2000	8,93			2030	8,62			2060	8,59		
Sector: (1)	2010	11,05	2020	47	2040	11,09	2050	47	2070	11,09	2080	47

(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 I, 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: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2011**

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 30/06/2011						Situación inicial 16/12/2010					
	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	8.500	3060	751.929	3110	751.929	3170	8.500	3230	850.000	3250	850.000
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
Total	3050	8.500			3160	751.929	3220	8.500			3300	850.000

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.06

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME I, 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: **1er Semestre**
Ejercicio: **2011**

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene
Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

N/A