

MADRID RMBS IV, FTA

INFORMACIÓN CORRESPONDIENTE AL MES DE SEPTIEMBRE DE 2013:
INFORMATION CORRESPONDING TO THE MONTH OF SEPTEMBER 2013:

La Sociedad Gestora informa de los siguientes conceptos/*The Sociedad Gestora provides the following information:*

* Saldo Vivo de Certificados de Transmisión Hipotecaria a 01/09/13: <i>Outstanding Balance of the Mortgage Transfer Certificates on 01/09/13:</i>	1,188,722,972.03 €
* Saldo Vivo de Certificados de Transmisión Hipotecaria a 30/09/13: <i>Outstanding Balance of the Mortgage Transfer Certificates on 30/09/13:</i>	1,181,618,443.35 €
* Tasa(1)de Amortización Anticipada (TAA) correspondiente al mes de SEPTIEMBRE: <i>Prepayment Rate(1)corresponding to the month of SEPTEMBER:</i>	1.76%
* TAA (12 meses)/ CPR (12 months):	3.88%
* Tipo de interés medio ponderado / <i>Weighted average interest rate:</i>	1.35%
* Vencimiento residual medio / <i>Weighted average maturity:</i>	24.87
* Vida Media bonos (TAA 16%) / <i>Average Life of bonds (CPR 16%) :</i>	
- Bonos A1 / <i>Bonds A1:</i>	0.48
- Bonos A2 / <i>Bonds A2:</i>	4.49
- Bonos B / <i>Bonds B:</i>	3.88
- Bonos C / <i>Bonds C:</i>	3.88
- Bonos D / <i>Bonds D:</i>	3.88
- Bonos E / <i>Bonds E:</i>	3.88
* Calificación Actual de los Bonos / <i>Current rating :</i>	
- Bonos A1 / <i>Bonds A1:</i>	(S&P)A(sf) / (M)A3(sf)
- Bonos A2 / <i>Bonds A2:</i>	(S&P)A(sf) / (M)Baa2(sf)
- Bonos B / <i>Bonds B:</i>	(S&P)A(sf)
- Bonos C / <i>Bonds C:</i>	(S&P)BB+(sf)
- Bonos D / <i>Bonds D:</i>	(S&P)B+(sf)
- Bonos E / <i>Bonds E:</i>	(S&P)B-(sf)
* Información Deposito Garantía por la bajada de calificación de la contrapartida del Swap : <i>Information on the Protection Deposit constituted due to the downgrade of the Swap counterparty:</i>	
- Importe depositado / <i>Amount of the deposit:</i>	14,600,000.00 €
- Fecha de constitución del Depósito / <i>Deposit Incorporation Date:</i>	25/11/2012
- Fecha de valoración del Depósito / <i>Deposit Valuation Date:</i>	23/10/2013
- Metodo de Cálculo / <i>Calculation Method:</i>	
El importe del depósito es el máximo entre / <i>The Deposit is the maximum between:</i>	
S&P Max [0;(Mtm + Option 1 VB *Mtm)] , y	
Moody's Max [0;(Mtm + (Multiplicador * Nocional))]	
- Periodicidad de Valoración / <i>Valuation frequency:</i>	Diario / <i>Daily</i>

La Sociedad Gestora, para facilitar a los inversores la valoración de los Bonos, suministra a demanda los flujos de pago previstos durante la vida del Bono, bajo diversas hipótesis alternativas de TAA.
In order to facilitate the evaluation of the Bonds for the investors, the Sociedad Gestora will supply upon request the projected cashflows for the life of the Bond, under different prepayment scenarios.

(1) Tasa Anualizada
(1) *Annualized Rate*

Nº: 7114/13
MADRID RMBS IV\Info.mensual\Sep13