

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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2013**

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 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: 1er Semestre
Ejercicio: 2013

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2013		Periodo Anterior 31/12/2012
---------------------------------	--	-------------------------------------	--	---------------------------------------

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

A) ACTIVO NO CORRIENTE	0008	359.133	1008	459.995
-------------------------------	------	---------	------	---------

I. Activos financieros a largo plazo	0010	359.133	1010	459.995
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	358.928	1200	459.995
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	330.369	1206	421.051
2.7 Préstamos a empresas	0207	23.768	1207	35.501
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	6.052	1220	4.704
2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0221	-1.261	1221	-1.261
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	205	1230	0
3.1 Derivados de cobertura	0231	205	1231	0
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 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: 1er Semestre

Ejercicio: 2013

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2013		Periodo Anterior 31/12/2012
B) ACTIVO CORRIENTE	0270	251.417	1270	286.479
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0280	0	1280	0
V. Activos financieros a corto plazo	0290	161.489	1290	194.954
1. Deudores y otras cuentas a cobrar	0300	939	1300	1.535
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	160.467	1400	193.407
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	130.465	1406	162.780
3.7 Préstamos a empresas	0407	22.597	1407	26.632
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	10.602	1420	6.892
3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0421	-4.109	1421	-4.109
3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0422	627	1422	941
3.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0423	0	1423	0
3.24 Intereses vencidos e impagados	0424	285	1424	271
4. Derivados	0430	71	1430	0
4.1 Derivados de cobertura	0431	71	1431	0
4.2 Derivados de negociación	0432	0	1432	0
5. Otros activos financieros	0440	12	1440	12
5.1 Garantías financieras	0441	0	1441	0
5.2 Otros	0442	12	1442	12
VI. Ajustes por periodificaciones	0450	0	1450	0
1. Comisiones	0451	0	1451	0
2. Otros	0452	0	1452	0
VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes	0460	89.928	1460	91.525
1. Tesorería	0461	89.928	1461	91.525
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462	0	1462	0

TOTAL ACTIVO	0500	610.550	1500	746.474
--------------	------	---------	------	---------

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

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: 1er Semestre				
Ejercicio: 2013				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2013		Periodo Anterior 31/12/2012
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0650	436.563	1650	540.211
I. Provisiones a largo plazo	0660	0	1660	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0700	436.563	1700	540.211
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	19.590	1710	124.933
1.1 Series no subordinadas	0711	19.590	1711	124.933
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	416.973	1720	414.421
2.1 Préstamo subordinado	0721	32.495	1721	33.327
2.2 Crédito línea de liquidez	0722	0	1722	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0723	386.000	1723	386.000
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0724	-1.522	1724	-4.906
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	857
3.1 Derivados de cobertura	0731	0	1731	857
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	173.806	1760	207.090
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	173.699	1800	206.981
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	0	1810	0
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	164.101	1820	197.065
2.1 Series no subordinadas	0821	163.664	1821	196.303
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	437	1824	762
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	268	1830	223
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	229	1835	223
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836	0	1836	0
3.7 Intereses vencidos e impagados	0837	39	1837	0
4. Derivados	0840	0	1840	253
4.1 Derivados de cobertura	0841	0	1841	253
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	9.330	1850	9.440
5.1 Importe bruto	0851	9.330	1851	9.440
5.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0852		1852	

VII. Ajustes por periodificación	0900	107	1900	109
1. Comisiones	0910	19	1910	20
1.1 Comisión sociedad gestora	0911	11	1911	11
1.2 Comisión administrador	0912	6	1912	7
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	88	1920	89
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0930	181	1930	-827
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0940	0	1940	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0950	181	1950	-827
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0960	0	1960	0
XI. Gastos de constitución en transición	0970		1970	
TOTAL PASIVO	1000	610.550	2000	746.474

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: 1er Semestre							
Ejercicio: 2013							

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. Corriente Actual 2º semestre		P. Corriente Anterior 2º semestre		Acumulado Actual 30/06/2013		Acumulado Anterior 30/06/2012
1. Intereses y rendimientos asimilados	0100		1100		2100	8.684	3100	18.953
1.1 Valores representativos de deuda	0110		1110		2110	0	3110	0
1.2 Derechos de crédito	0120		1120		2120	8.603	3120	18.540
1.3 Otros activos financieros	0130		1130		2130	81	3130	413
2. Intereses y cargas asimiladas	0200		1200		2200	-3.917	3200	-11.330
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210		1210		2210	-2.849	3210	-8.537
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220		1220		2220	-1.068	3220	-2.793
2.3 Otros pasivos financieros	0230		1230		2230		3230	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0240		1240		2240	-569	3240	-1.177
A) MARGEN DE INTERESES	0250		1250		2250	4.198	3250	6.446
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0300		1300		2300	1	3300	0
4.1 Ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0310		1310		2310	0	3310	0
4.2 Activos financieros disponibles para la venta	0320		1320		2320	0	3320	0
4.3 Otros	0330		1330		2330	1	3330	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0400		1400		2400	0	3400	0
6. Otros ingresos de explotación	0500		1500		2500	0	3500	0
7. Otros gastos de explotación	0600		1600		2600	-786	3600	-6.457
7.1 Servicios exteriores	0610		1610		2610	-37	3610	-2.175
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611		1611		2611	-37	3611	-575
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0612		1612		2612		3612	-1.600
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	0
7.3 Otros gastos de gestión corrientes	0630		1630		2630	-749	3630	-4.282
7.3.1 Comisión de sociedad gestora	0631		1631		2631	-52	3631	-53
7.3.2 Comisión administrador	0632		1632		2632	-32	3632	-48
7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos	0633		1633		2633	-9	3633	-9
7.3.4 Comisión variable - resultados realizados (neto)	0634		1634		2634	-656	3634	-4.134
7.3.5 Comisión variables - resultados no realizados (neto)	0635		1635		2635	0	3635	0
7.3.6 Otras comisiones del cedente	0636		1636		2636		3636	
7.3.7 Otros gastos	0637		1637		2637	0	3637	-38
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0700		1700		2700	-29	3700	11
8.1 Deterioro neto de valores representativos de deuda	0710		1710		2710	0	3710	0
8.2 Deterioro neto de derechos de crédito	0720		1720		2720	-29	3720	11
8.3 Deterioro neto de derivados	0730		1730		2730	0	3730	0
8.4 Deterioro neto de otros activos financieros	0740		1740		2740	0	3740	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0750		1750		2750	0	3750	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0800		1800		2800	0	3800	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0850		1850		2850	-3.384	3850	0
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0900		1900		2900	0	3900	0
12. Impuesto sobre beneficios	0950		1950		2950	0	3950	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	3000		4000		5000	0	6000	0

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.03

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: 1er Semestre

Ejercicio: 2013

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2013		Mismo Periodo año Anterior 30/06/2012
A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN	8000	3.107	9000	21.354
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	8100	3.853	9100	7.119
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	8.916	9110	17.725
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-3.174	9120	-7.324
1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados	8130	-948	9130	-1.248
1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras	8140	81	9140	363
1.5 Intereses pagados por préstamos y créditos en entidades de crédito	8150	-1.022	9150	-2.397
1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	8160	0	9160	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo	8200	-749	9200	-4.502
2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora	8210	-51	9210	-157
2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados	8220	-34	9220	-41
2.3 Comisiones pagadas al agente financiero	8230	-9	9230	-7
2.4 Comisiones variables pagadas	8240	-655	9240	-4.297
2.5 Otras comisiones	8250		9250	
3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo	8300	3	9300	18.737
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	3	9330	18.737
B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION	8350	-4.704	9350	46.430
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	-3.725	9600	46.674
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	134.257	9610	184.590
6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados	8620	0	9620	0
6.3 Pagos por amortización de valores de titulización	8630	-137.982	9630	-137.916
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	8700	-979	9700	-244
7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos	8710	0	9710	5.697
7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos	8720	-942	9720	-5.323
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	-37	9750	-618
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	-1.597	9800	67.784
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	91.525	9900	32.300
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	89.928	9990	100.084

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.04

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: 1er Semestre
Ejercicio: 2013

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2013		Mismo Periodo año Anterior 30/06/2012
1 Activos financieros disponibles para la venta				
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
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	6100	0	7100	0
2 Cobertura de los flujos de efectivo				
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6110	439	7110	-3.286
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6120	439	7120	-3.286
2.1.2 Efecto fiscal	6121	0	7121	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6122	569	7122	1.177
2.3 Otras reclasificaciones	6130	0	7130	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6140	-1.008	7140	2.109
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	6200	0	7200	0
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	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
Total Ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	6400	0	7400	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	6500	0	7500	0

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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2013**

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 30/06/2013				Situación cierre anual anterior 31/12/2012				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	5.391	0036	477.488	0066	6.118	0096	595.426	0126	7.392	0156	879.141
Préstamos a empresas	0008	33	0037	46.365	0067	39	0097	62.133	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	
Total	0021	5.424	0050	523.853	0080	6.157	0110	657.559	0140	7.446	0170	1.000.000

(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 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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2013**

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 30/06/2013		Situación cierre anual anterior 31/12/2012	
	Código	Importe	Código	Importe
Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior	0196	-43	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	-97.001	0210	-267.579
Amortización anticipada desde el cierre anual anterior	0201	-36.663	0211	-56.209
Total importe amortizado acumulado, incluyendo adjudicaciones y otros pagos en especie, desde el origen del Fondo	0202	-476.105	0212	-342.441
Importe de principal pendiente de amortización de los nuevos activos incorporados en el periodo (1)	0203	0	0213	0
Principal pendiente cierre del periodo (2)	0204	523.853	0214	657.559
Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)	0205	7,44	0215	5,73

(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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2013**

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	250	0710	352	0720	37	0730	389	0740	12.889	0750	13.278
De 1 a 3 meses	0701	103	0711	832	0721	63	0731	895	0741	10.486	0751	11.381
De 3 a 6 meses	0703	53	0713	435	0723	49	0733	484	0743	2.927	0753	3.411
De 6 a 9 meses	0704	37	0714	989	0724	64	0734	1.053	0744	2.130	0754	3.183
De 9 a 12 meses	0705	36	0715	1.226	0725	110	0735	1.336	0745	1.773	0755	3.109
De 12 meses a 2 años	0706	78	0716	3.960	0726	335	0736	4.295	0746	3.214	0756	7.509
Más de 2 años	0708	0	0718	0	0728	0	0738	0	0748	0	0758	0
Total	0709	557	0719	7.794	0729	658	0739	8.452	0749	33.419	0759	41.871

(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	5	0782	9	0792	1	0802	10	0812	556	0822	566	0832	860	0842	65,82
De 1 a 3 meses	0773	1	0783	7	0793	1	0803	8	0813	451	0823	459	0833	724	0843	63,34
De 3 a 6 meses	0774	0	0784	0	0794	0	0804	0	0814	0	0824	0	0834	0	1854	0,00
De 6 a 9 meses	0775	0	0785	0	0795	0	0805	0	0815	0	0825	0	0835	0	1855	0,00
De 9 a 12 meses	0776	1	0786	7	0796	3	0806	10	0816	77	0826	87	0836	53	1856	53,0846
De 12 meses a 2 años	0777	0	0787	0	0797	0	0807	0	0817	0	0827	0	0837	0	1857	0,00
Más de 2 años	0778	0	0788	0	0798	0	0808	0	0818	0	0828	0	0838	0	1858	0,00
Total	0779	7	0789	23	0799	5	0809	28	0819	1.084	0829	1.112	0839	1.637	0849	67,93

(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 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: 1er Semestre

Ejercicio: 2013

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

CUADRO D	Situación actual 30/06/2013						Situación cierre anual anterior 31/12/2012						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	3,49	0873	0,01	0891	0,00	0909	1,95	0927	0,00	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 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 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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2013**

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 30/06/2013				Situación cierre anual anterior 31/12/2012				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	1.032	1310	36.870	1320	1.018	1330	38.624	1340	881	1350	81.497
Entre 1 y 2 años	1301	1.061	1311	56.072	1321	884	1331	51.169	1341	1.059	1351	108.307
Entre 2 y 3 años	1302	1.474	1312	108.875	1322	1.654	1332	121.325	1342	973	1352	95.405
Entre 3 y 5 años	1303	939	1313	118.357	1323	1.349	1333	179.522	1343	2.726	1353	334.217
Entre 5 y 10 años	1304	762	1314	147.922	1324	1.027	1334	185.547	1344	1.359	1354	241.811
Superior a 10 años	1305	156	1315	55.756	1325	225	1335	81.372	1345	448	1355	138.762
Total	1306	5.424	1316	523.852	1326	6.157	1336	657.559	1346	7.446	1356	999.999
Vida residual media ponderada (años)	1307	5,19			1327	5,32			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 30/06/2013		Situación cierre anual anterior 31/12/2012		Situación inicial 23/12/2011	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	3,77	0632	3,23	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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2013**

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 30/06/2013				Situación cierre anual anterior 31/12/2012				Escenario inicial 23/12/2011			
		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
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	46	183.254	0,18	4.000	80	321.237	0,53	4.000	100	400.000	1,46
Total		8006	6.140	8025	183.254	8045	6.140	8065	321.237	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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2013**

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	39	0	0	0	0	0						
ES0358933010	Bono A2 (G)	NS		EURIBOR 3 m	2,00	2,20	360	39	437	0	183.254	0	183.691						
Total									9228	437	9105	0	9085	183.254	9095	0	9115	183.691	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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2013**

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 30/06/2013				Situación cierre anual anterior 31/12/2012			
			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	22-02-2039	0	214.000	0	2.798	214.000	214.000	2.798	2.798
ES0358933010	Bono A2 (G)	22-02-2039	137.982	216.745	3.174	13.231	78.763	78.763	10.057	10.057
Total			7305	137.982	7315	430.745	7325	3.174	7335	16.029
							7345	292.763	7355	292.763
									7365	12.855
									7375	12.855

(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**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2013**

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)	02-07-2012	MDY	A3	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: 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: 1er Semestre Ejercicio: 2013
--

INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS <i>(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)</i>		Situación actual 30/06/2013		Situación cierre anual anterior 31/12/2012
1. Importe del Fondo de Reserva	0010	28.670	1010	30.000
2. Porcentaje que representa el Fondo de Reserva, u otras mejoras equivalentes, sobre el total de activos titulizados	0020	5,47	1020	4,56
3. Exceso de spread (%) (1)	0040	0,94	1040	1,11
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	100,00	1120	100,00
10. Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales	0150	183.254	1150	321.237
11. Porcentaje que representa el aval sobre el total de los pasivos emitidos	0160	100,00	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				

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 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: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2013**

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	9.433	0200	11.508	0300	0,02	0400	0,02	1120	0,02	
2. Activos Morosos por otras razones					0110		0210		0310		0410		1130		
Total Morosos					0120	9.433	0220	11.508	0320	0,02	0420	0,02	1140	0,02	1280
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	0050		0060		0130	7.220	0230	88	0330	0,01	0430	0,00	1050	0,01	
4. Activos Fallidos por otras razones					0140	0	0240	0	0340	0,00	0440	0,00	1160	0,00	
Total Fallidos					0150	7.220	0250	88	0350	0,01	0450	0,00	1200	0,01	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		Ref. Folleto		
			Pago				
Amortización secuencial: series (4)	0500	0520	0540	0560			
Bono A2 (G) ES0358933010	2,50	0,72	0,48		4.9.3 Nota de Valores		
Bono A1 ES0358933002	2,50	0,72	0,48		4.9.3 Nota de Valores		
Diferimiento/postergamiento intereses: series (5)	0506	0526	0546	0566			
N/A N/A							
No Reducción del Fondo de Reserva (6)	0512	0532	15,64	0552	11,97	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**
 Período: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2013**

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 30/06/2013				Situación cierre anual anterior 31/12/2012				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	416	0426	36.560	0452	468	0478	42.766	0504	565	0530	60.440
Aragón	0401	71	0427	7.684	0453	80	0479	9.073	0505	98	0531	13.094
Asturias	0402	46	0428	6.754	0454	51	0480	8.037	0506	63	0532	10.530
Baleares	0403	82	0429	11.383	0455	86	0481	14.919	0507	101	0533	28.086
Canarias	0404	54	0430	7.601	0456	64	0482	11.771	0508	84	0534	21.207
Cantabria	0405	44	0431	2.347	0457	51	0483	2.795	0509	57	0535	3.789
Castilla-León	0406	211	0432	30.438	0458	233	0484	34.080	0510	288	0536	45.627
Castilla La Mancha	0407	732	0433	42.383	0459	824	0485	49.346	0511	956	0537	66.420
Cataluña	0408	715	0434	75.991	0460	813	0486	93.930	0512	1.003	0538	157.435
Ceuta	0409	16	0435	297	0461	16	0487	416	0513	17	0539	635
Extremadura	0410	78	0436	17.870	0462	97	0488	28.419	0514	108	0540	36.568
Galicia	0411	149	0437	19.685	0463	160	0489	24.880	0515	194	0541	41.393
Madrid	0412	2.027	0438	159.531	0464	2.352	0490	207.036	0516	2.891	0542	339.083
Meilla	0413	0	0439	0	0465	0	0491	0	0517	0	0543	0
Murcia	0414	122	0440	16.641	0466	133	0492	19.338	0518	161	0544	27.624
Navarra	0415	115	0441	11.885	0467	123	0493	14.297	0519	130	0545	17.754
La Rioja	0416	21	0442	2.437	0468	21	0494	2.671	0520	32	0546	4.238
Comunidad Valenciana	0417	447	0443	62.520	0469	500	0495	79.411	0521	601	0547	105.934
País Vasco	0418	78	0444	11.847	0470	85	0496	14.375	0522	97	0548	20.145
Total España	0419	5.424	0445	523.854	0471	6.157	0497	657.560	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
Total general	0425	5.424	0450	523.854	0475	6.157	0501	657.560	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**
 Período: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2013**

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 30/06/2013						Situación cierre anual anterior 31/12/2012						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	5.424	0577	523.853	0583	523.853	0600	6.157	0606	657.559	0611	657.559	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
Total	0576	5.424			0588	523.853	0605	6.157			0616	657.559	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: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2013**

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 30/06/2013				Situación cierre anual anterior 31/12/2012				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	4	1110	1.065	1120	0	1130	0	1140	0	1150	0
40% - 60%	1101	29	1111	6.011	1121	16	1131	5.147	1141	0	1151	0
60% - 80%	1102	44	1112	15.014	1122	56	1132	17.366	1142	61	1152	23.654
80% - 100%	1103	19	1113	2.335	1123	23	1133	3.419	1143	29	1153	4.292
100% - 120%	1104	2	1114	502	1124	4	1134	795	1144	7	1154	1.338
120% - 140%	1105	1	1115	98	1125	2	1135	183	1145	4	1155	837
140% - 160%	1106	1	1116	84	1126	1	1136	84	1146	1	1156	116
superior al 160%	1107	4	1117	1.473	1127	4	1137	1.495	1147	5	1157	1.625
Total	1108	104	1118	26.582	1128	106	1138	28.489	1148	107	1158	31.862
Media ponderada (%)			1119	76,56			1139	79,71			1159	85,74

(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: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2013**

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	
EURIBOR	3.695		419.278		1,27		2,69	
TIPO FIJO	1.728		104.566		0,00		5,30	
CECA	1		9		2,00		7,31	
Total	1405	5.424	1415	523.853	1425	1,02	1435	3,21

(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: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2013**

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 30/06/2013				Situación cierre anual anterior 31/12/2012				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	152	1521	13.706	1542	109	1563	826	1584	172	1605	3.512
1% - 1,49%	1501	252	1522	34.240	1543	126	1564	20.824	1585	16	1606	4.467
1,5% - 1,99%	1502	512	1523	97.758	1544	202	1565	15.723	1586	202	1607	26.126
2% - 2,49%	1503	462	1524	84.169	1545	489	1566	108.729	1587	156	1608	41.278
2,5% - 2,99%	1504	565	1525	52.538	1546	514	1567	105.536	1588	606	1609	144.874
3% - 3,49%	1505	431	1526	37.935	1547	625	1568	76.827	1589	565	1610	121.969
3,5% - 3,99%	1506	393	1527	28.076	1548	706	1569	69.320	1590	731	1611	114.103
4% - 4,49%	1507	712	1528	50.004	1549	430	1570	30.548	1591	1.067	1612	117.257
4,5% - 4,99%	1508	495	1529	44.518	1550	1.028	1571	82.842	1592	472	1613	85.998
5% - 5,49%	1509	434	1530	28.260	1551	652	1572	60.784	1593	1.279	1614	119.968
5,5% - 5,99%	1510	406	1531	21.647	1552	547	1573	34.199	1594	888	1615	95.494
6% - 6,49%	1511	242	1532	18.224	1553	283	1574	33.144	1595	594	1616	72.234
6,5% - 6,99%	1512	156	1533	5.276	1554	205	1575	8.043	1596	364	1617	34.545
7% - 7,49%	1513	111	1534	3.807	1555	126	1576	5.655	1597	203	1618	11.515
7,5% - 7,99%	1514	49	1535	2.678	1556	54	1577	3.290	1598	61	1619	4.955
8% - 8,49%	1515	37	1536	678	1557	44	1578	856	1599	50	1620	1.166
8,5% - 8,99%	1516	8	1537	287	1558	10	1579	351	1600	13	1621	450
9% - 9,49%	1517	2	1538	19	1559	2	1580	22	1601	2	1622	27
9,5% - 9,99%	1518	1	1539	1	1560	1	1581	3	1602	1	1623	8
Superior al 10%	1519	4	1540	31	1561	4	1582	37	1603	4	1624	53
Total	1520	5.424	1541	523.852	1562	6.157	1583	657.559	1604	7.446	1625	999.999
Tipo de interés medio ponderado de los activos(%)			9542	3,21			9584	3,75			1626	4,27
Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%)			9543	2,27			9585	2,64			1627	0,00

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: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2013**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

Concentración	Situación actual 30/06/2013				Situación cierre anual anterior 31/12/2012				Situación inicial 23/12/2011			
	Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	2000	10,38			2030	9,69			2060	8,40		
Sector: (1)	2010	12,89	2020	35	2040	12,81	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: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2013**

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 30/06/2013						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	183.254	3110	183.254	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
Total	3050	6.140			3160	183.254	3220	6.140			3300	614.000

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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2013**

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene
Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

N/A