

MADRID RMBS I

INFORMACI3N CORRESPONDIENTE AL MES DE FEBRERO DE 2011:
INFORMATION CORRESPONDING TO THE MONTH OF FEBRUARY 2011:

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

* Saldo Vivo de Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisi3n Hipotecarias a 01/02/11: <i>Outstanding Balance of the Mortgage Share Certificates and Mortgage Transfer Certificates on 01/02/11:</i>	1.137.693.804,14 Euros
* Saldo Vivo de Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisi3n Hipotecarias a 28/02/11: <i>Outstanding Balance of the Mortgage Share Certificates and Mortgage Transfer Certificates on 28/02/11:</i>	1.132.504.743,10 Euros
* Tasa(1)de Amortizaci3n Anticipada (TAA) correspondiente al mes de FEBRERO: <i>Prepayment Rate(1)corresponding to the month of FEBRUARY:</i>	1,69%
* TAA (12 meses)/ CPR (12 months):	3,36%
* Tipo de inter3s medio ponderado / <i>Weighted average interest rate:</i>	2,46%
* Vencimiento residual medio / <i>Weighted average maturity:</i>	23,55
* Vida Media bonos (TAA 10%) / <i>Average Life of bonds (CPR 10%):</i>	
- Bonos A2 / <i>Bonds A2:</i>	5,91
- Bonos B / <i>Bonds B:</i>	6,95
- Bonos C / <i>Bonds C:</i>	6,95
- Bonos D / <i>Bonds D:</i>	6,95
- Bonos E / <i>Bonds E:</i>	6,95
* Calificaci3n Actual de los Bonos / <i>Current Rating :</i>	
- Bonos A2 / <i>Bonds A2:</i>	(F) AA sf / (S&P) AA sf / (M) A1 sf
- Bonos B / <i>Bonds B:</i>	(F) A+ sf / (S&P) BBB- sf / (M) Ba1 sf
- Bonos C / <i>Bonds C:</i>	(F) BB+ sf / (S&P) B sf / (M) Caa2 sf
- Bonos D / <i>Bonds D:</i>	(F) CCC sf / (S&P) CCC sf / (M) C sf
- Bonos E / <i>Bonds E:</i>	(F) CC sf / (S&P) CCC sf / (M) C sf
* Informaci3n Deposito Garantía por la bajada de calificaci3n 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>	0,00 €
- Fecha de constituci3n del Dep3sito / <i>Deposit Incorporation Date:</i>	23/03/2011
- Última fecha de actualizaci3n del Dep3sito / <i>Last Deposit update:</i>	30/03/2011
- Metodo de Cálculo / <i>Calculation Method :</i>	Según lo establecido en el Anexo III / As set out in Annex III
- Periodicidad de Valoraci3n / <i>Valuation frequency:</i>	Semanal / Weekly

La Sociedad Gestora, para facilitar a los inversores la valoraci3n 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: 2052/11
MADRID RMBS \Info.mensual\Feb11