

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.00

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

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

Número de registro del Fondo: **10064**

NIF Fondo: **V-86356474**

Denominación del compartimento:

Número de registro del compartimento:

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

NIF gestora: **A-80352750**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **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: 2º Semestre
Ejercicio: 2013

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

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

A) ACTIVO NO CORRIENTE	0008	286.909	1008	459.995
-------------------------------	------	---------	------	---------

I. Activos financieros a largo plazo	0010	286.909	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	286.583	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	265.394	1206	421.051
2.7 Préstamos a empresas	0207	17.396	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	5.032	1220	4.704
2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0221	-1.239	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	326	1230	0
3.1 Derivados de cobertura	0231	326	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: 2º Semestre

Ejercicio: 2013

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2013		Periodo Anterior 31/12/2012
B) ACTIVO CORRIENTE	0270	190.805	1270	286.479
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0280	0	1280	0
V. Activos financieros a corto plazo	0290	126.074	1290	194.954
1. Deudores y otras cuentas a cobrar	0300	1.410	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	124.517	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	107.468	1406	162.780
3.7 Préstamos a empresas	0407	16.836	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	12.639	1420	6.892
3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0421	-13.126	1421	-4.109
3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0422	441	1422	941
3.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0423	0	1423	0
3.24 Intereses vencidos e impagados	0424	259	1424	271
4. Derivados	0430	136	1430	0
4.1 Derivados de cobertura	0431	136	1431	0
4.2 Derivados de negociación	0432	0	1432	0
5. Otros activos financieros	0440	11	1440	12
5.1 Garantías financieras	0441	0	1441	0
5.2 Otros	0442	11	1442	12
VI. Ajustes por periodificaciones	0450	1	1450	0
1. Comisiones	0451	0	1451	0
2. Otros	0452	1	1452	0
VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes	0460	64.730	1460	91.525
1. Tesorería	0461	64.730	1461	91.525
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462	0	1462	0

TOTAL ACTIVO	0500	477.714	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: 2º Semestre				
Ejercicio: 2013				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2013		Periodo Anterior 31/12/2012
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0650	411.723	1650	540.211
I. Provisiones a largo plazo	0660	0	1660	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0700	411.723	1700	540.211
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	0	1710	124.933
1.1 Series no subordinadas	0711	0	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	411.723	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	-6.772	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	65.728	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	65.623	1800	206.981
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	0	1810	0
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	58.111	1820	197.065
2.1 Series no subordinadas	0821	57.972	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	139	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	362	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	245	1835	223
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836	0	1836	0
3.7 Intereses vencidos e impagados	0837	117	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	7.150	1850	9.440
5.1 Importe bruto	0851	7.150	1851	9.440
5.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0852		1852	

VII. Ajustes por periodificación	0900	105	1900	109
1. Comisiones	0910	18	1910	20
1.1 Comisión sociedad gestora	0911	11	1911	11
1.2 Comisión administrador	0912	5	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	87	1920	89
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0930	263	1930	-827
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0940	0	1940	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0950	263	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	477.714	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: 2º Semestre								
Ejercicio: 2013								

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. Corriente Actual		P. Corriente Anterior		Acumulado Actual		Acumulado Anterior	
		2º semestre		2º semestre		31/12/2013		31/12/2012	
1. Intereses y rendimientos asimilados	0100	6.493	1100	12.802	2100	15.191	3100	31.755	
1.1 Valores representativos de deuda	0110	0	1110	0	2110	0	3110	0	
1.2 Derechos de crédito	0120	6.421	1120	12.609	2120	15.038	3120	31.149	
1.3 Otros activos financieros	0130	72	1130	193	2130	153	3130	606	
2. Intereses y cargas asimiladas	0200	-2.450	1200	-6.421	2200	-6.368	3200	-17.752	
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210	-1.346	1210	-4.917	2210	-4.195	3210	-13.455	
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220	-1.104	1220	-1.504	2220	-2.173	3220	-4.297	
2.3 Otros pasivos financieros	0230		1230		2230		3230		
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0240	-202	1240	-1.502	2240	-772	3240	-2.679	
A) MARGEN DE INTERESES	0250	3.841	1250	4.879	2250	8.051	3250	11.324	
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0300	0	1300	-2	2300	1	3300	0	
4.1 Ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0310	0	1310	0	2310	0	3310	0	
4.2 Activos financieros disponibles para la venta	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0	
4.3 Otros	0330	0	1330	-2	2330	1	3330	0	
5. Diferencias de cambio (neto)	0400	0	1400	0	2400	0	3400	0	
6. Otros ingresos de explotación	0500	0	1500	0	2500	0	3500	0	
7. Otros gastos de explotación	0600	-92	1600	-104	2600	-877	3600	-5.978	
7.1 Servicios exteriores	0610	-1	1610	-1	2610	-38	3610	-2.176	
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611	-1	1611	-1	2611	-38	3611	-576	
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	0	1620	0	2620	0	3620	0	
7.3 Otros gastos de gestión corrientes	0630	-91	1630	-103	2630	-839	3630	-3.802	
7.3.1 Comisión de sociedad gestora	0631	-51	1631	-50	2631	-103	3631	-103	
7.3.2 Comisión administrador	0632	-26	1632	-39	2632	-58	3632	-87	
7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos	0633	-9	1633	-9	2633	-18	3633	-18	
7.3.4 Comisión variable - resultados realizados (neto)	0634	0	1634	0	2634	-655	3634	-3.551	
7.3.5 Comisión variables - resultados no realizados (neto)	0635	0	1635	0	2635	0	3635	0	
7.3.6 Otras comisiones del cedente	0636		1636		2636		3636		
7.3.7 Otros gastos	0637	-5	1637	-5	2637	-5	3637	-43	
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0700	-8.999	1700	-5.357	2700	-9.041	3700	-5.346	
8.1 Deterioro neto de valores representativos de deuda	0710	0	1710	0	2710	0	3710	0	
8.2 Deterioro neto de derechos de crédito	0720	-8.999	1720	-5.357	2720	-9.041	3720	-5.346	
8.3 Deterioro neto de derivados	0730	0	1730	0	2730	0	3730	0	
8.4 Deterioro neto de otros activos financieros	0740	0	1740	0	2740	0	3740	0	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0750	0	1750	0	2750	0	3750	0	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0800	0	1800	0	2800	0	3800	0	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0850	5.250	1850	584	2850	1.866	3850	0	
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0900	0	1900	0	2900	0	3900	0	
12. Impuesto sobre beneficios	0950	0	1950	0	2950	0	3950	0	
C) RESULTADO DEL PERIODO	3000	0	4000	0	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: 2º Semestre
Ejercicio: 2013

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2013		Mismo Periodo año Anterior 31/12/2012
A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN	8000	6.762	9000	3.957
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	8100	7.600	9100	12.510
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	15.549	9110	32.111
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-4.817	9120	-12.855
1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados	8130	-1.255	9130	-3.217
1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras	8140	155	9140	598
1.5 Intereses pagados por préstamos y créditos en entidades de crédito	8150	-2.032	9150	-4.127
1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	8160	0	9160	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo	8200	-837	9200	-8.552
2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora	8210	-103	9210	-207
2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados	8220	-61	9220	-81
2.3 Comisiones pagadas al agente financiero	8230	-18	9230	-16
2.4 Comisiones variables pagadas	8240	-655	9240	-8.248
2.5 Otras comisiones	8250		9250	
3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo	8300	-1	9300	-1
3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos	8310	0	9310	0
3.2 Pagos de provisiones	8320		9320	
3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta	8325		9325	
3.4 Otros	8330	-1	9330	-1
B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION	8350	-33.557	9350	55.268
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	-30.392	9600	51.192
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	232.873	9610	343.955
6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados	8620	0	9620	0
6.3 Pagos por amortización de valores de titulización	8630	-263.265	9630	-292.763
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	8700	-3.165	9700	4.076
7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos	8710	0	9710	13.537
7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos	8720	-3.122	9720	-7.242
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	-43	9750	-2.219
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	-26.795	9800	59.225
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	91.525	9900	32.300
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	64.730	9990	91.525

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: 2º Semestre
Ejercicio: 2013

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS <i>(miles de euros)</i>		Periodo Actual 31/12/2013		Mismo Periodo año Anterior 31/12/2012
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	318	7110	-3.778
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6120	318	7120	-3.778
2.1.2 Efecto fiscal	6121	0	7121	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6122	772	7122	2.679
2.3 Otras reclasificaciones	6130	0	7130	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6140	-1.090	7140	1.099
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: **2º 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 31/12/2013				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	4.729	0036	390.533	0066	6.118	0096	595.426	0126	7.392	0156	879.141
Préstamos a empresas	0008	28	0037	34.232	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	4.757	0050	424.765	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: **2º 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 31/12/2013		Situación cierre anual anterior 31/12/2012	
	Código	Importe	Código	Importe
Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior	0196	-47	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	-176.658	0210	-267.579
Amortización anticipada desde el cierre anual anterior	0201	-56.089	0211	-56.209
Total importe amortizado acumulado, incluyendo adjudicaciones y otros pagos en especie, desde el origen del Fondo	0202	-575.188	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	424.765	0214	657.559
Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)	0205	8,53	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: **2º 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	224	0710	313	0720	28	0730	341	0740	11.043	0750	11.384
De 1 a 3 meses	0701	90	0711	368	0721	38	0731	406	0741	8.489	0751	8.895
De 3 a 6 meses	0703	41	0713	203	0723	17	0733	220	0743	910	0753	1.130
De 6 a 9 meses	0704	36	0714	752	0724	54	0734	806	0744	1.932	0754	2.738
De 9 a 12 meses	0705	39	0715	708	0725	80	0735	788	0745	1.862	0755	2.650
De 12 meses a 2 años	0706	130	0716	7.191	0726	573	0736	7.764	0746	4.065	0756	11.829
Más de 2 años	0708	4	0718	39	0728	2	0738	41	0748	9	0758	50
Total	0709	564	0719	9.574	0729	792	0739	10.366	0749	28.310	0759	38.676

(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	4	0792	2	0802	6	0812	780	0822	786	0832	1.146	0842	68,58		
De 1 a 3 meses	0773	0	0783	0	0793	0	0803	0	0813	0	0823	0	0833	0	0843	0,00		
De 3 a 6 meses	0774	0	0784	0	0794	0	0804	0	0814	0	0824	0	0834	0	1854	0844	0,00	
De 6 a 9 meses	0775	1	0785	22	0795	4	0805	26	0815	436	0825	462	0835	724	1855	724	0845	63,69
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	6	0789	26	0799	6	0809	32	0819	1.216	0829	1.248	0839	1.870		0849	66,74	

(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: 2º Semestre

Ejercicio: 2013

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

CUADRO D	Situación actual 31/12/2013						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	4,52	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 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 II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **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 31/12/2013				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	890	1310	21.255	1320	1.018	1330	38.624	1340	881	1350	81.497
Entre 1 y 2 años	1301	1.483	1311	67.598	1321	884	1331	51.169	1341	1.059	1351	108.307
Entre 2 y 3 años	1302	790	1312	76.875	1322	1.654	1332	121.325	1342	973	1352	95.405
Entre 3 y 5 años	1303	748	1313	81.991	1323	1.349	1333	179.522	1343	2.726	1353	334.217
Entre 5 y 10 años	1304	708	1314	129.341	1324	1.027	1334	185.547	1344	1.359	1354	241.811
Superior a 10 años	1305	138	1315	47.705	1325	225	1335	81.372	1345	448	1355	138.762
Total	1306	4.757	1316	424.765	1326	6.157	1336	657.559	1346	7.446	1356	999.999
Vida residual media ponderada (años)	1307	5,16			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 31/12/2013		Situación cierre anual anterior 31/12/2012		Situación inicial 23/12/2011	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	4,33	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: **2º 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 31/12/2013				Situación cierre anual anterior 31/12/2012				Escenario inicial 23/12/2011			
		Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente
Serie (2)		0001	0002	0003	0004	0005	0006	0007	0008	0009	0070	0080	0090
ES0358933002	Bono A1	2.140	0	0	0,00	2.140	0	0	0,00	2.140	100	214.000	0,39
ES0358933010	Bono A2 (G)	4.000	14	57.972	0,02	4.000	80	321.237	0,53	4.000	100	400.000	1,46
Total		8006	6.140	8025	57.972	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: **2º 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	2,22	360	39	139	0	57.972	0	58.111						
Total									9228	139	9105	0	9085	57.972	9095	0	9115	58.111	9227

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

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

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

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

(5) Días acumulados desde la última fecha de pago

(6) Intereses acumulados desde la última fecha de pago

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **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 31/12/2013				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	22-08-2012	0	214.000	0	2.798	214.000	214.000	2.798	2.798
ES0358933010	Bono A2 (G)	22-02-2039	263.265	342.028	4.817	14.874	78.763	78.763	10.057	10.057
Total			7305	263.265	7315	556.028	7325	4.817	7335	17.672
							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**

Período: **2º 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: 2º Semestre Ejercicio: 2013

INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS <i>(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)</i>		Situación actual 31/12/2013		Situación cierre anual anterior 31/12/2012
---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	----------------------------------------------	--	-----------------------------------------------------------------------

1. Importe del Fondo de Reserva	0010	27.518	1010	30.000
2. Porcentaje que representa el Fondo de Reserva, u otras mejoras equivalentes, sobre el total de activos titulizados	0020	6,48	1020	4,56
3. Exceso de spread (%) (1)	0040	0,60	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	57.972	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	Ministerio de Economía
Contraparte del derivado de crédito	0260		1270	N/A

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.4

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **2º 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		
	0010		0030	90	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					0100	6.344	0200	9.433	0300	0,02	0400	0,02	1120	0,02	
2. Activos Morosos por otras razones					0110		0210		0310		0410		1130		
Total Morosos					0120	6.344	0220	9.433	0320	0,02	0420	0,02	1140	0,02	1280
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	0050	12	0060		0130	11.327	0230	7.220	0330	0,03	0430	0,01	1050	0,02	
4. Activos Fallidos por otras razones					0140	0	0240	0	0340	0,00	0440	0,00	1160	0,00	
Total Fallidos					0150	11.327	0250	7.220	0350	0,03	0450	0,01	1200	0,02	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) ES0358933010	77,20	86,94	78,16		4.9.4 Nota de Valores
Bono A2 (G) ES0358933010	1,50	1,53	1,95		4.9.4 Nota de Valores
Bono A2 (G) ES0358933010	10,00	41,34	44,40		4.9.4 Nota de Valores
Bono A1 ES0358933002	2,50	1,21	1,04		4.9.3 Nota de Valores
Bono A1 ES0358933002	77,20	86,94	78,16		4.9.4 Nota de Valores
Bono A1 ES0358933002	1,50	1,53	1,95		4.9.4 Nota de Valores
Bono A1 ES0358933002	10,00	41,34	44,40		4.9.4 Nota de Valores
Bono A2 (G) ES0358933010	2,50	1,21	1,04		4.9.3 Nota de Valores
Diferimiento/postergamiento intereses: series (5)	0506	0526	0546	0566	
Bono A2 (G) ES0358933010	6,50	1,13	1,02		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 II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **2º Semestre**
 Ejercicio: **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 31/12/2013				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	377	0426	31.558	0452	468	0478	42.766	0504	565	0530	60.440
Aragón	0401	67	0427	6.516	0453	80	0479	9.073	0505	98	0531	13.094
Asturias	0402	43	0428	5.702	0454	51	0480	8.037	0506	63	0532	10.530
Baleares	0403	70	0429	6.779	0455	86	0481	14.919	0507	101	0533	28.086
Canarias	0404	47	0430	6.564	0456	64	0482	11.771	0508	84	0534	21.207
Cantabria	0405	36	0431	1.976	0457	51	0483	2.795	0509	57	0535	3.789
Castilla-León	0406	191	0432	27.150	0458	233	0484	34.080	0510	288	0536	45.627
Castilla La Mancha	0407	669	0433	36.071	0459	824	0485	49.346	0511	956	0537	66.420
Cataluña	0408	614	0434	60.880	0460	813	0486	93.930	0512	1.003	0538	157.435
Ceuta	0409	12	0435	226	0461	16	0487	416	0513	17	0539	635
Extremadura	0410	63	0436	15.076	0462	97	0488	28.419	0514	108	0540	36.568
Galicia	0411	126	0437	13.916	0463	160	0489	24.880	0515	194	0541	41.393
Madrid	0412	1.736	0438	126.200	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	109	0440	13.179	0466	133	0492	19.338	0518	161	0544	27.624
Navarra	0415	111	0441	10.268	0467	123	0493	14.297	0519	130	0545	17.754
La Rioja	0416	20	0442	2.191	0468	21	0494	2.671	0520	32	0546	4.238
Comunidad Valenciana	0417	398	0443	50.889	0469	500	0495	79.411	0521	601	0547	105.934
País Vasco	0418	68	0444	9.626	0470	85	0496	14.375	0522	97	0548	20.145
Total España	0419	4.757	0445	424.767	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	4.757	0450	424.767	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**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2013**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

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

CUADRO B

Divisa/Activos titulizados	Situación actual 31/12/2013						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	4.757	0577	424.765	0583	424.765	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	4.757			0588	424.765	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: **2º 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 31/12/2013				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	5	1110	1.545	1120	0	1130	0	1140	0	1150	0
40% - 60%	1101	38	1111	7.607	1121	16	1131	5.147	1141	0	1151	0
60% - 80%	1102	39	1112	12.475	1122	56	1132	17.366	1142	61	1152	23.654
80% - 100%	1103	12	1113	1.354	1123	23	1133	3.419	1143	29	1153	4.292
100% - 120%	1104	3	1114	581	1124	4	1134	795	1144	7	1154	1.338
120% - 140%	1105	1	1115	73	1125	2	1135	183	1145	4	1155	837
140% - 160%	1106	1	1116	182	1126	1	1136	84	1146	1	1156	116
superior al 160%	1107	3	1117	1.255	1127	4	1137	1.495	1147	5	1157	1.625
Total	1108	102	1118	25.072	1128	106	1138	28.489	1148	107	1158	31.862
Media ponderada (%)			1119	73,66			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: **2º 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	
TIPO FIJO	1.390		71.696		0,00		5,30	
EURIBOR	3.366		353.061		1,24		2,31	
CECA	1		8		2,00		7,15	
Total	1405	4.757	1415	424.765	1425	1,03	1435	2,81

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
 Estados agregados: No
 Periodo: 2º Semestre
 Ejercicio: 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 31/12/2013				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	144	1521	17.123	1542	109	1563	826	1584	172	1605	3.512
1% - 1,49%	1501	563	1522	95.156	1543	126	1564	20.824	1585	16	1606	4.467
1,5% - 1,99%	1502	343	1523	63.596	1544	202	1565	15.723	1586	202	1607	26.126
2% - 2,49%	1503	315	1524	45.783	1545	489	1566	108.729	1587	156	1608	41.278
2,5% - 2,99%	1504	751	1525	48.504	1546	514	1567	105.536	1588	606	1609	144.874
3% - 3,49%	1505	60	1526	8.865	1547	625	1568	76.827	1589	565	1610	121.969
3,5% - 3,99%	1506	727	1527	46.361	1548	706	1569	69.320	1590	731	1611	114.103
4% - 4,49%	1507	452	1528	27.567	1549	430	1570	30.548	1591	1.067	1612	117.257
4,5% - 4,99%	1508	320	1529	20.746	1550	1.028	1571	82.842	1592	472	1613	85.998
5% - 5,49%	1509	287	1530	19.964	1551	652	1572	60.784	1593	1.279	1614	119.968
5,5% - 5,99%	1510	312	1531	10.776	1552	547	1573	34.199	1594	888	1615	95.494
6% - 6,49%	1511	170	1532	11.427	1553	283	1574	33.144	1595	594	1616	72.234
6,5% - 6,99%	1512	130	1533	3.518	1554	205	1575	8.043	1596	364	1617	34.545
7% - 7,49%	1513	96	1534	2.889	1555	126	1576	5.655	1597	203	1618	11.515
7,5% - 7,99%	1514	41	1535	1.661	1556	54	1577	3.290	1598	61	1619	4.955
8% - 8,49%	1515	34	1536	556	1557	44	1578	856	1599	50	1620	1.166
8,5% - 8,99%	1516	7	1537	244	1558	10	1579	351	1600	13	1621	450
9% - 9,49%	1517	1	1538	7	1559	2	1580	22	1601	2	1622	27
9,5% - 9,99%	1518	0	1539	0	1560	1	1581	3	1602	1	1623	8
Superior al 10%	1519	4	1540	24	1561	4	1582	37	1603	4	1624	53
Total	1520	4.757	1541	424.767	1562	6.157	1583	657.559	1604	7.446	1625	999.999
Tipo de interés medio ponderado de los activos(%)			9542	2,81			9584	3,75			1626	4,27
Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%)			9543	2,21			9585	2,64			1627	3,17

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **2º Semestre**
 Ejercicio: **2013**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

Concentración	Situación actual 31/12/2013				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	10,94			2030	9,69			2060	8,40		
Sector: (1)	2010	14,47	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: **2º 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 31/12/2013						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	57.972	3110	57.972	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	57.972	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: **2º Semestre**

Ejercicio: **2013**

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene
Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

N/A