

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.00

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

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

Número de registro del Fondo: **9836**

NIF Fondo: **V-86100104**

Denominación del compartimento:

Número de registro del compartimento:

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

NIF gestora: **A-80352750**

Estados agregados: **No**

Periodo: **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 I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
Estados agregados: No
Periodo: 2º Semestre
Ejercicio: 2013

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

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

A) ACTIVO NO CORRIENTE	0008	358.150	1008	503.507
-------------------------------	------	---------	------	---------

I. Activos financieros a largo plazo	0010	358.150	1010	503.507
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	340.453	1200	472.696
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	320.840	1206	435.415
2.7 Préstamos a empresas	0207	12.175	1207	28.117
2.8 Préstamos Corporativos	0208	0	1208	0
2.9 Cédulas territoriales	0209	0	1209	0
2.10 Bonos de Tesorería	0210	0	1210	0
2.11 Deuda Subordinada	0211	0	1211	0
2.12 Créditos AAPP	0212	0	1212	0
2.13 Préstamos Consumo	0213	0	1213	0
2.14 Préstamos automoción	0214	0	1214	0
2.15 Cuotas de Arrendamiento financiero (leasing)	0215	0	1215	0
2.16 Cuentas a cobrar	0216	0	1216	0
2.17 Derechos de crédito futuros	0217	0	1217	0
2.18 Bonos de titulización	0218	0	1218	0
2.19 Otros	0219	0	1219	0
2.20 Activos dudosos	0220	9.230	1220	11.744
2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0221	-1.792	1221	-2.580
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	17.697	1230	30.811
3.1 Derivados de cobertura	0231	17.697	1231	30.811
3.2 Derivados de negociación	0232	0	1232	0
4. Otros activos financieros	0240	0	1240	0
4.1 Garantías financieras	0241	0	1241	0
4.2 Otros	0242	0	1242	0

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

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

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2013		Periodo Anterior 31/12/2012
B) ACTIVO CORRIENTE	0270	327.146	1270	391.799
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0280	564	1280	223
V. Activos financieros a corto plazo	0290	113.013	1290	150.678
1. Deudores y otras cuentas a cobrar	0300	380	1300	1.545
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	107.005	1400	148.077
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	92.212	1406	125.371
3.7 Préstamos a empresas	0407	13.842	1407	19.229
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	12.533	1420	9.560
3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0421	-12.112	1421	-6.980
3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0422	338	1422	659
3.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0423	0	1423	0
3.24 Intereses vencidos e impagados	0424	192	1424	238
4. Derivados	0430	5.622	1430	1.056
4.1 Derivados de cobertura	0431	5.622	1431	1.056
4.2 Derivados de negociación	0432	0	1432	0
5. Otros activos financieros	0440	6	1440	0
5.1 Garantías financieras	0441	0	1441	0
5.2 Otros	0442	6	1442	0
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	213.569	1460	240.898
1. Tesorería	0461	213.569	1461	240.898
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462	0	1462	0

TOTAL ACTIVO	0500	685.296	1500	895.306
--------------	------	---------	------	---------

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

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

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2013		Periodo Anterior 31/12/2012
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0650	516.948	1650	666.066
I. Provisiones a largo plazo	0660	0	1660	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0700	516.948	1700	666.066
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	70.170	1710	222.303
1.1 Series no subordinadas	0711	70.170	1711	222.303
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	446.778	1720	443.763
2.1 Préstamo subordinado	0721	162.574	1721	162.574
2.2 Crédito línea de liquidez	0722	0	1722	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0723	285.000	1723	285.000
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0724	-796	1724	-3.811
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0725	0	1725	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0726	0	1726	0
3. Derivados	0730	0	1730	0
3.1 Derivados de cobertura	0731	0	1731	0
3.2 Derivados de negociación	0732	0	1732	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0733		1733	
4. Otros pasivos financieros	0740	0	1740	0
4.1 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0741		1741	
4.2 Otros	0742	0	1742	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0750	0	1750	0
B) PASIVO CORRIENTE	0760	145.778	1760	197.932
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	145.756	1800	197.909
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	0	1810	0
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	119.020	1820	155.012
2.1 Series no subordinadas	0821	118.587	1821	154.160
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	433	1824	852
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	1.836	1830	407
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	421	1835	407
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836	0	1836	0
3.7 Intereses vencidos e impagados	0837	1.415	1837	0
4. Derivados	0840	0	1840	0
4.1 Derivados de cobertura	0841	0	1841	0
4.2 Derivados de negociación	0842	0	1842	0
4.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0843		1843	
5. Otros pasivos financieros	0850	24.900	1850	42.490
5.1 Importe bruto	0851	24.900	1851	42.490
5.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0852		1852	

VII. Ajustes por periodificación	0900	22	1900	23
1. Comisiones	0910	19	1910	22
1.1 Comisión sociedad gestora	0911	11	1911	11
1.2 Comisión administrador	0912	5	1912	7
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0913	3	1913	4
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	3	1920	1
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0930	22.570	1930	31.308
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0940	0	1940	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0950	22.570	1950	31.308
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0960	0	1960	0
XI. Gastos de constitución en transición	0970		1970	
TOTAL PASIVO	1000	685.296	2000	895.306

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.02

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

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. Corriente Actual 2º semestre		P. Corriente Anterior 2º semestre		Acumulado Actual 31/12/2013		Acumulado Anterior 31/12/2012	
1. Intereses y rendimientos asimilados	0100	3.673	1100	7.517	2100	8.273	3100	19.806	
1.1 Valores representativos de deuda	0110	0	1110	0	2110	0	3110	0	
1.2 Derechos de crédito	0120	3.658	1120	7.299	2120	8.245	3120	18.640	
1.3 Otros activos financieros	0130	15	1130	218	2130	28	3130	1.166	
2. Intereses y cargas asimiladas	0200	-4.482	1200	-7.596	2200	-9.866	3200	-20.053	
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210	-2.500	1210	-5.191	2210	-5.956	3210	-13.714	
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220	-1.982	1220	-2.405	2220	-3.910	3220	-6.339	
2.3 Otros pasivos financieros	0230		1230		2230		3230		
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0240	4.540	1240	4.679	2240	9.409	3240	10.403	
A) MARGEN DE INTERESES	0250	3.731	1250	4.600	2250	7.816	3250	10.156	
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0300	-2	1300	0	2300	-1	3300	-1	
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	-2	1330	0	2330	-1	3330	-1	
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	-106	2600	-243	3600	-2.723	
7.1 Servicios exteriores	0610	-1	1610	-1	2610	-47	3610	-46	
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611	-1	1611	-1	2611	-47	3611	-46	
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0612		1612		2612		3612		
7.1.3 Publicidad y propaganda	0613		1613		2613		3613		
7.1.4 Otros servicios	0614		1614		2614		3614		
7.2 Tributos	0620	0	1620	0	2620	0	3620	0	
7.3 Otros gastos de gestión corrientes	0630	-91	1630	-105	2630	-196	3630	-2.677	
7.3.1 Comisión de sociedad gestora	0631	-52	1631	-51	2631	-105	3631	-103	
7.3.2 Comisión administrador	0632	-26	1632	-36	2632	-57	3632	-79	
7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos	0633	-13	1633	-18	2633	-29	3633	-39	
7.3.4 Comisión variable - resultados realizados (neto)	0634	0	1634	0	2634	0	3634	-2.451	
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	0	1637	0	2637	-5	3637	-5	
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0700	-4.500	1700	-7.187	2700	-4.557	3700	-7.432	
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	-4.500	1720	-7.187	2720	-4.557	3720	-7.432	
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	863	1850	2.693	2850	-3.015	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 I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
Estados agregados: No
Periodo: 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	8.803	9000	4.230
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	8100	8.998	9100	8.812
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	8.613	9110	19.393
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-6.375	9120	-15.131
1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados	8130	9.220	9130	10.273
1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras	8140	21	9140	1.238
1.5 Intereses pagados por préstamos y créditos en entidades de crédito	8150	-2.481	9150	-6.961
1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	8160	0	9160	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo	8200	-194	9200	-4.583
2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora	8210	-105	9210	-102
2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados	8220	-59	9220	-81
2.3 Comisiones pagadas al agente financiero	8230	-30	9230	-41
2.4 Comisiones variables pagadas	8240		9240	-4.359
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	-36.132	9350	24.212
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	-18.490	9600	-16.429
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	169.217	9610	229.427
6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados	8620	0	9620	0
6.3 Pagos por amortización de valores de titulización	8630	-187.707	9630	-245.856
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	8700	-17.642	9700	40.641
7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos	8710	0	9710	42.490
7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos	8720	-17.590	9720	-1.798
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	-52	9750	-51
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	-27.329	9800	28.442
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	240.898	9900	212.456
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	213.569	9990	240.898

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.04

Denominación del Fondo: MADRID FTPYME I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
Estados agregados: No
Periodo: 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	671	7110	663
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6120	671	7120	663
2.1.2 Efecto fiscal	6121	0	7121	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6122	-9.409	7122	-10.403
2.3 Otras reclasificaciones	6130	0	7130	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6140	8.738	7140	9.740
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 I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2013**

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

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

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

Tipología de activos titulizados	Situación actual 31/12/2013				Situación cierre anual anterior 31/12/2012				Situación inicial 16/12/2010			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)		
Participaciones hipotecarias	0001		0030		0060		0090		0120		0150	
Certificados de transmisión hipotecaria	0002		0031		0061		0091		0121		0151	
Préstamos hipotecarios	0003		0032		0062		0092		0122		0152	
Cédulas hipotecarias	0004		0033		0063		0093		0123		0153	
Préstamos a promotores	0005		0034		0064		0094		0124		0154	
Préstamos a PYMES	0007	4.714	0036	434.814	0066	6.629	0096	582.090	0126	10.130	0156	1.035.548
Préstamos a empresas	0008	15	0037	26.016	0067	23	0097	47.346	0127	32	0157	99.452
Préstamos Corporativos	0009		0038		0068		0098		0128		0158	
Cédulas territoriales	0010		0039		0069		0099		0129		0159	
Bonos de tesorería	0011		0040		0070		0100		0130		0160	
Deuda subordinada	0012		0041		0071		0101		0131		0161	
Créditos AAPP	0013		0042		0072		0102		0132		0162	
Préstamos consumo	0014		0043		0073		0103		0133		0163	
Préstamos automoción	0015		0044		0074		0104		0134		0164	
Arrendamiento financiero	0016		0045		0075		0105		0135		0165	
Cuentas a cobrar	0017		0046		0076		0106		0136		0166	
Derechos de crédito futuros	0018		0047		0077		0107		0137		0167	
Bonos de titulización	0019		0048		0078		0108		0138		0168	
Otros	0020		0049		0079		0109		0139		0169	
Total	0021	4.729	0050	460.830	0080	6.652	0110	629.436	0140	10.162	0170	1.135.000

(1) Entendido como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **2º Semestre**
 Ejercicio: **2013**
 Entidades cedentes de los activos titulizados: CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

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

CUADRO B

Movimiento de la cartera de activos titulizados/Tasa de amortización anticipada	Situación actual 31/12/2013		Situación cierre anual anterior 31/12/2012	
	Código	Importe	Código	Importe
Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior	0196	-217	0206	-300
Derechos de crédito dados de baja por dación/adjudicación de bienes desde el cierre anual anterior	0197	-341	0207	-222
Amortización ordinaria desde el cierre anual anterior	0200	-138.228	0210	-189.285
Amortización anticipada desde el cierre anual anterior	0201	-29.819	0211	-39.009
Total importe amortizado acumulado, incluyendo adjudicaciones y otros pagos en especie, desde el origen del Fondo	0202	-673.652	0212	-505.264
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	460.831	0214	629.436
Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)	0205	4,74	0215	4,55

(1) En fondos abiertos, importe de principal pendiente de reembolso en la fecha de presentación de la información de los nuevos activos incorporados en el periodo

(2) Importe del principal pendiente de reembolso de la totalidad de los activos (incluidas las nuevas incorporaciones del periodo) a fecha del informe

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 2º Semestre

Ejercicio: 2013

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

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

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

CUADRO C

Total Impagados (1)	Nº de activos	Importe impagado						Deuda Total				
		Principal pendiente vencido	Intereses ordinarios (2)		Total	Principal pendiente no vencido						
Hasta 1 mes	0700	245	0710	261	0720	14	0730	275	0740	11.746	0750	12.021
De 1 a 3 meses	0701	132	0711	807	0721	34	0731	841	0741	11.783	0751	12.624
De 3 a 6 meses	0703	36	0713	174	0723	11	0733	185	0743	1.565	0753	1.750
De 6 a 9 meses	0704	25	0714	227	0724	12	0734	239	0744	836	0754	1.075
De 9 a 12 meses	0705	26	0715	418	0725	15	0735	433	0745	615	0755	1.048
De 12 meses a 2 años	0706	144	0716	4.506	0726	238	0736	4.744	0746	5.929	0756	10.673
Más de 2 años	0708	121	0718	3.510	0728	351	0738	3.861	0748	3.981	0758	7.842
Total	0709	729	0719	9.903	0729	675	0739	10.578	0749	36.455	0759	47.033

(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	33	0782	35	0792	5	0802	40	0812	4.921	0822	4.961	0832	12.512	0842	39,65
De 1 a 3 meses	0773	10	0783	28	0793	5	0803	33	0813	1.803	0823	1.836	0833	3.587	0843	51,18
De 3 a 6 meses	0774	3	0784	18	0794	4	0804	22	0814	643	0824	665	0834	1.247	0844	53,30
De 6 a 9 meses	0775	4	0785	35	0795	6	0805	41	0815	484	0825	525	0835	1.699	0845	30,93
De 9 a 12 meses	0776	2	0786	19	0796	4	0806	23	0816	215	0826	238	0836	472	0846	50,39
De 12 meses a 2 años	0777	15	0787	412	0797	87	0807	499	0817	3.025	0827	3.524	0837	7.963	0847	44,26
Más de 2 años	0778	4	0788	280	0798	86	0808	366	0818	1.256	0828	1.622	0838	2.453	0848	66,07
Total	0779	71	0789	827	0799	197	0809	1.024	0819	12.347	0829	13.371	0839	29.933	0849	44,67

(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 pignoral, etc.) si el valor de las mismas se ha considerado en el momento inicial del Fondo

(4) Se incluirá el valor de las garantías que tengan una tasación superior a dos años

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 2º Semestre

Ejercicio: 2013

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

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

CUADRO D	Situación actual 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	5,01	0873	0,12	0891	0,00	0909	3,66	0927	0,05	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 I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Periodo: **2º Semestre**
 Ejercicio: **2013**
 Entidades cedentes de los activos titulizados: CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

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

CUADRO E Vida residual de los activos cedidos al Fondo (1)	Situación actual 31/12/2013				Situación cierre anual anterior 31/12/2012				Situación inicial 16/12/2010			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente			Nº de activos vivos	Principal pendiente			Nº de activos vivos	Principal pendiente		
Inferior a 1 año	1300	1.318	1310	19.289	1320	1.671	1330	26.558	1340	649	1350	16.997
Entre 1 y 2 años	1301	1.023	1311	57.302	1321	1.318	1331	43.074	1341	1.912	1351	72.863
Entre 2 y 3 años	1302	468	1312	27.672	1322	1.133	1332	93.439	1342	1.903	1352	142.422
Entre 3 y 5 años	1303	530	1313	65.835	1323	829	1333	82.143	1343	2.904	1353	274.706
Entre 5 y 10 años	1304	1.009	1314	189.360	1324	1.115	1334	217.599	1344	1.834	1354	319.320
Superior a 10 años	1305	381	1315	101.373	1325	586	1335	166.624	1345	960	1355	308.692
Total	1306	4.729	1316	460.831	1326	6.652	1336	629.437	1346	10.162	1356	1.135.000
Vida residual media ponderada (años)	1307	6,96			1327	7,01			1347	7,19		

(1) Los intervalos se entenderán excluido el inicio del mismo e incluido el final (p.e. Entre 1 y 2 años: superior a 1 año y menor o igual a 2 años)

Antigüedad	Situación actual 31/12/2013		Situación cierre anual anterior 31/12/2012		Situación inicial 16/12/2010	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	5,39	0632	4,36	0634	2,33

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **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 16/12/2010			
		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
ES0358932004	Bono A1	1.700	0	0	0,00	1.700	0	0	0,00	1.700	100	170.000	0,82
ES0358932012	Bono A2 (G)	6.800	28	188.757	0,64	6.800	55	376.464	2,33	6.800	100	680.000	4,18
Total		8006	8.500	8025	188.757	8045	8.500	8065	376.464	8085	8.500	8105	850.000

(1) Importes en años. En caso de ser estimado se indicará en las notas explicativas las hipótesis de estimación

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **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					
ES0358932004	Bono A1	NS		EURIBOR 3 m	1,25	0,00	360	39	0	0	0	0	0						
ES0358932012	Bono A2 (G)	NS		EURIBOR 3 m	1,90	2,12	360	39	433	0	188.757	0	189.190						
Total									9228	433	9105	0	9085	188.757	9095	0	9115	189.190	9227

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

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

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

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

(5) Días acumulados desde la última fecha de pago

(6) Intereses acumulados desde la última fecha de pago

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **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
ES0358932004	Bono A1	22-11-2011	0	170.000	0	1.979	0	170.000	0	1.979
ES0358932012	Bono A2 (G)	22-02-2043	187.707	491.244	6.375	41.618	245.856	303.537	15.131	35.243
Total			7305	187.707	7315	661.244	7325	6.375	7335	43.597
							7345	245.856	7355	473.537
									7365	15.131
									7375	37.222

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

(2) Entendiendo como fecha final aquella que de acuerdo con la documentación contractual determine la extinción del Fondo, siempre que no se haya producido previamente una causa de liquidación anticipada

(3) Total de pagos realizados desde el último cierre anual

(4) Total de pagos realizados desde la fecha de constitución del Fondo

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **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
ES0358932004	Bono A1	14-12-2010	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0358932004	Bono A1	14-06-2011	SYP	AA-	AA-	AAA
ES0358932012	Bono A2 (G)	02-07-2012	MDY	A3	A3	Aaa
ES0358932012	Bono A2 (G)	19-11-2012	SYP	A	A	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 I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2013**

INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS

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

		Situación actual 31/12/2013		Situación cierre anual anterior 31/12/2012	
1. Importe del Fondo de Reserva	0010	158.587	1010	161.170	
2. Porcentaje que representa el Fondo de Reserva, u otras mejoras equivalentes, sobre el total de activos titulizados	0020	34,41	1020	25,61	
3. Exceso de spread (%) (1)	0040	-0,53	1040	-0,03	
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	188.757	1150	376.464	
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 I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **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		
					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	3.796	0200	9.842	0300	0,01	0400	0,02	1120	0,01	
2. Activos Morosos por otras razones					0110		0210		0310		0410		1130		
Total Morosos					0120	3.796	0220	9.842	0320	0,01	0420	0,02	1140	0,01	1280
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	0050	12	0060		0130	18.034	0230	14.304	0330	0,04	0430	0,03	1050	0,04	
4. Activos Fallidos por otras razones					0140	901	0240	245	0340	0,00	0440	0,00	1160	0,00	
Total Fallidos					0150	18.935	0250	14.549	0350	0,04	0450	0,03	1200	0,04	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) ES0358932012	50,22	60,16	55,76		4.9.4 Nota de Valores
Bono A2 (G) ES0358932012	1,50	0,85	1,25		4.9.4 Nota de Valores
Bono A2 (G) ES0358932012	10,00	39,00	41,74		4.9.4 Nota de Valores
Bono A2 (G) ES0358932012	25,00	1,67	1,51		4.9.3 Nota de Valores
Diferimiento/postergamiento intereses: series (5)	0506	0526	0546	0566	
Bono A2 (G) ES0358932012	6,50	1,67	1,51		3.4.6.2. Modulo Adicional
No Reducción del Fondo de Reserva (6)	0512	0532	0552	0572	3.4.2.2. Modulo Adicional
84,02		69,68			
OTROS TRIGGERS (3)	0513	0523	0553	0573	
N/A					

(3) En caso de existir triggers adicionales a los recogidos en la presente tabla se indicarán su nombre o concepto debajo de OTROS TRIGGERS. Si los triggers recogidos expresamente en la tabla no están previstos en el Fondo, no se cumplimentarán

(4) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto al modo de amortización (prorrata/secuencial) de algunas de las series se indicarán las series afectadas indicando su ISIN, y en su defecto el nombre, el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

(5) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto al diferimiento o postergamiento de intereses de algunas de las series se indicarán las series afectadas indicando su ISIN o nombre, el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

(6) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto a la no reducción del fondo de reserva se indicará el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

--

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **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 16/12/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)	
Andalucía	0400	400	0426	37.159	0452	534	0478	48.693	0504	825	0530	83.023
Aragón	0401	70	0427	10.400	0453	87	0479	12.036	0505	137	0531	19.654
Asturias	0402	50	0428	6.896	0454	65	0480	9.781	0506	83	0532	14.133
Baleares	0403	67	0429	8.467	0455	84	0481	10.048	0507	116	0533	13.879
Canarias	0404	45	0430	3.172	0456	65	0482	4.604	0508	104	0534	9.226
Cantabria	0405	40	0431	1.725	0457	62	0483	2.431	0509	128	0535	5.639
Castilla-León	0406	166	0432	17.443	0458	220	0484	22.741	0510	319	0536	42.547
Castilla La Mancha	0407	496	0433	34.318	0459	748	0485	50.296	0511	1.154	0537	96.485
Cataluña	0408	528	0434	48.354	0460	749	0486	70.701	0512	1.161	0538	139.710
Ceuta	0409	20	0435	3.263	0461	30	0487	3.797	0513	42	0539	5.195
Extremadura	0410	34	0436	3.528	0462	46	0488	5.247	0514	72	0540	10.478
Galicia	0411	132	0437	18.642	0463	186	0489	23.859	0515	260	0541	39.212
Madrid	0412	2.149	0438	186.169	0464	3.057	0490	251.799	0516	4.743	0542	463.433
Meilla	0413	0	0439	0	0465	0	0491	0	0517	0	0543	0
Murcia	0414	58	0440	7.726	0466	67	0492	9.933	0518	107	0544	18.230
Navarra	0415	34	0441	9.181	0467	42	0493	10.126	0519	54	0545	17.763
La Rioja	0416	19	0442	1.903	0468	25	0494	2.656	0520	40	0546	5.856
Comunidad Valenciana	0417	351	0443	51.900	0469	498	0495	76.414	0521	696	0547	125.430
País Vasco	0418	70	0444	10.585	0470	87	0496	14.273	0522	121	0548	25.106
Total España	0419	4.729	0445	460.831	0471	6.652	0497	629.435	0523	10.162	0549	1.134.999
Otros países Unión europea	0420	0	0446	0	0472	0	0498	0	0524	0	0550	0
Resto	0422	0	0448	0	0474	0	0500	0	0526	0	0552	0
Total general	0425	4.729	0450	460.831	0475	6.652	0501	629.435	0527	10.162	0553	1.134.999

(1) Entendiendo como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **2º 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 31/12/2013						Situación cierre anual anterior 31/12/2012						Situación inicial 16/12/2010					
	Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)	
Euro - EUR	0571	4.729	0577	460.831	0583	460.831	0600	6.652	0606	629.436	0611	629.436	0620	10.162	0626	1.135.000	0631	1.135.000
EEUU Dólar - USD	0572	0	0578	0	0584	0	0601	0	0607	0	0612	0	0621	0	0627	0	0632	0
Japón Yen - JPY	0573	0	0579	0	0585	0	0602	0	0608	0	0613	0	0622	0	0628	0	0633	0
Reino Unido Libra - GBP	0574	0	0580	0	0586	0	0603	0	0609	0	0614	0	0623	0	0629	0	0634	0
Otras	0575	0			0587	0	0604	0			0615	0	0624	0			0635	0
Total	0576	4.729			0588	460.831	0605	6.652			0616	629.436	0625	10.162			0636	1.135.000

(1) Entendiendo como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **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 16/12/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	1100	237	1110	35.244	1120	188	1130	28.246	1140	181	1150	34.362
40% - 60%	1101	445	1111	112.839	1121	486	1131	126.787	1141	187	1151	51.881
60% - 80%	1102	45	1112	13.517	1122	92	1132	33.431	1142	464	1152	146.897
80% - 100%	1103	5	1113	1.403	1123	10	1133	2.180	1143	32	1153	10.582
100% - 120%	1104	0	1114	0	1124	1	1134	425	1144	5	1154	1.106
120% - 140%	1105	1	1115	732	1125	1	1135	782	1145	3	1155	828
140% - 160%	1106	0	1116	0	1126	0	1136	0	1146	1	1156	876
superior al 160%	1107	3	1117	2.329	1127	4	1137	2.914	1147	4	1157	3.443
Total	1108	736	1118	166.064	1128	782	1138	194.765	1148	877	1158	249.975
Media ponderada (%)			1119	51,27			1139	55,53			1159	64,07

(1) Distribución según el valor de la razón entre el importe pendiente de amortizar de los préstamos con garantía real y la última valoración disponible de tasación de los inmuebles hipotecados, o valor razonable de otras garantías reales, siempre que el valor de las mismas se haya considerado en el momento inicial del Fondo, expresada en porcentaje

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **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 ICO	448		15.999		1,47		2,36	
IRPH	10		297		0,82		4,39	
EURIBOR	3.796		423.866		0,85		1,42	
TIPO FIJO	468		20.541		0,00		4,35	
CECA	7		128		0,28		5,49	
Total	1405	4.729	1415	460.831	1425	0,83	1435	1,59

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 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 16/12/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior al 1%	1500	471	1521	72.225	1542	26	1563	223	1584	98	1605	7.952
1% - 1,49%	1501	1.652	1522	209.905	1543	47	1564	20.562	1585	91	1606	62.046
1,5% - 1,99%	1502	617	1523	84.634	1544	1.672	1565	115.660	1586	3.211	1607	435.265
2% - 2,49%	1503	546	1524	35.636	1545	1.207	1566	246.957	1587	1.630	1608	294.850
2,5% - 2,99%	1504	688	1525	32.124	1546	1.106	1567	123.971	1588	1.185	1609	106.891
3% - 3,49%	1505	89	1526	2.047	1547	867	1568	56.623	1589	1.463	1610	91.721
3,5% - 3,99%	1506	214	1527	10.089	1548	712	1569	34.373	1590	642	1611	50.928
4% - 4,49%	1507	77	1528	4.916	1549	165	1570	10.619	1591	498	1612	25.421
4,5% - 4,99%	1508	115	1529	3.906	1550	410	1571	9.425	1592	265	1613	11.445
5% - 5,49%	1509	83	1530	2.143	1551	153	1572	4.109	1593	223	1614	19.050
5,5% - 5,99%	1510	110	1531	2.176	1552	167	1573	5.401	1594	290	1615	11.753
6% - 6,49%	1511	24	1532	319	1553	34	1574	460	1595	199	1616	7.332
6,5% - 6,99%	1512	13	1533	286	1554	20	1575	381	1596	236	1617	7.867
7% - 7,49%	1513	2	1534	42	1555	2	1576	43	1597	31	1618	720
7,5% - 7,99%	1514	5	1535	196	1556	12	1577	278	1598	23	1619	583
8% - 8,49%	1515	17	1536	123	1557	41	1578	251	1599	66	1620	977
8,5% - 8,99%	1516	2	1537	38	1558	5	1579	53	1600	5	1621	97
9% - 9,49%	1517	2	1538	22	1559	4	1580	39	1601	5	1622	92
9,5% - 9,99%	1518	1	1539	4	1560	1	1581	4	1602	0	1623	0
Superior al 10%	1519	1	1540	0	1561	1	1582	4	1603	1	1624	9
Total	1520	4.729	1541	460.831	1562	6.652	1583	629.436	1604	10.162	1625	1.134.999
Tipo de interés medio ponderado de los activos(%)			9542	1,59			9584	2,53			1626	2,40
Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%)			9543	2,11			9585	2,56			1627	2,69

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2013**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

CUADRO F

Concentración	Situación actual 31/12/2013				Situación cierre anual anterior 31/12/2012				Situación inicial 16/12/2010			
	Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	2000	9,77			2030	9,80			2060	8,59		
Sector: (1)	2010	11,87	2020	47	2040	11,28	2050	47	2070	11,09	2080	47

(1) Indíquese denominación del sector con mayor concentración

(2) Incluir código CNAE con dos niveles de agregación

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID FTPYME I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 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 16/12/2010					
	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros		Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros	
Euro - EUR	3000	8.500	3060	188.757	3110	188.757	3170	8.500	3230	850.000	3250	850.000
EEUU Dólar - USDR	3010	0	3070	0	3120	0	3180	0	3240	0	3260	0
Japón Yen - JPY	3020	0	3080	0	3130	0	3190	0	3250	0	3270	0
Reino Unido Libra - GBP	3030	0	3090	0	3140	0	3200	0	3260	0	3280	0
Otras	3040	0			3150	0	3210	0			3290	0
Total	3050	8.500			3160	188.757	3220	8.500			3300	850.000

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.06

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

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene
Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

N/A