

**MADRID RMBS II - Fondo de Titulización de Activos**

LIQUIDACION DEL PERIODO 22/08/12 - 22/11/12

|                                                         | Euros                |
|---------------------------------------------------------|----------------------|
| <b>I. Situación al 22/08/12:</b>                        | <b>6.324.515,43</b>  |
| Saldo Inial Cuenta Tesorería                            | 6.324.515,43         |
| <b>II. Fondos recibidos del emisor</b>                  | <b>19.719.429,97</b> |
| <b>Principal:</b>                                       |                      |
| Según calendario hasta 31/10/12:                        | 7.341.290,75         |
| Amort. Anticipada hasta 31/10/12:                       | 6.134.501,56         |
| <b>Intereses:</b>                                       | 5.045.171,66         |
| <b>Ingreso por venta de inmuebles</b>                   | 1.198.466,00         |
| <b>III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):</b>     | <b>26.043.945,40</b> |
| <b>IV. Total intereses de la reinversión:</b>           | <b>18.329,52</b>     |
| Intereses de la Cta. De Tesorería                       | 18.329,52            |
| <b>V. Recursos disponibles ( III + IV):</b>             | <b>26.062.274,92</b> |
| <b>VI. Gastos:</b>                                      | <b>71.731,97</b>     |
| <b>VII. Liquidación SWAP:</b>                           | <b>-2.413.773,47</b> |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):                | 3.014.662,27         |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (BBVA):                 | 600.888,80           |
| <b>VIII. Pago a los Bonos:</b>                          | <b>22.346.092,71</b> |
| <b>Bonos A2 :</b>                                       |                      |
| Intereses correspondientes al 22/11/12:                 | 516.765,60           |
| Retenciones practicadas a los bonos:                    | 108.482,40           |
| Amortización correspondiente al 22/11/12:               | 21.096.784,80        |
| <b>Bonos A3 :</b>                                       |                      |
| Intereses correspondientes al 22/11/12:                 | 355.347,00           |
| Retenciones practicadas a los bonos:                    | 74.628,00            |
| Amortización correspondiente al 22/11/12:               | 0,00                 |
| <b>Bonos B:</b>                                         |                      |
| Intereses correspondientes al 22/11/12:                 | 92.572,20            |
| Retenciones practicadas a los bonos:                    | 19.441,80            |
| Amortización correspondiente al 22/11/12:               | 0,00                 |
| <b>Bonos C:</b>                                         |                      |
| Intereses correspondientes al 22/11/12:                 | 107.811,00           |
| Retenciones practicadas a los bonos:                    | 22.639,50            |
| Amortización correspondiente al 22/11/12:               | 0,00                 |
| <b>Bonos D:</b>                                         |                      |
| Intereses correspondientes al 22/11/12:                 | 64.513,98            |
| Retenciones practicadas a los bonos:                    | 13.546,62            |
| Amortización correspondiente al 22/11/12:               | 0,00                 |
| <b>Bonos E:</b>                                         |                      |
| Intereses correspondientes al 22/11/12:                 | 112.298,13           |
| Retenciones practicadas a los bonos:                    | 23.583,42            |
| Amortización correspondiente al 22/11/12:               | 0,00                 |
| <b>Reinversión o devolución de las retenciones (1):</b> | <b>-262.321,74</b>   |
| <b>IX. Saldo disponible ( V - VI + VII - VIII ):</b>    | <b>1.230.676,77</b>  |
| <b>Distribución del saldo disponible:</b>               |                      |
| Fondo de Reserva previo (22/08/12):                     | 6.324.515,43         |
| Aportación al Fondo de Reserva                          | -5.093.838,66        |
| Intereses préstamo subordinado Desfase pagados          | 0,00                 |
| Intereses préstamo subordinado G.I. pagados             | 0,00                 |
| Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada         | 0,00                 |
| Amortización préstamo subordinado Desfase               | 0,00                 |
| Amortización préstamo subordinado G.I.                  | 0,00                 |
| Amortización Préstamo Participativo                     | 0,00                 |
| Otros recursos                                          | 0,00                 |
| <b>Remuneración Variable Prést. Participativo</b>       | <b>0,00</b>          |
| <b>Fondo de Reserva (22/11/12):</b>                     | <b>1.230.676,77</b>  |

(1) Hasta el 20/12/12

Destinatarios: CNMV; AIAF.



Nº: 7993/12

Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.: 917020808

http://www.tda-sgft.com

MADRID RMBS II Iq.trimNov12

**MADRID RMBS II****INFORMACION A LOS INVERSORES****FECHA DE PAGO: 22 de Noviembre de 2012**

| Importes en euros                                                                  |                          |                  |
|------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------|------------------|
| <b>I. BONOS A2 ES0359092014</b>                                                    | <b>Sobre 9360 bonos</b>  | <b>Por Bono</b>  |
| 1. Saldo inicial (18/12/06):                                                       | 936.000.000,00 €         | 100.000,00 €     |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:                          | 425.711.145,60 €         | 45.481,96 €      |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:                           | 516.765,60 €             | 55,21 €          |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:                            | 21.096.784,80 €          | 2.253,93 €       |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:                               | 404.614.360,80 €         | 43.228,03 €      |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento:                                            | 43,228030%               | 43,228030%       |
| <b>II. BONOS A3 ES0359092022</b>                                                   | <b>Sobre 2700 bonos</b>  | <b>Por Bono</b>  |
| 1. Saldo inicial (18/12/06):                                                       | 270.000.000,00 €         | 100.000,00 €     |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:                          | 270.000.000,00 €         | 100.000,00 €     |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:                           | 355.347,00 €             | 131,61 €         |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:                            | 0,00 €                   | 0,00 €           |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:                               | 270.000.000,00 €         | 100.000,00 €     |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento:                                            | 100,000000%              | 100,000000%      |
| <b>III. BONOS B ES0359092030</b>                                                   | <b>Sobre 630 bonos</b>   | <b>Por Bono</b>  |
| 1. Saldo inicial (18/12/06):                                                       | 63.000.000,00 €          | 100.000,00 €     |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:                          | 63.000.000,00 €          | 100.000,00 €     |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:                           | 92.572,20 €              | 146,94 €         |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:                            | 0,00 €                   | 0,00 €           |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:                               | 63.000.000,00 €          | 100.000,00 €     |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento:                                            | 100,000000%              | 100,000000%      |
| <b>IV. BONOS C ES0359092048</b>                                                    | <b>Sobre 675 bonos</b>   | <b>Por Bono</b>  |
| 1. Saldo inicial (18/12/06):                                                       | 67.500.000,00 €          | 100.000,00 €     |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:                          | 67.500.000,00 €          | 100.000,00 €     |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:                           | 107.811,00 €             | 159,72 €         |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:                            | 0,00 €                   | 0,00 €           |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:                               | 67.500.000,00 €          | 100.000,00 €     |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento:                                            | 100,000000%              | 100,000000%      |
| <b>V. BONOS D ES0359092055</b>                                                     | <b>Sobre 306 bonos</b>   | <b>Por Bono</b>  |
| 1. Saldo inicial (18/12/06):                                                       | 30.600.000,00 €          | 100.000,00 €     |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:                          | 30.600.000,00 €          | 100.000,00 €     |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:                           | 64.513,98 €              | 210,83 €         |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:                            | 0,00 €                   | 0,00 €           |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:                               | 30.600.000,00 €          | 100.000,00 €     |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento:                                            | 100,000000%              | 100,000000%      |
| <b>VI. BONOS E ES0359092063</b>                                                    | <b>Sobre 189 bonos</b>   | <b>Por Bono</b>  |
| 1. Saldo inicial (18/12/06):                                                       | 18.900.000,00 €          | 100.000,00 €     |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:                          | 18.900.000,00 €          | 100.000,00 €     |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:                           | 112.298,13 €             | 594,17 €         |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:                            | 0,00 €                   | 0,00 €           |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:                               | 18.900.000,00 €          | 100.000,00 €     |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento:                                            | 100,000000%              | 100,000000%      |
| <b>VII. EL FONDO</b>                                                               | <b>Importes en euros</b> |                  |
| <b>1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/10/12:</b>                        |                          |                  |
| a) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias No Fallidas: |                          | 854.614.369,44 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias Fallidas:    |                          | 114.141.387,13 € |
| c) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias No Fallidas:       |                          | 854.914.027,83 € |
| d) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias Fallidas:          |                          | 119.113.254,24 € |
| <b>2. Amortización del periodo 31/07/12 a 31/10/12:</b>                            |                          |                  |
| a) Según calendario:                                                               |                          | 7.341.290,75 €   |
| b) Amortización anticipada hasta 31/10/12:                                         |                          | 6.134.501,56 €   |
| <b>3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):</b>                            |                          |                  |
| a) Ultimo año:                                                                     |                          | 5,08%            |
| b) Ultimo semestre:                                                                |                          | 5,46%            |
| c) Ultimo trimestre:                                                               |                          | 2,77%            |
| 4. Porcentaje de fallidos (1):                                                     |                          | 12,23%           |
| 5. Nivel de Impago(2):                                                             |                          | 0,85%            |

(1) Saldo pendiente de las participaciones hipotecarias fallidas según definición del Folleto de Emisión (retraso de 6 meses y otras causas), sobre el saldo pendiente total.

(2) Importe de principal de las Participaciones Hipotecarias con morosidad superior a 90 días en la Fecha de Cobro inmediata anterior a la Fecha de Pago en curso, sobre el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias.

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF; Agencia de Calificación.



**Nº: 7994/12**

Titulación de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.: 917020808

<http://www.tda-egft.com>

MADRID RMBS IIInfoinver.trimNov12

**MADRID RMBS II , FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
**INFORMACION CORRESPONDIENTE AL PERÍODO: 22/08/12-22/11/12**
**I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO**

|                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|---------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Fecha de Constitución del Fondo                                                 | 12 de diciembre de 2006                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| Fecha Emisión BTH                                                               | 12 de diciembre de 2006                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| Fecha Final Amortización BTH (teórica) (10% TAA)                                | 22 de mayo de 2023                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| Sociedad Gestora                                                                | Titulización de Activos, SGFT,S.A.                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca | BANKIA (Caja Madrid)                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| Agente de Pagos                                                                 | Barclays Bank PLC                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| Negociación Mercado                                                             | Mercado AIAF                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| Agencia de Calificación                                                         | Moody's Investors Service/ Fitch Ibcfa/Standard & Poor's                                                                                                                                                                                                                                               |
| Calificación                                                                    | Bonos A2: A(sf) (F)/ A3(sf) (M)/ A+(sf) (S&P)<br>Bonos A3: A(sf) (F)/ A3(sf) (M)/ A+(sf) (S&P)<br>Bonos B: BBB(sf) (F)/ Ba1(sf) (M)/ BB(sf) (S&P)<br>Bonos C: BB-(sf) (F)/ Caa2(sf) (M)/ B(sf) (S&P)<br>Bonos D: CCC(sf) (F)/ C(sf) (M)/ B-(sf) (S&P)<br>Bonos E: CC(sf) (F)/ C(sf) (M)/ CCC(sf) (S&P) |

**II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO**

| Nombre                                    | Bonos de Titulización MADRID RMBS II |
|-------------------------------------------|--------------------------------------|
| Serie A2:                                 |                                      |
| Código ISIN                               | ES0359092014                         |
| Nominal en circulación total (inicial)    | 936.000.000,00 Euros                 |
| Nominal en circulación total (actual)     | 404.614.360,80 Euros                 |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros                     |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 43.228,03 Euros                      |

## II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)

| Nombre                                    | Bonos de Titulización MADRID RMBS II |
|-------------------------------------------|--------------------------------------|
| <b>Serie A3:</b>                          |                                      |
| Código ISIN                               | ES0359092022                         |
| Nominal en circulación total (inicial)    | 270.000.000,00 Euros                 |
| Nominal en circulación total (actual)     | 270.000.000,00 Euros                 |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros                     |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 100.000,00 Euros                     |
| <b>Serie B:</b>                           |                                      |
| Código ISIN                               | ES0359092030                         |
| Nominal en circulación total (inicial)    | 63.000.000,00 Euros                  |
| Nominal en circulación total (actual)     | 63.000.000,00 Euros                  |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros                     |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 100.000,00 Euros                     |
| <b>Serie C:</b>                           |                                      |
| Código ISIN                               | ES0359092048                         |
| Nominal en circulación total (inicial)    | 67.500.000,00 Euros                  |
| Nominal en circulación total (actual)     | 67.500.000,00 Euros                  |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros                     |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 100.000,00 Euros                     |
| <b>Serie D:</b>                           |                                      |
| Código ISIN                               | ES0359092055                         |
| Nominal en circulación total (inicial)    | 30.600.000,00 Euros                  |
| Nominal en circulación total (actual)     | 30.600.000,00 Euros                  |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros                     |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 100.000,00 Euros                     |
| <b>Serie E:</b>                           |                                      |
| Código ISIN                               | ES0359092063                         |
| Nominal en circulación total (inicial)    | 18.900.000,00 Euros                  |
| Nominal en circulación total (actual)     | 18.900.000,00 Euros                  |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros                     |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 100.000,00 Euros                     |

## III. INFORMACION INCLUIDA

|                                                                        |
|------------------------------------------------------------------------|
| * Liquidación del Período:22/08/12-22/11/12                            |
| * Flujos de Caja del Período:22/08/12-22/11/12                         |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 22 de Noviembre de 2012 |

**MADRID RMBS II****Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/08/12 - 22/11/12**

| <b>I. INVERSIONES/FINANCIACIONES</b>          | <b>Euros</b>         |                      |
|-----------------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                               | <u>Ingresos</u>      | <u>Pagos</u>         |
| Amortización Bonos Titulización Hip.          |                      | 21.096.784,80        |
| Amortización Participaciones Hip.             | 13.475.792,31        |                      |
| Amortización Ptmos. Subordinados              |                      | 0,00                 |
| Ingresos por venta de inmuebles               | 1.198.466,00         |                      |
| <b>II. INTERESES</b>                          |                      |                      |
| Intereses pagados a los BTH                   |                      | 1.249.307,91         |
| Intereses recibidos de las PHs                | 5.045.171,66         |                      |
| Intereses Ptmos. Subordinados                 |                      | 0,00                 |
| Intereses Inversiones Temporales              | 18.329,52            |                      |
| <b>III. GASTOS</b>                            |                      |                      |
| Comisiones y gastos periódicos:               |                      | 71.731,97            |
| Neto SWAP a favor de la Parte A (Contraparte) |                      | 2.413.773,47         |
| Remuneración Variable Préstamo Participativo  |                      | 0,00                 |
| <b>Total Ingresos/Pagos</b>                   | <b>19.737.759,49</b> | <b>24.831.598,15</b> |
| Saldo inicial 22/08/12                        | 6.324.515,43         |                      |
| A Inversiones Temporales                      |                      | 1.230.676,77         |
| <b>Total</b>                                  | <b>26.062.274,92</b> | <b>26.062.274,92</b> |
| Retenciones practicadas el 22/11/12           | 262.321,74           |                      |
| A Inv.Temporales hasta el 20/12/12            |                      | 262.321,74           |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 7999/12**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.:917020808

<http://www.tda-sgft.com>

MADRID RMBS IIflujo.trimNov12