

# ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.00

## I. DATOS IDENTIFICATIVOS

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

Número de registro del Fondo: **9724**

NIF Fondo: **V-85981231**

Denominación del compartimento:

Número de registro del compartimento:

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

NIF gestora: **A-80352750**

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

## 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: <b>MADRID RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS</b>
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: <b>TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.</b>
Estados agregados: <b>No</b>
Periodo: <b>1er Trimestre</b>
Ejercicio: <b>2016</b>

<b>BALANCE</b> (miles de euros)		<b>Periodo Actual</b> 31/03/2016		<b>Periodo Anterior</b> 31/12/2015
---------------------------------	--	-------------------------------------	--	---------------------------------------

<b>ACTIVO</b>				
---------------	--	--	--	--

<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0008	412.595	1008	417.878
-------------------------------	------	---------	------	---------

<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0010	412.595	1010	417.878
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	411.763	1200	417.046
2.1 Participaciones hipotecarias	0201	0	1201	0
2.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0202	404.133	1202	409.590
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	0	1206	0
2.7 Préstamos a empresas	0207	0	1207	0
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	7.832	1220	7.711
2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0221	-202	1221	-255
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	832	1230	832
3.1 Derivados de cobertura	0231	832	1231	832
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

<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0250	0	1250	0
--	------	---	------	---

<b>III. Otros activos no corrientes</b>	0260	0	1260	0
---	------	---	------	---

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: MADRID RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 1er Trimestre

Ejercicio: 2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 31/03/2016		Periodo Anterior 31/12/2015
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0270	74.263	1270	74.699
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0280	5.644	1280	5.387
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0290	17.854	1290	17.676
1. Deudores y otras cuentas a cobrar	0300	183	1300	144
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	17.671	1400	17.532
3.1 Participaciones hipotecarias	0401	0	1401	0
3.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0402	16.891	1402	16.797
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	0	1406	0
3.7 Préstamos a empresas	0407	0	1407	0
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	825	1420	804
3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0421	-234	1421	-268
3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0422	131	1422	141
3.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0423	0	1423	0
3.24 Intereses vencidos e impagados	0424	58	1424	58
4. Derivados	0430	0	1430	0
4.1 Derivados de cobertura	0431	0	1431	0
4.2 Derivados de negociación	0432	0	1432	0
5. Otros activos financieros	0440	0	1440	0
5.1 Garantías financieras	0441	0	1441	0
5.2 Otros	0442	0	1442	0
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0450	0	1450	1
1. Comisiones	0451	0	1451	0
2. Otros	0452	0	1452	1
<b>VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes</b>	0460	50.765	1460	51.635
1. Tesorería	0461	50.765	1461	51.635
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462	0	1462	0

TOTAL ACTIVO	0500	486.858	1500	492.577
--------------	------	---------	------	---------

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: <b>MADRID RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS</b>				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: <b>TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.</b>				
Estados agregados: <b>No</b>				
Periodo: <b>1er Trimestre</b>				
Ejercicio: <b>2016</b>				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 31/03/2016		Periodo Anterior 31/12/2015
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0650	465.933	1650	471.704
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0660	0	1660	0
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0700	465.933	1700	471.704
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	264.548	1710	270.204
1.1 Series no subordinadas	0711	264.548	1711	270.204
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	201.385	1720	201.500
2.1 Préstamo subordinado	0721	60.291	1721	60.291
2.2 Crédito línea de liquidez	0722	0	1722	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0723	144.000	1723	144.000
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0724	-2.906	1724	-2.791
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
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	0750	0	1750	0
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0760	20.197	1760	20.067
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0770	0	1770	0
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	0780	0	1780	0
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	0800	20.178	1800	20.049
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	0	1810	0
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	17.777	1820	17.695
2.1 Series no subordinadas	0821	17.716	1821	17.601
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	61	1824	94
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	2.326	1830	2.279
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	80	1835	102
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836	0	1836	0
3.7 Intereses vencidos e impagados	0837	2.246	1837	2.177
4. Derivados	0840	75	1840	75
4.1 Derivados de cobertura	0841	75	1841	75
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	0	1850	0
5.1 Importe bruto	0851	0	1851	0
5.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0852		1852	

<b>VII. Ajustes por periodificación</b>	0900	19	1900	18
1. Comisiones	0910	13	1910	13
1.1 Comisión sociedad gestora	0911	6	1911	6
1.2 Comisión administrador	0912	5	1912	5
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0913	2	1913	2
1.4 Comisión variable - resultados realizados	0914	807	1914	807
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	-807	1917	-807
1.8 Otras comisiones	0918	0	1918	0
2. Otros	0920	6	1920	5
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0930	728	1930	806
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0940	0	1940	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0950	728	1950	806
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0960	0	1960	0
<b>XI. Gastos de constitución en transición</b>	0970		1970	
<b>TOTAL PASIVO</b>	1000	486.858	2000	492.577

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.02

Denominación del Fondo: <b>MADRID RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS</b>							
Denominación del compartimento:							
Denominación de la gestora: <b>TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.</b>							
Estados agregados: <b>No</b>							
Periodo: <b>1er Trimestre</b>							
Ejercicio: <b>2016</b>							

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. Corriente Actual 2º semestre		P. Corriente Anterior 2º semestre		Acumulado Actual 31/03/2016		Acumulado Anterior 31/03/2015
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0100		1100		2100	848	3100	
1.1 Valores representativos de deuda	0110		1110		2110	0	3110	
1.2 Derechos de crédito	0120		1120		2120	848	3120	
1.3 Otros activos financieros	0130		1130		2130	0	3130	
<b>2. Intereses y cargas asimiladas</b>	0200		1200		2200	-406	3200	
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210		1210		2210	-192	3210	
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220		1220		2220	-214	3220	
2.3 Otros pasivos financieros	0230		1230		2230		3230	
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0240		1240		2240	76	3240	
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0250		1250		2250	518	3250	
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	0300		1300		2300	0	3300	
4.1 Ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0310		1310		2310	0	3310	
4.2 Activos financieros disponibles para la venta	0320		1320		2320	0	3320	
4.3 Otros	0330		1330		2330	0	3330	
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0400		1400		2400	0	3400	
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0500		1500		2500	0	3500	
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0600		1600		2600	-131	3600	
7.1 Servicios exteriores	0610		1610		2610	-97	3610	
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611		1611		2611	-97	3611	
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		1620		2620	0	3620	
7.3 Otros gastos de gestión corrientes	0630		1630		2630	-34	3630	
7.3.1 Comisión de sociedad gestora	0631		1631		2631	-17	3631	
7.3.2 Comisión administrador	0632		1632		2632	-11	3632	
7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos	0633		1633		2633	-6	3633	
7.3.4 Comisión variable - resultados realizados (neto)	0634		1634		2634	0	3634	
7.3.5 Comisión variables - resultados no realizados (neto)	0635		1635		2635	0	3635	
7.3.6 Otras comisiones del cedente	0636		1636		2636		3636	
7.3.7 Otros gastos	0637		1637		2637	0	3637	
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0700		1700		2700	-542	3700	
8.1 Deterioro neto de valores representativos de deuda	0710		1710		2710	0	3710	
8.2 Deterioro neto de derechos de crédito	0720		1720		2720	-542	3720	
8.3 Deterioro neto de derivados	0730		1730		2730	0	3730	
8.4 Deterioro neto de otros activos financieros	0740		1740		2740	0	3740	
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	0750		1750		2750	0	3750	
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0800		1800		2800	39	3800	
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0850		1850		2850	116	3850	
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0900		1900		2900	0	3900	
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0950		1950		2950	0	3950	
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	3000		4000		5000	0	6000	

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.03

Denominación del Fondo: <b>MADRID RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS</b>
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: <b>TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.</b>
Estados agregados: <b>No</b>
Periodo: <b>1er Trimestre</b>
Ejercicio: <b>2016</b>

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		Periodo Actual 31/03/2016		Mismo Periodo año Anterior 31/03/2015
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN</b>	8000	553	9000	
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	8100	466	9100	
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	859	9110	
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-224	9120	
1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados	8130	-2	9130	
1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras	8140	0	9140	
1.5 Intereses pagados por préstamos y créditos en entidades de crédito	8150	-167	9150	
1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	8160	0	9160	
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo</b>	8200	-34	9200	
2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora	8210	-17	9210	
2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados	8220	-11	9220	
2.3 Comisiones pagadas al agente financiero	8230	-6	9230	
2.4 Comisiones variables pagadas	8240		9240	
2.5 Otras comisiones	8250		9250	
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo</b>	8300	121	9300	
3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos	8310	0	9310	
3.2 Pagos de provisiones	8320		9320	
3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta	8325	120	9325	
3.4 Otros	8330	1	9330	
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION</b>	8350	-1.423	9350	
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	8400	0	9400	
4.1 Cobros por emisión de valores de titulización	8410	0	9410	
4.2 Pagos por emisión de valores de titulización (aseguramiento colocación)	8420		9420	
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	8500		9500	
5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito	8510		9510	
5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras	8520		9520	
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones</b>	8600	-1.326	9600	
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	4.215	9610	
6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados	8620	0	9620	
6.3 Pagos por amortización de valores de titulización	8630	-5.541	9630	
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	8700	-97	9700	
7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos	8710	0	9710	
7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos	8720		9720	
7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso	8730	0	9730	
7.4 Administraciones públicas - Pasivo	8740	0	9740	
7.5 Otros deudores y acreedores	8750	-97	9750	
7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras	8770	0	9770	
7.7 Cobros de Subvenciones	8780	0	9780	
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	8800	-870	9800	
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	51.635	9900	
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	50.765	9990	



ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.04

Denominación del Fondo: **MADRID RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **1er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		Periodo Actual 31/03/2016	Mismo Periodo año Anterior 31/03/2015
<b>1 Activos financieros disponibles para la venta</b>			
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6010	0	7010
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6020	0	7020
1.1.2 Efecto fiscal	6021	0	7021
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6022	0	7022
1.3 Otras reclasificaciones	6030	0	7030
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6040	0	7040
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>6100</b>	<b>0</b>	<b>7100</b>
<b>2 Cobertura de los flujos de efectivo</b>			
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6110	-2	7110
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6120	-2	7120
2.1.2 Efecto fiscal	6121	0	7121
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6122	-76	7122
2.3 Otras reclasificaciones	6130	0	7130
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6140	78	7140
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>6200</b>	<b>0</b>	<b>7200</b>
<b>3 Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>			
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el periodo	6310	0	7310
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6320	0	7320
3.1.2 Efecto fiscal	6321	0	7321
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6322	0	7322
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6330	0	7330
<b>Total Ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>6400</b>	<b>0</b>	<b>7400</b>
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>6500</b>	<b>0</b>	<b>7500</b>

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

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 31/03/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 29/06/2010			
	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	2.632	0031	429.681	0061	2.644	0091	434.903	0121	3.163	0151	600.000
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		0036		0066		0096		0126		0156	
Préstamos a empresas	0008		0037		0067		0097		0127		0157	
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	
<b>Total</b>	<b>0021</b>	<b>2.632</b>	<b>0050</b>	<b>429.681</b>	<b>0080</b>	<b>2.644</b>	<b>0110</b>	<b>434.903</b>	<b>0140</b>	<b>3.163</b>	<b>0170</b>	<b>600.000</b>

(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 RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **1er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**  
 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 31/03/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015	
Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior	0196	-628	0206	-2.799
Derechos de crédito dados de baja por dación/adjudicación de bienes desde el cierre anual anterior	0197	-338	0207	-1.442
Amortización ordinaria desde el cierre anual anterior	0200	-3.263	0210	-14.089
Amortización anticipada desde el cierre anual anterior	0201	-992	0211	-7.162
Total importe amortizado acumulado, incluyendo adjudicaciones y otros pagos en especie, desde el origen del Fondo	0202	-159.480	0212	-154.887
Importe de principal pendiente de amortización de los nuevos activos incorporados en el periodo (1)	0203	0	0213	0
<b>Principal pendiente cierre del periodo (2)</b>	0204	429.681	0214	434.903
<b>Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)</b>	0205	1,42	0215	1,56

(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 RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 1er Trimestre

Ejercicio: 2016

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	98	0710	27	0720	10	0730	37	0740	14.007	0750	14.044
De 1 a 3 meses	0701	29	0711	22	0721	8	0731	30	0741	5.012	0751	5.042
De 3 a 6 meses	0703	7	0713	12	0723	5	0733	17	0743	1.180	0753	1.197
De 6 a 9 meses	0704	3	0714	8	0724	5	0734	13	0744	414	0754	427
De 9 a 12 meses	0705	5	0715	22	0725	11	0735	33	0745	685	0755	718
De 12 meses a 2 años	0706	13	0716	74	0726	43	0736	117	0746	1.963	0756	2.080
Más de 2 años	0708	26	0718	360	0728	263	0738	623	0748	3.939	0758	4.562
<b>Total</b>	<b>0709</b>	<b>181</b>	<b>0719</b>	<b>525</b>	<b>0729</b>	<b>345</b>	<b>0739</b>	<b>870</b>	<b>0749</b>	<b>27.200</b>	<b>0759</b>	<b>28.070</b>

(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	98	0782	27	0792	10	0802	37	0812	14.007	0822	14.044	0832	18.015	0842	77,96
De 1 a 3 meses	0773	29	0783	22	0793	8	0803	30	0813	5.012	0823	5.042	0833	6.165	0843	81,79
De 3 a 6 meses	0774	7	0784	12	0794	5	0804	17	0814	1.180	0824	1.197	0834	1.547	0844	77,35
De 6 a 9 meses	0775	3	0785	8	0795	5	0805	13	0815	414	0825	427	0835	520	0845	82,29
De 9 a 12 meses	0776	5	0786	22	0796	11	0806	33	0816	685	0826	718	0836	941	0846	76,31
De 12 meses a 2 años	0777	13	0787	74	0797	43	0807	117	0817	1.963	0827	2.080	0837	2.457	0847	84,64
Más de 2 años	0778	26	0788	360	0798	263	0808	623	0818	3.939	0828	4.562	0838	5.098	0848	89,49
<b>Total</b>	<b>0779</b>	<b>181</b>	<b>0789</b>	<b>525</b>	<b>0799</b>	<b>345</b>	<b>0809</b>	<b>870</b>	<b>0819</b>	<b>27.200</b>	<b>0829</b>	<b>28.070</b>	<b>0839</b>	<b>34.743</b>	<b>0849</b>	<b>80,79</b>

(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 pignoralas, 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 RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 1er Trimestre

Ejercicio: 2016

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 31/03/2016						Situación cierre anual anterior 31/12/2015						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	2,01	0869	2,43	0887	0,00	0905	1,96	0923	2,27	0941	0,00	0959	0,00	0977	0,00	0995	0,00
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		0873		0891		0909		0927		0945		0963		0981		0999	
Préstamos a empresas	0856		0874		0892		0910		0928		0946		0964		0982		1000	
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 RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **1er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**  
 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 31/03/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 29/06/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior a 1 año	1300	0	1310	0	1320	1	1330	43	1340	0	1350	0
Entre 1 y 2 años	1301	0	1311	0	1321	0	1331	0	1341	0	1351	0
Entre 2 y 3 años	1302	1	1312	13	1322	0	1332	0	1342	0	1352	0
Entre 3 y 5 años	1303	3	1313	84	1323	3	1333	79	1343	0	1353	0
Entre 5 y 10 años	1304	36	1314	2.520	1324	35	1334	2.372	1344	1	1354	58
Superior a 10 años	1305	2.592	1315	427.064	1325	2.605	1335	432.409	1345	3.162	1355	599.942
<b>Total</b>	1306	2.632	1316	429.681	1326	2.644	1336	434.903	1346	3.163	1356	600.000
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	1307	24,22			1327	24,47			1347	29,68		

(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 31/03/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 29/06/2010	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	9,05	0632	8,80	0634	3,22

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

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 31/03/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Escenario inicial 29/06/2010			
		Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)		
Serie (2)		0001	0002	0003	0004	0005	0006	0007	0008	0009	0070	0080	0090
ES0358969006	Bono A	4.560	62	282.264	6,94	4.560	63	287.805	6,80	4.560	100	456.000	6,21
<b>Total</b>		8006	4.560	8025	282.264	8045	4.560	8065	287.805	8085	4.560	8105	456.000

(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 RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

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 B

Serie (1)	Denominación serie	Grado de subordinación (2)	Índice de referencia (3)	Margen (4)	Tipo aplicado	Intereses				Principal pendiente		Total 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							
		9950	9960	9970	9980	9990	9991	9993	9997	9994	9995	9998	9995					
ES0358969006	Bono A	NS	EURIBOR 3 m	0,40	0,21	360	38	61	0	282.264	0	282.325						
<b>Total</b>								9228	61	9105	0	9085	282.264	9095	0	9115	282.325	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 RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

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 31/03/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015			
			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)	
		7290	7300	7310	7320	7330	7340	7350	7360	7370
ES0358969006	Bono A	22-02-2052	5.541	173.736	224	20.878	25.115	168.195	1.293	20.654
<b>Total</b>			7305	5.541	7315	173.736	7325	224	7335	20.878
			7345	25.115	7355	168.195	7365	1.293	7375	20.654

(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 RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

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
ES0358969006	Bono A	25-02-2015	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0358969006	Bono A	05-11-2012	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 cda 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 RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

## INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS

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

		Situación actual 31/03/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015	
1. Importe del Fondo de Reserva	0010	47.176	1010	47.254	
2. Porcentaje que representa el Fondo de Reserva, u otras mejoras equivalentes, sobre el total de activos titulizados	0020	10,98	1020	10,87	
3. Exceso de spread (%) (1)	0040	0,57	1040	0,58	
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		1150		
11. Porcentaje que representa el aval sobre el total de los pasivos emitidos	0160		1160		
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 mejoras equivalentes (5)	0200		1210	Caja Madrid
Permutas financieras de tipos de interés	0210		1220	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria. S.A.
Permutas financieras de tipos de cambio	0220		1230	N/A
Otras permutas financieras	0230		1240	N/A
Contraparte de la Línea de Liquidez	0240		1250	N/A
Entidad Avalista	0250		1260	N/A
Contraparte del derivado de crédito	0260		1270	N/A

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.4

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

### 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			Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	0010		0030	90	0100	2.608	0200	2.620	0300	0,01	0400	0,01	1120	0,00	
2. Activos Morosos por otras razones					0110		0210		0310		0410		1130		
<b>Total Morosos</b>					0120	2.608	0220	2.620	0320	0,01	0420	0,01	1140	0,00	1280
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	0050	12	0060		0130	21.632	0230	21.180	0330	0,05	0430	0,05	1050	0,05	
4. Activos Fallidos por otras razones					0140	575	0240	405	0340	0,00	0440	0,00	1160	0,00	
<b>Total Fallidos</b>					0150	22.207	0250	21.585	0350	0,05	0450	0,05	1200	0,05	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
<b>Amortización secuencial: series (4)</b>	0500	0520	0540			0560
Bono A ES0358969006	48,00	33,78	33,35			4.9.4 Nota de Valores
Bono A ES0358969006	1,50	0,55	0,43			4.9.4 Nota de Valores
Bono A ES0358969006	10,00	70,51	71,04			4.9.4 Nota de Valores
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series (5)</b>	0506	0526	0546			0566
Bono A ES0358969006	9,95	3,70	3,72			3.4.6.2. Modulo Adicional
<b>No Reducción del Fondo de Reserva (6)</b>	0512	0532	0552	0572		
		16,71	16,42	0572	3.4.2.2. Modulo Adicional	
<b>OTROS TRIGGERS (3)</b>	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 RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

### 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 31/03/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 29/06/2010			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)		
Andalucía	0400	294	0426	35.926	0452	295	0478	36.363	0504	351	0530	51.156
Aragón	0401	36	0427	4.668	0453	36	0479	4.706	0505	38	0531	5.717
Asturias	0402	45	0428	5.019	0454	46	0480	5.149	0506	50	0532	6.714
Baleares	0403	50	0429	8.886	0455	50	0481	8.945	0507	65	0533	12.923
Canarias	0404	47	0430	5.317	0456	47	0482	5.365	0508	60	0534	7.971
Cantabria	0405	41	0431	5.113	0457	41	0483	5.153	0509	45	0535	6.748
Castilla-León	0406	92	0432	10.917	0458	92	0484	11.028	0510	112	0536	16.110
Castilla La Mancha	0407	212	0433	26.373	0459	214	0485	26.891	0511	285	0537	42.443
Cataluña	0408	258	0434	43.996	0460	260	0486	44.525	0512	330	0538	63.316
Ceuta	0409	6	0435	613	0461	6	0487	619	0513	7	0539	900
Extremadura	0410	29	0436	2.779	0462	29	0488	2.805	0514	36	0540	4.120
Galicia	0411	109	0437	14.589	0463	109	0489	14.679	0515	126	0541	18.967
Madrid	0412	1.145	0438	224.818	0464	1.150	0490	227.486	0516	1.339	0542	305.733
Meilla	0413	0	0439	0	0465	0	0491	0	0517	0	0543	0
Murcia	0414	17	0440	2.213	0466	17	0492	2.234	0518	23	0544	3.585
Navarra	0415	8	0441	1.153	0467	8	0493	1.163	0519	10	0545	1.875
La Rioja	0416	10	0442	1.487	0468	10	0494	1.499	0520	11	0546	1.834
Comunidad Valenciana	0417	196	0443	28.698	0469	197	0495	29.138	0521	234	0547	40.478
País Vasco	0418	37	0444	7.116	0470	37	0496	7.158	0522	41	0548	9.409
<b>Total España</b>	0419	2.632	0445	429.681	0471	2.644	0497	434.906	0523	3.163	0549	599.999
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
<b>Total general</b>	0425	2.632	0450	429.681	0475	2.644	0501	434.906	0527	3.163	0553	599.999

(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 RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

### 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 31/03/2016						Situación cierre anual anterior 31/12/2015						Situación inicial 29/06/2010					
	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	2.632	0577	429.681	0583	429.681	0600	2.644	0606	434.903	0611	434.903	0620	3.163	0626	600.000	0631	600.000
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
<b>Total</b>	<b>0576</b>	<b>2.632</b>			<b>0588</b>	<b>429.681</b>	<b>0605</b>	<b>2.644</b>			<b>0616</b>	<b>434.903</b>	<b>0625</b>	<b>3.163</b>			<b>0636</b>	<b>600.000</b>

(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 RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

### 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 31/03/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 29/06/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	1100	18	1110	1.298	1120	16	1130	1.148	1140	0	1150	0
40% - 60%	1101	92	1111	12.075	1121	78	1131	9.843	1141	0	1151	0
60% - 80%	1102	1.768	1112	286.514	1122	1.752	1132	285.608	1142	0	1152	0
80% - 100%	1103	612	1113	112.996	1123	652	1133	120.982	1143	2.918	1153	567.668
100% - 120%	1104	49	1114	4.933	1124	51	1134	5.175	1144	50	1154	5.203
120% - 140%	1105	38	1115	3.989	1125	38	1135	3.980	1145	62	1155	7.514
140% - 160%	1106	23	1116	2.787	1126	24	1136	2.910	1146	43	1156	5.469
superior al 160%	1107	32	1117	5.089	1127	33	1137	5.256	1147	90	1157	14.146
<b>Total</b>	<b>1108</b>	<b>2.632</b>	<b>1118</b>	<b>429.681</b>	<b>1128</b>	<b>2.644</b>	<b>1138</b>	<b>434.902</b>	<b>1148</b>	<b>3.163</b>	<b>1158</b>	<b>600.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>			<b>1119</b>	<b>78,09</b>			<b>1139</b>	<b>78,71</b>			<b>1159</b>	<b>91,03</b>

(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 RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **1er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**

### 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 vivos		Principal Pendiente		Margen ponderado s/ índice de referencia		Tipo de interés medio ponderado (2)	
Índice de referencia (1)	1400		1410		1420		1430	
IRPH	94		12.527		0,33		2,69	
TIPO FIJO	3		223				4,86	
EURIBOR	2.535		416.930		0,64		0,85	
<b>Total</b>	<b>1405</b>	<b>2.632</b>	<b>1415</b>	<b>429.680</b>	<b>1425</b>	<b>0,63</b>	<b>1435</b>	<b>0,91</b>

(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 RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

### 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 31/03/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 29/06/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior al 1%	1500	1.892	1521	327.466	1542	1.724	1563	305.116	1584	0	1605	0
1% - 1,49%	1501	499	1522	69.400	1543	583	1564	83.827	1585	12	1606	3.865
1,5% - 1,99%	1502	115	1523	16.259	1544	188	1565	26.227	1586	2.030	1607	409.352
2% - 2,49%	1503	59	1524	8.397	1545	56	1566	7.753	1587	653	1608	109.436
2,5% - 2,99%	1504	52	1525	6.070	1546	63	1567	8.242	1588	214	1609	36.016
3% - 3,49%	1505	10	1526	1.632	1547	23	1568	3.054	1589	144	1610	23.864
3,5% - 3,99%	1506	1	1527	81	1548	2	1569	223	1590	35	1611	5.263
4% - 4,49%	1507	1	1528	154	1549	1	1570	82	1591	8	1612	1.507
4,5% - 4,99%	1508	2	1529	162	1550	3	1571	319	1592	18	1613	2.978
5% - 5,49%	1509	0	1530	0	1551	0	1572	0	1593	33	1614	5.735
5,5% - 5,99%	1510	1	1531	62	1552	1	1573	62	1594	11	1615	1.377
6% - 6,49%	1511	0	1532	0	1553	0	1574	0	1595	2	1616	316
6,5% - 6,99%	1512	0	1533	0	1554	0	1575	0	1596	3	1617	292
7% - 7,49%	1513	0	1534	0	1555	0	1576	0	1597	0	1618	0
7,5% - 7,99%	1514	0	1535	0	1556	0	1577	0	1598	0	1619	0
8% - 8,49%	1515	0	1536	0	1557	0	1578	0	1599	0	1620	0
8,5% - 8,99%	1516	0	1537	0	1558	0	1579	0	1600	0	1621	0
9% - 9,49%	1517	0	1538	0	1559	0	1580	0	1601	0	1622	0
9,5% - 9,99%	1518	0	1539	0	1560	0	1581	0	1602	0	1623	0
Superior al 10%	1519	0	1540	0	1561	0	1582	0	1603	0	1624	0
<b>Total</b>	<b>1520</b>	<b>2.632</b>	<b>1541</b>	<b>429.683</b>	<b>1562</b>	<b>2.644</b>	<b>1583</b>	<b>434.905</b>	<b>1604</b>	<b>3.163</b>	<b>1625</b>	<b>600.001</b>
<b>Tipo de interés medio ponderado de los activos(%)</b>			<b>9542</b>	<b>0,90</b>			<b>9584</b>	<b>0,97</b>			<b>1626</b>	<b>2,03</b>
<b>Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%)</b>			<b>9543</b>	<b>0,34</b>			<b>9585</b>	<b>0,39</b>			<b>1627</b>	<b>0,95</b>

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **1er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**

### OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

#### CUADRO F

Concentración	Situación actual 31/03/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 29/06/2010			
	Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	2000	1,59			2030	1,59			2060	1,46		
Sector: (1)	2010		2020		2040		2050		2070		2080	

(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 RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **1er Trimestre**  
 Ejercicio: **2016**

### 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 31/03/2016						Situación inicial 29/06/2010					
	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	4.560	3060	282.264	3110	282.264	3170	4.560	3230	456.000	3250	456.000
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
<b>Total</b>	<b>3050</b>	<b>4.560</b>			<b>3160</b>	<b>282.264</b>	<b>3220</b>	<b>4.560</b>			<b>3300</b>	<b>456.000</b>

# ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.06

Denominación del Fondo: **MADRID RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
Denominación del compartimento:  
Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
Estados agregados: **No**  
Periodo: **1er Trimestre**  
Ejercicio: **2016**

## NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene  
Información adicional  
en fichero adjunto

## INFORME DE AUDITOR

N/A