

# ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.00

## I. DATOS IDENTIFICATIVOS

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

Número de registro del Fondo: **8591**

NIF Fondo: **V-84916956**

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: **2009**

## II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA



### Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:

Como consecuencia del proceso de auditoria, se ha modificado del estado S01 al estado S04, así como los estados S05 referidos al activo, exceptuando los estados S05\_1C y S05\_1D

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: <b>MADRID RMBS 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>2º Semestre</b>
Ejercicio: <b>2009</b>

<b>BALANCE</b> (miles de euros)		<b>Periodo Actual</b> 31/12/2009		<b>Periodo Anterior</b> 31/12/2008
---------------------------------	--	-------------------------------------	--	---------------------------------------

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

<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0008	1.119.854	1008	
-------------------------------	------	-----------	------	--

<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0010	1.119.854	1010	
1. Valores representativos de deuda	0100	0	1100	
1.1 Bancos centrales	0101	0	1101	
1.2 Administraciones Públicas españolas	0102	0	1102	
1.3 Entidades de crédito	0103	0	1103	
1.4 Otros sectores residentes	0104	0	1104	
1.5 Administraciones Públicas no residentes	0105	0	1105	
1.6 Otros sectores no residentes	0106	0	1106	
1.7 Activos dudosos	0107	0	1107	
1.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0108		1108	
1.9 Intereses y gastos devengados no vencidos	0109	0	1109	
1.10 Ajustes por operaciones de cobertura	0110	0	1110	
2. Derechos de crédito	0200	1.116.252	1200	
2.1 Participaciones hipotecarias	0201	0	1201	
2.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0202	1.050.740	1202	
2.3 Préstamos hipotecarios	0203	0	1203	
2.4 Cédulas Hipotecarias	0204	0	1204	
2.5 Préstamos a promotores	0205	0	1205	
2.6 Préstamos a PYMES	0206	0	1206	
2.7 Préstamos a empresas	0207	0	1207	
2.8 Préstamos Corporativos	0208	0	1208	
2.9 Cédulas territoriales	0209	0	1209	
2.10 Bonos de Tesorería	0210	0	1210	
2.11 Deuda Subordinada	0211	0	1211	
2.12 Créditos AAPP	0212	0	1212	
2.13 Préstamos Consumo	0213	0	1213	
2.14 Préstamos automoción	0214	0	1214	
2.15 Cuotas de Arrendamiento financiero (leasing)	0215	0	1215	
2.16 Cuentas a cobrar	0216	0	1216	
2.17 Derechos de crédito futuros	0217	0	1217	
2.18 Bonos de titulización	0218	0	1218	
2.19 Otros	0219	0	1219	
2.20 Activos dudosos	0220	120.758	1220	
2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0221	-55.246	1221	
2.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0222	0	1222	
2.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0223	0	1223	
3. Derivados	0230	3.602	1230	
3.1 Derivados de cobertura	0231	3.602	1231	
3.2 Derivados de negociación	0232	0	1232	
4. Otros activos financieros	0240	0	1240	
4.1 Garantías financieras	0241	0	1241	
4.2 Otros	0242	0	1242	

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: <b>MADRID RMBS 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>2º Semestre</b>				
Ejercicio: <b>2009</b>				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2009		Periodo Anterior 31/12/2008
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0270	68.691	1270	
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0280	0	1280	
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0290	35.917	1290	
1. Deudores y otras cuentas a cobrar	0300	0	1300	
2. Valores representativos de deuda	0310	0	1310	
2.1 Bancos centrales	0311	0	1311	
2.2 Administraciones Públicas españolas	0312	0	1312	
2.3 Entidades de crédito	0313	0	1313	
2.4 Otros sectores residentes	0314	0	1314	
2.5 Administraciones Públicas no residentes	0315	0	1315	
2.6 Otros sectores no residentes	0316	0	1316	
2.7 Activos dudosos	0317	0	1317	
2.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0318		1318	
2.9 Intereses y gastos devengados no vencidos	0319	0	1319	
2.10 Ajustes por operaciones de cobertura	0320	0	1320	
3. Derechos de crédito	0400	35.617	1400	
3.1 Participaciones hipotecarias	0401	0	1401	
3.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0402	34.030	1402	
3.3 Préstamos hipotecarios	0403	0	1403	
3.4 Cédulas Hipotecarias	0404	0	1404	
3.5 Préstamos a promotores	0405	0	1405	
3.6 Préstamos a PYMES	0406	0	1406	
3.7 Préstamos a empresas	0407	0	1407	
3.8 Préstamos Corporativos	0408	0	1408	
3.9 Cédulas territoriales	0409	0	1409	
3.10 Bonos de Tesorería	0410	0	1410	
3.11 Deuda Subordinada	0411	0	1411	
3.12 Créditos AAPP	0412	0	1412	
3.13 Préstamos Consumo	0413	0	1413	
3.14 Préstamos automoción	0414	0	1414	
3.15 Arrendamiento financiero	0415	0	1415	
3.16 Cuentas a cobrar	0416	0	1416	
3.17 Derechos de crédito futuros	0417	0	1417	
3.18 Bonos de titulización	0418	0	1418	
3.19 Otros	0419	0	1419	
3.20 Activos dudosos	0420	649	1420	
3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0421		1421	
3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0422	938	1422	
3.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0423	0	1423	
4. Derivados	0430	300	1430	
4.1 Derivados de cobertura	0431	300	1431	
4.2 Derivados de negociación	0432	0	1432	
5. Otros activos financieros	0440	0	1440	
5.1 Garantías financieras	0441	0	1441	
5.2 Otros	0442	0	1442	
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0450	3	1450	
1. Comisiones	0451	0	1451	
2. Otros	0452	3	1452	
<b>VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes</b>	0460	32.771	1460	
1. Tesorería	0461	32.771	1461	
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462	0	1462	
<b>TOTAL ACTIVO</b>	<b>0500</b>	<b>1.188.545</b>	<b>1500</b>	

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: <b>MADRID RMBS 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>2º Semestre</b>				
Ejercicio: <b>2009</b>				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2009		Periodo Anterior 31/12/2008
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0650	1.134.213	1650	
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0660	0	1660	
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0700	1.134.213	1700	
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	1.104.943	1710	
1.1 Series no subordinadas	0711	0	1711	
1.2 Series subordinadas	0712	1.104.943	1712	
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0713		1713	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0714	0	1714	
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0715	0	1715	
2. Deudas con entidades de crédito	0720	29.270	1720	
2.1 Préstamo subordinado	0721	68.941	1721	
2.2 Crédito línea de liquidez	0722	0	1722	
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0723	0	1723	
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0724	-39.671	1724	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0725	0	1725	
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0726	0	1726	
3. Derivados	0730	0	1730	
3.1 Derivados de cobertura	0731	0	1731	
3.2 Derivados de negociación	0732	0	1732	
4. Otros pasivos financieros	0740	0	1740	
4.1 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0741		1741	
4.2 Otros	0742	0	1742	
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	0750	0	1750	
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0760	48.212	1760	
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0770	0	1770	
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	0780	0	1780	
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	0800	48.183	1800	
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	2.309	1810	
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	35.910	1820	
2.1 Series no subordinadas	0821	0	1821	
2.2 Series subordinadas	0822	34.317	1822	
2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0823		1823	
2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0824	1.593	1824	
2.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0825	0	1825	
3. Deudas con entidades de crédito	0830	9.964	1830	
3.1 Préstamo subordinado	0831	0	1831	
3.2 Crédito línea de liquidez	0832	0	1832	
3.3 Otras deudas con entidades de crédito	0833	0	1833	
3.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0834		1834	
3.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0835	9.964	1835	
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836	0	1836	
4. Derivados	0840	0	1840	
4.1 Derivados de cobertura	0841	0	1841	
4.2 Derivados de negociación	0842	0	1842	
5. Otros pasivos financieros	0850	0	1850	
5.1 Importe bruto	0851	0	1851	
5.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0852		1852	
<b>VII. Ajustes por periodificación</b>	0900	29	1900	
1. Comisiones	0910	28	1910	
1.1 Comisión sociedad gestora	0911	22	1911	

1.2 Comisión administrador	0912	0	1912	
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0913	6	1913	
1.4 Comisión variable - resultados realizados	0914	0	1914	
1.5 Comisión variable - resultados no realizados	0915	0	1915	
1.6 Otras comisiones del cedente	0916	0	1916	
1.7 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0917		1917	
1.8 Otras comisiones	0918	0	1918	
2. Otros	0920	1	1920	
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0930	6.120	1930	
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0940	0	1940	
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0950	6.120	1950	
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0960	0	1960	
<b>XI. Gastos de constitución en transición</b>	0970		1970	
<b>TOTAL PASIVO</b>	1000	1.188.545	2000	

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.02

Denominación del Fondo: <b>MADRID RMBS 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>2º Semestre</b>							
Ejercicio: <b>2009</b>							

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. Corriente Actual 2º semestre		P. Corriente Anterior 2º semestre		Acumulado Actual 31/12/2009		Acumulado Anterior 31/12/2008
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0100	28.302	1100		2100	52.290	3100	
1.1 Valores representativos de deuda	0110	0	1110		2110	0	3110	
1.2 Derechos de crédito	0120	17.866	1120		2120	51.323	3120	
1.3 Otros activos financieros	0130	10.436	1130		2130	967	3130	
<b>2. Intereses y cargas asimiladas</b>	0200	-23.900	1200		2200	-43.957	3200	
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210	-7.217	1210		2210	-25.748	3210	
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220	-1.036	1220		2220	-2.562	3220	
2.3 Otros pasivos financieros	0230	-15.647	1230		2230	-15.647	3230	
<b>MARGEN DE INTERESES</b>	0250	4.402	1250		2250	8.333	3250	
<b>3. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	0300	-1	1300		2300	-1	3300	
3.1 Ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0310	0	1310		2310	0	3310	
3.2 Activos financieros disponibles para la venta	0320	0	1320		2320	0	3320	
3.3 Otros	0330	-1	1330		2330	-1	3330	
<b>4. Diferencias de cambio (neto)</b>	0400	0	1400		2400	0	3400	
<b>5. Otros ingresos de explotación</b>	0500	0	1500		2500	0	3500	
<b>6. Otros gastos de explotación</b>	0600	-144	1600		2600	-322	3600	
6.1 Servicios exteriores	0610	-72	1610		2610	-95	3610	
6.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611	-72	1611		2611	-95	3611	
6.1.2 Servicios bancarios y similares	0612		1612		2612		3612	
6.1.3 Publicidad y propaganda	0613		1613		2613		3613	
6.1.4 Otros servicios	0614		1614		2614		3614	
6.2 Tributos	0620	0	1620		2620	0	3620	
6.3 Otros gastos de gestión corrientes	0630	-72	1630		2630	-227	3630	
6.3.1 Comisión de sociedad gestora	0631	-38	1631		2631	-159	3631	
6.3.2 Comisión administrador	0632		1632		2632		3632	
6.3.3 Comisión del agente financiero/pagos	0633	-29	1633		2633	-63	3633	
6.3.4 Comisión variable - resultados realizados	0634	0	1634		2634	0	3634	
6.3.5 Comisión variables - resultados no realizados	0635	0	1635		2635	0	3635	
6.3.6 Otras comisiones del cedente	0636		1636		2636		3636	
6.3.7 Otros gastos	0637	-5	1637		2637	-5	3637	
<b>7. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0700	-55.246	1700		2700	-55.246	3700	
7.1 Deterioro neto de valores representativos de deuda (-)	0710	0	1710		2710	0	3710	
7.2 Deterioro neto de derechos de crédito (-)	0720	-55.246	1720		2720	-55.246	3720	
7.3 Deterioro neto de derivados (-)	0730	0	1730		2730	0	3730	
7.4 Deterioro neto de otros activos financieros(-)	0740	0	1740		2740	0	3740	
<b>8. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	0750	0	1750		2750	0	3750	
<b>9. Ganancias (pérdidas) en la baja de activos no corrientes en venta</b>	0800	0	1800		2800	0	3800	
<b>10. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0850	50.989	1850		2850	47.236	3850	
<b>RESULTADOS ANTES DE IMPUESTOS</b>	0900	0	1900		2900	0	3900	
<b>11. Impuesto sobre beneficios</b>	0950	0	1950		2950	0	3950	
<b>RESULTADO DEL PERIODO</b>	3000	0	4000		5000	0	6000	

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.03

Denominación del Fondo: <b>MADRID RMBS 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>2º Semestre</b>
Ejercicio: <b>2009</b>

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2009		Periodo Anterior 31/12/2008
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN</b>	8000	135.307	9000	0
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	8100	7.910	9100	0
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	57.331	9110	
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-30.514	9120	
1.3 Intereses cobrados/pagados netos por operaciones de derivados	8130	-19.968	9130	
1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras	8140	1.061	9140	
1.5 Intereses pagados de préstamos y créditos en entidades de crédito	8150		9150	
1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	8160		9160	
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo</b>	8200	-299	9200	
2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora	8210	-234	9210	
2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados	8220		9220	
2.3 Comisiones pagadas al agente financiero	8230	-65	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	127.696	9300	0
3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos	8310	129.558	9310	
3.2 Pagos de provisiones	8320		9320	
3.3 Otros	8330	-1.862	9330	
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION</b>	8350	-140.315	9350	0
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	8400	0	9400	0
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	-140.286	9600	0
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	168.196	9610	
6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados	8620		9620	
6.3 Pagos por amortización de valores de titulización	8630	-308.482	9630	
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	8700	-29	9700	0
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		9730	
7.4 Administraciones públicas - Pasivo	8740		9740	
7.5 Otros deudores y acreedores	8750	-29	9750	
7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras	8770		9770	
7.7 Cobros de Subvenciones	8780		9780	
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	8800	-5.008	9800	0
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	37.779	9900	
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	32.771	9990	

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.04

Denominación del Fondo: <b>MADRID RMBS 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>2º Semestre</b> Ejercicio: <b>2009</b>
---

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2009		Periodo Anterior 31/12/2008
<b>1 Activos financieros disponibles para la venta</b>				
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6010	0	7010	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6020		7020	
1.1.2 Efecto fiscal	6021		7021	
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6022		7022	
1.3 Otras reclasificaciones	6030		7030	
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6040		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>0</b>
<b>2 Cobertura de los flujos de efectivo</b>				
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6110	114.652	7110	0
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6120	114.652	7120	
2.1.2 Efecto fiscal	6121		7121	
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6122	15.647	7122	
2.3 Otras reclasificaciones	6130		7130	
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6140	-130.299	7140	
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>6200</b>	<b>0</b>	<b>7200</b>	<b>0</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	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6320		7320	
3.1.2 Efecto fiscal	6321		7321	
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6322		7322	
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6330		7330	
<b>Total Ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>6400</b>	<b>0</b>	<b>7400</b>	<b>0</b>
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>6500</b>	<b>0</b>	<b>7500</b>	<b>0</b>



## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2009**

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 A Tipología de activos titulizados	Situación actual 31/12/2009				Situación cierre anual anterior 31/12/2008				Situación inicial 12/12/2006			
	Nº de activos vivos	Importe pendiente (1)			Nº de activos vivos	Importe pendiente (1)			Nº de activos vivos	Importe pendiente (1)		
Participaciones hipotecarias	0001		0030		0060		0090		0120		0150	
Certificados de transmisión hipotecaria	0002	7.028	0031	1.205.815	0061	8.457	0091	1.503.569	0121	9.884	0151	1.800.000
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>7.028</b>	<b>0050</b>	<b>1.205.815</b>	<b>0080</b>	<b>8.457</b>	<b>0110</b>	<b>1.503.569</b>	<b>0140</b>	<b>9.884</b>	<b>0170</b>	<b>1.800.000</b>

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **2º Semestre**  
 Ejercicio: **2009**  
 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 31/12/2009		Situación cierre anual anterior 31/12/2008	
	Código	Importe	Código	Importe
Amortización ordinaria desde el cierre anual anterior	0200	-149.176	0210	-37.375
Amortización anticipada desde el cierre anual anterior	0201	-148.578	0211	-80.329
Total importe amortizado acumulado desde el origen del Fondo	0202	-594.185	0212	-296.431
Importe pendiente de amortización de los nuevos activos incorporados en el periodo (1)	0203	0	0213	0
<b>Importe pendiente cierre del periodo (2)</b>	<b>0204</b>	<b>1.205.815</b>	<b>0214</b>	<b>1.503.569</b>
<b>Tasa amortización anticipada efectiva del periodo</b>	<b>0205</b>	<b>0,05</b>	<b>0215</b>	<b>0,05</b>

(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 RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 2º Semestre

Ejercicio: 2009

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						Principal pendiente no vencido		Deuda Total		
		Principal	Intereses ordinarios		Total	Principal	Total					
Hasta 1 mes	0700	444	0710	108	0720	129	0730	237	0740	77.256	0750	77.493
De 1 a 2 meses	0701	91	0711	50	0721	65	0731	115	0741	16.183	0751	16.298
De 2 a 3 meses	0702	42	0712	36	0722	45	0732	81	0742	7.189	0752	7.270
De 3 a 6 meses	0703	68	0713	85	0723	127	0733	212	0743	11.299	0753	11.511
De 6 a 12 meses	0704	176	0714	598	0724	1.007	0734	1.605	0744	31.207	0754	32.812
De 12 a 18 meses	0705	234	0715	1.008	0725	2.711	0735	3.719	0745	44.099	0755	47.818
De 18 meses a 2 años	0706	139	0716	747	0726	2.323	0736	3.070	0746	26.149	0756	29.219
De 2 a 3 años	0707	28	0717	180	0727	667	0737	847	0747	5.674	0757	6.521
Más de 3 años	0708	0	0718	0	0728	0	0738	0	0748	0	0758	0
<b>Total</b>	<b>0709</b>	<b>1.222</b>	<b>0719</b>	<b>2.812</b>	<b>0729</b>	<b>7.074</b>	<b>0739</b>	<b>9.886</b>	<b>0749</b>	<b>219.056</b>	<b>0759</b>	<b>228.942</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 2 meses, estos es: superior a 1 mes y menor o igual a 2 meses)

Impagados con garantía real (2)	Nº de activos	Importe impagado						Principal pendiente no		Deuda Total	Valor garantía (3)	% Deuda/v. Tasación				
		Principal	Intereses ordinarios		Total	vencido										
Hasta 1 mes	0770	444	0780	108	0790	129	0800	237	0810	77.256	0820	77.493	0830	86.707	0840	89,37
De 1 a 2 meses	0771	91	0781	50	0791	65	0801	115	0811	16.183	0821	16.298	0831	18.212	0841	89,50
De 2 a 3 meses	0772	42	0782	36	0792	45	0802	81	0812	7.189	0822	7.270	0832	8.146	0842	89,24
De 3 a 6 meses	0773	68	0783	85	0793	127	0803	212	0813	11.299	0823	11.511	0833	12.714	0843	90,54
De 6 a 12 meses	0774	176	0784	598	0794	1.007	0804	1.605	0814	31.207	0824	32.812	0834	36.740	0844	89,31
De 12 a 18 meses	0775	234	0785	1.008	0795	2.711	0805	3.719	0815	44.099	0825	47.818	0835	49.783	0845	96,05
De 18 meses a 2 años	0776	139	0786	747	0796	2.323	0806	3.070	0816	26.149	0826	29.219	0836	29.415	0846	99,33
De 2 a 3 años	0777	28	0787	180	0797	667	0807	847	0817	5.674	0827	6.521	0837	6.185	0847	105,42
Más de 3 años	0778	0	0788	0	0798	0	0808	0	0818	0	0828	0	0838	0	0848	0,00
<b>Total</b>	<b>0779</b>	<b>1.222</b>	<b>0789</b>	<b>2.812</b>	<b>0799</b>	<b>7.074</b>	<b>0809</b>	<b>9.886</b>	<b>0819</b>	<b>219.056</b>	<b>0829</b>	<b>228.942</b>	<b>0839</b>	<b>247.902</b>	<b>0849</b>	<b>92,35</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 pignoral, etc.) si el valor de las mismas se ha considerado en el momento inicial del Fondo

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 2º Semestre

Ejercicio: 2009

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 31/12/2009				Situación cierre anual anterior 31/12/2008				Escenario inicial			
	Tasa de activos dudosos (A)	Tasa de fallido (B)	Tasa de recuperación de activos dudosos (C)	Tasa de recuperación fallidos (D)	Tasa de activos dudosos (A)	Tasa de fallido (B)	Tasa de recuperación de activos dudosos (C)	Tasa de recuperación fallidos (D)	Tasa de activos dudosos (A)	Tasa de fallido (B)	Tasa de recuperación de activos dudosos (C)	Tasa de recuperación fallidos (D)
Participaciones hipotecarias	0850	0868	0886	0904	0922	0940	0958	0976	0994	1012	1030	1048
Certificados de transmisión de hipoteca	0851	0,01 0869	0,11 0887	0,18 0905	0,06 0923	0,08 0941	0,26 0959	1,05 0977	0,00 0995	0,00 1013	0,00 1031	0,00 1049
Préstamos hipotecarios	0852	0870	0888	0906	0924	0942	0960	0978	0996	1014	1032	1050
Cédulas Hipotecarias	0853	0871	0889	0907	0925	0943	0961	0979	0997	1015	1033	1051
Préstamos a promotores	0854	0872	0890	0908	0926	0944	0962	0980	0998	1016	1034	1052
Préstamos a PYMES	0855	0873	0891	0909	0927	0945	0963	0981	0999	1017	1035	1053
Préstamos a empresas	0856	0874	0892	0910	0928	0946	0964	0982	1000	1018	1036	1054
Préstamos Corporativos	0857	0875	0893	0911	0929	0947	0965	0983	1001	1019	1037	1055
Bonos de Tesorería	0858	0876	0894	0912	0930	0948	0966	0984	1002	1020	1038	1056
Deuda subordinada	0859	0877	0895	0913	0931	0949	0967	0985	1003	1021	1039	1057
Créditos AAPP	0860	0878	0896	0914	0932	0950	0968	0986	1004	1022	1040	1058
Préstamos Consumo	0861	0879	0897	0915	0933	0951	0969	0987	1005	1023	1041	1059
Préstamos automoción	0862	0880	0898	0916	0934	0952	0970	0988	1006	1024	1042	1060
Cuotas arrendamiento financiero	0863	0881	0899	0917	0935	0953	0971	0989	1007	1025	1043	1061
Cuentas a cobrar	0864	0882	0900	0918	0936	0954	0972	0990	1008	1026	1044	1062
Derechos de crédito futuros	0865	0883	0901	0919	0937	0955	0973	0991	1009	1027	1045	1063
Bonos de titulización	0866	0884	0902	0920	0938	0956	0974	0992	1010	1028	1046	1064
Otros	0867	0885	0903	0921	0939	0957	0975	0993	1011	1029	1047	1065

(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")

(A) Determinada por el cociente entre el importe de principal pendiente de reembolso de los activos clasificados como dudoso y el resultado de minorar al importe de principal pendiente de reembolso del total de la cartera, el importe de principal pendiente de reembolso de los activos fallidos. La clasificación como dudosos se realizará con arreglo a lo previsto en las Normas 13ª y 23ª

(B) Determinada por el cociente entre el importe de principal pendiente de reembolso del total activos clasificados como fallidos y el resultado de minorar al importe principal pendiente de reembolso del total de la cartera, el importe de principal pendiente de reembolso del total de activos fallidos. Se considera 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).

(C) Determinada por el cociente entre la suma de: el importe total de recuperaciones de impagos de principal de activos clasificados como dudosos, más el importe de principal pendiente de reembolso de los activos que salen de dudosos por las recuperaciones de principal producidas en el periodo, dividido por el importe de principal pendiente de reembolso de los activos clasificados como dudosos antes de las recuperaciones

(D) Determinada por el cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos y el importe de principal pendiente de reembolso de activos clasificados como fallidos antes de las recuperaciones

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **2º Semestre**  
 Ejercicio: **2009**  
 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 31/12/2009				Situación cierre anual anterior 31/12/2008				Situación inicial 12/12/2006			
	Nº de activos vivos		Importe pendiente		Nº de activos vivos		Importe pendiente		Nº de activos vivos		Importe pendiente	
Inferior a 1 año	1300	0	1310	0	1320	1	1330	10	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	11	1322	0	1332	0	1342	0	1352	0
Entre 3 y 5 años	1303	3	1313	93	1323	0	1333	0	1343	0	1353	0
Entre 5 y 10 años	1304	35	1314	2.674	1324	29	1334	2.189	1344	3	1354	241
Superior a 10 años	1305	6.989	1315	1.203.037	1325	8.427	1335	1.501.370	1345	9.881	1355	1.799.759
<b>Total</b>	1306	7.028	1316	1.205.815	1326	8.457	1336	1.503.569	1346	9.884	1356	1.800.000
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	1307	24,52			1327	25,49			1347	27,35		

(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 31/12/2009		Situación cierre anual anterior 31/12/2008		Situación inicial 12/12/2006	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	4,77	0632	3,74	0634	1,72

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2009**

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 (2)	Denominación serie	Situación actual 31/12/2009				Situación cierre anual anterior 31/12/2008				Escenario inicial 12/12/2006			
		Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Importe pendiente	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Importe pendiente	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Importe pendiente	Vida media de los pasivos (1)
		0001	0002	0003	0004	0005	0006	0007	0008	0009	0070	0080	0090
ES0359092006	SERIE A1	4.140	0	0	0,00	4.140	15	61.741	0,19	4.140	100	414.000	0,75
ES0359092014	SERIE A2	9.360	74	689.260	3,74	9.360	100	936.000	3,37	9.360	100	936.000	3,81
ES0359092022	SERIE A3	2.700	100	270.000	12,09	2.700	100	270.000	12,35	2.700	100	270.000	10,00
ES0359092030	SERIE B	630	100	63.000	7,86	630	100	63.000	8,22	630	100	63.000	7,19
ES0359092048	SERIE C	675	100	67.500	7,86	675	100	67.500	8,22	675	100	67.500	7,19
ES0359092055	SERIE D	306	100	30.600	7,86	306	100	30.600	8,22	306	100	30.600	7,19
ES0359092063	SERIE E	189	100	19.376	7,86	189	100	18.900	8,22	189	100	18.900	7,19
<b>Total</b>		<b>8006</b>	<b>18.000</b>	<b>8025</b>	<b>1.139.736</b>	<b>8045</b>	<b>18.000</b>	<b>8065</b>	<b>1.447.741</b>	<b>8085</b>	<b>18.000</b>	<b>8105</b>	<b>1.800.000</b>

(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 RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2009**

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	Base de cálculo de intereses	Días Acumulados (5)	Intereses Acumulados (6)	Importe pendiente								
									Principal no vencido	Principal impagado	Intereses impagados	Total pendiente (7)					
									9994	9995	9997	9998					
ES0359092006	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	360	38	0	0	0	0	0	0				
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,87	360	38	629	689.260	0	0	0	689.260				
ES0359092022	SERIE A3	S	EURIBOR 3 m	0,19	0,91	360	38	258	270.000	0	0	0	270.000				
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	0,97	360	38	64	63.000	0	0	0	63.000				
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	1,02	360	38	72	67.500	0	0	0	67.500				
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	1,22	360	38	39	30.600	0	0	0	30.600				
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	2,72	360	38	54	18.900	0	0	476	19.376				
<b>Total</b>								9228	1.116	9085	1.139.260	9095	0	9105	476	9115	1.139.736

(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

(7) Incluye el principal no vencido y todos los importes impagados a la fecha de la declaración

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2009**

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 31/12/2009				Situación cierre anual anterior 31/12/2008			
			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
ES0359092006	SERIE A1	22-08-2049	61.741	414.000	763	23.408	185.387	352.259	8.972	22.645
ES0359092014	SERIE A2	22-08-2049	246.740	246.740	19.664	103.512	0	0	46.488	83.848
ES0359092022	SERIE A3	22-08-2049	0	0	6.004	30.403	0	0	13.521	24.399
ES0359092030	SERIE B	22-08-2049	0	0	1.439	7.206	0	0	3.193	5.767
ES0359092048	SERIE C	22-08-2049	0	0	1.576	7.822	0	0	3.456	6.246
ES0359092055	SERIE D	22-08-2049	0	0	776	3.728	0	0	1.629	2.952
ES0359092063	SERIE E	22-08-2049	0	0	290	2.670	0	0	1.296	2.380
<b>Total</b>			<b>7305</b>	<b>308.481</b>	<b>7315</b>	<b>660.740</b>	<b>7325</b>	<b>30.512</b>	<b>7335</b>	<b>178.749</b>
							<b>7345</b>	<b>185.387</b>	<b>7355</b>	<b>352.259</b>
									<b>7365</b>	<b>78.555</b>
									<b>7375</b>	<b>148.237</b>

(1) La gestora deberá complementar 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 RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2009**

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
ES0359092006	SERIE A1	12-12-2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0359092006	SERIE A1	12-12-2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092006	SERIE A1	12-12-2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092014	SERIE A2	18-03-2009	FCH	AA-	AAA	AAA
ES0359092014	SERIE A2	12-12-2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	29-04-2009	SYP	AA	AAA	AAA
ES0359092022	SERIE A3	18-03-2009	FCH	AA-	AAA	AAA
ES0359092022	SERIE A3	11-09-2009	MDY	A1	Aa2	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	29-04-2009	SYP	AA	AAA	AAA
ES0359092030	SERIE B	18-03-2009	FCH	A-	AA	AA
ES0359092030	SERIE B	11-09-2009	MDY	Ba1	A2	Aa1
ES0359092030	SERIE B	22-05-2009	SYP	BB	A	AA
ES0359092048	SERIE C	18-03-2009	FCH	BB	A-	A
ES0359092048	SERIE C	11-09-2009	MDY	Caa2	Baa2	A1
ES0359092048	SERIE C	22-05-2009	SYP	B	BBB	A
ES0359092055	SERIE D	18-03-2009	FCH	CCC	BBB-	BBB
ES0359092055	SERIE D	11-09-2009	MDY	C	Ba3	Baa2
ES0359092055	SERIE D	29-04-2009	SYP	CCC	B	BBB
ES0359092063	SERIE E	18-03-2009	FCH	CC	BB-	BB+
ES0359092063	SERIE E	11-09-2009	MDY	C	B3	Ba1
ES0359092063	SERIE E	22-05-2009	SYP	D	CCC	BB

(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 -

# ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.3

Denominación del Fondo: <b>MADRID RMBS 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>2º Semestre</b> Ejercicio: <b>2009</b>
---

<b>INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS</b> <i>(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)</i>		<b>Situación actual</b> <b>31/12/2009</b>		<b>Situación cierre</b> <b>anual anterior</b> <b>31/12/2008</b>
---	--	--	--	---

1. Importe del Fondo de Reserva u otras mejoras equivalentes	0010	0	1010	0
2. Porcentaje que representa el Fondo de Reserva, u otras mejoras equivalentes, sobre el total de activos titulizados	0020	0,00	1020	0,00
3. Exceso de spread (%) (1)	0040	1,52	1040	2,05
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		1090	
8. Subordinación de series (S/N)	0110	Si	1110	Si
9. Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total de bonos (3)	0120	60,50	1120	4,26
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	No	1180	No

(1) Diferencial existente entre los tipos de interés medios percibidos de la cartera de activos titulizados 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

<b>Información sobre contrapartes de las mejoras crediticias</b>		<b>NIF</b>	<b>*</b>	<b>Denominación</b>
Contraparte del Fondo de Reserva u otras mejoras equivalentes (5)	0200		1210	Caja Madrid
Permutas financieras de tipos de interés	0210		1220	Caja Madrid
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 RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2009**

**CIRCUNSTANCIAS ESPECÍFICAS ESTABLECIDAS CONTRACTUALMENTE EN EL FONDO**

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

Concepto (1)	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio (2)				Ref. Folleto		
	0010		0030	90	Situación actual	Periodo anterior	Situación actual	Periodo anterior	Situación actual	Periodo anterior	Última Fecha Pago				
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a					0100	9.565	0200	84.453	0300	0,01	0400	0,06	1120	0,01	
2. Activos Morosos por otras razones					0110		0210		0310		0410		1130		
<b>Total Morosos</b>					0120	9.565	0220	84.453	0320	0,01	0420	0,06	1140	0,01	1280
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	0050	6	0060		0130	110.525	0230	99.351	0330	0,10	0430	0,07	1050	0,11	
4. Activos Fallidos por otras razones					0140		0240		0340		0440		1160		
<b>Total Fallidos</b>					0150	110.525	0250	99.351	0350	0,10	0450	0,07	1200	0,11	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	
SERIE C ES0359092048	7,50	5,92	5,66		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359092048	1,75	0,88	1,47		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359092048	10,00	66,99	68,66		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359092063	2,10	1,66	1,58		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359092063	1,25	0,88	1,47		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359092063	10,00	66,99	68,66		4.9.4 Nota de Valores
SERIE A2 ES0359092014	25,00	6,62	7,27		4.9.4 Nota de Valores
SERIE A1 ES0359092006	25,00	6,62	7,27		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359092055	3,40	2,69	2,56		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359092055	1,50	0,88	1,47		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359092055	10,00	66,99	68,66		4.9.4 Nota de Valores

SERIE A3 ES0359092022		25,00		6,62		7,27		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359092030		7,00		5,53		5,28		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359092030		2,00		0,88		1,47		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359092030		10,00		66,99		68,66		4.9.4 Nota de Valores
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series (5)</b>		<b>0506</b>		<b>0526</b>		<b>0546</b>		<b>0566</b>
SERIE C ES0359092048		13,20		6,62		7,27		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE B ES0359092030		18,30		6,62		7,27		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE E ES0359092063		8,00		6,62		7,27		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE D ES0359092055		9,40		6,62		7,27		3.4.6.2. Modulo Adicional
<b>No Reducción del Fondo de Reserva (6)</b>	<b>0512</b>		<b>0532</b>	0,00	<b>0552</b>	0,00	<b>0572</b>	3.4.2.1. Modulo Adicional
<b>OTROS TRIGGERS (3)</b>		<b>0513</b>		<b>0523</b>		<b>0553</b>		<b>0573</b>
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 RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 2º Semestre

Ejercicio: 2009

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 31/12/2009				Situación cierre anual anterior 31/12/2008				Situación inicial 12/12/2006			
	Nº de activos vivos		Importe pendiente (1)		Nº de activos vivos		Importe pendiente (1)		Nº de activos vivos		Importe pendiente (1)	
Andalucía	0400	291	0426	37.164	0452	329	0478	43.042	0504	413	0530	55.364
Aragón	0401	133	0427	18.125	0453	157	0479	22.508	0505	176	0531	26.730
Asturias	0402	54	0428	6.244	0454	60	0480	7.090	0506	71	0532	8.457
Baleares	0403	61	0429	9.916	0455	65	0481	10.792	0507	73	0533	12.511
Canarias	0404	50	0430	5.817	0456	68	0482	8.503	0508	84	0534	10.967
Cantabria	0405	99	0431	12.316	0457	109	0483	14.289	0509	129	0535	18.240
Castilla-León	0406	158	0432	18.540	0458	175	0484	21.806	0510	212	0536	27.344
Castilla La Mancha	0407	335	0433	48.347	0459	412	0485	63.206	0511	489	0537	75.861
Cataluña	0408	678	0434	123.885	0460	781	0486	147.346	0512	968	0538	187.210
Ceuta	0409	39	0435	2.636	0461	46	0487	3.238	0513	59	0539	4.472
Extremadura	0410	34	0436	3.041	0462	37	0488	3.339	0514	39	0540	3.661
Galicia	0411	105	0437	13.400	0463	110	0489	14.341	0515	128	0541	17.541
Madrid	0412	4.467	0438	837.556	0464	5.469	0490	1.058.229	0516	6.243	0542	1.238.324
Meilla	0413	0	0439	0	0465	0	0491	0	0517	0	0543	0
Murcia	0414	34	0440	4.275	0466	47	0492	5.910	0518	63	0544	8.031
Navarra	0415	27	0441	4.075	0467	33	0493	5.308	0519	45	0545	7.831
La Rioja	0416	29	0442	3.998	0468	42	0494	6.069	0520	48	0546	7.344
Comunidad Valenciana	0417	309	0443	34.000	0469	385	0495	44.143	0521	482	0547	58.238
País Vasco	0418	125	0444	22.481	0470	132	0496	24.412	0522	162	0548	31.874
<b>Total España</b>	0419	7.028	0445	1.205.816	0471	8.457	0497	1.503.571	0523	9.884	0549	1.800.000
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	7.028	0450	1.205.816	0475	8.457	0501	1.503.571	0527	9.884	0553	1.800.000

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2009**

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

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

#### CUADRO B

Divisa/Activos titulizados	Situación actual 31/12/2009						Situación cierre anual anterior 31/12/2008						Situación inicial 12/12/2006					
	Nº de activos vivos		Importe pendiente en Divisa (1)		Importe pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Importe pendiente en Divisa (1)		Importe pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Importe pendiente en Divisa (1)		Importe pendiente en euros (1)	
Euro - EUR	0571	7.028	0577	1.205.815	0583	1.205.815	0600	8.457	0606	1.503.569	0611	1.503.569	0620	9.884	0626	1.800.000	0631	1.800.000
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>	0576	7.028			0588	1.205.815	0605	8.457			0616	1.503.569	0625	9.884			0636	1.800.000

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2009**

### 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 31/12/2009				Situación cierre anual anterior 31/12/2008				Situación inicial 12/12/2006			
	Nº de activos vivos		Importe pendiente		Nº de activos vivos		Importe pendiente		Nº de activos vivos		Importe pendiente	
0% - 40%	1100	0	1110	1.489	1120	0	1130	1.040	1140	0	1150	0
40% - 60%	1101	0	1111	14.394	1121	0	1131	12.351	1141	0	1151	0
60% - 80%	1102	0	1112	97.921	1122	0	1132	43.336	1142	0	1152	0
80% - 100%	1103	0	1113	1.091.441	1123	0	1133	1.444.160	1143	0	1153	1.699.335
100% - 120%	1104	0	1114	569	1124	0	1134	2.682	1144	0	1154	100.665
120% - 140%	1105	0	1115	0	1125	0	1135	0	1145	0	1155	0
140% - 160%	1106	0	1116	0	1126	0	1136	0	1146	0	1156	0
superior al 160%	1107	0	1117	0	1127	0	1137	0	1147	0	1157	0
<b>Total</b>	<b>1108</b>	<b>0</b>	<b>1118</b>	<b>1.205.814</b>	<b>1128</b>	<b>0</b>	<b>1138</b>	<b>1.503.569</b>	<b>1148</b>	<b>0</b>	<b>1158</b>	<b>1.800.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>			<b>1119</b>	<b>0,89</b>			<b>1139</b>	<b>0,91</b>			<b>1159</b>	<b>0,94</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 RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **2º Semestre**  
 Ejercicio: **2009**

### 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		Importe Pendiente		Margen ponderado s/ índice de referencia		Tipo de interés medio ponderado (2)	
	vivos							
Índice de referencia (1)	1400		1410		1420		1430	
EURIBOR		7.028		1.205.815		1,04		2,45
<b>Total</b>	<b>1405</b>	<b>7.028</b>	<b>1415</b>	<b>1.205.815</b>	<b>1425</b>	<b>1,04</b>	<b>1435</b>	<b>2,45</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 RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 2º Semestre

Ejercicio: 2009

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 31/12/2009				Situación cierre anual anterior 31/12/2008				Situación inicial 12/12/2006			
	Nº de activos vivos		Importe pendiente		Nº de activos vivos		Importe pendiente		Nº de activos vivos		Importe pendiente	
Inferior al 1%	1500	0	1521	0	1542	0	1563	0	1584	0	1605	0
1% - 1,49%	1501	0	1522	0	1543	0	1564	0	1585	0	1606	0
1,5% - 1,99%	1502	957	1523	200.041	1544	0	1565	0	1586	0	1607	0
2% - 2,49%	1503	2.588	1524	452.271	1545	0	1566	0	1587	0	1608	0
2,5% - 2,99%	1504	2.566	1525	424.939	1546	0	1567	0	1588	2	1609	715
3% - 3,49%	1505	782	1526	112.394	1547	0	1568	0	1589	10	1610	1.870
3,5% - 3,99%	1506	132	1527	15.793	1548	1	1569	178	1590	651	1611	149.152
4% - 4,49%	1507	1	1528	161	1549	0	1570	0	1591	2.908	1612	564.581
4,5% - 4,99%	1508	0	1529	0	1550	2	1571	381	1592	4.003	1613	716.576
5% - 5,49%	1509	1	1530	79	1551	83	1572	17.684	1593	1.835	1614	307.979
5,5% - 5,99%	1510	0	1531	0	1552	1.788	1573	361.205	1594	469	1615	58.649
6% - 6,49%	1511	0	1532	0	1553	3.341	1574	585.811	1595	6	1616	478
6,5% - 6,99%	1512	1	1533	138	1554	2.646	1575	457.314	1596	0	1617	0
7% - 7,49%	1513	0	1534	0	1555	593	1576	80.737	1597	0	1618	0
7,5% - 7,99%	1514	0	1535	0	1556	3	1577	259	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>	1520	7.028	1541	1.205.816	1562	8.457	1583	1.503.569	1604	9.884	1625	1.800.000
<b>Tipo de interés medio ponderado (%)</b>			9542	2,45			9584	6,34			1626	4,60

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2009**

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

#### CUADRO F

Concentración	Situación actual 31/12/2009				Situación cierre anual anterior 31/12/2008				Situación inicial 12/12/2006			
	Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	2000	0,49			2030	0,42			2060	0,37		
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 RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **2º Semestre**  
 Ejercicio: **2009**

### 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 31/12/2009						Situación inicial 12/12/2006					
	Nº de pasivos emitidos		Importe pendiente en Divisa		Importe pendiente en euros		Nº de pasivos emitidos		Importe pendiente en Divisa		Importe pendiente en euros	
Euro - EUR	3000	18.000	3060	1.139.736	3110	1.139.736	3170	18.000	3230	1.800.000	3250	1.800.000
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>18.000</b>			<b>3160</b>	<b>1.139.736</b>	<b>3220</b>	<b>18.000</b>			<b>3300</b>	<b>1.800.000</b>

# ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.06

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
Denominación del compartimento:  
Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
Estados agregados: **No**  
Periodo: **2º Semestre**  
Ejercicio: **2009**

## NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene  
Información adicional  
en fichero adjunto

## INFORME DE AUDITOR

N/A