

# 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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2014**

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



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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: **MADRID 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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2014**

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2014		Periodo Anterior 31/12/2013
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0008	769.906	1008	792.228
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0010	769.906	1010	792.228
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	769.906	1200	792.228
2.1 Participaciones hipotecarias	0201	0	1201	0
2.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0202	730.491	1202	753.972
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	40.038	1220	39.469
2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0221	-623	1221	-1.213
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	0	1230	0
3.1 Derivados de cobertura	0231	0	1231	0
3.2 Derivados de negociación	0232	0	1232	0
4. Otros activos financieros	0240	0	1240	0
4.1 Garantías financieras	0241	0	1241	0
4.2 Otros	0242	0	1242	0
<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: <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>1er Semestre</b>				
Ejercicio: <b>2014</b>				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2014		Periodo Anterior 31/12/2013
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0270	85.869	1270	85.646
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0280	38.933	1280	36.765
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0290	38.771	1290	38.577
1. Deudores y otras cuentas a cobrar	0300	0	1300	0
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	38.770	1400	38.577
3.1 Participaciones hipotecarias	0401	0	1401	0
3.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0402	34.498	1402	34.750
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	5.254	1420	4.804
3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0421	-1.805	1421	-1.805
3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0422	424	1422	428
3.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0423	0	1423	0
3.24 Intereses vencidos e impagados	0424	399	1424	400
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	1	1440	0
5.1 Garantías financieras	0441	0	1441	0
5.2 Otros	0442	1	1442	0
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0450	5	1450	0
1. Comisiones	0451	0	1451	0
2. Otros	0452	5	1452	0
<b>VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes</b>	0460	8.160	1460	10.304
1. Tesorería	0461	8.160	1461	10.304
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462	0	1462	0

TOTAL ACTIVO	0500	855.775	1500	877.874
--------------	------	---------	------	---------

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>1er Semestre</b>				
Ejercicio: <b>2014</b>				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2014		Periodo Anterior 31/12/2013
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0650	801.302	1650	825.191
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0660	0	1660	0
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0700	801.302	1700	825.191
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	744.040	1710	765.718
1.1 Series no subordinadas	0711	564.040	1711	585.718
1.2 Series subordinadas	0712	180.000	1712	180.000
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	45.600	1720	47.551
2.1 Préstamo subordinado	0721	68.941	1721	68.941
2.2 Crédito línea de liquidez	0722	0	1722	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0723	0	1723	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0724	-23.341	1724	-21.390
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	11.662	1730	11.922
3.1 Derivados de cobertura	0731	11.662	1731	11.922
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	66.456	1760	65.596
<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	60.165	1800	59.625
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	0	1810	0
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	40.865	1820	40.378
2.1 Series no subordinadas	0821	39.752	1821	39.554
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	476	1824	401
2.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0825	0	1825	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0826	637	1826	423
3. Deudas con entidades de crédito	0830	18.476	1830	17.688
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	173	1835	166
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836	0	1836	0
3.7 Intereses vencidos e impagados	0837	18.303	1837	17.522
4. Derivados	0840	824	1840	1.559
4.1 Derivados de cobertura	0841	824	1841	1.559
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	6.291	1900	5.971
1. Comisiones	0910	21	1910	21
1.1 Comisión sociedad gestora	0911	17	1911	17
1.2 Comisión administrador	0912	0	1912	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0913	4	1913	4
1.4 Comisión variable - resultados realizados	0914	0	1914	0
1.5 Comisión variable - resultados no realizados	0915	0	1915	0
1.6 Otras comisiones del cedente	0916	0	1916	0
1.7 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0917		1917	
1.8 Otras comisiones	0918	0	1918	0
2. Otros	0920	6.270	1920	5.950
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0930	-11.983	1930	-12.913
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0940	0	1940	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0950	-11.983	1950	-12.913
<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	855.775	2000	877.874

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>1er Semestre</b>							
Ejercicio: <b>2014</b>							

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. Corriente Actual 2º semestre		P. Corriente Anterior 2º semestre		Acumulado Actual 30/06/2014		Acumulado Anterior 30/06/2013
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0100		1100		2100	5.751	3100	6.514
1.1 Valores representativos de deuda	0110		1110		2110	0	3110	0
1.2 Derechos de crédito	0120		1120		2120	5.748	3120	6.513
1.3 Otros activos financieros	0130		1130		2130	3	3130	1
<b>2. Intereses y cargas asimiladas</b>	0200		1200		2200	-2.842	3200	-2.643
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210		1210		2210	-2.054	3210	-1.878
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220		1220		2220	-788	3220	-765
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	-1.271	3240	-2.177
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0250		1250		2250	1.638	3250	1.694
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	0300		1300		2300	1	3300	0
4.1 Ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0310		1310		2310	0	3310	0
4.2 Activos financieros disponibles para la venta	0320		1320		2320	0	3320	0
4.3 Otros	0330		1330		2330	1	3330	0
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0400		1400		2400	0	3400	0
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0500		1500		2500	0	3500	0
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0600		1600		2600	-293	3600	-2.837
7.1 Servicios exteriores	0610		1610		2610	-190	3610	-2.725
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611		1611		2611	-190	3611	-2.725
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	0
7.3 Otros gastos de gestión corrientes	0630		1630		2630	-103	3630	-112
7.3.1 Comisión de sociedad gestora	0631		1631		2631	-83	3631	-86
7.3.2 Comisión administrador	0632		1632		2632		3632	
7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos	0633		1633		2633	-20	3633	-21
7.3.4 Comisión variable - resultados realizados (neto)	0634		1634		2634	0	3634	0
7.3.5 Comisión variables - resultados no realizados (neto)	0635		1635		2635	0	3635	0
7.3.6 Otras comisiones del cedente	0636		1636		2636		3636	
7.3.7 Otros gastos	0637		1637		2637	0	3637	-5
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0700		1700		2700	-3.297	3700	-5.711
8.1 Deterioro neto de valores representativos de deuda	0710		1710		2710	0	3710	0
8.2 Deterioro neto de derechos de crédito	0720		1720		2720	-3.297	3720	-5.711
8.3 Deterioro neto de derivados	0730		1730		2730	0	3730	0
8.4 Deterioro neto de otros activos financieros	0740		1740		2740	0	3740	0
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	0750		1750		2750	0	3750	0
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0800		1800		2800	0	3800	-209
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0850		1850		2850	1.951	3850	7.063
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0900		1900		2900	0	3900	0
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0950		1950		2950	0	3950	0
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	3000		4000		5000	0	6000	0

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>1er Semestre</b>
Ejercicio: <b>2014</b>

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2014		Mismo Periodo año Anterior 30/06/2013
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN</b>	8000	2.715	9000	2.535
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	8100	2.658	9100	2.191
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	5.754	9110	6.732
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-1.764	9120	-1.670
1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados	8130	-1.335	9130	-2.872
1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras	8140	3	9140	1
1.5 Intereses pagados por préstamos y créditos en entidades de crédito	8150		9150	
1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	8160	0	9160	0
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo</b>	8200	-103	9200	-107
2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora	8210	-83	9210	-86
2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados	8220		9220	
2.3 Comisiones pagadas al agente financiero	8230	-20	9230	-21
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	160	9300	451
3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos	8310	160	9310	0
3.2 Pagos de provisiones	8320		9320	
3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta	8325		9325	276
3.4 Otros	8330	0	9330	175
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION</b>	8350	-4.859	9350	-7.876
<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	0
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	-4.663	9600	-5.153
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	16.818	9610	21.716
6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados	8620	0	9620	0
6.3 Pagos por amortización de valores de titulización	8630	-21.481	9630	-26.869
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	8700	-196	9700	-2.723
7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos	8710	0	9710	0
7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos	8720		9720	
7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso	8730	0	9730	0
7.4 Administraciones públicas - Pasivo	8740	0	9740	0
7.5 Otros deudores y acreedores	8750	-196	9750	-2.723
7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras	8770	0	9770	0
7.7 Cobros de Subvenciones	8780	0	9780	0
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	8800	-2.144	9800	-5.341
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	10.304	9900	15.669
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	8.160	9990	10.328



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>1er Semestre</b>
Ejercicio: <b>2014</b>

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS <i>(miles de euros)</i>		Periodo Actual 30/06/2014		Mismo Periodo año Anterior 30/06/2013
<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	0	7020	0
1.1.2 Efecto fiscal	6021	0	7021	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6022	0	7022	0
1.3 Otras reclasificaciones	6030	0	7030	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6040	0	7040	0
<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	-341	7110	-992
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6120	-341	7120	-992
2.1.2 Efecto fiscal	6121	0	7121	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6122	1.271	7122	2.177
2.3 Otras reclasificaciones	6130	0	7130	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6140	-930	7140	-1.185
<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	0	7320	0
3.1.2 Efecto fiscal	6321	0	7321	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6322	0	7322	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6330	0	7330	0
<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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2014**

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 30/06/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Situación inicial 12/12/2006			
	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	5.437	0031	810.281	0061	5.500	0091	832.995	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>5.437</b>	<b>0050</b>	<b>810.281</b>	<b>0080</b>	<b>5.500</b>	<b>0110</b>	<b>832.995</b>	<b>0140</b>	<b>9.884</b>	<b>0170</b>	<b>1.800.000</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 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: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **2014**  
 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 30/06/2014		Situación cierre anual anterior 31/12/2013	
Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior	0196	-3.792	0206	-8.317
Derechos de crédito dados de baja por dación/adjudicación de bienes desde el cierre anual anterior	0197	-2.264	0207	-5.327
Amortización ordinaria desde el cierre anual anterior	0200	-13.873	0210	-28.471
Amortización anticipada desde el cierre anual anterior	0201	-2.784	0211	-13.524
Total importe amortizado acumulado, incluyendo adjudicaciones y otros pagos en especie, desde el origen del Fondo	0202	-940.404	0212	-921.483
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	810.281	0214	832.995
<b>Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)</b>	0205	0,99	0215	1,52

(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: 1er Semestre

Ejercicio: 2014

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	382	0710	117	0720	61	0730	178	0740	59.478	0750	59.656
De 1 a 3 meses	0701	101	0711	83	0721	45	0731	128	0741	15.697	0751	15.825
De 3 a 6 meses	0703	40	0713	77	0723	50	0733	127	0743	6.945	0753	7.072
De 6 a 9 meses	0704	17	0714	47	0724	31	0734	78	0744	2.669	0754	2.747
De 9 a 12 meses	0705	21	0715	98	0725	47	0735	145	0745	2.871	0755	3.016
De 12 meses a 2 años	0706	96	0716	726	0726	431	0736	1.157	0746	14.895	0756	16.052
Más de 2 años	0708	106	0718	2.220	0728	1.324	0738	3.544	0748	14.744	0758	18.288
<b>Total</b>	<b>0709</b>	<b>763</b>	<b>0719</b>	<b>3.368</b>	<b>0729</b>	<b>1.989</b>	<b>0739</b>	<b>5.357</b>	<b>0749</b>	<b>117.299</b>	<b>0759</b>	<b>122.656</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	382	0782	117	0792	61	0802	178	0812	59.478	0822	59.656	0832	75.438	0842	79,08
De 1 a 3 meses	0773	101	0783	83	0793	45	0803	128	0813	15.697	0823	15.825	0833	19.834	0843	79,79
De 3 a 6 meses	0774	40	0784	77	0794	50	0804	127	0814	6.945	0824	7.072	0834	8.386	0844	84,32
De 6 a 9 meses	0775	17	0785	47	0795	31	0805	78	0815	2.669	0825	2.747	0835	3.185	0845	86,26
De 9 a 12 meses	0776	21	0786	98	0796	47	0806	145	0816	2.871	0826	3.016	0836	3.697	0846	81,57
De 12 meses a 2 años	0777	96	0787	726	0797	431	0807	1.157	0817	14.895	0827	16.052	0837	18.797	0847	85,40
Más de 2 años	0778	106	0788	2.220	0798	1.324	0808	3.544	0818	14.744	0828	18.288	0838	22.219	0848	82,31
<b>Total</b>	<b>0779</b>	<b>763</b>	<b>0789</b>	<b>3.368</b>	<b>0799</b>	<b>1.989</b>	<b>0809</b>	<b>5.357</b>	<b>0819</b>	<b>117.299</b>	<b>0829</b>	<b>122.656</b>	<b>0839</b>	<b>151.556</b>	<b>0849</b>	<b>80,93</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 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: 1er Semestre

Ejercicio: 2014

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 30/06/2014						Situación cierre anual anterior 31/12/2013						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	5,59	0869	5,85	0887	0,42	0905	5,31	0923	5,31	0941	0,27	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 expresaran 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 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: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **2014**  
 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 30/06/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Situación inicial 12/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior a 1 año	1300	2	1310	2	1320	3	1330	11	1340	0	1350	0
Entre 1 y 2 años	1301	6	1311	113	1321	3	1331	62	1341	0	1351	0
Entre 2 y 3 años	1302	4	1312	134	1322	4	1332	168	1342	0	1352	0
Entre 3 y 5 años	1303	12	1313	672	1323	16	1333	704	1343	0	1353	0
Entre 5 y 10 años	1304	216	1314	12.816	1324	186	1334	11.121	1344	3	1354	241
Superior a 10 años	1305	5.197	1315	796.544	1325	5.288	1335	820.929	1345	9.881	1355	1.799.759
<b>Total</b>	1306	5.437	1316	810.281	1326	5.500	1336	832.995	1346	9.884	1356	1.800.000
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	1307	20,42			1327	20,80			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 30/06/2014		Situación cierre anual anterior 31/12/2013		Situación inicial 12/12/2006	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	9,21	0632	8,71	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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2014**

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 30/06/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Escenario inicial 12/12/2006			
		Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente
Serie (2)		0001	0002	0003	0004	0005	0006	0007	0008	0009	0070	0080	0090
ES0359092006	SERIE A1	4.140	0	0	0,00	4.140	0	0	0,00	4.140	100	414.000	0,75
ES0359092014	SERIE A2	9.360	36	333.792	4,38	9.360	38	355.273	4,11	9.360	100	936.000	3,81
ES0359092022	SERIE A3	2.700	100	270.000	12,06	2.700	100	270.000	11,78	2.700	100	270.000	10,00
ES0359092030	SERIE B	630	100	63.000	15,18	630	100	63.000	14,60	630	100	63.000	7,19
ES0359092048	SERIE C	675	100	67.500	15,18	675	100	67.500	14,60	675	100	67.500	7,19
ES0359092055	SERIE D	306	100	30.600	15,18	306	100	30.600	14,60	306	100	30.600	7,19
ES0359092063	SERIE E	189	100	18.900	0,00	189	100	18.900	0,00	189	100	18.900	7,19
<b>Total</b>		<b>8006</b>	<b>18.000</b>	<b>8025</b>	<b>783.792</b>	<b>8045</b>	<b>18.000</b>	<b>8065</b>	<b>805.273</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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2014**

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													Intereses		Principal pendiente		Corrección de valor por repercusión de pérdidas	
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)	Intereses impagados	Principal no vencido	Principal impagado	Total pendiente	Corrección de valor por repercusión de pérdidas					
														9950	9960	9970	9980	9990
ES0359092006	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	360	39	0	0	0	0	0						
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,47	360	39	169	0	333.792	0	333.961						
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	0,51	360	39	149	0	270.000	0	270.149						
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	0,57	360	39	39	0	63.000	0	63.039						
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	0,62	360	39	45	0	67.500	0	67.545						
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	0,82	360	39	27	0	30.600	0	30.627						
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	2,32	360	39	47	637	18.900	0	19.584						
<b>Total</b>								<b>9228</b>	<b>476</b>	<b>9105</b>	<b>637</b>	<b>9085</b>	<b>783.792</b>	<b>9095</b>	<b>0</b>	<b>9115</b>	<b>784.905</b>	<b>9227</b>

(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 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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2014**

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 30/06/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013			
			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	22-05-2009	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408
ES0359092014	SERIE A2	22-08-2049	21.481	602.207	704	124.201	49.341	580.726	1.397	123.497
ES0359092022	SERIE A3	22-08-2049	0	0	599	41.560	0	0	1.091	40.961
ES0359092030	SERIE B	22-08-2049	0	0	159	9.982	0	0	293	9.823
ES0359092048	SERIE C	22-08-2049	0	0	187	10.949	0	0	348	10.762
ES0359092055	SERIE D	22-08-2049	0	0	116	5.426	0	0	220	5.310
ES0359092063	SERIE E	22-08-2049	0	0	0	4.849	0	0	0	4.849
<b>Total</b>			<b>7305</b>	<b>21.481</b>	<b>7315</b>	<b>1.016.207</b>	<b>7325</b>	<b>1.765</b>	<b>7335</b>	<b>220.375</b>
			<b>7345</b>	<b>49.341</b>	<b>7355</b>	<b>994.726</b>	<b>7365</b>	<b>3.349</b>	<b>7375</b>	<b>218.610</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: 1er Semestre

Ejercicio: 2014

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	17-05-2013	FCH	BBB	BBB	AAA
ES0359092014	SERIE A2	02-07-2012	MDY	A3	A3	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	28-02-2012	SYP	A+	A+	AAA
ES0359092022	SERIE A3	17-05-2013	FCH	BBB	BBB	AAA
ES0359092022	SERIE A3	30-04-2013	MDY	Baa2	Baa2	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	28-02-2012	SYP	A+	A+	AAA
ES0359092030	SERIE B	17-05-2013	FCH	BB	BB	AA
ES0359092030	SERIE B	30-04-2013	MDY	Ba3	Ba3	Aa1
ES0359092030	SERIE B	20-03-2013	SYP	BB-	BB-	AA
ES0359092048	SERIE C	17-05-2013	FCH	B	B	A
ES0359092048	SERIE C	11-09-2009	MDY	Caa2	Caa2	A1
ES0359092048	SERIE C	20-03-2013	SYP	B-	B-	A
ES0359092055	SERIE D	18-03-2009	FCH	CCC	CCC	BBB
ES0359092055	SERIE D	11-09-2009	MDY	C	C	Baa2
ES0359092055	SERIE D	20-03-2013	SYP	CCC+	CCC+	BBB
ES0359092063	SERIE E	18-03-2009	FCH	CC	CC	BB+
ES0359092063	SERIE E	11-09-2009	MDY	C	C	Ba1
ES0359092063	SERIE E	20-03-2013	SYP	D	D	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; DBRS para Dominion Bond Rating Service -

# 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>1er Semestre</b> Ejercicio: <b>2014</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>30/06/2014</b>		<b>Situación cierre</b> <b>anual anterior</b> <b>31/12/2013</b>
---	--	--	--	---

1. Importe del Fondo de Reserva	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	1,00	1040	1,11
4. Permuta financiera de intereses (S/N)	0050	Si	1050	Si
5. Permuta financiera de tipos de cambio (S/N)	0070	No	1070	No
6. Otras permutas financieras (S/N)	0080	No	1080	No
7. Importe disponible de la línea/s de liquidez (2)	0090	0	1090	0
8. Subordinación de series (S/N)	0110	Si	1110	Si
9. Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total de bonos (3)	0120	77,03	1120	44,12
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 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

<b>Información sobre contrapartes de las mejoras crediticias</b>		<b>NIF</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	ROYAL BANK OF SCOTLAND, PLC
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**  
 Período: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **2014**

**CIRCUNSTANCIAS ESPECÍFICAS ESTABLECIDAS CONTRACTUALMENTE EN EL FONDO**

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

Concepto (1)	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio (2)				Ref. Folleto		
	0010		0030	90	Situación actual	Periodo anterior	Situación actual	Periodo anterior	Situación actual	Periodo anterior	Última Fecha Pago				
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a					0100	6.810	0200	4.671	0300	0,01	0400	0,01	1120	0,01	
2. Activos Morosos por otras razones					0110		0210		0310		0410		1130		
<b>Total Morosos</b>					0120	6.810	0220	4.671	0320	0,01	0420	0,01	1140	0,01	1280
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	0050		0060		0130	127.121	0230	123.484	0330	0,17	0430	0,16	1050	0,16	
4. Activos Fallidos por otras razones		6			0140	839	0240	587	0340	0,00	0440	0,00	1160	0,00	
<b>Total Fallidos</b>					0150	127.960	0250	124.071	0350	0,17	0450	0,16	1200	0,16	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 D ES0359092055	3,40	3,90	3,86		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359092055	1,50	0,82	0,63		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359092055	10,00	49,62	49,93		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359092063	2,10	2,41	2,38		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359092063	1,25	0,82	0,63		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359092063	10,00	49,62	49,93		4.9.4 Nota de Valores
SERIE A2 ES0359092014	25,00	7,11	7,04		4.9.4 Nota de Valores
SERIE A1 ES0359092006	25,00	7,11	7,04		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359092048	7,50	8,61	8,51		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359092048	1,75	0,82	0,63		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359092048	10,00	49,62	49,93		4.9.4 Nota de Valores

SERIE A3 ES0359092022		25,00		7,11		7,04		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359092030		7,00		8,04		7,94		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359092030		2,00		0,82		0,63		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359092030		10,00		49,62		49,93		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 E ES0359092063		8,00		7,11		7,04		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE C ES0359092048		13,20		7,11		7,04		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE B ES0359092030		18,30		7,11		7,04		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE D ES0359092055		9,40		7,11		7,04		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>	3.4.2.2. 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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2014**

### 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 30/06/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Situación inicial 12/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)	
Andalucía	0400	250	0426	27.403	0452	252	0478	28.025	0504	413	0530	55.364
Aragón	0401	100	0427	11.163	0453	102	0479	11.736	0505	176	0531	26.730
Asturias	0402	52	0428	5.137	0454	52	0480	5.229	0506	71	0532	8.457
Baleares	0403	52	0429	7.464	0455	52	0481	7.580	0507	73	0533	12.511
Canarias	0404	41	0430	4.005	0456	41	0482	4.091	0508	84	0534	10.967
Cantabria	0405	89	0431	9.482	0457	89	0483	9.676	0509	129	0535	18.240
Castilla-León	0406	132	0432	12.907	0458	133	0484	13.351	0510	212	0536	27.344
Castilla La Mancha	0407	245	0433	29.930	0459	249	0485	31.237	0511	489	0537	75.861
Cataluña	0408	581	0434	95.220	0460	586	0486	97.279	0512	968	0538	187.210
Ceuta	0409	32	0435	1.745	0461	33	0487	1.883	0513	59	0539	4.472
Extremadura	0410	32	0436	2.349	0462	32	0488	2.423	0514	39	0540	3.661
Galicia	0411	99	0437	11.028	0463	100	0489	11.348	0515	128	0541	17.541
Madrid	0412	3.322	0438	546.013	0464	3.364	0490	561.426	0516	6.243	0542	1.238.324
Meilla	0413	0	0439	0	0465	0	0491	0	0517	0	0543	0
Murcia	0414	25	0440	2.664	0466	26	0492	2.802	0518	63	0544	8.031
Navarra	0415	22	0441	2.907	0467	23	0493	2.968	0519	45	0545	7.831
La Rioja	0416	21	0442	2.322	0468	22	0494	2.492	0520	48	0546	7.344
Comunidad Valenciana	0417	231	0443	21.296	0469	233	0495	21.907	0521	482	0547	58.238
País Vasco	0418	111	0444	17.245	0470	111	0496	17.541	0522	162	0548	31.874
<b>Total España</b>	<b>0419</b>	<b>5.437</b>	<b>0445</b>	<b>810.280</b>	<b>0471</b>	<b>5.500</b>	<b>0497</b>	<b>832.994</b>	<b>0523</b>	<b>9.884</b>	<b>0549</b>	<b>1.800.000</b>
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>	<b>0425</b>	<b>5.437</b>	<b>0450</b>	<b>810.280</b>	<b>0475</b>	<b>5.500</b>	<b>0501</b>	<b>832.994</b>	<b>0527</b>	<b>9.884</b>	<b>0553</b>	<b>1.800.000</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 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: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **2014**

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

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

Divisa/Activos titulizados	Situación actual 30/06/2014						Situación cierre anual anterior 31/12/2013						Situación inicial 12/12/2006					
	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	5.437	0577	810.281	0583	810.281	0600	5.500	0606	832.995	0611	832.995	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	5.437			0588	810.281	0605	5.500			0616	832.995	0625	9.884			0636	1.800.000

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID 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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2014**

### 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 30/06/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Situación inicial 12/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	1100	94	1110	4.479	1120	90	1130	4.453	1140	0	1150	0
40% - 60%	1101	440	1111	34.452	1121	341	1131	28.098	1141	0	1151	0
60% - 80%	1102	2.819	1112	382.168	1122	2.655	1132	354.584	1142	0	1152	0
80% - 100%	1103	2.084	1113	389.182	1123	2.414	1133	445.860	1143	9.439	1153	1.699.335
100% - 120%	1104	0	1114	0	1124	0	1134	0	1144	445	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>5.437</b>	<b>1118</b>	<b>810.281</b>	<b>1128</b>	<b>5.500</b>	<b>1138</b>	<b>832.995</b>	<b>1148</b>	<b>9.884</b>	<b>1158</b>	<b>1.800.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>			<b>1119</b>	<b>78,99</b>			<b>1139</b>	<b>80,15</b>			<b>1159</b>	<b>94,44</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: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **2014**

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

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

#### CUADRO D

Rendimiento índice del periodo	Número de activos		Principal Pendiente		Margen ponderado s/ índice de referencia		Tipo de interés medio ponderado (2)	
	vivos							
Índice de referencia (1)	1400		1410		1420		1430	
EURIBOR		5.437		810.281		0,96		1,49
<b>Total</b>	<b>1405</b>	<b>5.437</b>	<b>1415</b>	<b>810.281</b>	<b>1425</b>	<b>0,96</b>	<b>1435</b>	<b>1,49</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: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **2014**

**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 30/06/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Situación inicial 12/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior al 1%	1500	499	1521	102.098	1542	144	1563	29.839	1584	0	1605	0
1% - 1,49%	1501	1.992	1522	310.261	1543	2.060	1564	346.645	1585	0	1606	0
1,5% - 1,99%	1502	2.060	1523	291.943	1544	2.299	1565	332.628	1586	0	1607	0
2% - 2,49%	1503	665	1524	88.349	1545	751	1566	104.009	1587	0	1608	0
2,5% - 2,99%	1504	219	1525	17.412	1546	246	1567	19.874	1588	2	1609	715
3% - 3,49%	1505	2	1526	220	1547	0	1568	0	1589	10	1610	1.870
3,5% - 3,99%	1506	0	1527	0	1548	0	1569	0	1590	651	1611	149.152
4% - 4,49%	1507	0	1528	0	1549	0	1570	0	1591	2.908	1612	564.581
4,5% - 4,99%	1508	0	1529	0	1550	0	1571	0	1592	4.003	1613	716.576
5% - 5,49%	1509	0	1530	0	1551	0	1572	0	1593	1.835	1614	307.979
5,5% - 5,99%	1510	0	1531	0	1552	0	1573	0	1594	469	1615	58.649
6% - 6,49%	1511	0	1532	0	1553	0	1574	0	1595	6	1616	478
6,5% - 6,99%	1512	0	1533	0	1554	0	1575	0	1596	0	1617	0
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>5.437</b>	<b>1541</b>	<b>810.283</b>	<b>1562</b>	<b>5.500</b>	<b>1583</b>	<b>832.995</b>	<b>1604</b>	<b>9.884</b>	<b>1625</b>	<b>1.800.000</b>
<b>Tipo de interés medio ponderado de los activos(%)</b>			<b>9542</b>	<b>1,49</b>			<b>9584</b>	<b>1,56</b>			<b>1626</b>	<b>4,60</b>
<b>Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%)</b>			<b>9543</b>	<b>0,50</b>			<b>9585</b>	<b>0,45</b>			<b>1627</b>	<b>3,83</b>

## 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: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **2014**

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

Concentración	Situación actual 30/06/2014				Situación cierre anual anterior 31/12/2013				Situación inicial 12/12/2006			
	Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	2000	0,61			2030	0,61			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: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **2014**

### 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 30/06/2014						Situación inicial 12/12/2006					
	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	18.000	3060	783.792	3110	783.792	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>783.792</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: **1er Semestre**  
Ejercicio: **2014**

## NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene  
Información adicional  
en fichero adjunto

## INFORME DE AUDITOR

N/A