

# ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.00

## I. DATOS IDENTIFICATIVOS

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

Número de registro del Fondo: **8558**

NIF Fondo: **V-84889229**

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: **2011**

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



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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: <b>MADRID RMBS I, 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>2011</b>

<b>BALANCE</b> (miles de euros)		<b>Periodo Actual</b> 30/06/2011		<b>Periodo Anterior</b> 31/12/2010
---------------------------------	--	-------------------------------------	--	---------------------------------------

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

<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0008	1.112.451	1008	1.151.408
-------------------------------	------	-----------	------	-----------

<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0010	1.112.451	1010	1.151.408
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	1.112.451	1200	1.151.408
2.1 Participaciones hipotecarias	0201	0	1201	0
2.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0202	1.070.628	1202	1.106.712
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	47.523	1220	63.643
2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0221	-5.700	1221	-18.947
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 I, 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>2011</b>				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2011		Periodo Anterior 31/12/2010
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0270	103.049	1270	97.931
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0280	25.426	1280	7.996
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0290	37.779	1290	40.509
1. Deudores y otras cuentas a cobrar	0300	0	1300	95
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	37.731	1400	40.376
3.1 Participaciones hipotecarias	0401	0	1401	0
3.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0402	36.984	1402	38.270
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	3.579	1420	233
3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0421	-4.767	1421	
3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0422	1.081	1422	1.873
3.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0423	0	1423	0
3.24 Intereses vencidos e impagados	0424	854	1424	
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	48	1440	38
5.1 Garantías financieras	0441	0	1441	0
5.2 Otros	0442	48	1442	38
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0450	0	1450	0
1. Comisiones	0451	0	1451	0
2. Otros	0452	0	1452	0
<b>VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes</b>	0460	39.844	1460	49.426
1. Tesorería	0461	39.844	1461	49.426
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462	0	1462	0

TOTAL ACTIVO	0500	1.215.500	1500	1.249.339
--------------	------	-----------	------	-----------

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: <b>MADRID RMBS I, 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>2011</b>				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2011		Periodo Anterior 31/12/2010
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0650	1.171.237	1650	1.212.783
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0660	0	1660	0
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0700	1.171.237	1700	1.212.783
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	1.081.528	1710	1.120.544
1.1 Series no subordinadas	0711	881.528	1711	920.544
1.2 Series subordinadas	0712	200.000	1712	200.000
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	71.000	1720	71.000
2.1 Préstamo subordinado	0721	71.000	1721	71.000
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		1724	
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	18.709	1730	21.239
3.1 Derivados de cobertura	0731	18.709	1731	21.239
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	63.351	1760	58.404
<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	54.811	1800	51.442
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	28	1810	0
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	42.517	1820	40.079
2.1 Series no subordinadas	0821	40.563	1821	38.503
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	1.954	1824	1.576
2.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0825	0	1825	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0826	0	1826	0
3. Deudas con entidades de crédito	0830	10.550	1830	9.500
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	242	1835	9.500
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836	0	1836	0
3.7 Intereses vencidos e impagados	0837	10.308	1837	
4. Derivados	0840	1.716	1840	1.863
4.1 Derivados de cobertura	0841	1.716	1841	1.863
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	8.540	1900	6.962
1. Comisiones	0910	8.540	1910	6.957
1.1 Comisión sociedad gestora	0911	21	1911	22
1.2 Comisión administrador	0912	0	1912	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0913	6	1913	6
1.4 Comisión variable - resultados realizados	0914	8.513	1914	6.929
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	0	1920	5
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0930	-19.088	1930	-21.848
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0940	0	1940	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0950	-19.088	1950	-21.848
<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	1.215.500	2000	1.249.339

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.02

Denominación del Fondo: <b>MADRID RMBS I, 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>2011</b>							

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. Corriente Actual 2º semestre		P. Corriente Anterior 2º semestre		Acumulado Actual 30/06/2011		Acumulado Anterior 30/06/2010
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0100		1100		2100	14.429	3100	16.030
1.1 Valores representativos de deuda	0110		1110		2110	0	3110	0
1.2 Derechos de crédito	0120		1120		2120	14.218	3120	15.913
1.3 Otros activos financieros	0130		1130		2130	211	3130	117
<b>2. Intereses y cargas asimiladas</b>	0200		1200		2200	-8.824	3200	-10.713
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210		1210		2210	-7.774	3210	-5.554
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220		1220		2220	-1.050	3220	-886
2.3 Otros pasivos financieros	0230		1230		2230		3230	-4.273
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0240		1240		2240	-2.373	3240	
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0250		1250		2250	3.232	3250	5.317
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	0300		1300		2300	0	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	0	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	-1.738	3600	-5.317
7.1 Servicios exteriores	0610		1610		2610	-22	3610	-23
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611		1611		2611	-22	3611	-23
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	-1.716	3630	-5.294
7.3.1 Comisión de sociedad gestora	0631		1631		2631	-104	3631	-110
7.3.2 Comisión administrador	0632		1632		2632		3632	
7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos	0633		1633		2633	-28	3633	-31
7.3.4 Comisión variable - resultados realizados	0634		1634		2634	-1.584	3634	-5.153
7.3.5 Comisión variables - resultados no realizados	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	0
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0700		1700		2700	-1.494	3700	0
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	-1.494	3720	0
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	0
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0850		1850		2850	0	3850	0
<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 I, 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>2011</b>

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2011		Mismo Periodo año Anterior 30/06/2010
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN</b>	8000	4.661	9000	36.675
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	8100	4.718	9100	3.109
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	14.203	9110	13.682
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-7.396	9120	-5.683
1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados	8130	-2.290	9130	-4.978
1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras	8140	201	9140	88
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	-133	9200	-143
2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora	8210	-104	9210	-112
2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados	8220		9220	
2.3 Comisiones pagadas al agente financiero	8230	-29	9230	-31
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	76	9300	33.709
3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos	8310	0	9310	33.606
3.2 Pagos de provisiones	8320		9320	
3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta	8325		9325	
3.4 Otros	8330	76	9330	103
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION</b>	8350	-14.243	9350	-39.311
<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	-14.215	9600	-39.288
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	22.741	9610	36.744
6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados	8620	0	9620	0
6.3 Pagos por amortización de valores de titulización	8630	-36.956	9630	-76.032
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	8700	-28	9700	-23
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	-28	9750	-23
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	-9.582	9800	-2.636
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	49.426	9900	40.671
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	39.844	9990	38.035

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.04

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **2011**

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2011		Mismo Periodo año Anterior 30/06/2010
<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	387	7110	-27.611
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6120	387	7120	-27.611
2.1.2 Efecto fiscal	6121	0	7121	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6122	2.373	7122	4.273
2.3 Otras reclasificaciones	6130	0	7130	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6140	-2.760	7140	23.338
<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 I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

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 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 15/11/2006			
	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	7.144	0031	1.158.714	0061	7.343	0091	1.208.858	0121	11.090	0151	2.000.000
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>7.144</b>	<b>0050</b>	<b>1.158.714</b>	<b>0080</b>	<b>7.343</b>	<b>0110</b>	<b>1.208.858</b>	<b>0140</b>	<b>11.090</b>	<b>0170</b>	<b>2.000.000</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 I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **2011**  
 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 30/06/2011		Situación cierre anual anterior 31/12/2010	
Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior	0196	-9.591	0206	-6.333
Derechos de crédito dados de baja por dación/adjudicación de bienes desde el cierre anual anterior	0197	-14.470	0207	-8.948
Amortización ordinaria desde el cierre anual anterior	0200	-15.915	0210	-87.238
Amortización anticipada desde el cierre anual anterior	0201	-10.171	0211	-44.398
Total importe amortizado acumulado, incluyendo adjudicaciones y otros pagos en especie, desde el origen del Fondo	0202	-826.436	0212	-791.142
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	1.158.714	0214	1.208.858
<b>Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)</b>	0205	2,48	0215	3,31

(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 I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

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	627	0710	154	0720	184	0730	338	0740	105.379	0750	105.717
De 1 a 3 meses	0701	216	0711	142	0721	185	0731	327	0741	37.505	0751	37.832
De 3 a 6 meses	0703	69	0713	98	0723	134	0733	232	0743	11.546	0753	11.778
De 6 a 9 meses	0704	29	0714	84	0724	91	0734	175	0744	5.206	0754	5.381
De 9 a 12 meses	0705	20	0715	72	0725	79	0735	151	0745	3.210	0755	3.361
De 12 meses a 2 años	0706	68	0716	436	0726	410	0736	846	0746	10.364	0756	11.210
Más de 2 años	0708	110	0718	1.160	0728	1.949	0738	3.109	0748	18.926	0758	22.035
<b>Total</b>	<b>0709</b>	<b>1.139</b>	<b>0719</b>	<b>2.146</b>	<b>0729</b>	<b>3.032</b>	<b>0739</b>	<b>5.178</b>	<b>0749</b>	<b>192.136</b>	<b>0759</b>	<b>197.314</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	627	0782	154	0792	184	0802	338	0812	105.379	0822	105.717	0832	120.476	0842	87,75		
De 1 a 3 meses	0773	216	0783	142	0793	185	0803	327	0813	37.505	0823	37.832	0833	42.452	0843	89,12		
De 3 a 6 meses	0774	69	0784	98	0794	134	0804	232	0814	11.546	0824	11.778	0834	13.080	1854	13.080	0844	90,05
De 6 a 9 meses	0775	29	0785	84	0795	91	0805	175	0815	5.206	0825	5.381	0835	6.024	1855	6.024	0845	89,32
De 9 a 12 meses	0776	20	0786	72	0796	79	0806	151	0816	3.210	0826	3.361	0836	3.904	1856	3.904	0846	86,06
De 12 meses a 2 años	0777	68	0787	436	0797	410	0807	846	0817	10.364	0827	11.210	0837	13.146	1857	13.146	0847	85,27
Más de 2 años	0778	110	0788	1.160	0798	1.949	0808	3.109	0818	18.926	0828	22.035	0838	22.178	1858	22.178	0848	99,36
<b>Total</b>	<b>0779</b>	<b>1.139</b>	<b>0789</b>	<b>2.146</b>	<b>0799</b>	<b>3.032</b>	<b>0809</b>	<b>5.178</b>	<b>0819</b>	<b>192.136</b>	<b>0829</b>	<b>197.314</b>	<b>0839</b>	<b>221.260</b>			<b>0849</b>	<b>89,18</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

(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 I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 1er Semestre

Ejercicio: 2011

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 30/06/2011						Situación cierre anual anterior 31/12/2010						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	4,41	0869	1,39	0887	0,00	0905	5,28	0923	0,52	0941	0,00	0959	0,00	0977	0,00	0995	0,00
Préstamos hipotecarios	0852		0870		0888		0906		0924		0942		0960		0978		0996	
Cédulas Hipotecarias	0853		0871		0889		0907		0925		0943		0961		0979		0997	
Préstamos a promotores	0854		0872		0890		0908		0926		0944		0962		0980		0998	
Préstamos a PYMES	0855		0873		0891		0909		0927		0945		0963		0981		0999	
Préstamos a empresas	0856		0874		0892		0910		0928		0946		0964		0982		1000	
Préstamos Corporativos	0857		0875		0893		0911		0929		0947		0965		0983		1001	
Cédulas Territoriales	1066		1084		1102		1120		1138		1156		1174		1192		1210	
Bonos de Tesorería	0858		0876		0894		0912		0930		0948		0966		0984		1002	
Deuda subordinada	0859		0877		0895		0913		0931		0949		0967		0985		1003	
Créditos AAPP	0860		0878		0896		0914		0932		0950		0968		0986		1004	
Préstamos Consumo	0861		0879		0897		0915		0933		0951		0969		0987		1005	
Préstamos automoción	0862		0880		0898		0916		0934		0952		0970		0988		1006	
Cuotas arrendamiento financiero	0863		0881		0899		0917		0935		0953		0971		0989		1007	
Cuentas a cobrar	0864		0882		0900		0918		0936		0954		0972		0990		1008	
Derechos de crédito futuros	0865		0883		0901		0919		0937		0955		0973		0991		1009	
Bonos de titulización	0866		0884		0902		0920		0938		0956		0974		0992		1010	
Otros	0867		0885		0903		0921		0939		0957		0975		0993		1011	

(1) Estos ratios se referirán exclusivamente a la cartera de activos cedidos al Fondo (presentados en el balance en la partida de "derechos de crédito") y se expresarán en términos porcentuales

(A) Determinada por el cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos a la fecha de presentación de la información, y el principal pendiente (sin incluir intereses, e incluyendo principales impagados) del total activos dados de alta en el balance a la fecha de presentación de la información. La clasificación como dudosos se realizará con arreglo a lo previsto en las Normas 13ª y 23ª

(B) Determinada por el cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos a la fecha de presentación de la información, y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en el balance a la fecha de presentación de la información más el principal de los activos clasificados como fallidos. Se considerará la definición de fallidos recogida en la Circular (no necesariamente coincidentes con la definición de la escritura o folleto, recogidas en el estado 5.4)

(D) Determinada por el cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo período del año anterior y el importe de principal de activos clasificados como fallidos al cierre del mismo período del año anterior

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS I, FONDO DE TITULACION 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: **2011**  
 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 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 15/11/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior a 1 año	1300	1	1310	2	1320	0	1330	0	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	2	1312	55	1322	1	1332	38	1342	0	1352	0
Entre 3 y 5 años	1303	9	1313	447	1323	9	1333	416	1343	0	1353	0
Entre 5 y 10 años	1304	45	1314	2.983	1324	41	1334	2.743	1344	2	1354	194
Superior a 10 años	1305	7.087	1315	1.155.226	1325	7.292	1335	1.205.661	1345	11.088	1355	1.999.806
<b>Total</b>	1306	7.144	1316	1.158.713	1326	7.343	1336	1.208.858	1346	11.090	1356	2.000.000
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	1307	23,18			1327	23,67			1347	27,56		

(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 30/06/2011		Situación cierre anual anterior 31/12/2010		Situación inicial 15/11/2006	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	6,23	0632	5,73	0634	1,64

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

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 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Escenario inicial 15/11/2006			
		Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)		
Serie (2)		0001	0002	0003	0004	0005	0006	0007	0008	0009	0070	0080	0090
ES0359091008	SERIE A1	4.600	0	0	0,00	4.600	0	0	0,00	4.600	100	460.000	1,00
ES0359091016	SERIE A2	13.400	69	922.091	5,90	13.400	72	959.048	5,94	13.400	100	1.340.000	6,18
ES0359091024	SERIE B	700	100	70.000	6,73	700	100	70.000	7,19	700	100	70.000	8,42
ES0359091032	SERIE C	750	100	75.000	6,73	750	100	75.000	7,19	750	100	75.000	8,42
ES0359091040	SERIE D	340	100	34.000	6,73	340	100	34.000	7,19	340	100	34.000	8,42
ES0359091057	SERIE E	210	100	21.000	6,73	210	100	21.000	7,19	210	100	21.000	8,42
<b>Total</b>		8006	20.000	8025	1.122.091	8045	20.000	8065	1.159.048	8085	20.000	8105	2.000.000

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

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

### INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)

Serie (1)	Denominación serie	Grado de subordinación (2)	Índice de referencia (3)	Margen (4)	Tipo aplicado	Intereses				Principal pendiente		Total pendiente	Corrección de valor por repercusión de pérdidas						
						Base de cálculo de intereses	Días Acumulados (5)	Intereses Acumulados (6)	Intereses impagados	Principal no vencido	Principal impagado								
														9950	9960	9970	9980	9990	9991
ES0359091008	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,06	1,49	360		38	0	0	0	0	0	0					
ES0359091016	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,16	1,59	360		38	1.551	0	922.091	0	923.642						
ES0359091024	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	1,68	360		38	124	0	70.000	0	70.124						
ES0359091032	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	1,73	360		38	137	0	75.000	0	75.137						
ES0359091040	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	1,93	360		38	69	0	34.000	0	34.069						
ES0359091057	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	1,80	3,23	360		38	72	0	21.000	0	21.072						
<b>Total</b>									<b>9228</b>	<b>1.953</b>	<b>9105</b>	<b>0</b>	<b>9085</b>	<b>1.122.091</b>	<b>9095</b>	<b>0</b>	<b>9115</b>	<b>1.124.044</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 I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

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 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010											
			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								
ES0359091008	SERIE A1	22-06-2049	0	460.000	0	26.346	0	460.000	0	26.346								
ES0359091016	SERIE A2	22-06-2049	36.956	417.909	5.846	167.497	117.478	380.953	9.266	161.651								
ES0359091024	SERIE B	22-06-2049	0	0	463	9.358	0	0	700	8.895								
ES0359091032	SERIE C	22-06-2049	0	0	515	10.197	0	0	788	9.682								
ES0359091040	SERIE D	22-06-2049	0	0	268	4.934	0	0	426	4.666								
ES0359091057	SERIE E	22-06-2049	0	0	304	4.293	0	0	539	3.989								
<b>Total</b>			<b>7305</b>	<b>36.956</b>	<b>7315</b>	<b>877.909</b>	<b>7325</b>	<b>7.396</b>	<b>7335</b>	<b>222.625</b>	<b>7345</b>	<b>117.478</b>	<b>7355</b>	<b>840.953</b>	<b>7365</b>	<b>11.719</b>	<b>7375</b>	<b>215.229</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) 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 I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 1er Semestre

Ejercicio: 2011

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
ES0359091008	SERIE A1	15-11-2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0359091008	SERIE A1	15-11-2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359091008	SERIE A1	15-11-2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359091016	SERIE A2	18-03-2009	FCH	AA	AA	AAA
ES0359091016	SERIE A2	11-09-2009	MDY	A1	A1	Aaa
ES0359091016	SERIE A2	29-04-2009	SYP	AA	AA	AAA
ES0359091024	SERIE B	18-03-2009	FCH	A+	A+	AA
ES0359091024	SERIE B	11-09-2009	MDY	Ba1	Ba1	Aa2
ES0359091024	SERIE B	22-05-2009	SYP	BBB-	BBB-	AA
ES0359091032	SERIE C	18-03-2009	FCH	BB+	BB+	A
ES0359091032	SERIE C	11-09-2009	MDY	Caa2	Caa2	A2
ES0359091032	SERIE C	22-05-2009	SYP	B	B	A
ES0359091040	SERIE D	18-03-2009	FCH	CCC	CCC	BBB
ES0359091040	SERIE D	11-09-2009	MDY	C	C	Baa2
ES0359091040	SERIE D	22-05-2009	SYP	CCC	CCC	BBB
ES0359091057	SERIE E	18-03-2009	FCH	CC	CC	BB+
ES0359091057	SERIE E	11-09-2009	MDY	C	C	Ba2
ES0359091057	SERIE E	29-04-2009	SYP	CCC	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 I, 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>2011</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>30/06/2011</b>		<b>Situación cierre</b> <b>anual anterior</b> <b>31/12/2010</b>
1. Importe del Fondo de Reserva	0010	26.058	1010	25.358
2. Porcentaje que representa el Fondo de Reserva, u otras mejoras equivalentes, sobre el total de activos titulizados	0020	2,25	1020	2,10
3. Exceso de spread (%) (1)	0040	1,15	1040	1,13
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	
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	82,18	1120	82,74
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	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria. S.A.
Permutas financieras de tipos de cambio	0220		1230	N/A
Otras permutas financieras	0230		1240	N/A
Contraparte de la Línea de Liquidez	0240		1250	N/A
Entidad Avalista	0250		1260	N/A
Contraparte del derivado de crédito	0260		1270	N/A

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.4

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **2011**

**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	11.539	0200	5.478	0300	0,01	0400	0,00	1120	0,01	
2. Activos Morosos por otras razones					0110		0210		0310		0410		1130		
<b>Total Morosos</b>					0120	11.539	0220	5.478	0320	0,01	0420	0,00	1140	0,01	1280
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	0050		12	0060	0130	90.343	0230	64.592	0330	0,08	0430	0,06	1050	0,06	
4. Activos Fallidos por otras razones					0140		0240		0340		0440		1160		
<b>Total Fallidos</b>					0150	90.343	0250	64.592	0350	0,08	0450	0,06	1200	0,06	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
			0540	0560	
<b>Amortización secuencial: series (4)</b>	0500	0520	0540	0560	
SERIE B ES0359091024	7,00	6,24	6,15		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359091040	3,40	3,03	2,99		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359091057	2,10	1,87	1,85		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359091032	7,50	6,68	6,59		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359091024	2,00	0,97	0,83		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359091040	1,50	0,97	0,83		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359091057	1,25	0,97	0,83		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359091032	1,75	0,97	0,83		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359091024	10,00	60,07	60,51		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359091040	10,00	60,07	60,51		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359091057	10,00	60,07	60,51		4.9.4 Nota de Valores

SERIE C ES0359091032		10,00		60,07		60,51		4.9.4 Nota de Valores
SERIE A1 ES0359091008		25,00		4,52		4,39		4.9.4 Nota de Valores
SERIE A2 ES0359091016		25,00		4,52		4,39		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 ES0359091032		13,20		4,52		4,39		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE B ES0359091024		18,30		4,52		4,39		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE E ES0359091057		8,00		4,52		4,39		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE D ES0359091040		9,40		4,52		4,39		3.4.6.2. Modulo Adicional
<b>No Reducción del Fondo de Reserva (6)</b>	<b>0512</b>		<b>0532</b>	2,32	<b>0552</b>	2,36	<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 I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **2011**

### 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 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 15/11/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)	
Andalucía	0400	337	0426	39.985	0452	343	0478	41.235	0504	484	0530	62.633
Aragón	0401	122	0427	15.768	0453	130	0479	17.077	0505	206	0531	30.916
Asturias	0402	56	0428	5.647	0454	56	0480	5.722	0506	71	0532	7.768
Baleares	0403	52	0429	7.559	0455	52	0481	7.641	0507	73	0533	11.943
Canarias	0404	39	0430	4.342	0456	40	0482	4.482	0508	82	0534	10.692
Cantabria	0405	107	0431	13.852	0457	108	0483	14.119	0509	142	0535	20.344
Castilla-León	0406	164	0432	18.556	0458	168	0484	19.368	0510	235	0536	30.276
Castilla La Mancha	0407	333	0433	47.441	0459	340	0485	48.992	0511	560	0537	89.081
Cataluña	0408	720	0434	118.933	0460	737	0486	123.339	0512	1.050	0538	188.843
Ceuta	0409	27	0435	2.126	0461	28	0487	2.263	0513	43	0539	3.879
Extremadura	0410	31	0436	2.560	0462	31	0488	2.600	0514	41	0540	4.142
Galicia	0411	102	0437	12.152	0463	103	0489	12.441	0515	127	0541	17.283
Madrid	0412	4.530	0438	804.206	0464	4.669	0490	841.309	0516	7.105	0542	1.401.798
Meilla	0413	0	0439	0	0465	0	0491	0	0517	0	0543	0
Murcia	0414	33	0440	3.485	0466	35	0492	3.716	0518	72	0544	8.796
Navarra	0415	26	0441	3.777	0467	26	0493	3.846	0519	38	0545	6.331
La Rioja	0416	37	0442	5.045	0468	38	0494	5.258	0520	61	0546	9.523
Comunidad Valenciana	0417	285	0443	28.950	0469	295	0495	30.640	0521	502	0547	58.875
País Vasco	0418	143	0444	24.329	0470	144	0496	24.809	0522	198	0548	36.877
<b>Total España</b>	0419	7.144	0445	1.158.713	0471	7.343	0497	1.208.857	0523	11.090	0549	2.000.000
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	7.144	0450	1.158.713	0475	7.343	0501	1.208.857	0527	11.090	0553	2.000.000

(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 I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **2011**

### 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 30/06/2011						Situación cierre anual anterior 31/12/2010						Situación inicial 15/11/2006					
	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	7.144	0577	1.158.714	0583	1.158.714	0600	7.343	0606	1.208.858	0611	1.208.858	0620	11.090	0626	2.000.000	0631	2.000.000
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	7.144			0588	1.158.714	0605	7.343			0616	1.208.858	0625	11.090			0636	2.000.000

(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 I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **2011**

### 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 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 15/11/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	1100	48	1110	2.196	1120	44	1130	2.049	1140	0	1150	0
40% - 60%	1101	108	1111	11.131	1121	89	1131	9.223	1141	0	1151	0
60% - 80%	1102	1.520	1112	175.658	1122	1.250	1132	142.971	1142	0	1152	0
80% - 100%	1103	5.467	1113	969.517	1123	5.959	1133	1.054.401	1143	0	1153	1.878.659
100% - 120%	1104	1	1114	212	1124	1	1134	214	1144	0	1154	121.341
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>7.144</b>	<b>1118</b>	<b>1.158.714</b>	<b>1128</b>	<b>7.343</b>	<b>1138</b>	<b>1.208.858</b>	<b>1148</b>	<b>0</b>	<b>1158</b>	<b>2.000.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>			<b>1119</b>	<b>86,89</b>			<b>1139</b>	<b>88,01</b>			<b>1159</b>	<b>95,42</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 I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **2011**

### 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		7.143		1.158.473		1,01		2,42
TIPO FIJO		1		241		0,00		1,21
<b>Total</b>	<b>1405</b>	<b>7.144</b>	<b>1415</b>	<b>1.158.714</b>	<b>1425</b>	<b>1,01</b>	<b>1435</b>	<b>2,42</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 I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **2011**

**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 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 15/11/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior al 1%	1500	0	1521	0	1542	1	1563	247	1584	0	1605	0
1% - 1,49%	1501	1	1522	241	1543	0	1564	0	1585	0	1606	0
1,5% - 1,99%	1502	891	1523	181.399	1544	1.170	1565	230.445	1586	0	1607	0
2% - 2,49%	1503	3.327	1524	537.121	1545	3.209	1566	521.314	1587	0	1608	0
2,5% - 2,99%	1504	2.453	1525	385.036	1546	2.394	1567	384.143	1588	30	1609	7.129
3% - 3,49%	1505	470	1526	54.704	1547	531	1568	67.728	1589	10	1610	2.349
3,5% - 3,99%	1506	2	1527	213	1548	38	1569	4.981	1590	1.030	1611	218.116
4% - 4,49%	1507	0	1528	0	1549	0	1570	0	1591	3.846	1612	712.430
4,5% - 4,99%	1508	0	1529	0	1550	0	1571	0	1592	4.309	1613	770.182
5% - 5,49%	1509	0	1530	0	1551	0	1572	0	1593	1.535	1614	248.372
5,5% - 5,99%	1510	0	1531	0	1552	0	1573	0	1594	330	1615	41.422
6% - 6,49%	1511	0	1532	0	1553	0	1574	0	1595	0	1616	0
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>7.144</b>	<b>1541</b>	<b>1.158.714</b>	<b>1562</b>	<b>7.343</b>	<b>1583</b>	<b>1.208.858</b>	<b>1604</b>	<b>11.090</b>	<b>1625</b>	<b>2.000.000</b>
<b>Tipo de interés medio ponderado de los activos(%)</b>			<b>9542</b>	<b>2,42</b>			<b>9584</b>	<b>2,38</b>			<b>1626</b>	<b>4,51</b>
<b>Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%)</b>			<b>9543</b>	<b>1,27</b>			<b>9585</b>				<b>1627</b>	

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **2011**

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

Concentración	Situación actual 30/06/2011			Situación cierre anual anterior 31/12/2010			Situación inicial 15/11/2006		
	Porcentaje		CNAE (2)	Porcentaje		CNAE (2)	Porcentaje		CNAE (2)
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	2000	0,46		2030	0,44		2060	0,33	
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 I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **2011**

### 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 30/06/2011						Situación inicial 15/11/2006					
	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	20.000	3060	1.122.091	3110	1.122.091	3170	20.000	3230	2.000.000	3250	2.000.000
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>20.000</b>			<b>3160</b>	<b>1.122.091</b>	<b>3220</b>	<b>20.000</b>			<b>3300</b>	<b>2.000.000</b>

# ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.06

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
Denominación del compartimento:  
Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
Estados agregados: **No**  
Periodo: **1er Semestre**  
Ejercicio: **2011**

## NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene  
Información adicional  
en fichero adjunto

## INFORME DE AUDITOR

N/A