

MADRID RMBS II - Fondo de Titulización de Activos**LIQUIDACION DEL PERIODO 23/05/11 - 22/08/11**

	Euros
I. Situación al 23/05/11:	20.794.159,11
Saldo Inial Cuenta Tesorería	20.794.159,11
II. Fondos recibidos del emisor	20.021.972,85
Principal:	
Según calendario hasta 31/07/11:	7.132.877,71
Amort. Anticipada hasta 31/07/11:	6.243.071,70
Intereses:	6.646.023,44
III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):	40.816.131,96
IV. Total intereses de la reinversión:	104.577,62
Intereses de la Cta. De Tesorería	104.577,62
V. Recursos disponibles (III + IV):	40.920.709,58
VI. Gastos:	59.663,11
VII. Liquidación SWAP:	-917.015,14
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	4.358.823,92
Cantidad a Pagar por la Parte A (BBVA):	3.441.808,78
VIII. Pago a los Bonos:	22.532.304,78
Bonos A2 :	
Intereses correspondientes al 22/08/11:	2.176.668,00
Retenciones practicadas a los bonos:	413.524,80
Amortización correspondiente al 22/08/11:	18.369.561,60
Bonos A3 :	
Intereses correspondientes al 22/08/11:	1.108.377,00
Retenciones practicadas a los bonos:	210.600,00
Amortización correspondiente al 22/08/11:	0,00
Bonos B:	
Intereses correspondientes al 22/08/11:	268.178,40
Retenciones practicadas a los bonos:	50.954,40
Amortización correspondiente al 22/08/11:	0,00
Bonos C:	
Intereses correspondientes al 22/08/11:	295.866,00
Retenciones practicadas a los bonos:	56.214,00
Amortización correspondiente al 22/08/11:	0,00
Bonos D:	
Intereses correspondientes al 22/08/11:	149.594,22
Retenciones practicadas a los bonos:	28.424,34
Amortización correspondiente al 22/08/11:	0,00
Bonos E:	
Intereses correspondientes al 22/08/11:	164.059,56
Retenciones practicadas a los bonos:	31.171,77
Amortización correspondiente al 22/08/11:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones (1):	-790.889,31
IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII):	17.411.726,55
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva previo (23/05/11):	20.794.159,11
Aportación al Fondo de Reserva	-3.382.432,56
Intereses préstamo subordinado Desfase pagados	0,00
Intereses préstamo subordinado G.I. pagados	0,00
Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada	0,00
Amortización préstamo subordinado Desfase	0,00
Amortización préstamo subordinado G.I.	0,00
Amortización Préstamo Participativo	0,00
Otros recursos	0,00
Remuneración Variable Prést. Participativo	0,00
Fondo de Reserva (22/08/11):	17.411.726,55

(1) Hasta el 20/09/11

Destinatarios: CNMV, AIAF.

**Nº: 6213/11**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.
 Orense, 69
 28020 Madrid
 Tel.:917020808
 http://www.tda-sgft.com
 MADRID RMBS II/liqu.trim/Ago11

MADRID RMBS II**INFORMACION A LOS INVERSORES**
FECHA DE PAGO: 22 de Agosto de 2011

Importes en euros

I. BONOS A2 ES0359092014		Sobre 9360 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/12/06):	936.000.000,00 €		100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	543.626.179,20 €		58.079,72 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	2.176.668,00 €		232,55 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	18.369.561,60 €		1.962,56 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	525.256.617,60 €		56.117,16 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	56,117160%		56,117160%
II. BONOS A3 ES0359092022		Sobre 2700 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/12/06):	270.000.000,00 €		100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	270.000.000,00 €		100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	1.108.377,00 €		410,51 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	270.000.000,00 €		100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%		100,000000%
III. BONOS B ES0359092030		Sobre 630 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/12/06):	63.000.000,00 €		100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	63.000.000,00 €		100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	268.178,40 €		425,68 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	63.000.000,00 €		100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%		100,000000%
IV. BONOS C ES0359092048		Sobre 675 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/12/06):	67.500.000,00 €		100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	67.500.000,00 €		100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	295.866,00 €		438,32 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	67.500.000,00 €		100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%		100,000000%
V. BONOS D ES0359092055		Sobre 306 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/12/06):	30.600.000,00 €		100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	30.600.000,00 €		100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	149.594,22 €		488,87 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	30.600.000,00 €		100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%		100,000000%
VI. BONOS E ES0359092063		Sobre 189 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/12/06):	18.900.000,00 €		100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	18.900.000,00 €		100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	164.059,56 €		868,04 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	18.900.000,00 €		100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%		100,000000%
VII. EL FONDO		Importes en euros	
1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/07/11:		1.066.700.876,31 €	
a) No Fallidas:		975.256.658,51 €	
b) Fallidas:		91.444.217,80 €	
2. Amortización del período 30/04/11 a 31/07/11:		13.375.949,41 €	
a) Según calendario:		7.132.877,71 €	
b) Amortización anticipada hasta 31/07/11:		6.243.071,70 €	
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):			
a) Último año:		2,73%	
b) Último semestre:		2,39%	
c) Último trimestre:		2,49%	
4. Porcentaje de fallidos (1):		9,76%	
5. Nivel de Impago(2):		1,15%	

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

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

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



Nº: 6214/11

Titulización de Activos, (SGFI), S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

MADRID RMBS II Inforver.trimAgo11

MADRID RMBS II , FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL PERÍ ODO: 23/05/11-22/08/11
I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	12 de diciembre de 2006
Fecha Emisión BTH	12 de diciembre de 2006
Fecha Final Amortización BTH (teórica)(10% TAA)	22 de febrero de 2023
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca	BANKIA (Caja Madrid)
Agente de Pagos	Banco Santander
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Moody' s Investors Service/ Fitch Ibcra/Standard & Poor's
Calificación	Bonos A2: A(sf) (F)/ Aa1(sf) (M)/ AA(sf) (S&P) Bonos A3: A(sf) (F)/ A1(sf) (M)/ AA(sf) (S&P) Bonos B: BBB(sf) (F)/ Ba1(sf) (M)/ BB(sf) (S&P) Bonos C: BB(sf) (F)/ Caa2(sf) (M)/ B(sf) (S&P) Bonos D: CCC(sf) (F)/ C(sf) (M)/ CCC(sf) (S&P) Bonos E: CC(sf) (F)/ C(sf) (M)/ D(sf) (S&P)

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

Nombre	Bonos de Titulización MADRID RMBS II
Serie A2:	
Código ISIN	ES0359092014
Nominal en circulación total (inicial)	936.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	525.256.617,60 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	56.117,16 Euros

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)	
Nombre	Bonos de Titulización MADRID RMBS II
Serie A3:	
Código ISIN	ES0359092022
Nominal en circulación total (inicial)	270.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	270.000.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie B:	
Código ISIN	ES0359092030
Nominal en circulación total (inicial)	63.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	63.000.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie C:	
Código ISIN	ES0359092048
Nominal en circulación total (inicial)	67.500.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	67.500.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie D:	
Código ISIN	ES0359092055
Nominal en circulación total (inicial)	30.600.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	30.600.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie E:	
Código ISIN	ES0359092063
Nominal en circulación total (inicial)	18.900.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	18.900.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA
* Liquidación del Período:23/05/11-22/08/11
* Flujos de Caja del Período:23/05/11-22/08/11
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 22 de Agosto de 2011

MADRID RMBS II**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 23/05/11 - 22/08/11**

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip.		18.369.561,60
Amortización Participaciones Hip.	13.375.949,41	
Amortización Ptmos. Subordinados		0,00
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH		4.162.743,18
Intereses recibidos de las PHs	6.646.023,44	
Intereses Ptmos. Subordinados		0,00
Intereses Inversiones Temporales	104.577,62	
III. GASTOS		
Comisiones y gastos periódicos:		59.663,11
Neto SWAP a favor de la Parte A (Contraparte)		917.015,14
Remuneración Variable Préstamo Participativo		0,00
Total Ingresos/Pagos	20.126.550,47	23.508.983,03
Saldo inicial 23/05/11	20.794.159,11	
A Inversiones Temporales		17.411.726,55
Total	40.920.709,58	40.920.709,58
Retenciones practicadas el 22/08/11	790.889,31	
A Inv.Temporales hasta el 20/09/11		790.889,31

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 6219/11**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

MADRID RMBS II|fluj.trimAgo11