

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 9263
NIF Fondo: V85586055
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2017

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:
(sólo se cumplimentará en el supuesto de que se produzca el reenvío con alguna modificación de la información periódica)

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2017		Periodo anterior 31/12/2016
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	0	1001	113.596
I. Activos financieros a largo plazo	0002	0	1002	113.596
1. Activos titulizados	0003	0	1003	113.596
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	0	1005	111.398
1.3 Préstamos hipotecarios	0006	0	1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007	0	1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008	0	1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009	0	1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010	0	1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011	0	1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012	0	1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013	0	1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014	0	1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015	0	1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016	0	1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017	0	1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018	0	1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019	0	1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020	0	1020	0
1.18 Bonos de titulización	0021	0	1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022	0	1022	0
1.20 Otros	0023	0	1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024	0	1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	0	1025	2.208
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	0	1027	-10
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

S.01

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2017		Periodo anterior 31/12/2016
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	135.733	1041	29.388
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	587	1042	464
V. Activos financieros a corto plazo	0043	117.918	1043	11.162
1. Activos titulizados	0044	117.872	1044	11.095
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	115.096	1046	10.676
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048	0	1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049	0	1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050	0	1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051	0	1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052	0	1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053	0	1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054	0	1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055	0	1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056	0	1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057	0	1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058	0	1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060	0	1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061	0	1061	0
1.18 Bonos de titulización	0062	0	1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063	0	1063	0
1.20 Otros	0064	0	1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	28	1065	34
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	4	1066	5
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	2.745	1067	385
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	6	1068	7
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-8	1069	-12
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	46	1074	67
3.1 Valores representativos de deuda	0075	0	1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076	0	1076	0
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	46	1077	67
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	17.228	1085	17.762
1. Tesorería	0086	17.228	1086	17.762
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	135.733	1088	142.984

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2017		Periodo anterior 31/12/2016
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	0	1089	132.384
I. Provisiones a largo plazo	0090	0	1090	1.100
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	0	1092	1.100
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	0	1094	131.285
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	0	1095	79.172
1.1 Series no subordinadas	0096	0	1096	79.172
1.2 Series subordinadas	0097	0	1097	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	0	1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	0	1101	51.424
2.1 Préstamo subordinado	0102	0	1102	16.424
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	35.000
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	0	1105	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108	0	1108	689
3.1 Derivados de cobertura	0109	0	1109	689
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

S.01
Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2017		Periodo anterior 31/12/2016
B) PASIVO CORRIENTE	0117	136.544	1117	11.402
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118	0	1118	0
V. Provisiones a corto plazo	0119	1.176	1119	0
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	0
2. Provisión por margen de intermediación	0121	1.176	1121	0
3. Otras provisiones	0122	0	1122	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	135.356	1123	11.389
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	82.911	1124	11.074
1.1 Series no subordinadas	0125	82.900	1125	11.061
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	11	1128	13
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	0	1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	51.632	1131	190
2.1 Préstamo subordinado	0132	16.424	1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133	0	1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134	35.000	1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	0	1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	12	1136	13
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	195	1137	177
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	814	1139	125
3.1 Derivados de cobertura	0140	814	1140	125
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	11	1148	13
1. Comisiones	0149	11	1149	8
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	8	1150	6
1.2 Comisión administrador	0151	2	1151	1
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	1	1152	1
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	0	1157	5
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-811	1158	-802
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-811	1160	-802
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	135.733	1162	142.984

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2017		Acumulado anterior 30/06/2016
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	193	1201	265	2201	397	3201	561
1.1 Activos titulizados	0202	193	1202	265	2202	397	3202	561
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-54	1204	-100	2204	-113	3204	-237
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-26	1205	-58	2205	-55	3205	-140
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-29	1206	-43	2206	-58	3206	-97
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-25	1208	-39	2208	-55	3208	-73
A) MARGEN DE INTERESES	0209	113	1209	126	2209	230	3209	252
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210	0	3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211	0	3211	0
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212	0	3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213	0	3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214	0	3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-29	1217	-30	2217	-65	3217	-61
7.1 Servicios exteriores	0218	-7	1218	-10	2218	-26	3218	-22
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-7	1219	-10	2219	-26	3219	-22
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-22	1224	-20	2224	-39	3224	-39
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-16	1225	-14	2225	-29	3225	-29
7.3.2 Comisión administrador	0226	-4	1226	-3	2226	-7	3226	-7
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-2	1227	-2	2227	-3	3227	-3
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228	0	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-4	1231	0	2231	-88	3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-4	1232	0	2232	-88	3232	0
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	-81	1234	-96	2234	-77	3234	-190
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	-81	1236	-96	2236	-77	3236	-190
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238	0	3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	0	1239	0	2239	0	3239	0
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2017		Acumulado anterior 30/06/2016
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	103	1300	108	2300	208	3300	219
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	121	1301	128	2301	244	3301	259
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	195	1302	271	2302	405	3302	570
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-26	1303	-65	2303	-57	3303	-161
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-29	1305	-47	2305	-64	3305	-79
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	-19	1307	-31	2307	-40	3307	-72
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-17	1309	-19	2309	-35	3309	-40
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-13	1310	-14	2310	-26	3310	-29
2.2 Comisión administrador	0311	-3	1311	-3	2311	-6	3311	-7
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-2	1312	-2	2312	-3	3312	-4
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	0	1315	0	2315	0	3315	0
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-143	1322	-137	2322	-742	3322	-1.308
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	-133	1325	-124	2325	-711	3325	-1.281
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	2.406	1326	2.567	2326	4.899	3326	5.208
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	589	1327	749	2327	1.556	3327	1.473
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	163	1328	242	2328	167	3328	364
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-3.291	1331	-3.681	2331	-7.332	3331	-8.326
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-10	1332	-13	2332	-32	3332	-27
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-10	1336	-13	2336	-32	3336	-27
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-39	1337	-29	2337	-534	3337	-1.089
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	17.267	1338	17.465	2338	17.762	3338	18.525
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	17.228	1339	17.436	2339	17.228	3339	17.436

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2017		Acumulado anterior 30/06/2016
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-29	1357	-47	2357	-64	3357	-79
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-29	1358	-47	2358	-64	3358	-79
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359	0	3359	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	25	1360	39	2360	55	3360	73
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361	0	3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	4	1362	9	2362	9	3362	6
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2017								Situación cierre anual anterior 31/12/2016								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	2,33	0401	0,84	0421	0,00	0441	2,71	1381	2,08	1401	0,72	1421	0,00	1441	2,50	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	4,00
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	104	0467	27	0474	3	0481	0	0488	30	0495	4.924	0502	0	0509	4.955
De 1 a 3 meses	0461	17	0468	12	0475	1	0482	0	0489	13	0496	886	0503	0	0510	899
De 3 a 6 meses	0462	6	0469	8	0476	1	0483	1	0490	10	0497	475	0504	0	0511	484
De 6 a 9 meses	0463	2	0470	2	0477	0	0484	0	0491	2	0498	56	0505	0	0512	58
De 9 a 12 meses	0464	1	0471	2	0478	0	0485	0	0492	2	0499	19	0506	0	0513	21
Más de 12 meses	0465	21	0472	287	0479	6	0486	53	0493	346	0500	1.896	0507	0	0514	2.242
Total	0466	151	0473	339	0480	11	0487	54	0494	403	0501	8.255	0508	0	1515	8.659

Impagados con garantía real (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total		Valor garantía		Valor Garantía con Tasación > 2 años		% Deuda / v. Tasación	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total													
Hasta 1 mes	0515	104	0522	27	0529	3	0536	0	0543	30	0550	4.924	0557	0	0564	4.955	0571	11.974	0578	11.974	0584	41,38
De 1 a 3 meses	0516	17	0523	12	0530	1	0537	0	0544	13	0551	886	0558	0	0565	899	0572	2.019	0579	2.019	0585	44,51
De 3 a 6 meses	0517	6	0524	8	0531	1	0538	1	0545	10	0552	475	0559	0	0566	484	0573	789	0580	789	0586	61,39
De 6 a 9 meses	0518	2	0525	2	0532	0	0539	0	0546	2	0553	56	0560	0	0567	58	0574	141	0581	141	0587	41,37
De 9 a 12 meses	0519	1	0526	2	0533	0	0540	0	0547	2	0554	19	0561	0	0568	21	0575	65	0582	65	0588	32,42
Más de 12 meses	0520	21	0527	287	0534	6	0541	53	0548	346	0555	1.896	0562	0	0569	2.242	0576	3.558	0583	3.558	0589	63,00
Total	0521	151	0528	339	0535	11	0542	54	0549	403	0556	8.255	0563	0	0570	8.659	0577	18.546			0590	46,69

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 19/12/2008	
Inferior a 1 año	0600	446	1600	362	2600	120
Entre 1 y 2 años	0601	1.283	1601	1.231	2601	594
Entre 2 y 3 años	0602	1.859	1602	2.125	2602	1.941
Entre 3 y 4 años	0603	2.214	1603	2.356	2603	2.947
Entre 4 y 5 años	0604	2.767	1604	2.994	2604	4.452
Entre 5 y 10 años	0605	19.654	1605	20.267	2605	32.924
Superior a 10 años	0606	89.618	1606	95.332	2606	252.322
Total	0607	117.841	1607	124.667	2607	295.300
Vida residual media ponderada (años)	0608	16,71	1608	16,91	2608	20,66

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 19/12/2008	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	11,45	1609	11,01	2609	3,78

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 19/12/2008			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.702	0630	34.625	1620	1.748	1630	36.008	2620	1.221	2630	29.434
40% - 60%	0621	555	0631	41.240	1621	602	1631	42.803	2621	1.412	2631	67.657
60% - 80%	0622	290	0632	39.843	1622	315	1632	43.425	2622	1.556	2632	114.097
80% - 100%	0623	19	0633	2.133	1623	22	1633	2.431	2623	581	2633	84.112
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	2.566	0638	117.841	1628	2.687	1638	124.667	2628	4.770	2638	295.300
Media ponderada (%)	0639	49,47	0649		1639	50,29	1649		2639	66,21	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 19/12/2008	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,70	1650	0,79	2650	5,98
Tipo de interés nominal máximo	0651	8,25	1651	8,25	2651	8,36
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,12	1652	0,17	2652	3,00

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 19/12/2008			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	363	0683	15.736	1660	378	1683	16.609	2660	624	2683	38.449
Aragón	0661	13	0684	361	1661	14	1684	390	2661	37	2684	1.664
Asturias	0662	20	0685	803	1662	22	1685	845	2662	50	2685	2.688
Baleares	0663	19	0686	1.203	1663	21	1686	1.256	2663	30	2686	2.186
Canarias	0664	50	0687	2.190	1664	51	1687	2.284	2664	69	2687	5.095
Cantabria	0665	18	0688	889	1665	20	1688	932	2665	28	2688	1.766
Castilla-León	0666	96	0689	4.680	1666	99	1689	4.881	2666	162	2689	9.952
Castilla La Mancha	0667	237	0690	9.248	1667	242	1690	9.704	2667	417	2690	24.249
Cataluña	0668	217	0691	12.395	1668	224	1691	13.081	2668	369	2691	29.965
Ceuta	0669	33	0692	993	1669	36	1692	1.128	2669	52	2692	2.707
Extremadura	0670	65	0693	1.449	1670	70	1693	1.568	2670	117	2693	4.880
Galicia	0671	45	0694	2.288	1671	46	1694	2.361	2671	71	2694	4.305
Madrid	0672	1.145	0695	54.396	1672	1.210	1695	57.494	2672	2.330	2695	138.851
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	18	0697	705	1674	18	1697	739	2674	32	2697	2.303
Navarra	0675	12	0698	792	1675	12	1698	829	2675	18	2698	1.476
La Rioja	0676	6	0699	107	1676	6	1699	119	2676	12	2699	475
Comunidad Valenciana	0677	172	0700	7.553	1677	178	1700	8.217	2677	291	2700	19.689
País Vasco	0678	37	0701	2.054	1678	40	1701	2.232	2678	61	2701	4.600
Total España	0679	2.566	0702	117.841	1679	2.687	1702	124.667	2679	4.770	2702	295.300
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	2.566	0705	117.841	1682	2.687	1705	124.667	2682	4.770	2705	295.300

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 19/12/2008			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	3,25			1710	3,13			2710	1,84		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2017			Situación cierre anual anterior 31/12/2016			Situación inicial 19/12/2008					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0359494004	SERIE A (G)	2.603	31.848	82.900	2.603	34.665	90.233	2.603	100.000	260.300			
Total		0723	2.603	0724	82.900	1723	2.603	1724	90.233	2723	2.603	2724	260.300

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados		Intereses impagados		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
						0730	0731	0732	0733		0734	0735	0742	0736			0737	0738
ES0359494004	SERIE A (G)	NS	EURIBOR 3 m	0,45	0,12	11	0	SI	82.900	0	82.911	0	82.911	0				
Total						0740	11	0741	0		0743	82.900	0744	0	0745	82.911	0746	0

	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 19/12/2008	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,14	0748	0,21	0749	3,44

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2017								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2016							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753
ES0359494004	SERIE A (G)	3.291	177.400	26	16.003	3.681	162.999	65	15.862								
Total		0754	3.291	0755	177.400	0756	26	0757	16.003	1754	3.681	1755	162.999	1756	65	1757	15.862

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/06/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 19/12/2008
				0762	0763	0764
ES0359494004	SERIE A (G)	25/02/2015	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0359494004	SERIE A (G)	05/11/2012	SYP	A	A	AAA

S.05.2
Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2017
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 19/12/2008	
Inferior a 1 año	0765	82.900	1765	7.340	2765	10.227
Entre 1 y 2 años	0766	0	1766	6.868	2766	12.459
Entre 2 y 3 años	0767	0	1767	6.401	2767	13.095
Entre 3 y 4 años	0768	0	1768	5.955	2768	13.177
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769	5.591	2769	13.133
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770	22.687	2770	64.154
Superior a 10 años	0771	0	1771	35.392	2771	134.054
Total	0772	82.900	1772	90.233	2772	260.300
Vida residual media ponderada (años)	0773	0,05	1773	14,91	2773	26,16

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 19/12/2008	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	14.827	1775	15.038	2775	15.356
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	15.356	1776	15.356	2776	15.356
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	17,88	1777	16,67	2777	5,90
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Bankia	1778	Bankia	2778	Caja Madrid
1.4 Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781		1781		2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782		1782		2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784		1784		2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786	82.900	1786	90.233	2786	260.300
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787	100,00	1787	100,00	2787	100,00
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788	ICO	1788	ICO	2788	ICO
3.3 Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	N	1791	N	2791	N
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	100,00	1792	100,00	2792	100,00
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/06/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 19/12/2008	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap de Bases	BBVA	TRIMESTRAL	Media de los Euribor 12M en cada Fecha de Referencia	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	Tipo de Referencia de los Bonos + 0,16%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	-814	-814		
Total							0808 -814	0809 -814	0810	

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 19/12/2008		Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 19/12/2008			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	645	7006	862	7009	0,56	7012	0,70	7015	0,36		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	645	7008	862	7011	0,56	7014	0,70	7017	0,36	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	3.524	7024	2.999	7027	2,95	7030	2,38	7033	2,95		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	147	7025	147	7028	0,12	7031	0,12	7034	0,12		
Total Fallidos					7023	3.671	7026	3.146	7029	3,08	7032	2,50	7035	3,07	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

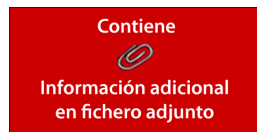
CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
Préstamo B	10,00	39,17	39,93	4.9.4
SERIE A (G) - ES0359494004	10,00	39,17	39,93	4.9.4
SERIE A (G) - ES0359494004	23,70	29,69	28,88	4.9.4
Préstamo B	2,00	0,49	0,36	4.9.4
Préstamo B	23,70	29,69	28,88	4.9.4
SERIE A (G) - ES0359494004	2,00	0,49	0,36	4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Préstamo B	6,00	1,53	1,53	3.4.6.2.
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		17,88	17,48	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862		2862	Saldo Nominal pendiente de cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,041	4862		5862		6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	Bankia	1863		2863	Saldo Nominal pendiente de cobro de los Préstamos Hipotecarios en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3863	0,010	4863		5863		6863	TRIMESTRAL	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BBVA	1864		2864	Saldo Nominal pendiente de cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3864	0,005	4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Bankia
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo Adicional 3.4.6.4.

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo											Total		
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872														
Margen de intereses	0873														
Deterioro de activos financieros (neto)	0874														
Dotaciones a provisiones (neto)	0875														
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876														
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877														
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878														
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879														
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880														
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881														
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882														
Comisión variable pagada	0883														
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884														

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
		22/02/2017	22/05/2017										
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885												
Saldo inicial	0886	15.038	15.067										
Cobros del periodo	0887	4.200	3.151										
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-42	-26										
Pagos por derivados	0889	-35	-29										
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-15.067	-14.827										
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-4.073	-3.317										
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-21	-19										
Resto pagos/retenciones	0893	0	0										
Saldo disponible	0894	0	0										
Liquidación de comisión variable	0895	0	0										0

S.06

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2017

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

INFORME SOBRE EL CUMPLIMIENTO DE LAS POLÍTICAS DE GESTIÓN DE ACTIVOS Y DE RIESGOS