

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.00

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

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

Número de registro del Fondo: **8591**

NIF Fondo: **V-84916956**

Denominación del compartimento:

Número de registro del compartimento:

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

NIF gestora: **A-80352750**

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2016**

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA



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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
Estados agregados: No
Periodo: 1er Semestre
Ejercicio: 2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2016		Periodo Anterior 31/12/2015
---------------------------------	--	-------------------------------------	--	---------------------------------------

ACTIVO				
---------------	--	--	--	--

A) ACTIVO NO CORRIENTE	0008	657.632	1008	683.732
-------------------------------	------	---------	------	---------

I. Activos financieros a largo plazo	0010	657.632	1010	683.732
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	657.632	1200	683.732
2.1 Participaciones hipotecarias	0201	0	1201	0
2.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0202	633.696	1202	655.092
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	24.530	1220	29.454
2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0221	-594	1221	-814
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

II. Activos por impuesto diferido	0250	0	1250	0
--	------	---	------	---

III. Otros activos no corrientes	0260	0	1260	0
---	------	---	------	---

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.				
Estados agregados: No				
Periodo: 1er Semestre				
Ejercicio: 2016				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2016		Periodo Anterior 31/12/2015
B) ACTIVO CORRIENTE	0270	78.268	1270	80.057
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0280	28.312	1280	28.721
V. Activos financieros a corto plazo	0290	40.048	1290	39.798
1. Deudores y otras cuentas a cobrar	0300	0	1300	0
2. Valores representativos de deuda	0310	0	1310	0
2.1 Bancos centrales	0311	0	1311	0
2.2 Administraciones Públicas españolas	0312	0	1312	0
2.3 Entidades de crédito	0313	0	1313	0
2.4 Otros sectores residentes	0314	0	1314	0
2.5 Administraciones Públicas no residentes	0315	0	1315	0
2.6 Otros sectores no residentes	0316	0	1316	0
2.7 Activos dudosos	0317	0	1317	0
2.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0318		1318	
2.9 Intereses y gastos devengados no vencidos	0319	0	1319	0
2.10 Ajustes por operaciones de cobertura	0320	0	1320	0
2.11 Intereses vencidos e impagados	0330	0	1330	0
3. Derechos de crédito	0400	40.048	1400	39.798
3.1 Participaciones hipotecarias	0401	0	1401	0
3.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0402	35.682	1402	35.311
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	4.801	1420	4.883
3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0421	-872	1421	-895
3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0422	237	1422	277
3.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0423	0	1423	0
3.24 Intereses vencidos e impagados	0424	200	1424	222
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	0	1440	0
5.1 Garantías financieras	0441	0	1441	0
5.2 Otros	0442	0	1442	0
VI. Ajustes por periodificaciones	0450	3	1450	0
1. Comisiones	0451	0	1451	0
2. Otros	0452	3	1452	0
VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes	0460	9.905	1460	11.538
1. Tesorería	0461	9.905	1461	11.538
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462	0	1462	0

TOTAL ACTIVO	0500	735.900	1500	763.789
--------------	------	---------	------	---------

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.				
Estados agregados: No				
Periodo: 1er Semestre				
Ejercicio: 2016				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2016		Periodo Anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0650	676.161	1650	704.587
I. Provisiones a largo plazo	0660	0	1660	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0700	676.161	1700	704.587
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	643.663	1710	670.587
1.1 Series no subordinadas	0711	463.663	1711	490.587
1.2 Series subordinadas	0712	180.000	1712	180.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0713		1713	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0714	0	1714	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0715	0	1715	0
2. Deudas con entidades de crédito	0720	23.015	1720	24.517
2.1 Préstamo subordinado	0721	68.941	1721	68.941
2.2 Crédito línea de liquidez	0722	0	1722	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0723	0	1723	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0724	-45.926	1724	-44.424
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	9.483	1730	9.483
3.1 Derivados de cobertura	0731	9.483	1731	9.483
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
III. Pasivos por impuesto diferido	0750	0	1750	0
B) PASIVO CORRIENTE	0760	71.060	1760	70.493
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0770	0	1770	0
V. Provisiones a corto plazo	0780	0	1780	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0800	65.345	1800	64.315
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	0	1810	0
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	41.951	1820	41.556
2.1 Series no subordinadas	0821	40.484	1821	40.193
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	46	1824	120
2.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0825	0	1825	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0826	1.421	1826	1.243
3. Deudas con entidades de crédito	0830	21.288	1830	20.653
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	127	1835	139
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836	0	1836	0
3.7 Intereses vencidos e impagados	0837	21.161	1837	20.514
4. Derivados	0840	2.106	1840	2.106
4.1 Derivados de cobertura	0841	2.106	1841	2.106
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	

VII. Ajustes por periodificación	0900	5.715	1900	6.178
1. Comisiones	0910	20	1910	20
1.1 Comisión sociedad gestora	0911	16	1911	16
1.2 Comisión administrador	0912	0	1912	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0913	4	1913	4
1.4 Comisión variable - resultados realizados	0914	0	1914	0
1.5 Comisión variable - resultados no realizados	0915	0	1915	0
1.6 Otras comisiones del cedente	0916	0	1916	0
1.7 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0917		1917	
1.8 Otras comisiones	0918	0	1918	0
2. Otros	0920	5.695	1920	6.158
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0930	-11.321	1930	-11.291
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0940	0	1940	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0950	-11.321	1950	-11.291
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0960	0	1960	0
XI. Gastos de constitución en transición	0970		1970	
TOTAL PASIVO	1000	735.900	2000	763.789

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.02

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Periodo: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2016**

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. Corriente Actual 2º semestre		P. Corriente Anterior 2º semestre		Acumulado Actual 30/06/2016		Acumulado Anterior 30/06/2015
1. Intereses y rendimientos asimilados	0100		1100		2100	3.470	3100	4.629
1.1 Valores representativos de deuda	0110		1110		2110	0	3110	0
1.2 Derechos de crédito	0120		1120		2120	3.470	3120	4.629
1.3 Otros activos financieros	0130		1130		2130	0	3130	0
2. Intereses y cargas asimiladas	0200		1200		2200	-985	3200	-1.813
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210		1210		2210	-350	3210	-1.104
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220		1220		2220	-635	3220	-709
2.3 Otros pasivos financieros	0230		1230		2230		3230	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0240		1240		2240	-1.124	3240	-1.303
A) MARGEN DE INTERESES	0250		1250		2250	1.361	3250	1.513
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0300		1300		2300	0	3300	-1
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	-1
5. Diferencias de cambio (neto)	0400		1400		2400	0	3400	0
6. Otros ingresos de explotación	0500		1500		2500	0	3500	0
7. Otros gastos de explotación	0600		1600		2600	-868	3600	-1.048
7.1 Servicios exteriores	0610		1610		2610	-773	3610	-949
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611		1611		2611	-773	3611	-949
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	-95	3630	-99
7.3.1 Comisión de sociedad gestora	0631		1631		2631	-75	3631	-81
7.3.2 Comisión administrador	0632		1632		2632		3632	
7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos	0633		1633		2633	-20	3633	-18
7.3.4 Comisión variable - resultados realizados (neto)	0634		1634		2634	0	3634	0
7.3.5 Comisión variables - resultados no realizados (neto)	0635		1635		2635	0	3635	0
7.3.6 Otras comisiones del cedente	0636		1636		2636		3636	
7.3.7 Otros gastos	0637		1637		2637	0	3637	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0700		1700		2700	-1.976	3700	-3.874
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	-1.976	3720	-3.874
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
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0750		1750		2750	0	3750	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0800		1800		2800	-19	3800	525
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0850		1850		2850	1.502	3850	2.885
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0900		1900		2900	0	3900	0
12. Impuesto sobre beneficios	0950		1950		2950	0	3950	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	3000		4000		5000	0	6000	0

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.03

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
Estados agregados: No
Periodo: 1er Semestre
Ejercicio: 2016

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2016		Mismo Periodo año Anterior 30/06/2015
A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN	8000	3.685	9000	6.486
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	8100	2.131	9100	2.269
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	3.533	9110	4.733
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-247	9120	-976
1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados	8130	-1.155	9130	-1.488
1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras	8140	0	9140	0
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
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo	8200	-95	9200	-99
2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora	8210	-75	9210	-80
2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados	8220		9220	
2.3 Comisiones pagadas al agente financiero	8230	-20	9230	-19
2.4 Comisiones variables pagadas	8240		9240	
2.5 Otras comisiones	8250		9250	
3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo	8300	1.649	9300	4.316
3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos	8310	0	9310	4
3.2 Pagos de provisiones	8320		9320	
3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta	8325	1.649	9325	4.312
3.4 Otros	8330	0	9330	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION	8350	-5.318	9350	-7.341
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	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	
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	8500		9500	
5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito	8510		9510	
5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras	8520		9520	
6. Flujos de caja netos por amortizaciones	8600	-4.545	9600	-6.390
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	22.089	9610	20.790
6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados	8620	0	9620	0
6.3 Pagos por amortización de valores de titulización	8630	-26.634	9630	-27.180
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	8700	-773	9700	-951
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	-1
7.5 Otros deudores y acreedores	8750	-773	9750	-950
7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras	8770	0	9770	0
7.7 Cobros de Subvenciones	8780	0	9780	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	8800	-1.633	9800	-855
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	11.538	9900	12.897
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	9.905	9990	12.042

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.04

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
Estados agregados: No
Periodo: 1er Semestre
Ejercicio: 2016

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2016		Mismo Periodo año Anterior 30/06/2015
1 Activos financieros disponibles para la venta				
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
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	6100	0	7100	0
2 Cobertura de los flujos de efectivo				
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6110	-1.154	7110	1.294
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6120	-1.154	7120	1.294
2.1.2 Efecto fiscal	6121	0	7121	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6122	1.124	7122	1.303
2.3 Otras reclasificaciones	6130	0	7130	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6140	30	7140	-2.597
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	6200	0	7200	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 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
Total Ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	6400	0	7400	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	6500	0	7500	0

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2016**

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 30/06/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 12/12/2006			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)		
Participaciones hipotecarias	0001		0030		0060		0090		0120		0150	
Certificados de transmisión hipotecaria	0002	5.057	0031	698.710	0061	5.150	0091	724.740	0121	9.884	0151	1.800.000
Préstamos hipotecarios	0003		0032		0062		0092		0122		0152	
Cédulas hipotecarias	0004		0033		0063		0093		0123		0153	
Préstamos a promotores	0005		0034		0064		0094		0124		0154	
Préstamos a PYMES	0007		0036		0066		0096		0126		0156	
Préstamos a empresas	0008		0037		0067		0097		0127		0157	
Préstamos Corporativos	0009		0038		0068		0098		0128		0158	
Cédulas territoriales	0010		0039		0069		0099		0129		0159	
Bonos de tesorería	0011		0040		0070		0100		0130		0160	
Deuda subordinada	0012		0041		0071		0101		0131		0161	
Créditos AAPP	0013		0042		0072		0102		0132		0162	
Préstamos consumo	0014		0043		0073		0103		0133		0163	
Préstamos automoción	0015		0044		0074		0104		0134		0164	
Arrendamiento financiero	0016		0045		0075		0105		0135		0165	
Cuentas a cobrar	0017		0046		0076		0106		0136		0166	
Derechos de crédito futuros	0018		0047		0077		0107		0137		0167	
Bonos de titulización	0019		0048		0078		0108		0138		0168	
Otros	0020		0049		0079		0109		0139		0169	
Total	0021	5.057	0050	698.710	0080	5.150	0110	724.740	0140	9.884	0170	1.800.000

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Periodo: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2016**
 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 30/06/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015	
Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior	0196	-2.220	0206	-8.111
Derechos de crédito dados de baja por dación/adjudicación de bienes desde el cierre anual anterior	0197	-1.259	0207	-4.298
Amortización ordinaria desde el cierre anual anterior	0200	-15.457	0210	-28.292
Amortización anticipada desde el cierre anual anterior	0201	-7.095	0211	-15.022
Total importe amortizado acumulado, incluyendo adjudicaciones y otros pagos en especie, desde el origen del Fondo	0202	-1.026.689	0212	-1.002.878
Importe de principal pendiente de amortización de los nuevos activos incorporados en el periodo (1)	0203	0	0213	0
Principal pendiente cierre del periodo (2)	0204	698.710	0214	724.740
Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)	0205	1,89	0215	1,92

(1) En fondos abiertos, importe de principal pendiente de reembolso en la fecha de presentación de la información de los nuevos activos incorporados en el periodo

(2) Importe del principal pendiente de reembolso de la totalidad de los activos (incluidas las nuevas incorporaciones del periodo) a fecha del informe

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 1er Semestre

Ejercicio: 2016

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	293	0710	100	0720	28	0730	128	0740	41.963	0750	42.091
De 1 a 3 meses	0701	55	0711	54	0721	16	0731	70	0741	7.784	0751	7.854
De 3 a 6 meses	0703	19	0713	37	0723	13	0733	50	0743	2.210	0753	2.260
De 6 a 9 meses	0704	7	0714	22	0724	10	0734	32	0744	1.104	0754	1.136
De 9 a 12 meses	0705	10	0715	48	0725	19	0735	67	0745	1.576	0755	1.643
De 12 meses a 2 años	0706	41	0716	322	0726	137	0736	459	0746	5.720	0756	6.179
Más de 2 años	0708	115	0718	2.854	0728	1.240	0738	4.094	0748	15.438	0758	19.532
Total	0709	540	0719	3.437	0729	1.463	0739	4.900	0749	75.795	0759	80.695

(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	293	0782	100	0792	28	0802	128	0812	41.963	0822	42.091	0832	56.403	0842	74,62
De 1 a 3 meses	0773	55	0783	54	0793	16	0803	70	0813	7.784	0823	7.854	0833	10.543	0843	74,50
De 3 a 6 meses	0774	19	0784	37	0794	13	0804	50	0814	2.210	0824	2.260	0834	3.218	1854	70,24
De 6 a 9 meses	0775	7	0785	22	0795	10	0805	32	0815	1.104	0825	1.136	0835	1.410	1855	80,63
De 9 a 12 meses	0776	10	0786	48	0796	19	0806	67	0816	1.576	0826	1.643	0836	1.998	1856	82,22
De 12 meses a 2 años	0777	41	0787	322	0797	137	0807	459	0817	5.720	0827	6.179	0837	7.853	1857	78,69
Más de 2 años	0778	115	0788	2.854	0798	1.240	0808	4.094	0818	15.438	0828	19.532	0838	23.644	1858	82,60
Total	0779	540	0789	3.437	0799	1.463	0809	4.900	0819	75.795	0829	80.695	0839	105.069	0849	76,80

(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 II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 1er Semestre

Ejercicio: 2016

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 30/06/2016						Situación cierre anual anterior 31/12/2015						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	4,20	0869	9,54	0887	0,00	0905	4,74	0923	9,02	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 II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Periodo: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2016**
 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 30/06/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 12/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior a 1 año	1300	4	1310	52	1320	4	1330	51	1340	0	1350	0
Entre 1 y 2 años	1301	6	1311	228	1321	6	1331	49	1341	0	1351	0
Entre 2 y 3 años	1302	8	1312	331	1322	12	1332	525	1342	0	1352	0
Entre 3 y 5 años	1303	40	1313	1.504	1323	31	1333	1.237	1343	0	1353	0
Entre 5 y 10 años	1304	328	1314	17.171	1324	292	1334	15.954	1344	3	1354	241
Superior a 10 años	1305	4.671	1315	679.423	1325	4.805	1335	706.924	1345	9.881	1355	1.799.759
Total	1306	5.057	1316	698.709	1326	5.150	1336	724.740	1346	9.884	1356	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	1307	18,62			1327	19,08			1347	27,35		

(1) Los intervalos se entenderán excluido el inicio del mismo e incluido el final (p.e. Entre 1 y 2 años: superior a 1 año y menor o igual a 2 años)

Antigüedad	Situación actual 30/06/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 12/12/2006	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	11,18	0632	10,69	0634	1,72

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2016**

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 30/06/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Escenario inicial 12/12/2006			
		Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)
Serie (2)	Denominación serie	0001	0002	0003	0004	0005	0006	0007	0008	0009	0070	0080	0090
ES0359092006	SERIE A1	4.140	0	0	0,00	4.140	0	0	0,00	4.140	100	414.000	0,75
ES0359092014	SERIE A2	9.360	25	234.146	2,91	9.360	28	260.780	3,11	9.360	100	936.000	3,81
ES0359092022	SERIE A3	2.700	100	270.000	8,58	2.700	100	270.000	8,94	2.700	100	270.000	10,00
ES0359092030	SERIE B	630	100	63.000	12,68	630	100	63.000	13,19	630	100	63.000	7,19
ES0359092048	SERIE C	675	100	67.500	12,68	675	100	67.500	13,19	675	100	67.500	7,19
ES0359092055	SERIE D	306	100	30.600	12,68	306	100	30.600	13,19	306	100	30.600	7,19
ES0359092063	SERIE E	189	100	18.900	12,68	189	100	18.900	13,19	189	100	18.900	7,19
Total		8006	18.000	8025	684.146	8045	18.000	8065	710.780	8085	18.000	8105	1.800.000

(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 II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2016**

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)

		Intereses								Principal pendiente								
Serie (1)	Denominación serie	Grado de subordinación (2)	Índice de referencia (3)	Margen (4)	Tipo aplicado	Base de cálculo de intereses	Días Acumulados (5)	Intereses Acumulados (6)	Intereses impagados	Principal no vencido	Principal impagado	Total pendiente	Corrección de valor por repercusión de pérdidas					
		9950	9960	9970	9980	9990	9991	9993	9997	9994	9995	9998	9995					
ES0359092006	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	360	38	0	0	0	0	0						
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	360	38	0	0	234.146	0	234.146						
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	0,00	360	38	0	0	270.000	0	270.000						
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	0,00	360	38	0	0	63.000	0	63.000						
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	0,04	360	38	3	0	67.500	0	67.503						
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	0,24	360	38	8	0	30.600	0	30.608						
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	1,74	360	38	35	1.421	18.900	0	20.356						
Total								9228	46	9105	1.421	9085	684.146	9095	0	9115	685.613	9227

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

(2) La gestora deberá indicar si la serie es subordinada o no subordinada (S=Subordinada; NS=No subordinada)

(3) La gestora deberá cumplimentar el índice de referencia que corresponda en cada caso (EURIBOR un año, EURIBOR a tres meses...). En el caso de tipos fijos esta columna se cumplimentará con el término "fijo"

(4) En el caso de tipos fijos esta columna no se cumplimentará

(5) Días acumulados desde la última fecha de pago

(6) Intereses acumulados desde la última fecha de pago

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2016**

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 30/06/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015											
			Amortización principal		Intereses		Amortización principal		Intereses									
Serie (1)	Denominación serie	Fecha final (2)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)								
		7290	7300	7310	7320	7330	7340	7350	7360	7370								
ES0359092006	SERIE A1	22-05-2009	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408								
ES0359092014	SERIE A2	22-08-2049	26.634	701.852	38	125.438	53.191	675.218	514	125.400								
ES0359092022	SERIE A3	22-08-2049	0	0	67	42.820	0	0	577	42.753								
ES0359092030	SERIE B	22-08-2049	0	0	34	10.352	0	0	173	10.318								
ES0359092048	SERIE C	22-08-2049	0	0	53	11.414	0	0	219	11.361								
ES0359092055	SERIE D	22-08-2049	0	0	55	5.760	0	0	161	5.705								
ES0359092063	SERIE E	22-08-2049	0	0	0	4.849	0	0	0	4.849								
Total			7305	26.634	7315	1.115.852	7325	247	7335	224.041	7345	53.191	7355	1.089.218	7365	1.644	7375	223.794

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

(2) Entendiendo como fecha final aquella que de acuerdo con la documentación contractual determine la extinción del Fondo, siempre que no se haya producido previamente una causa de liquidación anticipada

(3) Total de pagos realizados desde el último cierre anual

(4) Total de pagos realizados desde la fecha de constitución del Fondo

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 1er Semestre

Ejercicio: 2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

CUADRO D

Serie (1)	Denominación serie	Calificación				
		Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Situación actual	Situación anual cierre anterior	Situación inicial
		3310	3330	3350	3360	3370
ES0359092006	SERIE A1	12-12-2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0359092006	SERIE A1	12-12-2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092006	SERIE A1	12-12-2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092014	SERIE A2	27-02-2015	FCH	BBB-	BBB-	AAA
ES0359092014	SERIE A2	14-05-2016	MDY	Aa2	A1	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	01-12-2015	SYP	AA-	AA-	AAA
ES0359092022	SERIE A3	27-02-2015	FCH	BBB-	BBB-	AAA
ES0359092022	SERIE A3	14-05-2016	MDY	Aa2	A1	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	01-12-2015	SYP	BBB+	BBB+	AAA
ES0359092030	SERIE B	27-02-2015	FCH	BB-	BB-	AA
ES0359092030	SERIE B	14-05-2016	MDY	Baa1	Baa3	Aa1
ES0359092030	SERIE B	01-12-2015	SYP	BBB	BBB	AA
ES0359092048	SERIE C	27-02-2015	FCH	B-	B-	A
ES0359092048	SERIE C	14-05-2016	MDY	B1	B2	A1
ES0359092048	SERIE C	20-03-2013	SYP	B-	B-	A
ES0359092055	SERIE D	18-03-2009	FCH	CCC	CCC	BBB
ES0359092055	SERIE D	11-09-2009	MDY	C	C	Baa2
ES0359092055	SERIE D	20-03-2013	SYP	CCC+	CCC+	BBB
ES0359092063	SERIE E	18-03-2009	FCH	CC	CC	BB+
ES0359092063	SERIE E	11-09-2009	MDY	C	C	Ba1
ES0359092063	SERIE E	20-03-2013	SYP	D	D	BB

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

(2) La gestora deberá cumplimentar la calificación crediticia otorgada por cda agencia de rating, cuya denominación también deberá ser cumplimentada, para serie - MDY para Moody's; SYP para Standard & Poors; FCH para Fitch; DBRS para Dominion Bond Rating Service -

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.3

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2016**

INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS

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

		Situación actual 30/06/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015	
1. Importe del Fondo de Reserva	0010	0	1010	0	0
2. Porcentaje que representa el Fondo de Reserva, u otras mejoras equivalentes, sobre el total de activos titulizados	0020	0,00	1020	0,00	0,00
3. Exceso de spread (%) (1)	0040	0,93	1040	0,97	0,97
4. Permuta financiera de intereses (S/N)	0050	Si	1050	Si	Si
5. Permuta financiera de tipos de cambio (S/N)	0070	No	1070	No	No
6. Otras permutas financieras (S/N)	0080	No	1080	No	No
7. Importe disponible de la línea/s de liquidez (2)	0090	0	1090	0	0
8. Subordinación de series (S/N)	0110	Si	1110	Si	Si
9. Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total de bonos (3)	0120	73,69	1120	74,68	74,68
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	0
13. Otros (S/N) (4)	0180	No	1180	No	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

Información sobre contrapartes de las mejoras crediticias

		NIF		Denominación
Contraparte del Fondo de Reserva u otras mejores equivalentes (5)	0200		1210	Caja Madrid
Permutas financieras de tipos de interés	0210		1220	Banco Santander
Permutas financieras de tipos de cambio	0220		1230	N/A
Otras permutas financieras	0230		1240	N/A
Contraparte de la Línea de Liquidez	0240		1250	N/A
Entidad Avalista	0250		1260	N/A
Contraparte del derivado de crédito	0260		1270	N/A

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.4

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 1er Semestre

Ejercicio: 2016

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	1.988	0200	3.582	0300	0,00	0400	0,01	1120	0,00	
2. Activos Morosos por otras razones					0110		0210		0310		0410		1130		
Total Morosos					0120	1.988	0220	3.582	0320	0,00	0420	0,01	1140	0,00	1280
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	0050		0060		0130	110.278	0230	114.652	0330	0,17	0430	0,17	1050	0,17	
4. Activos Fallidos por otras razones		6			0140	725	0240	927	0340	0,00	0440	0,00	1160	0,00	
Total Fallidos					0150	111.003	0250	115.579	0350	0,17	0450	0,17	1200	0,17	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	
Amortización secuencial: series (4)	0500	0520	0540	0560	
SERIE A1 ES0359092006	25,00	6,17	6,24		4.9.4 Nota de Valores
SERIE A3 ES0359092022	25,00	6,17	6,24		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359092055	3,40	4,47	4,39		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359092055	1,50	0,24	0,21		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359092055	10,00	43,08	43,59		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359092030	7,00	9,21	9,03		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359092030	2,00	0,24	0,21		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359092030	10,00	43,08	43,59		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359092048	7,50	9,87	9,68		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359092048	1,75	0,24	0,21		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359092048	10,00	43,08	43,59		4.9.4 Nota de Valores

SERIE A2 ES0359092014		25,00		6,17		6,24		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359092063		2,10		2,76		2,71		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359092063		1,25		0,24		0,21		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359092063		10,00		43,08		43,59		4.9.4 Nota de Valores
Diferimiento/postergamiento intereses: series (5)		0506		0526		0546		0566
SERIE C ES0359092048		13,20		6,17		6,24		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE E ES0359092063		8,00		6,17		6,24		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE D ES0359092055		9,40		6,17		6,24		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE B ES0359092030		18,30		6,17		6,24		3.4.6.2. Modulo Adicional
No Reducción del Fondo de Reserva (6)	0512		0532	0,00	0552	0,00	0572	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS (3)		0513		0523		0553		0573
N/A								

(3) En caso de existir triggers adicionales a los recogidos en la presente tabla se indicarán su nombre o concepto debajo de OTROS TRIGGERS. Si los triggers recogidos expresamente en la tabla no están previstos en el Fondo, no se cumplimentarán

(4) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto al modo de amortización (prorrata/secuencial) de algunas de las series se indicarán las series afectadas indicando su ISIN, y en su defecto el nombre, el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

(5) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto al diferimiento o postergamiento de intereses de algunas de las series se indicarán las series afectadas indicando su ISIN o nombre, el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

(6) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto a la no reducción del fondo de reserva se indicará el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

--

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2016**

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 30/06/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 12/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)	
Andalucía	0400	240	0426	23.881	0452	241	0478	24.564	0504	413	0530	55.364
Aragón	0401	88	0427	9.030	0453	91	0479	9.386	0505	176	0531	26.730
Asturias	0402	46	0428	4.183	0454	47	0480	4.324	0506	71	0532	8.457
Baleares	0403	50	0429	6.723	0455	51	0481	6.937	0507	73	0533	12.511
Canarias	0404	38	0430	3.385	0456	40	0482	3.592	0508	84	0534	10.967
Cantabria	0405	86	0431	8.372	0457	87	0483	8.692	0509	129	0535	18.240
Castilla-León	0406	124	0432	11.113	0458	125	0484	11.400	0510	212	0536	27.344
Castilla La Mancha	0407	221	0433	24.873	0459	229	0485	26.386	0511	489	0537	75.861
Cataluña	0408	547	0434	84.103	0460	554	0486	86.679	0512	968	0538	187.210
Ceuta	0409	32	0435	1.493	0461	32	0487	1.550	0513	59	0539	4.472
Extremadura	0410	31	0436	2.065	0462	31	0488	2.121	0514	39	0540	3.661
Galicia	0411	97	0437	9.923	0463	98	0489	10.236	0515	128	0541	17.541
Madrid	0412	3.081	0438	470.014	0464	3.143	0490	488.152	0516	6.243	0542	1.238.324
Meilla	0413	0	0439	0	0465	0	0491	0	0517	0	0543	0
Murcia	0414	20	0440	1.777	0466	20	0492	1.822	0518	63	0544	8.031
Navarra	0415	21	0441	2.600	0467	21	0493	2.646	0519	45	0545	7.831
La Rioja	0416	17	0442	1.780	0468	17	0494	1.811	0520	48	0546	7.344
Comunidad Valenciana	0417	209	0443	17.699	0469	213	0495	18.324	0521	482	0547	58.238
País Vasco	0418	109	0444	15.696	0470	110	0496	16.117	0522	162	0548	31.874
Total España	0419	5.057	0445	698.710	0471	5.150	0497	724.739	0523	9.884	0549	1.800.000
Otros países Unión europea	0420	0	0446	0	0472	0	0498	0	0524	0	0550	0
Resto	0422	0	0448	0	0474	0	0500	0	0526	0	0552	0
Total general	0425	5.057	0450	698.710	0475	5.150	0501	724.739	0527	9.884	0553	1.800.000

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2016**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

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

CUADRO B

Divisa/Activos titulizados	Situación actual 30/06/2016						Situación cierre anual anterior 31/12/2015						Situación inicial 12/12/2006					
	Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)	
Euro - EUR	0571	5.057	0577	698.710	0583	698.710	0600	5.150	0606	724.740	0611	724.740	0620	9.884	0626	1.800.000	0631	1.800.000
EEUU Dólar - USD	0572	0	0578	0	0584	0	0601	0	0607	0	0612	0	0621	0	0627	0	0632	0
Japón Yen - JPY	0573	0	0579	0	0585	0	0602	0	0608	0	0613	0	0622	0	0628	0	0633	0
Reino Unido Libra - GBP	0574	0	0580	0	0586	0	0603	0	0609	0	0614	0	0623	0	0629	0	0634	0
Otras	0575	0			0587	0	0604	0			0615	0	0624	0			0635	0
Total	0576	5.057			0588	698.710	0605	5.150			0616	724.740	0625	9.884			0636	1.800.000

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2016**

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 30/06/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 12/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	1100	199	1110	9.033	1120	153	1130	6.698	1140	0	1150	0
40% - 60%	1101	863	1111	69.691	1121	780	1131	61.676	1141	0	1151	0
60% - 80%	1102	2.525	1112	347.623	1122	2.637	1132	362.123	1142	0	1152	0
80% - 100%	1103	1.470	1113	272.364	1123	1.580	1133	294.242	1143	9.439	1153	1.699.335
100% - 120%	1104	0	1114	0	1124	0	1134	0	1144	445	1154	100.665
120% - 140%	1105	0	1115	0	1125	0	1135	0	1145	0	1155	0
140% - 160%	1106	0	1116	0	1126	0	1136	0	1146	0	1156	0
superior al 160%	1107	0	1117	0	1127	0	1137	0	1147	0	1157	0
Total	1108	5.057	1118	698.711	1128	5.150	1138	724.739	1148	9.884	1158	1.800.000
Media ponderada (%)			1119	74,15			1139	75,33			1159	94,44

(1) Distribución según el valor de la razón entre el importe pendiente de amortizar de los préstamos con garantía real y la última valoración disponible de tasación de los inmuebles hipotecados, o valor razonable de otras garantías reales, siempre que el valor de las mismas se haya considerado en el momento inicial del Fondo, expresada en porcentaje

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2016**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

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

CUADRO D

Rendimiento índice del periodo	Número de activos		Principal Pendiente		Margen ponderado s/ índice de referencia		Tipo de interés medio ponderado (2)	
	vivos							
Índice de referencia (1)	1400		1410		1420		1430	
EURIBOR		5.057		698.710		0,94		1,08
Total	1405	5.057	1415	698.710	1425	0,94	1435	1,08

(1) La gestora deberá cumplimentar el índice de referencia que corresponda en cada caso (EURIBOR un año, LIBRO, etc.)

(2) En el caso de tipos fijos no se cumplimentará la columna de margen ponderado y se indicará el tipo de interés medio ponderado de los activos a tipo fijo en la columna "tipo de interés medio ponderado"

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2016**

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 30/06/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 12/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior al 1%	1500	1.985	1521	313.598	1542	1.251	1563	213.908	1584	0	1605	0
1% - 1,49%	1501	2.225	1522	292.251	1543	2.270	1564	313.584	1585	0	1606	0
1,5% - 1,99%	1502	632	1523	78.301	1544	1.341	1565	173.036	1586	0	1607	0
2% - 2,49%	1503	214	1524	14.493	1545	285	1566	24.022	1587	0	1608	0
2,5% - 2,99%	1504	0	1525	0	1546	2	1567	123	1588	2	1609	715
3% - 3,49%	1505	0	1526	0	1547	0	1568	0	1589	10	1610	1.870
3,5% - 3,99%	1506	1	1527	67	1548	0	1569	0	1590	651	1611	149.152
4% - 4,49%	1507	0	1528	0	1549	1	1570	69	1591	2.908	1612	564.581
4,5% - 4,99%	1508	0	1529	0	1550	0	1571	0	1592	4.003	1613	716.576
5% - 5,49%	1509	0	1530	0	1551	0	1572	0	1593	1.835	1614	307.979
5,5% - 5,99%	1510	0	1531	0	1552	0	1573	0	1594	469	1615	58.649
6% - 6,49%	1511	0	1532	0	1553	0	1574	0	1595	6	1616	478
6,5% - 6,99%	1512	0	1533	0	1554	0	1575	0	1596	0	1617	0
7% - 7,49%	1513	0	1534	0	1555	0	1576	0	1597	0	1618	0
7,5% - 7,99%	1514	0	1535	0	1556	0	1577	0	1598	0	1619	0
8% - 8,49%	1515	0	1536	0	1557	0	1578	0	1599	0	1620	0
8,5% - 8,99%	1516	0	1537	0	1558	0	1579	0	1600	0	1621	0
9% - 9,49%	1517	0	1538	0	1559	0	1580	0	1601	0	1622	0
9,5% - 9,99%	1518	0	1539	0	1560	0	1581	0	1602	0	1623	0
Superior al 10%	1519	0	1540	0	1561	0	1582	0	1603	0	1624	0
Total	1520	5.057	1541	698.710	1562	5.150	1583	724.742	1604	9.884	1625	1.800.000
Tipo de interés medio ponderado de los activos(%)			9542	1,08			9584	1,21			1626	4,60
Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%)			9543	0,15			9585	0,25			1627	3,83

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Periodo: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2016**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

Concentración	Situación actual 30/06/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 12/12/2006			
	Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	2000	0,66			2030	0,65			2060	0,37		
Sector: (1)	2010		2020		2040		2050		2070		2080	

(1) Indíquese denominación del sector con mayor concentración

(2) Incluir código CNAE con dos niveles de agregación

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2016**

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 30/06/2016						Situación inicial 12/12/2006					
	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros		Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros	
Euro - EUR	3000	18.000	3060	684.146	3110	684.146	3170	18.000	3230	1.800.000	3250	1.800.000
EEUU Dólar - USDR	3010	0	3070	0	3120	0	3180	0	3240	0	3260	0
Japón Yen - JPY	3020	0	3080	0	3130	0	3190	0	3250	0	3270	0
Reino Unido Libra - GBP	3030	0	3090	0	3140	0	3200	0	3260	0	3280	0
Otras	3040	0			3150	0	3210	0			3290	0
Total	3050	18.000			3160	684.146	3220	18.000			3300	1.800.000

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.06

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
Estados agregados: **No**
Periodo: **1er Semestre**
Ejercicio: **2016**

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene
Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

N/A