

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: A-80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2016

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)

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: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	113.596	1001	127.169
I. Activos financieros a largo plazo	0002	113.596	1002	127.169
1. Activos titulizados	0003	113.596	1003	127.169
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	111.398	1005	124.990
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	2.208	1025	2.191
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-10	1027	-12
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

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	29.388	1041	30.845
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	464	1042	475
V. Activos financieros a corto plazo	0043	11.162	1043	11.845
1. Activos titulizados	0044	11.095	1044	11.803
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	10.676	1046	11.436
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	34	1065	46
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	5	1066	6
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	385	1067	318
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	7	1068	7
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-12	1069	-10
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	67	1074	42
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	67	1077	42
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	0
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	17.762	1085	18.525
1. Tesorería	0086	17.762	1086	18.525
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	142.984	1088	158.014

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	132.384	1089	146.706
I. Provisiones a largo plazo	0090	1.100	1090	736
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	1.100	1092	736
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	131.285	1094	145.970
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	79.172	1095	93.873
1.1 Series no subordinadas	0096	79.172	1096	93.873
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	51.424	1101	51.424
2.1 Préstamo subordinado	0102	16.424	1102	16.424
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	35.000	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	689	1108	673
3.1 Derivados de cobertura	0109	689	1109	673
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

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) PASIVO CORRIENTE	0117	11.402	1117	12.093
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118	0	1118	0
V. Provisiones a corto plazo	0119	0	1119	0
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	0
2. Provisión por margen de intermediación	0121	0	1121	0
3. Otras provisiones	0122	0	1122	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	11.389	1123	12.080
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	11.074	1124	11.794
1.1 Series no subordinadas	0125	11.061	1125	11.754
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	13	1128	40
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	190	1131	145
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133	0	1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134	0	1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	0	1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	13	1136	25
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	177	1137	120
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	125	1139	141
3.1 Derivados de cobertura	0140	125	1140	141
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	13	1148	14
1. Comisiones	0149	8	1149	8
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	6	1150	6
1.2 Comisión administrador	0151	1	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	5	1157	5
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-802	1158	-785
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-802	1160	-785
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	142.984	1162	158.014

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	227	1201	321	2201	1.026	3201	1.503
1.1 Activos titulizados	0202	227	1202	321	2202	1.026	3202	1.499
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	5
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-66	1204	-174	2204	-382	3204	-813
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-34	1205	-109	2205	-218	3205	-525
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-32	1206	-65	2206	-165	3206	-289
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	-36	1208	-23	2208	-146	3208	-152
A) MARGEN DE INTERESES	0209	125	1209	124	2209	498	3209	538
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	-27	1217	-124	2217	-123	3217	-517
7.1 Servicios exteriores	0218	-3	1218	-1	2218	-41	3218	-29
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-3	1219	-1	2219	-41	3219	-29
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	-23	1224	-124	2224	-82	3224	-488
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-13	1225	-15	2225	-56	3225	-64
7.3.2 Comisión administrador	0226	-3	1226	-4	2226	-14	3226	-15
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-2	1227	-2	2227	-7	3227	-8
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	-98	2228	0	3228	-396
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-5	1230	-5	2230	-6	3230	-6
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-7	1231	0	2231	-12	3231	-17
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-7	1232	0	2232	-12	3232	-17
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	-91	1234	0	2234	-364	3234	0
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	-91	1236	0	2236	-364	3236	0
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	-4
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: 31/12/2016

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	110	1300	120	2300	435	3300	482
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	129	1301	140	2301	512	3301	567
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	227	1302	326	2302	1.039	3302	1.526
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-36	1303	-116	2303	-244	3303	-551
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	-40	1305	-24	2305	-162	3305	-210
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	5
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	-22	1307	-46	2307	-120	3307	-202
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-18	1309	-21	2309	-77	3309	-85
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-14	1310	-15	2310	-56	3310	-63
2.2 Comisión administrador	0311	-3	1311	-4	2311	-14	3311	-15
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-2	1312	-2	2312	-7	3312	-8
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	218	1322	737	2322	-1.198	3322	-944
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	221	1325	738	2325	-1.151	3325	-908
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	2.485	1326	2.736	2326	10.247	3326	11.001
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	809	1327	1.461	2327	3.221	3327	3.571
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	309	1328	191	2328	775	3328	675
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	-3.382	1331	-3.650	2331	-15.394	3331	-16.154
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-3	1332	-1	2332	-46	3332	-36
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	-3	1336	-1	2336	-46	3336	-36
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	328	1337	857	2337	-762	3337	-462
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	17.434	1338	17.667	2338	18.525	3338	18.987
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	17.762	1339	18.525	2339	17.762	3339	18.525

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
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	-41	1357	-108	2357	-163	3357	118
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-41	1358	-108	2358	-163	3358	118
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	36	1360	23	2360	146	3360	152
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	5	1362	85	2362	17	3362	-270
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: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2016								Situación cierre anual anterior 31/12/2015								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	2,08	0401	0,72	0421	0,00	0441	2,50	1381	1,81	1401	0,64	1421	0,00	1441	2,49	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: 31/12/2016

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	99	0467	28	0474	3	0481	0	0488	32	0495	4.842	0502	0	0509	4.874
De 1 a 3 meses	0461	19	0468	11	0475	2	0482	0	0489	12	0496	1.085	0503	0	0510	1.097
De 3 a 6 meses	0462	5	0469	5	0476	0	0483	0	0490	6	0497	226	0504	0	0511	232
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	1	0477	0	0484	0	0491	1	0498	6	0505	0	0512	7
De 9 a 12 meses	0464	2	0471	11	0478	1	0485	3	0492	14	0499	460	0506	0	0513	474
Más de 12 meses	0465	21	0472	239	0479	6	0486	51	0493	295	0500	1.645	0507	0	0514	1.940
Total	0466	147	0473	294	0480	12	0487	54	0494	360	0501	8.264	0508	0	1515	8.625

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	99	0522	28	0529	3	0536	0	0543	32	0550	4.842	0557	0	0564	4.874	0571	11.513	0578	11.513	0584	42,34
De 1 a 3 meses	0516	19	0523	11	0530	2	0537	0	0544	12	0551	1.085	0558	0	0565	1.097	0572	2.257	0579	2.257	0585	48,61
De 3 a 6 meses	0517	5	0524	5	0531	0	0538	0	0545	6	0552	226	0559	0	0566	232	0573	520	0580	520	0586	44,57
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	1	0532	0	0539	0	0546	1	0553	6	0560	0	0567	7	0574	35	0581	35	0587	20,39
De 9 a 12 meses	0519	2	0526	11	0533	1	0540	3	0547	14	0554	460	0561	0	0568	474	0575	704	0582	704	0588	67,36
Más de 12 meses	0520	21	0527	239	0534	6	0541	51	0548	295	0555	1.645	0562	0	0569	1.940	0576	3.050	0583	3.050	0589	63,62
Total	0521	147	0528	294	0535	12	0542	54	0549	360	0556	8.264	0563	0	0570	8.625	0577	18.079			0590	47,71

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: 31/12/2016

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 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 19/12/2008	
Inferior a 1 año	0600	362	1600	382	2600	120
Entre 1 y 2 años	0601	1.231	1601	1.033	2601	594
Entre 2 y 3 años	0602	2.125	1602	2.114	2602	1.941
Entre 3 y 4 años	0603	2.356	1603	2.983	2603	2.947
Entre 4 y 5 años	0604	2.994	1604	3.079	2604	4.452
Entre 5 y 10 años	0605	20.267	1605	22.408	2605	32.924
Superior a 10 años	0606	95.332	1606	106.936	2606	252.322
Total	0607	124.667	1607	138.935	2607	295.300
Vida residual media ponderada (años)	0608	16,91	1608	17,35	2608	20,66

Antigüedad	Situación actual 31/12/2016					
	Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 19/12/2008			
Antigüedad media ponderada (años)	0609	11,01	1609	10,12	2609	3,78

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

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 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				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	1.748	0630	36.008	1620	1.787	1630	36.781	2620	1.221	2630	29.434
40% - 60%	0621	602	0631	42.803	1621	721	1631	45.318	2621	1.412	2631	67.657
60% - 80%	0622	315	0632	43.425	1622	389	1632	53.817	2622	1.556	2632	114.097
80% - 100%	0623	22	0633	2.431	1623	29	1633	3.019	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	2.687	0638	124.667	1628	2.926	1638	138.935	2628	4.770	2638	295.300
Media ponderada (%)			0639	50,29			1639	51,95			2639	66,21

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: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 19/12/2008	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,79	1650	1,04	2650	5,98
Tipo de interés nominal máximo	0651	8,25	1651	8,25	2651	8,36
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,17	1652	0,36	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: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				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	378	0683	16.609	1660	407	1683	18.214	2660	624	2683	38.449
Aragón	0661	14	0684	390	1661	16	1684	479	2661	37	2684	1.664
Asturias	0662	22	0685	845	1662	25	1685	1.095	2662	50	2685	2.688
Baleares	0663	21	0686	1.256	1663	22	1686	1.350	2663	30	2686	2.186
Canarias	0664	51	0687	2.284	1664	53	1687	2.550	2664	69	2687	5.095
Cantabria	0665	20	0688	932	1665	20	1688	1.019	2665	28	2688	1.766
Castilla-León	0666	99	0689	4.881	1666	106	1689	5.355	2666	162	2689	9.952
Castilla La Mancha	0667	242	0690	9.704	1667	261	1690	10.919	2667	417	2690	24.249
Cataluña	0668	224	0691	13.081	1668	234	1691	14.217	2668	369	2691	29.965
Ceuta	0669	36	0692	1.128	1669	37	1692	1.245	2669	52	2692	2.707
Extremadura	0670	70	0693	1.568	1670	73	1693	1.797	2670	117	2693	4.880
Galicia	0671	46	0694	2.361	1671	47	1694	2.535	2671	71	2694	4.305
Madrid	0672	1.210	0695	57.494	1672	1.350	1695	64.717	2672	2.330	2695	138.851
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	18	0697	739	1674	19	1697	835	2674	32	2697	2.303
Navarra	0675	12	0698	829	1675	13	1698	899	2675	18	2698	1.476
La Rioja	0676	6	0699	119	1676	6	1699	143	2676	12	2699	475
Comunidad Valenciana	0677	178	0700	8.217	1677	194	1700	9.152	2677	291	2700	19.689
País Vasco	0678	40	0701	2.232	1678	43	1701	2.415	2678	61	2701	4.600
Total España	0679	2.687	0702	124.667	1679	2.926	1702	138.935	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	2.687	0705	124.667	1682	2.926	1705	138.935	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: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 19/12/2008			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	3,13			1710	2,91			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: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2016			Situación cierre anual anterior 31/12/2015			Situación inicial 19/12/2008		
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722
ES0359494004	SERIE A (G)	2.603	34.665	90.233	2.603	40.579	105.627	2.603	100.000	260.300
Total		0723 2.603		0724 90.233	1723 2.603		1724 105.627	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: 31/12/2016

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
ES0359494004	SERIE A (G)	NS	EURIBOR 3 m	0,45	0,14	13	0	SI	90.233	0	90.246	0	90.246	0			
Total						0740	13	0741	0	0743	90.233	0744	0	0745	90.246	0746	0

	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 19/12/2008	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,21	0748	0,45	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: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2016								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2015							
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	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0359494004	SERIE A (G)	3.382	170.067	36	15.946	3.650	154.673	116	15.702								
Total		0754	3.382	0755	170.067	0756	36	0757	15.946	1754	3.650	1755	154.673	1756	116	1757	15.702

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: 31/12/2016

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 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	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: 31/12/2016
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 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 19/12/2008	
Inferior a 1 año	0765	7.340	1765	10.524	2765	10.227
Entre 1 y 2 años	0766	6.868	1766	9.610	2766	12.459
Entre 2 y 3 años	0767	6.401	1767	7.055	2767	13.095
Entre 3 y 4 años	0768	5.955	1768	6.568	2768	13.177
Entre 4 y 5 años	0769	5.591	1769	6.101	2769	13.133
Entre 5 y 10 años	0770	22.687	1770	25.024	2770	64.154
Superior a 10 años	0771	35.392	1771	40.745	2771	134.054
Total	0772	90.233	1772	105.627	2772	260.300
Vida residual media ponderada (años)	0773	14,91	1773	16,16	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: 31/12/2016

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 19/12/2008	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	15.038	1775	15.190	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	16,67	1777	14,38	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	90.233	1786	105.627	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: 31/12/2016

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 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	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	-813		
Total							0808 -814	0809 -813	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: 31/12/2016

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 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 19/12/2008		Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		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: 31/12/2016

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 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	862	7006	703	7009	0,70	7012	0,51	7015	0,68		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	862	7008	703	7011	0,70	7014	0,51	7017	0,68	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	2.999	7024	2.921	7027	2,38	7030	2,08	7033	2,48		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	147	7025	147	7028	0,12	7031	0,11	7034	0,11		
Total Fallidos					7023	3.146	7026	3.069	7029	2,50	7032	2,19	7035	2,59	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		
	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: 31/12/2016

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
SERIE A (G) - ES0359494004	23,70	27,95	27,21	4.9.4 Nota de Valores
SERIE A (G) - ES0359494004	2,00	0,58	0,68	4.9.4 Nota de Valores
SERIE A (G) - ES0359494004	10,00	41,58	42,41	4.9.4 Nota de Valores
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE A (G) - ES0359494004	6,00	1,34	1,34	3.4.6.1. Modulo Adicional
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		16,67	16,00	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

Denominación Fondo: MADRID ICO-FTVPO I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

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: 31/12/2016

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: 31/12/2016

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo				Total
		22/02/2016	23/05/2016	22/08/2016	22/11/2016	
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885					
Saldo inicial	0886	15.190	14.862	14.958	14.982	
Cobros del periodo	0887	4.517	3.955	3.861	3.558	
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-34	-33	-34	-21	
Pagos por derivados	0889	-32	-47	-43	-40	
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-14.862	-14.958	-14.982	-15.038	
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-4.740	-3.747	-3.734	-3.418	
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-41	-31	-26	-22	
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0	0	
Saldo disponible	0894	0	0	0	0	
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	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: 31/12/2016

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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