

# ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.00

## I. DATOS IDENTIFICATIVOS

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

Número de registro del Fondo: **8558**

NIF Fondo: **V-84889229**

Denominación del compartimento:

Número de registro del compartimento:

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

NIF gestora: **A-80352750**

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

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

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

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

<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0008	741.388	1008	768.147
-------------------------------	------	---------	------	---------

<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0010	741.388	1010	768.147
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	741.388	1200	768.147
2.1 Participaciones hipotecarias	0201	0	1201	0
2.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0202	719.385	1202	743.167
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 titulización	0218	0	1218	0
2.19 Otros	0219	0	1219	0
2.20 Activos dudosos	0220	27.132	1220	30.922
2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0221	-5.129	1221	-5.942
2.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0222	0	1222	0
2.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0223	0	1223	0
3. Derivados	0230	0	1230	0
3.1 Derivados de cobertura	0231	0	1231	0
3.2 Derivados de negociación	0232	0	1232	0
4. Otros activos financieros	0240	0	1240	0
4.1 Garantías financieras	0241	0	1241	0
4.2 Otros	0242	0	1242	0

<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0250	0	1250	0
--	------	---	------	---

<b>III. Otros activos no corrientes</b>	0260	0	1260	0
---	------	---	------	---

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

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

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2016		Periodo Anterior 31/12/2015
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0270	83.389	1270	84.764
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0280	30.255	1280	30.328
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0290	42.973	1290	42.588
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	42.973	1400	42.588
3.1 Participaciones hipotecarias	0401	0	1401	0
3.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0402	40.418	1402	39.941
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	4.441	1420	4.527
3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0421	-2.346	1421	-2.419
3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0422	263	1422	307
3.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0423	0	1423	0
3.24 Intereses vencidos e impagados	0424	197	1424	232
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
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0450	0	1450	0
1. Comisiones	0451	0	1451	0
2. Otros	0452	0	1452	0
<b>VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes</b>	0460	10.161	1460	11.848
1. Tesorería	0461	10.161	1461	11.848
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462	0	1462	0

TOTAL ACTIVO	0500	824.777	1500	852.911
--------------	------	---------	------	---------

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

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

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2016		Periodo Anterior 31/12/2015
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0650	770.596	1650	799.437
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0660	0	1660	0
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0700	770.596	1700	799.437
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	729.307	1710	756.782
1.1 Series no subordinadas	0711	529.307	1711	556.782
1.2 Series subordinadas	0712	200.000	1712	200.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0713		1713	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0714	0	1714	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0715	0	1715	0
2. Deudas con entidades de crédito	0720	30.712	1720	32.078
2.1 Préstamo subordinado	0721	71.000	1721	71.000
2.2 Crédito línea de liquidez	0722	0	1722	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0723	0	1723	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0724	-40.288	1724	-38.922
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	10.577	1730	10.577
3.1 Derivados de cobertura	0731	10.577	1731	10.577
3.2 Derivados de negociación	0732	0	1732	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0733		1733	
4. Otros pasivos financieros	0740	0	1740	0
4.1 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0741		1741	
4.2 Otros	0742	0	1742	0
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	0750	0	1750	0
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0760	66.934	1760	66.214
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0770	0	1770	0
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	0780	0	1780	0
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	0800	65.804	1800	64.910
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	0	1810	0
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	44.904	1820	44.592
2.1 Series no subordinadas	0821	44.858	1821	44.468
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	124
2.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0825	0	1825	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0826	0	1826	0
3. Deudas con entidades de crédito	0830	18.373	1830	17.791
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	116	1835	128
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836	0	1836	0
3.7 Intereses vencidos e impagados	0837	18.257	1837	17.663
4. Derivados	0840	2.527	1840	2.527
4.1 Derivados de cobertura	0841	2.527	1841	2.527
4.2 Derivados de negociación	0842	0	1842	0
4.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0843		1843	
5. Otros pasivos financieros	0850	0	1850	0
5.1 Importe bruto	0851	0	1851	0
5.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0852		1852	

<b>VII. Ajustes por periodificación</b>	0900	1.130	1900	1.304
1. Comisiones	0910	22	1910	21
1.1 Comisión sociedad gestora	0911	17	1911	17
1.2 Comisión administrador	0912	0	1912	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0913	5	1913	4
1.4 Comisión variable - resultados realizados	0914	1.600	1914	1.600
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	-1.600	1917	-1.600
1.8 Otras comisiones	0918	0	1918	0
2. Otros	0920	1.108	1920	1.283
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0930	-12.753	1930	-12.740
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0940	0	1940	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0950	-12.753	1950	-12.740
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0960	0	1960	0
<b>XI. Gastos de constitución en transición</b>	0970		1970	
<b>TOTAL PASIVO</b>	1000	824.777	2000	852.911

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.02

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

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
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0100		1100		2100	3.942	3100	5.306
1.1 Valores representativos de deuda	0110		1110		2110	0	3110	0
1.2 Derechos de crédito	0120		1120		2120	3.942	3120	5.306
1.3 Otros activos financieros	0130		1130		2130	0	3130	0
<b>2. Intereses y cargas asimiladas</b>	0200		1200		2200	-942	3200	-1.848
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210		1210		2210	-360	3210	-1.189
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220		1220		2220	-582	3220	-659
2.3 Otros pasivos financieros	0230		1230		2230		3230	
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0240		1240		2240	-1.411	3240	-1.543
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0250		1250		2250	1.589	3250	1.915
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	0300		1300		2300	-2	3300	0
4.1 Ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0310		1310		2310	0	3310	0
4.2 Activos financieros disponibles para la venta	0320		1320		2320	0	3320	0
4.3 Otros	0330		1330		2330	-2	3330	0
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0400		1400		2400	0	3400	0
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0500		1500		2500	0	3500	0
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0600		1600		2600	-1.057	3600	-1.039
7.1 Servicios exteriores	0610		1610		2610	-952	3610	-930
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611		1611		2611	-952	3611	-930
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	-105	3630	-109
7.3.1 Comisión de sociedad gestora	0631		1631		2631	-82	3631	-88
7.3.2 Comisión administrador	0632		1632		2632		3632	
7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos	0633		1633		2633	-23	3633	-21
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
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0700		1700		2700	-2.082	3700	-3.388
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	-2.082	3720	-3.388
8.3 Deterioro neto de derivados	0730		1730		2730	0	3730	0
8.4 Deterioro neto de otros activos financieros	0740		1740		2740	0	3740	0
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	0750		1750		2750	0	3750	0
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0800		1800		2800	185	3800	455
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0850		1850		2850	1.367	3850	2.057
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0900		1900		2900	0	3900	0
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0950		1950		2950	0	3950	0
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	3000		4000		5000	0	6000	0

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.03

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

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2016		Mismo Periodo año Anterior 30/06/2015
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN</b>	8000	3.730	9000	5.453
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	8100	2.158	9100	2.264
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	4.020	9110	5.423
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-437	9120	-1.265
1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados	8130	-1.425	9130	-1.894
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
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo</b>	8200	-104	9200	-108
2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora	8210	-82	9210	-87
2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados	8220		9220	
2.3 Comisiones pagadas al agente financiero	8230	-22	9230	-21
2.4 Comisiones variables pagadas	8240		9240	
2.5 Otras comisiones	8250		9250	
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo</b>	8300	1.676	9300	3.297
3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos	8310	0	9310	0
3.2 Pagos de provisiones	8320		9320	
3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta	8325	1.677	9325	3.295
3.4 Otros	8330	-1	9330	2
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION</b>	8350	-5.417	9350	-7.801
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	8400	0	9400	0
4.1 Cobros por emisión de valores de titulización	8410	0	9410	0
4.2 Pagos por emisión de valores de titulización (aseguramiento colocación)	8420		9420	
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	8500		9500	
5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito	8510		9510	
5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras	8520		9520	
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones</b>	8600	-4.461	9600	-6.864
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	22.623	9610	24.060
6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados	8620	0	9620	0
6.3 Pagos por amortización de valores de titulización	8630	-27.084	9630	-30.924
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	8700	-956	9700	-937
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	-4	9740	0
7.5 Otros deudores y acreedores	8750	-952	9750	-937
7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras	8770	0	9770	0
7.7 Cobros de Subvenciones	8780	0	9780	0
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	8800	-1.687	9800	-2.348
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	11.848	9900	14.740
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	10.161	9990	12.392



ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.04

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

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS <i>(miles de euros)</i>		Periodo Actual 30/06/2016		Mismo Periodo año Anterior 30/06/2015
<b>1 Activos financieros disponibles para la venta</b>				
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6010	0	7010	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6020	0	7020	0
1.1.2 Efecto fiscal	6021	0	7021	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6022	0	7022	0
1.3 Otras reclasificaciones	6030	0	7030	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6040	0	7040	0
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>6100</b>	<b>0</b>	<b>7100</b>	<b>0</b>
<b>2 Cobertura de los flujos de efectivo</b>				
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6110	-1.424	7110	1.477
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6120	-1.424	7120	1.477
2.1.2 Efecto fiscal	6121	0	7121	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6122	1.411	7122	1.543
2.3 Otras reclasificaciones	6130	0	7130	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6140	13	7140	-3.020
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>6200</b>	<b>0</b>	<b>7200</b>	<b>0</b>
<b>3 Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>				
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el periodo	6310	0	7310	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6320	0	7320	0
3.1.2 Efecto fiscal	6321	0	7321	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6322	0	7322	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6330	0	7330	0
<b>Total Ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>6400</b>	<b>0</b>	<b>7400</b>	<b>0</b>
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>6500</b>	<b>0</b>	<b>7500</b>	<b>0</b>

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **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 15/11/2006			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)		
Participaciones hipotecarias	0001		0030		0060		0090		0120		0150	
Certificados de transmisión hipotecaria	0002	5.815	0031	791.375	0061	5.903	0091	818.557	0121	11.090	0151	2.000.000
Préstamos hipotecarios	0003		0032		0062		0092		0122		0152	
Cédulas hipotecarias	0004		0033		0063		0093		0123		0153	
Préstamos a promotores	0005		0034		0064		0094		0124		0154	
Préstamos a PYMES	0007		0036		0066		0096		0126		0156	
Préstamos a empresas	0008		0037		0067		0097		0127		0157	
Préstamos Corporativos	0009		0038		0068		0098		0128		0158	
Cédulas territoriales	0010		0039		0069		0099		0129		0159	
Bonos de tesorería	0011		0040		0070		0100		0130		0160	
Deuda subordinada	0012		0041		0071		0101		0131		0161	
Créditos AAPP	0013		0042		0072		0102		0132		0162	
Préstamos consumo	0014		0043		0073		0103		0133		0163	
Préstamos automoción	0015		0044		0074		0104		0134		0164	
Arrendamiento financiero	0016		0045		0075		0105		0135		0165	
Cuentas a cobrar	0017		0046		0076		0106		0136		0166	
Derechos de crédito futuros	0018		0047		0077		0107		0137		0167	
Bonos de titulización	0019		0048		0078		0108		0138		0168	
Otros	0020		0049		0079		0109		0139		0169	
<b>Total</b>	<b>0021</b>	<b>5.815</b>	<b>0050</b>	<b>791.375</b>	<b>0080</b>	<b>5.903</b>	<b>0110</b>	<b>818.557</b>	<b>0140</b>	<b>11.090</b>	<b>0170</b>	<b>2.000.000</b>

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **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	-2.967	0206	-9.267
Derechos de crédito dados de baja por dación/adjudicación de bienes desde el cierre anual anterior	0197	-1.419	0207	-5.702
Amortización ordinaria desde el cierre anual anterior	0200	-16.788	0210	-33.173
Amortización anticipada desde el cierre anual anterior	0201	-6.007	0211	-15.528
Total importe amortizado acumulado, incluyendo adjudicaciones y otros pagos en especie, desde el origen del Fondo	0202	-1.131.609	0212	-1.107.395
Importe de principal pendiente de amortización de los nuevos activos incorporados en el periodo (1)	0203	0	0213	0
<b>Principal pendiente cierre del periodo (2)</b>	0204	791.375	0214	818.557
<b>Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)</b>	0205	1,62	0215	1,76

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

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **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	340	0710	114	0720	35	0730	149	0740	46.914	0750	47.063
De 1 a 3 meses	0701	46	0711	43	0721	13	0731	56	0741	5.876	0751	5.932
De 3 a 6 meses	0703	14	0713	25	0723	12	0733	37	0743	2.350	0753	2.387
De 6 a 9 meses	0704	13	0714	43	0724	28	0734	71	0744	2.022	0754	2.093
De 9 a 12 meses	0705	8	0715	43	0725	15	0735	58	0745	1.423	0755	1.481
De 12 meses a 2 años	0706	56	0716	424	0726	205	0736	629	0746	8.277	0756	8.906
Más de 2 años	0708	110	0718	2.369	0728	1.121	0738	3.490	0748	14.598	0758	18.088
<b>Total</b>	<b>0709</b>	<b>587</b>	<b>0719</b>	<b>3.061</b>	<b>0729</b>	<b>1.429</b>	<b>0739</b>	<b>4.490</b>	<b>0749</b>	<b>81.460</b>	<b>0759</b>	<b>85.950</b>

(1) La distribución de los activos vencidos impagados entre los distintos tramos señalados se realizará en función de la antigüedad de la primera cuota vencida y no cobrada. Los intervalos se entenderán excluido el de inicio e incluido el final (p.e. De 1 a 3 meses, esto es: superior a 1 mes y menor o igual a 3 meses)

(2) Importe de intereses cuyo devengo, en su caso, se ha interrumpido conforme lo establecido en el apartado 12 de la norma 13ª de la Circular(p.e. De 1 a 3 meses, esto es: superior a 1 mes y menor o igual a 3 meses)

Impagados con garantía real (2)	Nº de activos	Importe impagado							Deuda Total	Valor garantía (3)	Valor Garantía con Tasación > 2 años (4)	% Deuda/v. Tasación				
		Principal pendiente vencido		Intereses ordinarios		Total		Principal pendiente no vencido								
Hasta 1 mes	0772	340	0782	114	0792	35	0802	149	0812	46.914	0822	47.063	0832	62.346	0842	75,49
De 1 a 3 meses	0773	46	0783	43	0793	13	0803	56	0813	5.876	0823	5.932	0833	7.955	0843	74,57
De 3 a 6 meses	0774	14	0784	25	0794	12	0804	37	0814	2.350	0824	2.387	0834	2.828	1854	84,38
De 6 a 9 meses	0775	13	0785	43	0795	28	0805	71	0815	2.022	0825	2.093	0835	2.621	1855	79,83
De 9 a 12 meses	0776	8	0786	43	0796	15	0806	58	0816	1.423	0826	1.481	0836	1.954	1856	75,78
De 12 meses a 2 años	0777	56	0787	424	0797	205	0807	629	0817	8.277	0827	8.906	0837	10.729	1857	83,00
Más de 2 años	0778	110	0788	2.369	0798	1.121	0808	3.490	0818	14.598	0828	18.088	0838	21.296	1858	84,94
<b>Total</b>	<b>0779</b>	<b>587</b>	<b>0789</b>	<b>3.061</b>	<b>0799</b>	<b>1.429</b>	<b>0809</b>	<b>4.490</b>	<b>0819</b>	<b>81.460</b>	<b>0829</b>	<b>85.950</b>	<b>0839</b>	<b>109.729</b>	<b>0849</b>	<b>78,33</b>

(2) La distribución de los activos vencidos impagados entre los distintos tramos señalados se realizará en función de la antigüedad de la primera cuota vencida y no cobrada. Los intervalos se entenderán excluido el de inicio e incluido el final (p.e. De 1 a 2 meses, estos es: superior a 1 mes y menor o igual a 2 meses)

(3) Cumplimentar con la última valoración disponible de tasación del inmueble o valor razonable de la garantía real (acciones o deuda pignoradas, etc.) si el valor de las mismas se ha considerado en el momento inicial del Fondo

(4) Se incluirá el valor de las garantías que tengan una tasación superior a dos años

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 1er Semestre

Ejercicio: 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	3,99	0869	8,84	0887	0,00	0905	4,33	0923	8,31	0941	0,00	0959	0,00	0977	0,00	0995	0,00
Préstamos hipotecarios	0852		0870		0888		0906		0924		0942		0960		0978		0996	
Cédulas Hipotecarias	0853		0871		0889		0907		0925		0943		0961		0979		0997	
Préstamos a promotores	0854		0872		0890		0908		0926		0944		0962		0980		0998	
Préstamos a PYMES	0855		0873		0891		0909		0927		0945		0963		0981		0999	
Préstamos a empresas	0856		0874		0892		0910		0928		0946		0964		0982		1000	
Préstamos Corporativos	0857		0875		0893		0911		0929		0947		0965		0983		1001	
Cédulas Territoriales	1066		1084		1102		1120		1138		1156		1174		1192		1210	
Bonos de Tesorería	0858		0876		0894		0912		0930		0948		0966		0984		1002	
Deuda subordinada	0859		0877		0895		0913		0931		0949		0967		0985		1003	
Créditos AAPP	0860		0878		0896		0914		0932		0950		0968		0986		1004	
Préstamos Consumo	0861		0879		0897		0915		0933		0951		0969		0987		1005	
Préstamos automoción	0862		0880		0898		0916		0934		0952		0970		0988		1006	
Cuotas arrendamiento financiero	0863		0881		0899		0917		0935		0953		0971		0989		1007	
Cuentas a cobrar	0864		0882		0900		0918		0936		0954		0972		0990		1008	
Derechos de crédito futuros	0865		0883		0901		0919		0937		0955		0973		0991		1009	
Bonos de titulización	0866		0884		0902		0920		0938		0956		0974		0992		1010	
Otros	0867		0885		0903		0921		0939		0957		0975		0993		1011	

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

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

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

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS I, FONDO DE TITULACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **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 15/11/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior a 1 año	1300	3	1310	122	1320	10	1330	222	1340	0	1350	0
Entre 1 y 2 años	1301	4	1311	157	1321	3	1331	35	1341	0	1351	0
Entre 2 y 3 años	1302	11	1312	305	1322	4	1332	200	1342	0	1352	0
Entre 3 y 5 años	1303	39	1313	1.328	1323	38	1333	1.358	1343	0	1353	0
Entre 5 y 10 años	1304	335	1314	18.723	1324	300	1334	17.154	1344	2	1354	194
Superior a 10 años	1305	5.423	1315	770.741	1325	5.548	1335	799.588	1345	11.088	1355	1.999.806
<b>Total</b>	1306	5.815	1316	791.376	1326	5.903	1336	818.557	1346	11.090	1356	2.000.000
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	1307	18,71			1327	19,16			1347	27,56		

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

Antigüedad	Situación actual 30/06/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 15/11/2006	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	11,18	0632	10,69	0634	1,64

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **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)*

Serie (2)	Denominación serie	Situación actual 30/06/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Escenario inicial 15/11/2006			
		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)
		0001	0002	0003	0004	0005	0006	0007	0008	0009	0070	0080	0090
ES0359091008	SERIE A1	4.600	0	0	0,00	4.600	0	0	0,00	4.600	100	460.000	1,00
ES0359091016	SERIE A2	13.400	43	574.165	6,27	13.400	45	601.250	6,65	13.400	100	1.340.000	6,18
ES0359091024	SERIE B	700	100	70.000	13,18	700	100	70.000	13,19	700	100	70.000	8,42
ES0359091032	SERIE C	750	100	75.000	13,18	750	100	75.000	13,19	750	100	75.000	8,42
ES0359091040	SERIE D	340	100	34.000	13,18	340	100	34.000	13,19	340	100	34.000	8,42
ES0359091057	SERIE E	210	100	21.000	13,18	210	100	21.000	2,44	210	100	21.000	8,42
<b>Total</b>		8006	20.000	8025	774.165	8045	20.000	8065	801.250	8085	20.000	8105	2.000.000

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

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **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)

Serie (1)	Denominación serie	Grado de subordinación (2)	Índice de referencia (3)	Margen (4)	Tipo aplicado	Intereses				Principal pendiente		Total pendiente	Corrección de valor por repercusión de pérdidas					
						Base de cálculo de intereses	Días Acumulados (5)	Intereses Acumulados (6)	Intereses impagados	Principal no vencido	Principal impagado							
														9950	9960	9970	9980	9990
ES0359091008	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,06	0,00	360	38	0	0	0	0	0	0					
ES0359091016	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,16	0,00	360	38	0	0	574.165	0	574.165						
ES0359091024	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	0,00	360	38	0	0	70.000	0	70.000						
ES0359091032	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	0,04	360	38	3	0	75.000	0	75.003						
ES0359091040	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	0,24	360	38	9	0	34.000	0	34.009						
ES0359091057	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	1,80	1,54	360	38	34	0	21.000	0	21.034						
<b>Total</b>								<b>9228</b>	<b>46</b>	<b>9105</b>	<b>0</b>	<b>9085</b>	<b>774.165</b>	<b>9095</b>	<b>0</b>	<b>9115</b>	<b>774.211</b>	<b>9227</b>

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

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

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

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

(5) Días acumulados desde la última fecha de pago

(6) Intereses acumulados desde la última fecha de pago



## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **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								
ES0359091008	SERIE A1	22-05-2009	0	460.000	0	26.346	0	460.000	0	26.346								
ES0359091016	SERIE A2	22-06-2049	27.084	765.835	103	191.035	59.666	738.751	1.176	190.932								
ES0359091024	SERIE B	22-06-2049	0	0	38	11.691	0	0	192	11.653								
ES0359091032	SERIE C	22-06-2049	0	0	59	12.886	0	0	244	12.827								
ES0359091040	SERIE D	22-06-2049	0	0	61	6.496	0	0	179	6.435								
ES0359091057	SERIE E	22-06-2049	0	0	176	6.644	0	0	387	6.468								
<b>Total</b>			<b>7305</b>	<b>27.084</b>	<b>7315</b>	<b>1.225.835</b>	<b>7325</b>	<b>437</b>	<b>7335</b>	<b>255.098</b>	<b>7345</b>	<b>59.666</b>	<b>7355</b>	<b>1.198.751</b>	<b>7365</b>	<b>2.178</b>	<b>7375</b>	<b>254.661</b>

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

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

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 1er Semestre

Ejercicio: 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
ES0359091008	SERIE A1	15-11-2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0359091008	SERIE A1	15-11-2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359091008	SERIE A1	15-11-2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359091016	SERIE A2	26-02-2015	FCH	BBB-	BBB-	AAA
ES0359091016	SERIE A2	14-05-2016	MDY	Aa3	A1	Aaa
ES0359091016	SERIE A2	15-01-2015	SYP	BBB	BBB	AAA
ES0359091024	SERIE B	26-02-2015	FCH	BB-	BB-	AA
ES0359091024	SERIE B	14-05-2016	MDY	Baa1	Baa3	Aa2
ES0359091024	SERIE B	15-01-2015	SYP	BB+	BB+	AA
ES0359091032	SERIE C	26-02-2015	FCH	B-	B-	A
ES0359091032	SERIE C	14-05-2016	MDY	B1	B2	A2
ES0359091032	SERIE C	20-03-2013	SYP	B-	B-	A
ES0359091040	SERIE D	18-03-2009	FCH	CCC	CCC	BBB
ES0359091040	SERIE D	11-09-2009	MDY	C	C	Baa2
ES0359091040	SERIE D	20-03-2013	SYP	CCC+	CCC+	BBB
ES0359091057	SERIE E	18-03-2009	FCH	CC	CC	BB+
ES0359091057	SERIE E	11-09-2009	MDY	C	C	Ba2
ES0359091057	SERIE E	20-03-2013	SYP	CCC-	CCC-	BB

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

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

# ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.3

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

<b>INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS</b> <i>(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)</i>		<b>Situación actual</b> <b>30/06/2016</b>		<b>Situación cierre</b> <b>anual anterior</b> <b>31/12/2015</b>
1. Importe del Fondo de Reserva	0010	0	1010	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
3. Exceso de spread (%) (1)	0040	0,95	1040	0,99
4. Permuta financiera de intereses (S/N)	0050	Si	1050	Si
5. Permuta financiera de tipos de cambio (S/N)	0070	No	1070	No
6. Otras permutas financieras (S/N)	0080	No	1080	No
7. Importe disponible de la línea/s de liquidez (2)	0090	0	1090	0
8. Subordinación de series (S/N)	0110	Si	1110	Si
9. Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total de bonos (3)	0120	74,17	1120	75,04
10. Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales	0150		1150	
11. Porcentaje que representa el aval sobre el total de los pasivos emitidos	0160		1160	
12. Importe máximo de riesgo cubierto por derivados de crédito u otras garantías financieras adquiridas	0170	0	1170	0
13. Otros (S/N) (4)	0180	No	1180	No
(1) Diferencial existente entre los tipos de interés medios ponderados percibidos de la cartera de activos titulizados conforme se establece en el Cuadro 5.5.E y el tipo de interés medio de los pasivos emitidos cuya finalidad ha sido la adquisición de los activos (2) Se incluirá el importe total disponible de las distintas líneas de liquidez en caso de que haya más de una (3) Entendiendo como no subordinadas aquellas series que en la fecha se encuentren, respecto a las demás, en una posición anterior para el cobro de capital conforme al orden de prelación de pagos (4) La gestora deberá incluir una descripción de dichas mejoras crediticias en las notas explicativas en caso de que las consideren relevantes				

<b>Información sobre contrapartes de las mejoras crediticias</b>		<b>NIF</b>		<b>Denominación</b>
Contraparte del Fondo de Reserva u otras mejoras equivalentes (5)	0200		1210	Caja Madrid
Permutas financieras de tipos de interés	0210		1220	Banco 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 I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **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		
	0100	0200	0300	0400	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	0010		0030	90	0100	2.316	0200	2.757	0300	0,00	0400	0,00	1120	0,00	
2. Activos Morosos por otras razones					0110		0210		0310		0410		1130		
<b>Total Morosos</b>					0120	2.316	0220	2.757	0320	0,00	0420	0,00	1140	0,00	1280
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	0050		0060	6	0130	118.989	0230	123.797	0330	0,16	0430	0,16	1050	0,16	
4. Activos Fallidos por otras razones					0140	1.173	0240	1.274	0340	0,00	0440	0,00	1160	0,00	
<b>Total Fallidos</b>					0150	120.162	0250	125.071	0350	0,16	0450	0,16	1200	0,16	1290

(1) En caso de existir definiciones adicionales a las recogidas en la presente tabla (moros cualificadas, fallidos subjetivos, etc) respecto a las que se establezca algún trigger se indicarán en la tabla de Otros ratios relevantes, indicando el nombre del ratio

(2) Los ratios se corresponden al importe total de activos fallidos o morosos entre el saldo vivo de los activos cedidos al fondo según se defina en la documentación contractual. En la columna Ref. Folleto se indicará el epígrafe o capítulo del folleto en el que el concepto esté definido

Otros ratios relevantes	Ratio (2)				Ref. Folleto
	Situación actual	periodo anterior	Última Fecha Pago		
N/A	0160	0260	0360	0460	

TRIGGERS (3)	Límite	% Actual	Última Fecha Pago		Ref. Folleto
			0540	0560	
<b>Amortización secuencial: series (4)</b>	0500	0520	0540	0560	
SERIE A1 ES0359091008	25,00	6,01	6,06		4.9.4 Nota de Valores
SERIE A2 ES0359091016	25,00	6,01	6,06		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359091040	3,40	4,39	4,32		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359091040	1,50	0,29	0,36		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359091040	10,00	43,72	44,14		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359091032	7,50	9,69	9,52		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359091032	1,75	0,29	0,36		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359091032	10,00	43,72	44,14		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359091024	7,00	9,04	8,89		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359091024	2,00	0,29	0,36		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359091024	10,00	43,72	44,14		4.9.4 Nota de Valores

SERIE E ES0359091057		2,10		2,71		2,67		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359091057		1,25		0,29		0,36		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359091057		10,00		43,72		44,14		4.9.4 Nota de Valores
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series (5)</b>		<b>0506</b>		<b>0526</b>		<b>0546</b>		<b>0566</b>
SERIE E ES0359091057		8,00		6,01		6,06		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE D ES0359091040		9,40		6,01		6,06		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE C ES0359091032		13,20		6,01		6,06		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE B ES0359091024		18,30		6,01		6,06		3.4.6.2. Modulo Adicional
<b>No Reducción del Fondo de Reserva (6)</b>	0512		0532	0,00	0552	0,00	0572	3.4.2.2. Modulo Adicional
<b>OTROS TRIGGERS (3)</b>		<b>0513</b>		<b>0523</b>		<b>0553</b>		<b>0573</b>
N/A								

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

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

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

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

--

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **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 15/11/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)	
Andalucía	0400	300	0426	29.714	0452	301	0478	30.558	0504	484	0530	62.633
Aragón	0401	96	0427	9.834	0453	101	0479	10.392	0505	206	0531	30.916
Asturias	0402	50	0428	4.380	0454	50	0480	4.470	0506	71	0532	7.768
Baleares	0403	47	0429	5.649	0455	48	0481	5.945	0507	73	0533	11.943
Canarias	0404	32	0430	2.990	0456	33	0482	3.151	0508	82	0534	10.692
Cantabria	0405	100	0431	10.514	0457	101	0483	10.760	0509	142	0535	20.344
Castilla-León	0406	143	0432	13.037	0458	145	0484	13.522	0510	235	0536	30.276
Castilla La Mancha	0407	240	0433	27.839	0459	242	0485	28.651	0511	560	0537	89.081
Cataluña	0408	629	0434	89.310	0460	636	0486	91.752	0512	1.050	0538	188.843
Ceuta	0409	22	0435	1.161	0461	22	0487	1.212	0513	43	0539	3.879
Extremadura	0410	28	0436	1.881	0462	28	0488	1.926	0514	41	0540	4.142
Galicia	0411	95	0437	9.731	0463	97	0489	10.176	0515	127	0541	17.283
Madrid	0412	3.615	0438	541.551	0464	3.667	0490	559.961	0516	7.105	0542	1.401.798
Meilla	0413	0	0439	0	0465	0	0491	0	0517	0	0543	0
Murcia	0414	24	0440	2.155	0466	25	0492	2.314	0518	72	0544	8.796
Navarra	0415	19	0441	2.183	0467	20	0493	2.243	0519	38	0545	6.331
La Rioja	0416	26	0442	2.790	0468	27	0494	2.982	0520	61	0546	9.523
Comunidad Valenciana	0417	214	0443	17.236	0469	224	0495	18.596	0521	502	0547	58.875
País Vasco	0418	135	0444	19.420	0470	136	0496	19.946	0522	198	0548	36.877
<b>Total España</b>	0419	5.815	0445	791.375	0471	5.903	0497	818.557	0523	11.090	0549	2.000.000
Otros países Unión europea	0420	0	0446	0	0472	0	0498	0	0524	0	0550	0
Resto	0422	0	0448	0	0474	0	0500	0	0526	0	0552	0
<b>Total general</b>	0425	5.815	0450	791.375	0475	5.903	0501	818.557	0527	11.090	0553	2.000.000

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

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

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

Divisa/Activos titulizados	Situación actual 30/06/2016						Situación cierre anual anterior 31/12/2015						Situación inicial 15/11/2006					
	Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)	
Euro - EUR	0571	5.815	0577	791.375	0583	791.375	0600	5.903	0606	818.557	0611	818.557	0620	11.090	0626	2.000.000	0631	2.000.000
EEUU Dólar - USD	0572	0	0578	0	0584	0	0601	0	0607	0	0612	0	0621	0	0627	0	0632	0
Japón Yen - JPY	0573	0	0579	0	0585	0	0602	0	0608	0	0613	0	0622	0	0628	0	0633	0
Reino Unido Libra - GBP	0574	0	0580	0	0586	0	0603	0	0609	0	0614	0	0623	0	0629	0	0634	0
Otras	0575	0			0587	0	0604	0			0615	0	0624	0			0635	0
<b>Total</b>	<b>0576</b>	<b>5.815</b>			<b>0588</b>	<b>791.375</b>	<b>0605</b>	<b>5.903</b>			<b>0616</b>	<b>818.557</b>	<b>0625</b>	<b>11.090</b>			<b>0636</b>	<b>2.000.000</b>

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

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **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 15/11/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	1100	181	1110	8.490	1120	166	1130	7.513	1140	0	1150	0
40% - 60%	1101	941	1111	72.868	1121	805	1131	62.439	1141	0	1151	0
60% - 80%	1102	2.851	1112	372.835	1122	2.921	1132	380.536	1142	0	1152	0
80% - 100%	1103	1.842	1113	337.183	1123	2.011	1133	368.069	1143	10.556	1153	1.878.659
100% - 120%	1104	0	1114	0	1124	0	1134	0	1144	534	1154	121.341
120% - 140%	1105	0	1115	0	1125	0	1135	0	1145	0	1155	0
140% - 160%	1106	0	1116	0	1126	0	1136	0	1146	0	1156	0
superior al 160%	1107	0	1117	0	1127	0	1137	0	1147	0	1157	0
<b>Total</b>	<b>1108</b>	<b>5.815</b>	<b>1118</b>	<b>791.376</b>	<b>1128</b>	<b>5.903</b>	<b>1138</b>	<b>818.557</b>	<b>1148</b>	<b>11.090</b>	<b>1158</b>	<b>2.000.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>			<b>1119</b>	<b>75,00</b>			<b>1139</b>	<b>76,25</b>			<b>1159</b>	<b>95,42</b>

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



## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **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		5.814		791.198		0,95		1,09
TIPO FIJO		1		178				1,50
<b>Total</b>	<b>1405</b>	<b>5.815</b>	<b>1415</b>	<b>791.376</b>	<b>1425</b>	<b>0,95</b>	<b>1435</b>	<b>1,09</b>

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Periodo: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **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 15/11/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior al 1%	1500	2.272	1521	343.292	1542	1.376	1563	225.021	1584	0	1605	0
1% - 1,49%	1501	2.611	1522	342.675	1543	2.704	1564	366.902	1585	0	1606	0
1,5% - 1,99%	1502	709	1523	89.068	1544	1.513	1565	199.876	1586	0	1607	0
2% - 2,49%	1503	223	1524	16.341	1545	307	1566	26.386	1587	0	1608	0
2,5% - 2,99%	1504	0	1525	0	1546	2	1567	283	1588	30	1609	7.129
3% - 3,49%	1505	0	1526	0	1547	0	1568	0	1589	10	1610	2.349
3,5% - 3,99%	1506	0	1527	0	1548	1	1569	89	1590	1.030	1611	218.116
4% - 4,49%	1507	0	1528	0	1549	0	1570	0	1591	3.846	1612	712.430
4,5% - 4,99%	1508	0	1529	0	1550	0	1571	0	1592	4.309	1613	770.182
5% - 5,49%	1509	0	1530	0	1551	0	1572	0	1593	1.535	1614	248.372
5,5% - 5,99%	1510	0	1531	0	1552	0	1573	0	1594	330	1615	41.422
6% - 6,49%	1511	0	1532	0	1553	0	1574	0	1595	0	1616	0
6,5% - 6,99%	1512	0	1533	0	1554	0	1575	0	1596	0	1617	0
7% - 7,49%	1513	0	1534	0	1555	0	1576	0	1597	0	1618	0
7,5% - 7,99%	1514	0	1535	0	1556	0	1577	0	1598	0	1619	0
8% - 8,49%	1515	0	1536	0	1557	0	1578	0	1599	0	1620	0
8,5% - 8,99%	1516	0	1537	0	1558	0	1579	0	1600	0	1621	0
9% - 9,49%	1517	0	1538	0	1559	0	1580	0	1601	0	1622	0
9,5% - 9,99%	1518	0	1539	0	1560	0	1581	0	1602	0	1623	0
Superior al 10%	1519	0	1540	0	1561	0	1582	0	1603	0	1624	0
<b>Total</b>	<b>1520</b>	<b>5.815</b>	<b>1541</b>	<b>791.376</b>	<b>1562</b>	<b>5.903</b>	<b>1583</b>	<b>818.557</b>	<b>1604</b>	<b>11.090</b>	<b>1625</b>	<b>2.000.000</b>
<b>Tipo de interés medio ponderado de los activos(%)</b>			<b>9542</b>	<b>1,09</b>			<b>9584</b>	<b>1,22</b>			<b>1626</b>	<b>4,51</b>
<b>Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%)</b>			<b>9543</b>	<b>0,14</b>			<b>9585</b>	<b>0,23</b>			<b>1627</b>	<b>3,77</b>

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

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

#### CUADRO F

Concentración	Situación actual 30/06/2016			Situación cierre anual anterior 31/12/2015			Situación inicial 15/11/2006		
	Porcentaje		CNAE (2)	Porcentaje		CNAE (2)	Porcentaje		CNAE (2)
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	2000	0,57		2030	0,56		2060	0,33	
Sector: (1)	2010		2020	2040		2050	2070		2080

(1) Indíquese denominación del sector con mayor concentración

(2) Incluir código CNAE con dos niveles de agregación

## ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**  
 Denominación del compartimento:  
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**  
 Estados agregados: **No**  
 Período: **1er Semestre**  
 Ejercicio: **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 15/11/2006					
	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros		Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros	
Euro - EUR	3000	20.000	3060	774.165	3110	774.165	3170	20.000	3230	2.000.000	3250	2.000.000
EEUU Dólar - USDR	3010	0	3070	0	3120	0	3180	0	3240	0	3260	0
Japón Yen - JPY	3020	0	3080	0	3130	0	3190	0	3250	0	3270	0
Reino Unido Libra - GBP	3030	0	3090	0	3140	0	3200	0	3260	0	3280	0
Otras	3040	0			3150	0	3210	0			3290	0
<b>Total</b>	<b>3050</b>	<b>20.000</b>			<b>3160</b>	<b>774.165</b>	<b>3220</b>	<b>20.000</b>			<b>3300</b>	<b>2.000.000</b>

# ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.06

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

## NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene  
Información adicional  
en fichero adjunto

## INFORME DE AUDITOR

N/A