

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.00

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

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

Número de registro del Fondo: **8591**

NIF Fondo: **V-84916956**

Denominación del compartimento:

Número de registro del compartimento:

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

NIF gestora: **A-80352750**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2012**

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA



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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
Estados agregados: No
Periodo: 2º Semestre
Ejercicio: 2012

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2012		Periodo Anterior 31/12/2011
---------------------------------	--	-------------------------------------	--	---------------------------------------

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

A) ACTIVO NO CORRIENTE	0008	849.433	1008	944.734
-------------------------------	------	---------	------	---------

I. Activos financieros a largo plazo	0010	849.433	1010	944.734
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	849.433	1200	944.734
2.1 Participaciones hipotecarias	0201	0	1201	0
2.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0202	809.728	1202	904.191
2.3 Préstamos hipotecarios	0203	0	1203	0
2.4 Cédulas Hipotecarias	0204	0	1204	0
2.5 Préstamos a promotores	0205	0	1205	0
2.6 Préstamos a PYMES	0206	0	1206	0
2.7 Préstamos a empresas	0207	0	1207	0
2.8 Préstamos Corporativos	0208	0	1208	0
2.9 Cédulas territoriales	0209	0	1209	0
2.10 Bonos de Tesorería	0210	0	1210	0
2.11 Deuda Subordinada	0211	0	1211	0
2.12 Créditos AAPP	0212	0	1212	0
2.13 Préstamos Consumo	0213	0	1213	0
2.14 Préstamos automoción	0214	0	1214	0
2.15 Cuotas de Arrendamiento financiero (leasing)	0215	0	1215	0
2.16 Cuentas a cobrar	0216	0	1216	0
2.17 Derechos de crédito futuros	0217	0	1217	0
2.18 Bonos de titulación	0218	0	1218	0
2.19 Otros	0219	0	1219	0
2.20 Activos dudosos	0220	41.287	1220	42.311
2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0221	-1.582	1221	-1.768
2.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0222	0	1222	0
2.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0223	0	1223	0
3. Derivados	0230	0	1230	0
3.1 Derivados de cobertura	0231	0	1231	0
3.2 Derivados de negociación	0232	0	1232	0
4. Otros activos financieros	0240	0	1240	0
4.1 Garantías financieras	0241	0	1241	0
4.2 Otros	0242	0	1242	0

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.				
Estados agregados: No				
Periodo: 2º Semestre				
Ejercicio: 2012				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2012		Periodo Anterior 31/12/2011
B) ACTIVO CORRIENTE	0270	85.381	1270	99.811
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0280	32.561	1280	33.280
V. Activos financieros a corto plazo	0290	37.148	1290	34.519
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	37.148	1400	34.485
3.1 Participaciones hipotecarias	0401	0	1401	0
3.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0402	33.650	1402	30.915
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	3.969	1420	3.203
3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0421	-1.615	1421	-1.504
3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0422	600	1422	1.125
3.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0423	0	1423	0
3.24 Intereses vencidos e impagados	0424	544	1424	746
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	34
5.1 Garantías financieras	0441	0	1441	0
5.2 Otros	0442	0	1442	34
VI. Ajustes por periodificaciones	0450	3	1450	3
1. Comisiones	0451	0	1451	0
2. Otros	0452	3	1452	3
VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes	0460	15.669	1460	32.009
1. Tesorería	0461	15.669	1461	32.009
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462	0	1462	0

TOTAL ACTIVO	0500	934.814	1500	1.044.545
--------------	------	---------	------	-----------

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.				
Estados agregados: No				
Periodo: 2º Semestre				
Ejercicio: 2012				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2012		Periodo Anterior 31/12/2011
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0650	888.415	1650	1.008.436
I. Provisiones a largo plazo	0660	0	1660	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0700	888.415	1700	1.008.436
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	816.996	1710	922.590
1.1 Series no subordinadas	0711	366.996	1711	472.590
1.2 Series subordinadas	0712	450.000	1712	450.000
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	56.309	1720	65.030
2.1 Préstamo subordinado	0721	68.941	1721	68.941
2.2 Crédito línea de liquidez	0722	0	1722	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0723	0	1723	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0724	-12.632	1724	-3.911
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	15.110	1730	20.816
3.1 Derivados de cobertura	0731	15.110	1731	20.816
3.2 Derivados de negociación	0732	0	1732	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0733		1733	
4. Otros pasivos financieros	0740	0	1740	0
4.1 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0741		1741	
4.2 Otros	0742	0	1742	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0750	0	1750	0
B) PASIVO CORRIENTE	0760	61.893	1760	57.101
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0770	0	1770	0
V. Provisiones a corto plazo	0780	0	1780	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0800	55.902	1800	57.075
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	0	1810	4.825
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	38.013	1820	35.871
2.1 Series no subordinadas	0821	37.619	1821	34.118
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	394	1824	1.753
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	16.142	1830	14.222
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	164	1835	259
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836	0	1836	0
3.7 Intereses vencidos e impagados	0837	15.978	1837	13.963
4. Derivados	0840	1.747	1840	2.157
4.1 Derivados de cobertura	0841	1.747	1841	2.157
4.2 Derivados de negociación	0842	0	1842	0
4.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0843		1843	
5. Otros pasivos financieros	0850	0	1850	0
5.1 Importe bruto	0851	0	1851	0
5.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0852		1852	

VII. Ajustes por periodificación	0900	5.991	1900	26
1. Comisiones	0910	23	1910	25
1.1 Comisión sociedad gestora	0911	18	1911	20
1.2 Comisión administrador	0912	0	1912	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0913	5	1913	5
1.4 Comisión variable - resultados realizados	0914	0	1914	0
1.5 Comisión variable - resultados no realizados	0915	0	1915	0
1.6 Otras comisiones del cedente	0916	0	1916	0
1.7 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0917		1917	
1.8 Otras comisiones	0918	0	1918	0
2. Otros	0920	5.968	1920	1
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0930	-15.494	1930	-20.992
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0940	0	1940	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0950	-15.494	1950	-20.992
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0960	0	1960	0
XI. Gastos de constitución en transición	0970		1970	
TOTAL PASIVO	1000	934.814	2000	1.044.545

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.02

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS								
Denominación del compartimento:								
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.								
Estados agregados: No								
Periodo: 2º Semestre								
Ejercicio: 2012								

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. Corriente Actual		P. Corriente Anterior		Acumulado Actual		Acumulado Anterior	
		2º semestre		2º semestre		31/12/2012		31/12/2011	
1. Intereses y rendimientos asimilados	0100	9.350	1100	14.502	2100	22.621	3100	26.983	
1.1 Valores representativos de deuda	0110	0	1110	0	2110	0	3110	0	
1.2 Derechos de crédito	0120	9.314	1120	14.289	2120	22.443	3120	26.597	
1.3 Otros activos financieros	0130	36	1130	213	2130	178	3130	386	
2. Intereses y cargas asimiladas	0200	-3.710	1200	-9.793	2200	-10.995	3200	-17.804	
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210	-2.865	1210	-8.563	2210	-9.075	3210	-15.485	
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220	-845	1220	-1.230	2220	-1.920	3220	-2.319	
2.3 Otros pasivos financieros	0230		1230		2230		3230		
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0240	-4.190	1240	-2.654	2240	-8.449	3240	-4.950	
A) MARGEN DE INTERESES	0250	1.450	1250	2.055	2250	3.177	3250	4.229	
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0300	-2	1300	-1	2300	-1	3300	-1	
4.1 Ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0310	0	1310	0	2310	0	3310	0	
4.2 Activos financieros disponibles para la venta	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0	
4.3 Otros	0330	-2	1330	-1	2330	-1	3330	-1	
5. Diferencias de cambio (neto)	0400	0	1400	0	2400	0	3400	0	
6. Otros ingresos de explotación	0500	0	1500	0	2500	0	3500	0	
7. Otros gastos de explotación	0600	-127	1600	-118	2600	-276	3600	-266	
7.1 Servicios exteriores	0610	-17	1610	-1	2610	-47	3610	-23	
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611	-17	1611	-1	2611	-47	3611	-23	
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	0	1620	0	2620	0	3620	0	
7.3 Otros gastos de gestión corrientes	0630	-110	1630	-117	2630	-229	3630	-243	
7.3.1 Comisión de sociedad gestora	0631	-88	1631	-93	2631	-179	3631	-188	
7.3.2 Comisión administrador	0632		1632		2632		3632		
7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos	0633	-22	1633	-24	2633	-45	3633	-50	
7.3.4 Comisión variable - resultados realizados (neto)	0634	0	1634	0	2634	0	3634	0	
7.3.5 Comisión variables - resultados no realizados (neto)	0635	0	1635	0	2635	0	3635	0	
7.3.6 Otras comisiones del cedente	0636		1636		2636		3636		
7.3.7 Otros gastos	0637	0	1637	0	2637	-5	3637	-5	
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0700	-6.811	1700	-9.514	2700	-9.833	3700	-14.913	
8.1 Deterioro neto de valores representativos de deuda	0710	0	1710	0	2710	0	3710	0	
8.2 Deterioro neto de derechos de crédito	0720	-6.811	1720	-9.514	2720	-9.833	3720	-14.913	
8.3 Deterioro neto de derivados	0730	0	1730	0	2730	0	3730	0	
8.4 Deterioro neto de otros activos financieros	0740	0	1740	0	2740	0	3740	0	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0750	0	1750	0	2750	0	3750	0	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0800	-1.610	1800	-93	2800	-1.789	3800	-93	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0850	7.100	1850	7.671	2850	8.722	3850	11.044	
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0900	0	1900	0	2900	0	3900	0	
12. Impuesto sobre beneficios	0950	0	1950	0	2950	0	3950	0	
C) RESULTADO DEL PERIODO	3000	0	4000	0	5000	0	6000	0	

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.03

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.				
Estados agregados: No				
Periodo: 2º Semestre				
Ejercicio: 2012				

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO <i>(miles de euros)</i>		Periodo Actual 31/12/2012		Mismo Periodo año Anterior 31/12/2011
A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN	8000	8.771	9000	7.939
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	8100	4.304	9100	7.846
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	23.593	9110	27.010
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-10.433	9120	-15.134
1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados	8130	-9.068	9130	-4.412
1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras	8140	212	9140	382
1.5 Intereses pagados por préstamos y créditos en entidades de crédito	8150		9150	
1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	8160	0	9160	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo	8200	-226	9200	-239
2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora	8210	-180	9210	-189
2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados	8220		9220	
2.3 Comisiones pagadas al agente financiero	8230	-46	9230	-50
2.4 Comisiones variables pagadas	8240		9240	
2.5 Otras comisiones	8250		9250	
3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo	8300	4.693	9300	332
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	4.693	9325	381
3.4 Otros	8330	0	9330	-49
B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION	8350	-25.111	9350	-13.736
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	8400	0	9400	0
4.1 Cobros por emisión de valores de titulización	8410	0	9410	0
4.2 Pagos por emisión de valores de titulización (aseguramiento colocación)	8420		9420	
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	8500		9500	
5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito	8510		9510	
5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras	8520		9520	
6. Flujos de caja netos por amortizaciones	8600	-25.058	9600	-13.707
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	77.035	9610	54.896
6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados	8620	0	9620	0
6.3 Pagos por amortización de valores de titulización	8630	-102.093	9630	-68.603
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	8700	-53	9700	-29
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	-1	9740	-1
7.5 Otros deudores y acreedores	8750	-52	9750	-28
7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras	8770	0	9770	0
7.7 Cobros de Subvenciones	8780	0	9780	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	8800	-16.340	9800	-5.797
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	32.009	9900	37.806
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	15.669	9990	32.009

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.04

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
Estados agregados: No
Periodo: 2º Semestre
Ejercicio: 2012

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS <i>(miles de euros)</i>		Periodo Actual 31/12/2012		Mismo Periodo año Anterior 31/12/2011
1 Activos financieros disponibles para la venta				
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6010	0	7010	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6020	0	7020	0
1.1.2 Efecto fiscal	6021	0	7021	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6022	0	7022	0
1.3 Otras reclasificaciones	6030	0	7030	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6040	0	7040	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	6100	0	7100	0
2 Cobertura de los flujos de efectivo				
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6110	-2.951	7110	-6.126
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6120	-2.951	7120	-6.126
2.1.2 Efecto fiscal	6121	0	7121	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6122	8.449	7122	4.950
2.3 Otras reclasificaciones	6130	0	7130	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6140	-5.498	7140	1.176
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	6200	0	7200	0
3 Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos				
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el periodo	6310	0	7310	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6320	0	7320	0
3.1.2 Efecto fiscal	6321	0	7321	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6322	0	7322	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6330	0	7330	0
Total Ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	6400	0	7400	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	6500	0	7500	0

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2012**

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 31/12/2012				Situación cierre anual anterior 31/12/2011				Situación inicial 12/12/2006			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)		
Participaciones hipotecarias	0001		0030		0060		0090		0120		0150	
Certificados de transmisión hipotecaria	0002	5.680	0031	888.634	0061	6.064	0091	980.621	0121	9.884	0151	1.800.000
Préstamos hipotecarios	0003		0032		0062		0092		0122		0152	
Cédulas hipotecarias	0004		0033		0063		0093		0123		0153	
Préstamos a promotores	0005		0034		0064		0094		0124		0154	
Préstamos a PYMES	0007		0036		0066		0096		0126		0156	
Préstamos a empresas	0008		0037		0067		0097		0127		0157	
Préstamos Corporativos	0009		0038		0068		0098		0128		0158	
Cédulas territoriales	0010		0039		0069		0099		0129		0159	
Bonos de tesorería	0011		0040		0070		0100		0130		0160	
Deuda subordinada	0012		0041		0071		0101		0131		0161	
Créditos AAPP	0013		0042		0072		0102		0132		0162	
Préstamos consumo	0014		0043		0073		0103		0133		0163	
Préstamos automoción	0015		0044		0074		0104		0134		0164	
Arrendamiento financiero	0016		0045		0075		0105		0135		0165	
Cuentas a cobrar	0017		0046		0076		0106		0136		0166	
Derechos de crédito futuros	0018		0047		0077		0107		0137		0167	
Bonos de titulización	0019		0048		0078		0108		0138		0168	
Otros	0020		0049		0079		0109		0139		0169	
Total	0021	5.680	0050	888.634	0080	6.064	0110	980.621	0140	9.884	0170	1.800.000

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **2º Semestre**
 Ejercicio: **2012**
 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 31/12/2012		Situación cierre anual anterior 31/12/2011	
Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior	0196	-9.030	0206	-20.477
Derechos de crédito dados de baja por dación/adjudicación de bienes desde el cierre anual anterior	0197	-7.064	0207	-26.747
Amortización ordinaria desde el cierre anual anterior	0200	-33.496	0210	-25.824
Amortización anticipada desde el cierre anual anterior	0201	-42.396	0211	-29.024
Total importe amortizado acumulado, incluyendo adjudicaciones y otros pagos en especie, desde el origen del Fondo	0202	-874.801	0212	-789.318
Importe de principal pendiente de amortización de los nuevos activos incorporados en el periodo (1)	0203	0	0213	0
Principal pendiente cierre del periodo (2)	0204	888.634	0214	980.621
Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)	0205	4,32	0215	2,68

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 2º Semestre

Ejercicio: 2012

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	389	0710	113	0720	81	0730	194	0740	61.351	0750	61.545
De 1 a 3 meses	0701	138	0711	110	0721	90	0731	200	0741	22.376	0751	22.576
De 3 a 6 meses	0703	48	0713	77	0723	68	0733	145	0743	7.153	0753	7.298
De 6 a 9 meses	0704	44	0714	120	0724	141	0734	261	0744	7.737	0754	7.998
De 9 a 12 meses	0705	38	0715	150	0725	168	0735	318	0745	6.690	0755	7.008
De 12 meses a 2 años	0706	86	0716	514	0726	666	0736	1.180	0746	15.243	0756	16.423
Más de 2 años	0708	55	0718	1.252	0728	939	0738	2.191	0748	6.321	0758	8.512
Total	0709	798	0719	2.336	0729	2.153	0739	4.489	0749	126.871	0759	131.360

(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	389	0782	113	0792	81	0802	194	0812	61.351	0822	61.545	0832	73.989	0842	83,18
De 1 a 3 meses	0773	138	0783	110	0793	90	0803	200	0813	22.376	0823	22.576	0833	26.903	0843	83,91
De 3 a 6 meses	0774	48	0784	77	0794	68	0804	145	0814	7.153	0824	7.298	0834	8.572	1854	85,13
De 6 a 9 meses	0775	44	0785	120	0795	141	0805	261	0815	7.737	0825	7.998	0835	9.010	1855	88,77
De 9 a 12 meses	0776	38	0786	150	0796	168	0806	318	0816	6.690	0826	7.008	0836	7.810	1856	89,73
De 12 meses a 2 años	0777	86	0787	514	0797	666	0807	1.180	0817	15.243	0827	16.423	0837	17.864	1857	91,93
Más de 2 años	0778	55	0788	1.252	0798	939	0808	2.191	0818	6.321	0828	8.512	0838	11.632	1858	73,17
Total	0779	798	0789	2.336	0799	2.153	0809	4.489	0819	126.871	0829	131.360	0839	155.780	0849	84,32

(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 pignoralas, etc.) si el valor de las mismas se ha considerado en el momento inicial del Fondo

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 2º Semestre

Ejercicio: 2012

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 31/12/2012						Situación cierre anual anterior 31/12/2011						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	5,09	0869	4,40	0887	0,00	0905	4,64	0923	2,85	0941	0,00	0959	0,00	0977	0,00	0995	0,00
Préstamos hipotecarios	0852		0870		0888		0906		0924		0942		0960		0978		0996	
Cédulas Hipotecarias	0853		0871		0889		0907		0925		0943		0961		0979		0997	
Préstamos a promotores	0854		0872		0890		0908		0926		0944		0962		0980		0998	
Préstamos a PYMES	0855		0873		0891		0909		0927		0945		0963		0981		0999	
Préstamos a empresas	0856		0874		0892		0910		0928		0946		0964		0982		1000	
Préstamos Corporativos	0857		0875		0893		0911		0929		0947		0965		0983		1001	
Cédulas Territoriales	1066		1084		1102		1120		1138		1156		1174		1192		1210	
Bonos de Tesorería	0858		0876		0894		0912		0930		0948		0966		0984		1002	
Deuda subordinada	0859		0877		0895		0913		0931		0949		0967		0985		1003	
Créditos AAPP	0860		0878		0896		0914		0932		0950		0968		0986		1004	
Préstamos Consumo	0861		0879		0897		0915		0933		0951		0969		0987		1005	
Préstamos automoción	0862		0880		0898		0916		0934		0952		0970		0988		1006	
Cuotas arrendamiento financiero	0863		0881		0899		0917		0935		0953		0971		0989		1007	
Cuentas a cobrar	0864		0882		0900		0918		0936		0954		0972		0990		1008	
Derechos de crédito futuros	0865		0883		0901		0919		0937		0955		0973		0991		1009	
Bonos de titulización	0866		0884		0902		0920		0938		0956		0974		0992		1010	
Otros	0867		0885		0903		0921		0939		0957		0975		0993		1011	

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

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

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Periodo: **2º Semestre**
 Ejercicio: **2012**
 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 31/12/2012				Situación cierre anual anterior 31/12/2011				Situación inicial 12/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior a 1 año	1300	2	1310	4	1320	2	1330	7	1340	0	1350	0
Entre 1 y 2 años	1301	4	1311	40	1321	3	1331	38	1341	0	1351	0
Entre 2 y 3 años	1302	3	1312	72	1322	4	1332	65	1342	0	1352	0
Entre 3 y 5 años	1303	10	1313	385	1323	10	1333	466	1343	0	1353	0
Entre 5 y 10 años	1304	112	1314	7.046	1324	55	1334	3.749	1344	3	1354	241
Superior a 10 años	1305	5.549	1315	881.086	1325	5.990	1335	976.296	1345	9.881	1355	1.799.759
Total	1306	5.680	1316	888.633	1326	6.064	1336	980.621	1346	9.884	1356	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	1307	21,70			1327	22,65			1347	27,35		

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

Antigüedad	Situación actual 31/12/2012		Situación cierre anual anterior 31/12/2011		Situación inicial 12/12/2006	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	7,72	0632	6,73	0634	1,72

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2012**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)

CUADRO A		Situación actual 31/12/2012				Situación cierre anual anterior 31/12/2011				Escenario inicial 12/12/2006			
		Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)
Serie (2)	Denominación serie	0001	0002	0003	0004	0005	0006	0007	0008	0009	0070	0080	0090
ES0359092006	SERIE A1	4.140	0	0	0,00	4.140	0	0	0,00	4.140	100	414.000	0,75
ES0359092014	SERIE A2	9.360	43	404.614	2,90	9.360	54	506.707	3,19	9.360	100	936.000	3,81
ES0359092022	SERIE A3	2.700	100	270.000	9,40	2.700	100	270.000	10,41	2.700	100	270.000	10,00
ES0359092030	SERIE B	630	100	63.000	5,50	630	100	63.000	6,12	630	100	63.000	7,19
ES0359092048	SERIE C	675	100	67.500	5,50	675	100	67.500	6,12	675	100	67.500	7,19
ES0359092055	SERIE D	306	100	30.600	5,50	306	100	30.600	6,12	306	100	30.600	7,19
ES0359092063	SERIE E	189	100	18.900	5,50	189	100	18.900	6,12	189	100	18.900	7,19
Total		8006	18.000	8025	854.614	8045	18.000	8065	956.707	8085	18.000	8105	1.800.000

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 2º Semestre

Ejercicio: 2012

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
ES0359092006	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	360	39	0	0	0	0	0						
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,34	360	39	149	0	404.614	0	404.763						
ES0359092022	SERIE A3	S	EURIBOR 3 m	0,19	0,38	360	39	111	0	270.000	0	270.111						
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	0,44	360	39	30	0	63.000	0	63.030						
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	0,49	360	39	36	0	67.500	0	67.536						
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	0,69	360	39	23	0	30.600	0	30.623						
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	2,19	360	39	45	0	18.900	0	18.945						
Total								9228	394	9105	0	9085	854.614	9095	0	9115	855.008	9227

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

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

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

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

(5) Días acumulados desde la última fecha de pago

(6) Intereses acumulados desde la última fecha de pago

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2012**

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 31/12/2012				Situación cierre anual anterior 31/12/2011											
			Amortización principal		Intereses		Amortización principal		Intereses									
Serie (1)	Denominación serie	Fecha final (2)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)								
		7290	7300	7310	7320	7330	7340	7350	7360	7370								
ES0359092006	SERIE A1	22-08-2049	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408								
ES0359092014	SERIE A2	22-08-2049	102.093	531.385	5.002	122.100	68.603	429.292	7.905	117.098								
ES0359092022	SERIE A3	22-08-2049	0	0	2.925	39.870	0	0	4.004	36.945								
ES0359092030	SERIE B	22-08-2049	0	0	721	9.530	0	0	973	8.809								
ES0359092048	SERIE C	22-08-2049	0	0	807	10.414	0	0	1.076	9.607								
ES0359092055	SERIE D	22-08-2049	0	0	428	5.090	0	0	550	4.662								
ES0359092063	SERIE E	22-08-2049	0	0	553	4.849	0	0	627	4.296								
Total			7305	102.093	7315	945.385	7325	10.436	7335	215.261	7345	68.603	7355	843.292	7365	15.135	7375	204.825

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

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

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2012**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

CUADRO D

Serie (1)	Denominación serie	Calificación				
		Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Situación actual	Situación anual cierre anterior	Situación inicial
		3310	3330	3350	3360	3370
ES0359092006	SERIE A1	12-12-2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0359092006	SERIE A1	12-12-2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092006	SERIE A1	12-12-2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092014	SERIE A2	28-07-2011	FCH	A	A	AAA
ES0359092014	SERIE A2	02-07-2012	MDY	A3	Aa1	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	28-02-2012	SYP	A+	AA	AAA
ES0359092022	SERIE A3	28-07-2011	FCH	A	A	AAA
ES0359092022	SERIE A3	02-07-2012	MDY	A3	A1	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	28-02-2012	SYP	A+	AA	AAA
ES0359092030	SERIE B	28-07-2011	FCH	BBB	BBB	AA
ES0359092030	SERIE B	11-09-2009	MDY	Ba1	Ba1	Aa1
ES0359092030	SERIE B	22-05-2009	SYP	BB	BB	AA
ES0359092048	SERIE C	18-04-2012	FCH	BB-	BB	A
ES0359092048	SERIE C	11-09-2009	MDY	Caa2	Caa2	A1
ES0359092048	SERIE C	22-05-2009	SYP	B	B	A
ES0359092055	SERIE D	18-03-2009	FCH	CCC	CCC	BBB
ES0359092055	SERIE D	11-09-2009	MDY	C	C	Baa2
ES0359092055	SERIE D	28-02-2012	SYP	B-	CCC	BBB
ES0359092063	SERIE E	18-03-2009	FCH	CC	CC	BB+
ES0359092063	SERIE E	11-09-2009	MDY	C	C	Ba1
ES0359092063	SERIE E	28-02-2012	SYP	CCC	D	BB

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.3

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS Denominación del compartimento: Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. Estados agregados: No Periodo: 2º Semestre Ejercicio: 2012

INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS <i>(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)</i>		Situación actual 31/12/2012		Situación cierre anual anterior 31/12/2011
1. Importe del Fondo de Reserva	0010	1.231	1010	11.461
2. Porcentaje que representa el Fondo de Reserva, u otras mejoras equivalentes, sobre el total de activos titulizados	0020	0,14	1020	1,17
3. Exceso de spread (%) (1)	0040	1,70	1040	1,20
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	47,34	1120	52,96
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				

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.4

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 2º Semestre

Ejercicio: 2012

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	6.631	0200	12.075	0300	0,01	0400	0,01	1120	0,01	
2. Activos Morosos por otras razones					0110		0210		0310		0410		1130		
Total Morosos					0120	6.631	0220	12.075	0320	0,01	0420	0,01	1140	0,01	1280
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	0050		0060	6	0130	108.912	0230	101.344	0330	0,13	0430	0,11	1050	0,13	
4. Activos Fallidos por otras razones					0140	695	0240		0340	0,00	0440		1160	0,00	
Total Fallidos					0150	109.607	0250	101.344	0350	0,13	0450	0,11	1200	0,13	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
			Pago		
Amortización secuencial: series (4)	0500	0520	0540	0560	
SERIE A2 ES0359092014	25,00	6,09	6,20		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359092030	7,00	7,37	7,19		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359092030	2,00	0,76	0,85		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359092030	10,00	52,94	53,69		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359092063	2,10	2,21	2,16		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359092063	1,25	0,76	0,85		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359092063	10,00	52,94	53,69		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359092055	3,40	3,58	3,49		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359092055	1,50	0,76	0,85		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359092055	10,00	52,94	53,69		4.9.4 Nota de Valores
SERIE A3 ES0359092022	25,00	6,09	6,20		4.9.4 Nota de Valores

SERIE C ES0359092048		7,50		7,90		7,71		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359092048		1,75		0,76		0,85		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359092048		10,00		52,94		53,69		4.9.4 Nota de Valores
SERIE A1 ES0359092006		25,00		6,09		6,20		4.9.4 Nota de Valores
Diferimiento/postergamiento intereses: series (5)		0506		0526		0546		0566
SERIE E ES0359092063		8,00		6,09		6,20		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE D ES0359092055		9,40		6,09		6,20		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE C ES0359092048		13,20		6,09		6,20		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE B ES0359092030		18,30		6,09		6,20		3.4.6.2. Modulo Adicional
No Reducción del Fondo de Reserva (6)	0512		0532	0,14	0552	0,72	0572	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS (3)		0513		0523		0553		0573
N/A								

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

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

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

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

--

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2012**

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 31/12/2012				Situación cierre anual anterior 31/12/2011				Situación inicial 12/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente (1)	
Andalucía	0400	262	0426	30.470	0452	271	0478	32.912	0504	413	0530	55.364
Aragón	0401	109	0427	13.151	0453	114	0479	14.386	0505	176	0531	26.730
Asturias	0402	52	0428	5.414	0454	54	0480	5.812	0506	71	0532	8.457
Baleares	0403	53	0429	8.040	0455	58	0481	9.032	0507	73	0533	12.511
Canarias	0404	41	0430	4.287	0456	43	0482	4.636	0508	84	0534	10.967
Cantabria	0405	91	0431	10.175	0457	92	0483	10.663	0509	129	0535	18.240
Castilla-León	0406	134	0432	14.134	0458	143	0484	15.720	0510	212	0536	27.344
Castilla La Mancha	0407	257	0433	33.136	0459	283	0485	37.926	0511	489	0537	75.861
Cataluña	0408	597	0434	101.685	0460	620	0486	108.040	0512	968	0538	187.210
Ceuta	0409	33	0435	1.993	0461	33	0487	2.093	0513	59	0539	4.472
Extremadura	0410	32	0436	2.532	0462	32	0488	2.631	0514	39	0540	3.661
Galicia	0411	102	0437	12.009	0463	103	0489	12.454	0515	128	0541	17.541
Madrid	0412	3.491	0438	600.787	0464	3.766	0490	668.255	0516	6.243	0542	1.238.324
Meilla	0413	0	0439	0	0465	0	0491	0	0517	0	0543	0
Murcia	0414	26	0440	2.926	0466	29	0492	3.420	0518	63	0544	8.031
Navarra	0415	23	0441	3.043	0467	26	0493	3.749	0519	45	0545	7.831
La Rioja	0416	24	0442	2.806	0468	26	0494	3.301	0520	48	0546	7.344
Comunidad Valenciana	0417	242	0443	23.832	0469	258	0495	26.752	0521	482	0547	58.238
País Vasco	0418	111	0444	18.213	0470	113	0496	18.838	0522	162	0548	31.874
Total España	0419	5.680	0445	888.633	0471	6.064	0497	980.620	0523	9.884	0549	1.800.000
Otros países Unión europea	0420	0	0446	0	0472	0	0498	0	0524	0	0550	0
Resto	0422	0	0448	0	0474	0	0500	0	0526	0	0552	0
Total general	0425	5.680	0450	888.633	0475	6.064	0501	980.620	0527	9.884	0553	1.800.000

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2012**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

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

CUADRO B

Divisa/Activos titulizados	Situación actual 31/12/2012						Situación cierre anual anterior 31/12/2011						Situación inicial 12/12/2006					
	Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)	
Euro - EUR	0571	5.680	0577	888.634	0583	888.634	0600	6.064	0606	980.621	0611	980.621	0620	9.884	0626	1.800.000	0631	1.800.000
EEUU Dólar - USD	0572	0	0578	0	0584	0	0601	0	0607	0	0612	0	0621	0	0627	0	0632	0
Japón Yen - JPY	0573	0	0579	0	0585	0	0602	0	0608	0	0613	0	0622	0	0628	0	0633	0
Reino Unido Libra - GBP	0574	0	0580	0	0586	0	0603	0	0609	0	0614	0	0623	0	0629	0	0634	0
Otras	0575	0			0587	0	0604	0			0615	0	0624	0			0635	0
Total	0576	5.680			0588	888.634	0605	6.064			0616	980.621	0625	9.884			0636	1.800.000

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2012**

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 31/12/2012				Situación cierre anual anterior 31/12/2011				Situación inicial 12/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	1100	73	1110	3.667	1120	53	1130	2.339	1140	0	1150	0
40% - 60%	1101	211	1111	19.439	1121	130	1131	13.457	1141	0	1151	0
60% - 80%	1102	2.228	1112	294.545	1122	1.863	1132	247.250	1142	0	1152	0
80% - 100%	1103	3.168	1113	570.983	1123	4.018	1133	717.575	1143	0	1153	1.699.335
100% - 120%	1104	0	1114	0	1124	0	1134	0	1144	0	1154	100.665
120% - 140%	1105	0	1115	0	1125	0	1135	0	1145	0	1155	0
140% - 160%	1106	0	1116	0	1126	0	1136	0	1146	0	1156	0
superior al 160%	1107	0	1117	0	1127	0	1137	0	1147	0	1157	0
Total	1108	5.680	1118	888.634	1128	6.064	1138	980.621	1148	0	1158	1.800.000
Media ponderada (%)			1119	82,46			1139	84,77			1159	94,44

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **2º Semestre**
 Ejercicio: **2012**

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		5.680		888.634		0,97		2,60
Total	1405	5.680	1415	888.634	1425	0,97	1435	2,60

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Periodo: **2º Semestre**
 Ejercicio: **2012**

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 31/12/2012				Situación cierre anual anterior 31/12/2011				Situación inicial 12/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior al 1%	1500	0	1521	0	1542	0	1563	0	1584	0	1605	0
1% - 1,49%	1501	0	1522	0	1543	0	1564	0	1585	0	1606	0
1,5% - 1,99%	1502	260	1523	56.847	1544	1	1565	171	1586	0	1607	0
2% - 2,49%	1503	1.838	1524	314.785	1545	1.335	1566	260.560	1587	0	1608	0
2,5% - 2,99%	1504	2.477	1525	373.836	1546	2.694	1567	428.122	1588	2	1609	715
3% - 3,49%	1505	843	1526	120.184	1547	1.678	1568	253.775	1589	10	1610	1.870
3,5% - 3,99%	1506	262	1527	22.982	1548	356	1569	37.993	1590	651	1611	149.152
4% - 4,49%	1507	0	1528	0	1549	0	1570	0	1591	2.908	1612	564.581
4,5% - 4,99%	1508	0	1529	0	1550	0	1571	0	1592	4.003	1613	716.576
5% - 5,49%	1509	0	1530	0	1551	0	1572	0	1593	1.835	1614	307.979
5,5% - 5,99%	1510	0	1531	0	1552	0	1573	0	1594	469	1615	58.649
6% - 6,49%	1511	0	1532	0	1553	0	1574	0	1595	6	1616	478
6,5% - 6,99%	1512	0	1533	0	1554	0	1575	0	1596	0	1617	0
7% - 7,49%	1513	0	1534	0	1555	0	1576	0	1597	0	1618	0
7,5% - 7,99%	1514	0	1535	0	1556	0	1577	0	1598	0	1619	0
8% - 8,49%	1515	0	1536	0	1557	0	1578	0	1599	0	1620	0
8,5% - 8,99%	1516	0	1537	0	1558	0	1579	0	1600	0	1621	0
9% - 9,49%	1517	0	1538	0	1559	0	1580	0	1601	0	1622	0
9,5% - 9,99%	1518	0	1539	0	1560	0	1581	0	1602	0	1623	0
Superior al 10%	1519	0	1540	0	1561	0	1582	0	1603	0	1624	0
Total	1520	5.680	1541	888.634	1562	6.064	1583	980.621	1604	9.884	1625	1.800.000
Tipo de interés medio ponderado de los activos(%)			9542	2,60			9584	2,77			1626	4,60
Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%)			9543	0,90			9585	1,57			1627	

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **2º Semestre**
 Ejercicio: **2012**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

Concentración	Situación actual 31/12/2012				Situación cierre anual anterior 31/12/2011				Situación inicial 12/12/2006			
	Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	2000	0,60			2030	0,56			2060	0,37		
Sector: (1)	2010		2020		2040		2050		2070		2080	

(1) Indíquese denominación del sector con mayor concentración

(2) Incluir código CNAE con dos niveles de agregación

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **2º Semestre**
 Ejercicio: **2012**

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 31/12/2012						Situación inicial 12/12/2006					
	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros		Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros	
Euro - EUR	3000	18.000	3060	854.614	3110	854.614	3170	18.000	3230	1.800.000	3250	1.800.000
EEUU Dólar - USDR	3010	0	3070	0	3120	0	3180	0	3240	0	3260	0
Japón Yen - JPY	3020	0	3080	0	3130	0	3190	0	3250	0	3270	0
Reino Unido Libra - GBP	3030	0	3090	0	3140	0	3200	0	3260	0	3280	0
Otras	3040	0			3150	0	3210	0			3290	0
Total	3050	18.000			3160	854.614	3220	18.000			3300	1.800.000

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.06

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
Estados agregados: **No**
Periodo: **2º Semestre**
Ejercicio: **2012**

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene
Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

N/A