

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.00

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

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

Número de registro del Fondo: **8591**

NIF Fondo: **V-84916956**

Denominación del compartimento:

Número de registro del compartimento:

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

NIF gestora: **A-80352750**

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA



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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
Estados agregados: No
Periodo: 1er Semestre
Ejercicio: 2011

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2011		Periodo Anterior 31/12/2010
---------------------------------	--	-------------------------------------	--	---------------------------------------

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

A) ACTIVO NO CORRIENTE	0008	988.464	1008	1.040.068
-------------------------------	------	---------	------	-----------

I. Activos financieros a largo plazo	0010	988.464	1010	1.040.068
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	988.464	1200	1.040.068
2.1 Participaciones hipotecarias	0201	0	1201	0
2.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0202	949.012	1202	984.114
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	41.075	1220	64.210
2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0221	-1.623	1221	-8.256
2.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0222	0	1222	0
2.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0223	0	1223	0
3. Derivados	0230	0	1230	0
3.1 Derivados de cobertura	0231	0	1231	0
3.2 Derivados de negociación	0232	0	1232	0
4. Otros activos financieros	0240	0	1240	0
4.1 Garantías financieras	0241	0	1241	0
4.2 Otros	0242	0	1242	0

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.				
Estados agregados: No				
Periodo: 1er Semestre				
Ejercicio: 2011				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2011		Periodo Anterior 31/12/2010
B) ACTIVO CORRIENTE	0270	99.657	1270	80.936
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0280	29.333	1280	6.887
V. Activos financieros a corto plazo	0290	35.840	1290	36.243
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	35.799	1400	36.213
3.1 Participaciones hipotecarias	0401	0	1401	0
3.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0402	32.931	1402	34.128
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	3.335	1420	240
3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0421	-2.226	1421	
3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0422	967	1422	1.845
3.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0423	0	1423	0
3.24 Intereses vencidos e impagados	0424	792	1424	
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	41	1440	30
5.1 Garantías financieras	0441	0	1441	0
5.2 Otros	0442	41	1442	30
VI. Ajustes por periodificaciones	0450	0	1450	0
1. Comisiones	0451	0	1451	0
2. Otros	0452	0	1452	0
VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes	0460	34.484	1460	37.806
1. Tesorería	0461	34.484	1461	37.806
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462	0	1462	0

TOTAL ACTIVO	0500	1.088.121	1500	1.121.004
--------------	------	-----------	------	-----------

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.				
Estados agregados: No				
Periodo: 1er Semestre				
Ejercicio: 2011				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2011		Periodo Anterior 31/12/2010
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0650	1.043.418	1650	1.079.318
I. Provisiones a largo plazo	0660	0	1660	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0700	1.043.418	1700	1.079.318
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	957.360	1710	990.942
1.1 Series no subordinadas	0711	507.360	1711	540.942
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	68.941	1720	68.941
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		1724	
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	17.117	1730	19.435
3.1 Derivados de cobertura	0731	17.117	1731	19.435
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	61.941	1760	61.502
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	58.155	1800	54.343
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	5.474	1810	4.846
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	38.004	1820	35.770
2.1 Series no subordinadas	0821	36.266	1821	34.368
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	1.738	1824	1.402
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	12.992	1830	11.903
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	250	1835	11.903
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836	0	1836	0
3.7 Intereses vencidos e impagados	0837	12.742	1837	
4. Derivados	0840	1.685	1840	1.824
4.1 Derivados de cobertura	0841	1.685	1841	1.824
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	3.786	1900	7.159
1. Comisiones	0910	3.785	1910	7.158
1.1 Comisión sociedad gestora	0911	20	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	3.760	1914	7.133
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	1	1920	1
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0930	-17.238	1930	-19.816
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0940	0	1940	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0950	-17.238	1950	-19.816
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0960	0	1960	0
XI. Gastos de constitución en transición	0970		1970	
TOTAL PASIVO	1000	1.088.121	2000	1.121.004

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.02

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Periodo: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2011**

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. Corriente Actual 2º semestre		P. Corriente Anterior 2º semestre		Acumulado Actual 30/06/2011		Acumulado Anterior 30/06/2010
1. Intereses y rendimientos asimilados	0100		1100		2100	12.722	3100	14.670
1.1 Valores representativos de deuda	0110		1110		2110	0	3110	0
1.2 Derechos de crédito	0120		1120		2120	12.549	3120	14.592
1.3 Otros activos financieros	0130		1130		2130	173	3130	78
2. Intereses y cargas asimiladas	0200		1200		2200	-8.012	3200	-9.348
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210		1210		2210	-6.922	3210	-4.979
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220		1220		2220	-1.090	3220	-930
2.3 Otros pasivos financieros	0230		1230		2230		3230	-3.439
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0240		1240		2240	-2.296	3240	
A) MARGEN DE INTERESES	0250		1250		2250	2.414	3250	5.322
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0300		1300		2300	0	3300	1
4.1 Ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0310		1310		2310	0	3310	0
4.2 Activos financieros disponibles para la venta	0320		1320		2320	0	3320	0
4.3 Otros	0330		1330		2330	0	3330	1
5. Diferencias de cambio (neto)	0400		1400		2400	0	3400	0
6. Otros ingresos de explotación	0500		1500		2500	0	3500	0
7. Otros gastos de explotación	0600		1600		2600	-147	3600	-5.323
7.1 Servicios exteriores	0610		1610		2610	-22	3610	-23
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611		1611		2611	-22	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		1620		2620	0	3620	0
7.3 Otros gastos de gestión corrientes	0630		1630		2630	-125	3630	-5.300
7.3.1 Comisión de sociedad gestora	0631		1631		2631	-95	3631	-101
7.3.2 Comisión administrador	0632		1632		2632		3632	
7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos	0633		1633		2633	-25	3633	-27
7.3.4 Comisión variable - resultados realizados	0634		1634		2634	0	3634	-5.172
7.3.5 Comisión variables - resultados no realizados	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	-5	3637	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0700		1700		2700	-5.640	3700	0
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	-5.640	3720	0
8.3 Deterioro neto de derivados	0730		1730		2730	0	3730	0
8.4 Deterioro neto de otros activos financieros	0740		1740		2740	0	3740	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0750		1750		2750	0	3750	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0800		1800		2800	0	3800	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0850		1850		2850	3.373	3850	0
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0900		1900		2900	0	3900	0
12. Impuesto sobre beneficios	0950		1950		2950	0	3950	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	3000		4000		5000	0	6000	0

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.03

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
Estados agregados: No
Periodo: 1er Semestre
Ejercicio: 2011

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		Periodo Actual 30/06/2011		Mismo Periodo año Anterior 30/06/2010
A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN	8000	4.545	9000	40.018
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	8100	4.065	9100	2.605
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	12.663	9110	12.057
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-6.585	9120	-5.581
1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados	8130	-2.175	9130	-3.953
1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras	8140	162	9140	82
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	-120	9200	-130
2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora	8210	-95	9210	-103
2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados	8220		9220	
2.3 Comisiones pagadas al agente financiero	8230	-25	9230	-27
2.4 Comisiones variables pagadas	8240		9240	
2.5 Otras comisiones	8250		9250	
3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo	8300	600	9300	37.543
3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos	8310	0	9310	36.961
3.2 Pagos de provisiones	8320		9320	
3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta	8325		9325	
3.4 Otros	8330	600	9330	582
B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION	8350	-7.867	9350	-47.230
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	-7.839	9600	-47.207
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	23.846	9610	33.591
6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados	8620	0	9620	0
6.3 Pagos por amortización de valores de titulización	8630	-31.685	9630	-80.798
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	8700	-28	9700	-23
7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos	8710	0	9710	0
7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos	8720		9720	
7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso	8730	0	9730	0
7.4 Administraciones públicas - Pasivo	8740	0	9740	0
7.5 Otros deudores y acreedores	8750	-28	9750	-23
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	-3.322	9800	-7.212
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	37.806	9900	32.771
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	34.484	9990	25.559

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.04

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
Estados agregados: No
Periodo: 1er Semestre
Ejercicio: 2011

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS <i>(miles de euros)</i>		Periodo Actual 30/06/2011		Mismo Periodo año Anterior 30/06/2010
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	282	7110	-20.153
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6120	282	7120	-20.153
2.1.2 Efecto fiscal	6121	0	7121	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6122	2.296	7122	3.439
2.3 Otras reclasificaciones	6130	0	7130	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6140	-2.578	7140	16.714
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	6200	0	7200	0
3 Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos				
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el periodo	6310	0	7310	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6320	0	7320	0
3.1.2 Efecto fiscal	6321	0	7321	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6322	0	7322	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6330	0	7330	0
Total Ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	6400	0	7400	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	6500	0	7500	0

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

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 A Tipología de activos titulizados	Situación actual 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				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	6.248	0031	1.026.353	0061	6.489	0091	1.082.693	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	6.248	0050	1.026.353	0080	6.489	0110	1.082.693	0140	9.884	0170	1.800.000

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Periodo: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2011**
 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 30/06/2011		Situación cierre anual anterior 31/12/2010	
Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior	0196	-10.007	0206	-5.096
Derechos de crédito dados de baja por dación/adjudicación de bienes desde el cierre anual anterior	0197	-19.135	0207	-7.856
Amortización ordinaria desde el cierre anual anterior	0200	-14.634	0210	-85.774
Amortización anticipada desde el cierre anual anterior	0201	-12.564	0211	-37.348
Total importe amortizado acumulado, incluyendo adjudicaciones y otros pagos en especie, desde el origen del Fondo	0202	-758.292	0212	-717.307
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	1.026.353	0214	1.082.693
Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)	0205	2,51	0215	3,10

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 1er Semestre

Ejercicio: 2011

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	583	0710	143	0720	177	0730	320	0740	98.916	0750	99.236
De 1 a 3 meses	0701	195	0711	127	0721	170	0731	297	0741	34.046	0751	34.343
De 3 a 6 meses	0703	61	0713	95	0723	121	0733	216	0743	10.672	0753	10.888
De 6 a 9 meses	0704	27	0714	63	0724	78	0734	141	0744	4.512	0754	4.653
De 9 a 12 meses	0705	20	0715	83	0725	89	0735	172	0745	3.495	0755	3.667
De 12 meses a 2 años	0706	40	0716	268	0726	237	0736	505	0746	5.952	0756	6.457
Más de 2 años	0708	108	0718	1.282	0728	1.939	0738	3.221	0748	17.987	0758	21.208
Total	0709	1.034	0719	2.061	0729	2.811	0739	4.872	0749	175.580	0759	180.452

(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	583	0782	143	0792	177	0802	320	0812	98.916	0822	99.236	0832	113.672	0842	87,30
De 1 a 3 meses	0773	195	0783	127	0793	170	0803	297	0813	34.046	0823	34.343	0833	38.701	0843	88,74
De 3 a 6 meses	0774	61	0784	95	0794	121	0804	216	0814	10.672	0824	10.888	0834	12.099	0844	89,98
De 6 a 9 meses	0775	27	0785	63	0795	78	0805	141	0815	4.512	0825	4.653	0835	5.230	0845	88,97
De 9 a 12 meses	0776	20	0786	83	0796	89	0806	172	0816	3.495	0826	3.667	0836	4.349	0846	84,32
De 12 meses a 2 años	0777	40	0787	268	0797	237	0807	505	0817	5.952	0827	6.457	0837	7.783	0847	82,98
Más de 2 años	0778	108	0788	1.282	0798	1.939	0808	3.221	0818	17.987	0828	21.208	0838	22.777	0848	93,12
Total	0779	1.034	0789	2.061	0799	2.811	0809	4.872	0819	175.580	0829	180.452	0839	204.611	0849	88,19

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 1er Semestre

Ejercicio: 2011

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 30/06/2011						Situación cierre anual anterior 31/12/2010						Escenario inicial					
	Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)		Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)		Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)	
Participaciones hipotecarias	0850		0868		0886		0904		0922		0940		0958		0976		0994	
Certificados de transmisión de hipoteca	0851	4,33	0869	1,49	0887	0,00	0905	5,95	0923	0,46	0941	0,00	0959	0,00	0977	0,00	0995	0,00
Préstamos hipotecarios	0852		0870		0888		0906		0924		0942		0960		0978		0996	
Cédulas Hipotecarias	0853		0871		0889		0907		0925		0943		0961		0979		0997	
Préstamos a promotores	0854		0872		0890		0908		0926		0944		0962		0980		0998	
Préstamos a PYMES	0855		0873		0891		0909		0927		0945		0963		0981		0999	
Préstamos a empresas	0856		0874		0892		0910		0928		0946		0964		0982		1000	
Préstamos Corporativos	0857		0875		0893		0911		0929		0947		0965		0983		1001	
Cédulas Territoriales	1066		1084		1102		1120		1138		1156		1174		1192		1210	
Bonos de Tesorería	0858		0876		0894		0912		0930		0948		0966		0984		1002	
Deuda subordinada	0859		0877		0895		0913		0931		0949		0967		0985		1003	
Créditos AAPP	0860		0878		0896		0914		0932		0950		0968		0986		1004	
Préstamos Consumo	0861		0879		0897		0915		0933		0951		0969		0987		1005	
Préstamos automoción	0862		0880		0898		0916		0934		0952		0970		0988		1006	
Cuotas arrendamiento financiero	0863		0881		0899		0917		0935		0953		0971		0989		1007	
Cuentas a cobrar	0864		0882		0900		0918		0936		0954		0972		0990		1008	
Derechos de crédito futuros	0865		0883		0901		0919		0937		0955		0973		0991		1009	
Bonos de titulización	0866		0884		0902		0920		0938		0956		0974		0992		1010	
Otros	0867		0885		0903		0921		0939		0957		0975		0993		1011	

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

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

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Periodo: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2011**
 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 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				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	3	1310	7	1320	2	1330	4	1340	0	1350	0
Entre 1 y 2 años	1301	1	1311	23	1321	0	1331	0	1341	0	1351	0
Entre 2 y 3 años	1302	3	1312	62	1322	3	1332	60	1342	0	1352	0
Entre 3 y 5 años	1303	10	1313	362	1323	9	1333	306	1343	0	1353	0
Entre 5 y 10 años	1304	49	1314	3.265	1324	47	1334	3.132	1344	3	1354	241
Superior a 10 años	1305	6.182	1315	1.022.634	1325	6.428	1335	1.079.191	1345	9.881	1355	1.799.759
Total	1306	6.248	1316	1.026.353	1326	6.489	1336	1.082.693	1346	9.884	1356	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	1307	23,14			1327	23,59			1347	27,35		

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

Antigüedad	Situación actual 30/06/2011		Situación cierre anual anterior 31/12/2010		Situación inicial 12/12/2006	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	6,23	0632	5,73	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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

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

CUADRO A		Situación actual 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				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	58	543.626	3,24	9.360	61	575.311	3,31	9.360	100	936.000	3,81
ES0359092022	SERIE A3	2.700	100	270.000	10,68	2.700	100	270.000	10,96	2.700	100	270.000	10,00
ES0359092030	SERIE B	630	100	63.000	6,56	630	100	63.000	6,84	630	100	63.000	7,19
ES0359092048	SERIE C	675	100	67.500	6,56	675	100	67.500	6,84	675	100	67.500	7,19
ES0359092055	SERIE D	306	100	30.600	6,56	306	100	30.600	6,84	306	100	30.600	7,19
ES0359092063	SERIE E	189	100	18.900	6,56	189	100	18.900	6,84	189	100	18.900	7,19
Total		8006	18.000	8025	993.626	8045	18.000	8065	1.025.311	8085	18.000	8105	1.800.000

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

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

		Intereses								Principal pendiente								
Serie (1)	Denominación serie	Grado de subordinación (2)	Índice de referencia (3)	Margen (4)	Tipo aplicado	Base de cálculo de intereses	Días Acumulados (5)	Intereses Acumulados (6)	Intereses impagados	Principal no vencido	Principal impagado	Total pendiente	Corrección de valor por repercusión de pérdidas					
														9950	9960	9970	9980	9990
ES0359092006	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	360	38	0	0	0	0	0						
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	1,58	360	38	909	0	543.626	0	544.535						
ES0359092022	SERIE A3	S	EURIBOR 3 m	0,19	1,62	360	38	463	0	270.000	0	270.463						
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	1,68	360	38	112	0	63.000	0	63.112						
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	1,73	360	38	124	0	67.500	0	67.624						
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	1,93	360	38	62	0	30.600	0	30.662						
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	3,43	360	38	69	0	18.900	0	18.969						
Total								9228	1.739	9105	0	9085	993.626	9095	0	9115	995.365	9227

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

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

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

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

(5) Días acumulados desde la última fecha de pago

(6) Intereses acumulados desde la última fecha de pago

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

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 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010											
			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	31.685	392.374	3.466	112.659	113.949	360.689	5.681	109.193								
ES0359092022	SERIE A3	22-08-2049	0	0	1.705	34.646	0	0	2.538	32.941								
ES0359092030	SERIE B	22-08-2049	0	0	417	8.253	0	0	630	7.836								
ES0359092048	SERIE C	22-08-2049	0	0	464	8.995	0	0	709	8.531								
ES0359092055	SERIE D	22-08-2049	0	0	241	4.353	0	0	384	4.112								
ES0359092063	SERIE E	22-08-2049	0	0	292	3.961	0	0	999	3.669								
Total			7305	31.685	7315	806.374	7325	6.585	7335	196.275	7345	113.949	7355	774.689	7365	10.941	7375	189.690

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

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

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: No

Periodo: 1er Semestre

Ejercicio: 2011

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	18-03-2009	FCH	AA-	AA-	AAA
ES0359092014	SERIE A2	12-12-2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	29-04-2009	SYP	AA	AA	AAA
ES0359092022	SERIE A3	18-03-2009	FCH	AA-	AA-	AAA
ES0359092022	SERIE A3	11-09-2009	MDY	A1	A1	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	29-04-2009	SYP	AA	AA	AAA
ES0359092030	SERIE B	18-03-2009	FCH	A-	A-	AA
ES0359092030	SERIE B	11-09-2009	MDY	Ba1	Ba1	Aa1
ES0359092030	SERIE B	22-05-2009	SYP	BB	BB	AA
ES0359092048	SERIE C	18-03-2009	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	29-04-2009	SYP	CCC	CCC	BBB
ES0359092063	SERIE E	18-03-2009	FCH	CC	CC	BB+
ES0359092063	SERIE E	11-09-2009	MDY	C	C	Ba1
ES0359092063	SERIE E	22-05-2009	SYP	D	D	BB

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

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.3

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS Denominación del compartimento: Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. Estados agregados: No Periodo: 1er Semestre Ejercicio: 2011

INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS <i>(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)</i>		Situación actual 30/06/2011		Situación cierre anual anterior 31/12/2010
1. Importe del Fondo de Reserva	0010	20.794	1010	0
2. Porcentaje que representa el Fondo de Reserva, u otras mejoras equivalentes, sobre el total de activos titulizados	0020	2,03	1020	0,00
3. Exceso de spread (%) (1)	0040	1,14	1040	1,11
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	
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	54,71	1120	56,11
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 mejoras 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: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

CIRCUNSTANCIAS ESPECÍFICAS ESTABLECIDAS CONTRACTUALMENTE EN EL FONDO

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

Concepto (1)	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio (2)				Ref. Folleto		
	0010		0030	90	Situación actual	Periodo anterior	Situación actual	Periodo anterior	Situación actual	Periodo anterior	Última Fecha Pago				
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a					0100	10.066	0200	6.497	0300	0,01	0400	0,01	1120	0,01	
2. Activos Morosos por otras razones					0110		0210		0310		0410		1130		
Total Morosos					0120	10.066	0220	6.497	0320	0,01	0420	0,01	1140	0,01	1280
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	0050		0060		0130	89.592	0230	73.183	0330	0,09	0430	0,07	1050	0,08	
4. Activos Fallidos por otras razones		6			0140		0240		0340		0440		1160		
Total Fallidos					0150	89.592	0250	73.183	0350	0,09	0450	0,07	1200	0,08	1290

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

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

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

TRIGGERS (3)	Límite	% Actual	Última Fecha Pago		Ref. Folleto
			0540	0560	
Amortización secuencial: series (4)	0500	0520	0540	0560	
SERIE E ES0359092063	2,10	1,90	1,87		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359092055	3,40	3,08	3,03		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359092048	7,50	6,79	6,69		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359092030	7,00	6,34	6,25		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359092063	1,25	1,01	0,81		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359092055	1,50	1,01	0,81		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359092048	1,75	1,01	0,81		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359092030	2,00	1,01	0,81		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359092063	10,00	59,53	60,04		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359092055	10,00	59,53	60,04		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359092048	10,00	59,53	60,04		4.9.4 Nota de Valores

SERIE B ES0359092030		10,00		59,53		60,04		4.9.4 Nota de Valores
SERIE A1 ES0359092006		25,00		4,98		4,82		4.9.4 Nota de Valores
SERIE A2 ES0359092014		25,00		4,98		4,82		4.9.4 Nota de Valores
SERIE A3 ES0359092022		25,00		4,98		4,82		4.9.4 Nota de Valores
Diferimiento/postergamiento intereses: series (5)		0506		0526		0546		0566
SERIE D ES0359092055		9,40		4,98		4,82		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE C ES0359092048		13,20		4,98		4,82		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE E ES0359092063		8,00		4,98		4,82		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE B ES0359092030		18,30		4,98		4,82		3.4.6.2. Modulo Adicional
No Reducción del Fondo de Reserva (6)	0512		0532	2,09	0552	2,09	0572	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS (3)		0513		0523		0553		0573
N/A								

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

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

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

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

--

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

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 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				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	274	0426	33.523	0452	277	0478	34.429	0504	413	0530	55.364
Aragón	0401	117	0427	15.119	0453	124	0479	16.353	0505	176	0531	26.730
Asturias	0402	54	0428	5.898	0454	54	0480	5.976	0506	71	0532	8.457
Baleares	0403	58	0429	9.143	0455	60	0481	9.562	0507	73	0533	12.511
Canarias	0404	43	0430	4.721	0456	45	0482	5.000	0508	84	0534	10.967
Cantabria	0405	95	0431	11.241	0457	95	0483	11.406	0509	129	0535	18.240
Castilla-León	0406	145	0432	16.193	0458	148	0484	16.661	0510	212	0536	27.344
Castilla La Mancha	0407	291	0433	39.356	0459	306	0485	42.283	0511	489	0537	75.861
Cataluña	0408	627	0434	110.657	0460	640	0486	114.140	0512	968	0538	187.210
Ceuta	0409	34	0435	2.167	0461	35	0487	2.285	0513	59	0539	4.472
Extremadura	0410	32	0436	2.678	0462	32	0488	2.723	0514	39	0540	3.661
Galicia	0411	103	0437	12.637	0463	103	0489	12.817	0515	128	0541	17.541
Madrid	0412	3.908	0438	704.180	0464	4.083	0490	746.862	0516	6.243	0542	1.238.324
Meilla	0413	0	0439	0	0465	0	0491	0	0517	0	0543	0
Murcia	0414	31	0440	3.740	0466	32	0492	3.924	0518	63	0544	8.031
Navarra	0415	26	0441	3.795	0467	27	0493	3.924	0519	45	0545	7.831
La Rioja	0416	27	0442	3.471	0468	28	0494	3.614	0520	48	0546	7.344
Comunidad Valenciana	0417	268	0443	28.318	0469	282	0495	30.196	0521	482	0547	58.238
País Vasco	0418	115	0444	19.516	0470	118	0496	20.538	0522	162	0548	31.874
Total España	0419	6.248	0445	1.026.353	0471	6.489	0497	1.082.693	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	6.248	0450	1.026.353	0475	6.489	0501	1.082.693	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**

Período: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

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

CUADRO B

Divisa/Activos titulizados	Situación actual 30/06/2011						Situación cierre anual anterior 31/12/2010						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	6.248	0577	1.026.353	0583	1.026.353	0600	6.489	0606	1.082.693	0611	1.082.693	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	6.248			0588	1.026.353	0605	6.489			0616	1.082.693	0625	9.884			0636	1.800.000

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

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

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

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 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				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	46	1110	2.155	1120	37	1130	1.823	1140	0	1150	0
40% - 60%	1101	117	1111	11.560	1121	111	1131	11.001	1141	0	1151	0
60% - 80%	1102	1.614	1112	211.627	1122	1.354	1132	173.421	1142	0	1152	0
80% - 100%	1103	4.471	1113	801.012	1123	4.986	1133	896.247	1143	0	1153	1.699.335
100% - 120%	1104	0	1114	0	1124	1	1134	201	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	6.248	1118	1.026.354	1128	6.489	1138	1.082.693	1148	0	1158	1.800.000
Media ponderada (%)			1119	85,92			1139	87,06			1159	94,44

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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2011**

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		6.248		1.026.353		1,00		2,41
Total	1405	6.248	1415	1.026.353	1425	1,00	1435	2,41

(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: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2011**

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 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				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	1	1564	79	1585	0	1606	0
1,5% - 1,99%	1502	820	1523	174.727	1544	1.067	1565	221.803	1586	0	1607	0
2% - 2,49%	1503	2.878	1524	472.843	1545	2.808	1566	463.376	1587	0	1608	0
2,5% - 2,99%	1504	2.129	1525	331.151	1546	2.105	1567	335.589	1588	2	1609	715
3% - 3,49%	1505	419	1526	47.486	1547	484	1568	58.676	1589	10	1610	1.870
3,5% - 3,99%	1506	2	1527	145	1548	24	1569	3.170	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	6.248	1541	1.026.352	1562	6.489	1583	1.082.693	1604	9.884	1625	1.800.000
Tipo de interés medio ponderado de los activos(%)			9542	2,41			9584	2,37			1626	4,60
Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%)			9543	1,27			9585				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**

Periodo: **1er Semestre**

Ejercicio: **2011**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

CUADRO F

Concentración	Situación actual 30/06/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 12/12/2006			
	Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	2000	0,55			2030	0,55			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**
 Periodo: **1er Semestre**
 Ejercicio: **2011**

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 30/06/2011						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	993.626	3110	993.626	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	993.626	3220	18.000			3300	1.800.000

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.06

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
Estados agregados: **No**
Periodo: **1er Semestre**
Ejercicio: **2011**

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene
Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

N/A