

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8591
NIF Fondo: V84916956
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A-80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2016

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:
(sólo se cumplimentará en el supuesto de que se produzca el reenvío con alguna modificación de la información periódica)

S.01

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	636.967	1001	683.732
I. Activos financieros a largo plazo	0002	636.967	1002	683.732
1. Activos titulizados	0003	636.967	1003	683.732
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	614.506	1005	655.092
1.3 Préstamos hipotecarios	0006	0	1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007	0	1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008	0	1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009	0	1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010	0	1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011	0	1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012	0	1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013	0	1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014	0	1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015	0	1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016	0	1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017	0	1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018	0	1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019	0	1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020	0	1020	0
1.18 Bonos de titulización	0021	0	1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022	0	1022	0
1.20 Otros	0023	0	1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024	0	1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	22.909	1025	29.454
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-447	1027	-814
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	78.030	1041	80.057
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	28.055	1042	28.721
V. Activos financieros a corto plazo	0043	40.417	1043	39.798
1. Activos titulizados	0044	40.417	1044	39.798
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	35.929	1046	35.311
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048	0	1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049	0	1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050	0	1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051	0	1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052	0	1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053	0	1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054	0	1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055	0	1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056	0	1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057	0	1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058	0	1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060	0	1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061	0	1061	0
1.18 Bonos de titulización	0062	0	1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063	0	1063	0
1.20 Otros	0064	0	1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	227	1065	277
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	29	1066	45
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	4.972	1067	4.883
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	141	1068	177
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-880	1069	-895
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075	0	1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076	0	1076	0
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	0
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	9.557	1085	11.538
1. Tesorería	0086	9.557	1086	11.538
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	714.997	1088	763.789

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	660.854	1089	704.587
I. Provisiones a largo plazo	0090	0	1090	0
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	0	1092	0
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	660.854	1094	704.587
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	621.497	1095	670.587
1.1 Series no subordinadas	0096	441.497	1096	490.587
1.2 Series subordinadas	0097	180.000	1097	180.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	0	1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	22.171	1101	24.517
2.1 Préstamo subordinado	0102	68.941	1102	68.941
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-46.769	1105	-44.424
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108	17.186	1108	9.483
3.1 Derivados de cobertura	0109	17.186	1109	9.483
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2016		Periodo anterior 31/12/2015
B) PASIVO CORRIENTE	0117	73.261	1117	70.493
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118	0	1118	0
V. Provisiones a corto plazo	0119	0	1119	0
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	0
2. Provisión por margen de intermediación	0121	0	1121	0
3. Otras provisiones	0122	0	1122	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	66.570	1123	64.315
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	42.527	1124	41.557
1.1 Series no subordinadas	0125	40.900	1125	40.193
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	41	1128	120
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	1.586	1129	1.243
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	21.890	1131	20.652
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133	0	1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134	0	1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	0	1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	126	1136	139
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	21.764	1137	20.514
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	2.149	1139	2.106
3.1 Derivados de cobertura	0140	2.149	1140	2.106
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	3	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	3	1146	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	6.692	1148	6.178
1. Comisiones	0149	19	1149	20
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	15	1150	16
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	4	1152	4
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	6.672	1157	6.158
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-19.118	1158	-11.291
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-19.118	1160	-11.291
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	714.997	1162	763.789

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	1.533	1201	1.869	2201	6.550	3201	8.542
1.1 Activos titulizados	0202	1.533	1202	1.869	2202	6.550	3202	8.542
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-410	1204	-702	2204	-1.804	3204	-3.295
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-97	1205	-360	2205	-552	3205	-1.894
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-299	1206	-343	2206	-1.237	3206	-1.400
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-14	1207	0	2207	-14	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-548	1208	-497	2208	-2.235	3208	-2.332
A) MARGEN DE INTERESES	0209	575	1209	670	2209	2.510	3209	2.916
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210	0	3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211	0	3211	0
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212	0	3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213	0	3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214	0	3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216	30	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-299	1217	-452	2217	-1.753	3217	-1.920
7.1 Servicios exteriores	0218	-248	1218	-399	2218	-1.559	3218	-1.721
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-248	1219	-399	2219	-1.559	3219	-1.721
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-51	1224	-53	2224	-193	3224	-200
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-36	1225	-39	2225	-148	3225	-158
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-10	1227	-9	2227	-40	3227	-36
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228	0	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-5	1230	-5	2230	-5	3230	-5
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-541	1231	-3.123	2231	-3.118	3231	-7.580
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-541	1232	-3.123	2232	-3.118	3232	-7.580
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234	0	2234	0	3234	0
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236	0	3236	0
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	10	1238	95	2238	-15	3238	735
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	255	1239	2.809	2239	2.345	3239	5.849
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	934	1300	1.074	2300	3.878	3300	4.291
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	950	1301	1.122	2301	4.035	3301	4.485
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	1.552	1302	1.935	2302	6.653	3302	8.745
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-16	1303	-309	2303	-289	3303	-1.642
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-575	1305	-505	2305	-2.317	3305	-2.619
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-11	1308	0	2308	-11	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-46	1309	-47	2309	-188	3309	-194
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-36	1310	-38	2310	-149	3310	-157
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-10	1312	-9	2312	-39	3312	-36
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	30	1315	0	2315	30	3315	0
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0
3.6 Otros cobros de explotación	0321	30	1321	0	2321	30	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	636	1322	1.240	2322	-5.858	3322	-5.650
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	884	1325	1.639	2325	-4.293	3325	-3.926
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	6.251	1326	6.229	2326	25.122	3326	23.559
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.983	1327	4.547	2327	11.052	3327	15.022
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.462	1328	848	2328	5.331	3328	4.334
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	75	1329	0	2329	75	3329	4
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	608	1330	868	2330	2.509	3330	6.346
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-9.496	1331	-10.852	2331	-48.383	3331	-53.191
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-248	1332	-399	2332	-1.565	3332	-1.724
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	-1	1335	0	2335	-12	3335	-2
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-246	1336	-399	2336	-1.553	3336	-1.722
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	1.571	1337	2.315	2337	-1.980	3337	-1.359
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	7.987	1338	9.223	2338	11.538	3338	12.897
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	9.557	1339	11.538	2339	9.557	3339	11.538

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2016		Acumulado anterior 31/12/2015
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-8.320	1357	-2.896	2357	-10.063	3357	-2.788
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-8.320	1358	-2.896	2358	-10.063	3358	-2.788
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359	0	3359	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	548	1360	497	2360	2.235	3360	2.332
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361	0	3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	7.772	1362	2.399	2362	7.827	3362	456
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2016								Situación cierre anual anterior 31/12/2015								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	4,11	0401	10,49	0421	0,00	0441	1,58	1381	4,74	1401	9,49	1421	0,00	1441	1,99	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	17,00
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	179	0467	65	0474	16	0481	0	0488	81	0495	23.187	0502	0	0509	23.267
De 1 a 3 meses	0461	46	0468	42	0475	12	0482	0	0489	54	0496	6.552	0503	0	0510	6.606
De 3 a 6 meses	0462	13	0469	26	0476	4	0483	2	0490	32	0497	1.621	0504	0	0511	1.653
De 6 a 9 meses	0463	16	0470	57	0477	6	0484	11	0491	74	0498	2.067	0505	0	0512	2.141
De 9 a 12 meses	0464	8	0471	37	0478	3	0485	10	0492	50	0499	1.013	0506	0	0513	1.063
Más de 12 meses	0465	149	0472	3.371	0479	128	0486	1.228	0493	4.727	0500	19.688	0507	0	0514	24.415
Total	0466	411	0473	3.597	0480	170	0487	1.251	0494	5.018	0501	54.128	0508	0	1515	59.146

Impagados con garantía real (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total		Valor garantía		Valor Garantía con Tasación > 2 años		% Deuda / v. Tasación	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total													
Hasta 1 mes	0515	179	0522	65	0529	16	0536	0	0543	81	0550	23.187	0557	0	0564	23.267	0571	32.658	0578	32.658	0584	71,25
De 1 a 3 meses	0516	46	0523	42	0530	12	0537	0	0544	54	0551	6.552	0558	0	0565	6.606	0572	8.678	0579	8.678	0585	76,12
De 3 a 6 meses	0517	13	0524	26	0531	4	0538	2	0545	32	0552	1.621	0559	0	0566	1.653	0573	2.325	0580	2.325	0586	71,09
De 6 a 9 meses	0518	16	0525	57	0532	6	0539	11	0546	74	0553	2.067	0560	0	0567	2.141	0574	2.875	0581	2.875	0587	74,48
De 9 a 12 meses	0519	8	0526	37	0533	3	0540	10	0547	50	0554	1.013	0561	0	0568	1.063	0575	1.481	0582	1.481	0588	71,80
Más de 12 meses	0520	149	0527	3.371	0534	128	0541	1.228	0548	4.727	0555	19.688	0562	0	0569	24.415	0576	30.013	0583	30.013	0589	81,35
Total	0521	411	0528	3.597	0535	170	0542	1.251	0549	5.018	0556	54.128	0563	0	0570	59.146	0577	78.030			0590	75,80

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	59	1600	51	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	512	1601	49	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	257	1602	525	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	712	1603	261	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	952	1604	976	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	18.537	1605	15.954	2605	241
Superior a 10 años	0606	657.286	1606	706.924	2606	1.799.759
Total	0607	678.315	1607	724.740	2607	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	18,16	1608	19,08	2608	27,35

Antigüedad	Situación actual 31/12/2016					
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 05/12/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	11,67	1609	10,69	2609	1,72

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 05/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	237	0630	10.066	1620	153	1630	6.698	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	959	0631	78.196	1621	780	1631	61.676	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	2.489	0632	346.126	1622	2.637	1632	362.123	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	1.327	0633	243.927	1623	1.580	1633	294.242	2623	9.439	2633	1.699.335
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	445	2634	100.665
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	5.012	0638	678.315	1628	5.150	1638	724.740	2628	9.884	2638	1.800.000
Media ponderada (%)			0639	72,92			1639	75,33			2639	94,44

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,96	1650	1,20	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	3,79	1651	4,00	2651	6,00
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,20	1652	0,38	2652	2,70

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2016
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 05/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	238	0683	23.003	1660	241	1683	24.564	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	87	0684	8.649	1661	91	1684	9.386	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	46	0685	4.092	1662	47	1685	4.324	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	50	0686	6.570	1663	51	1686	6.937	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	38	0687	3.296	1664	40	1687	3.592	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	85	0688	8.091	1665	87	1688	8.692	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	123	0689	10.763	1666	125	1689	11.400	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	220	0690	24.324	1667	229	1690	26.386	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	542	0691	81.508	1668	554	1691	86.679	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	32	0692	1.433	1669	32	1692	1.550	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	30	0693	1.967	1670	31	1693	2.121	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	97	0694	9.685	1671	98	1694	10.236	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	3.054	0695	456.701	1672	3.143	1695	488.152	2672	6.243	2695	1.238.324
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	20	0697	1.731	1674	20	1697	1.822	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	20	0698	2.551	1675	21	1698	2.646	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	17	0699	1.748	1676	17	1699	1.811	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	205	0700	16.957	1677	213	1700	18.324	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	108	0701	15.245	1678	110	1701	16.117	2678	162	2701	31.874
Total España	0679	5.012	0702	678.315	1679	5.150	1702	724.740	2679	9.884	2702	1.800.000
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	5.012	0705	678.315	1682	5.150	1705	724.740	2682	9.884	2705	1.800.000

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 05/12/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,67			1710	0,65			2710	0,37		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2016			Situación cierre anual anterior 31/12/2015			Situación inicial 05/12/2006					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0359092006	SERIE A1	4.140	0	0	4.140	0	0	4.140	100.000	414.000			
ES0359092014	SERIE A2	9.360	22.692	212.397	9.360	27.861	260.780	9.360	100.000	936.000			
ES0359092022	SERIE A3	2.700	100.000	270.000	2.700	100.000	270.000	2.700	100.000	270.000			
ES0359092030	SERIE B	630	100.000	63.000	630	100.000	63.000	630	100.000	63.000			
ES0359092048	SERIE C	675	100.000	67.500	675	100.000	67.500	675	100.000	67.500			
ES0359092055	SERIE D	306	100.000	30.600	306	100.000	30.600	306	100.000	30.600			
ES0359092063	SERIE E	189	100.000	18.900	189	100.000	18.900	189	100.000	18.900			
Total		0723	18.000	0724	662.397	1723	18.000	1724	710.780	2723	18.000	2724	1.800.000

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
						0730	0731		0732	0733	0734	0735			0742	0736	0737
ES0359092006	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	0	0	SI	0	0	0	0	0	0			
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	0	0	SI	212.397	0	0	212.397	0	0			
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	0,00	0	0	SI	270.000	0	0	270.000	0	0			
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	0,00	0	0	SI	63.000	0	0	63.000	0	0			
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	0,00	0	0	SI	67.500	0	0	67.500	0	0			
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	0,19	6	0	SI	30.600	0	0	30.606	0	0			
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	1,69	35	1.586	SI	18.900	0	0	20.521	0	0			
Total						0740	41	0741	1.586	0743	662.397	0744	0	0745	664.024	0746	0

	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,07	0748	0,24	0749	0,00

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2016								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2015							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0359092006	SERIE A1	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408
ES0359092014	SERIE A2	9.496	723.603	0	125.437	10.852	675.220	82	125.398	10.852	675.220	82	125.398	82	675.220	82	125.398
ES0359092022	SERIE A3	0	0	0	42.820	0	0	109	42.753	0	0	109	42.753	109	0	109	42.753
ES0359092030	SERIE B	0	0	0	10.352	0	0	35	10.318	0	0	35	10.318	35	0	35	10.318
ES0359092048	SERIE C	0	0	0	11.422	0	0	46	11.361	0	0	46	11.361	46	0	46	11.361
ES0359092055	SERIE D	0	0	16	5.794	0	0	36	5.705	0	0	36	5.705	36	0	36	5.705
ES0359092063	SERIE E	0	0	0	4.849	0	0	0	4.849	0	0	0	4.849	0	0	0	4.849
Total		0754	9.496	0755	1.137.603	0756	16	0757	224.082	1754	10.852	1755	1.089.220	1756	309	1757	223.793

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Calificación				
		Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 05/12/2006
		0760	0761	0762	0763	0764
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092014	SERIE A2	27/02/2015	FCH	BBB-	BBB-	AAA
ES0359092014	SERIE A2	14/05/2016	MDY	Aa2	A1	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	01/12/2015	SYP	AA-	AA-	AAA
ES0359092022	SERIE A3	27/02/2015	FCH	BBB-	BBB-	AAA
ES0359092022	SERIE A3	14/05/2016	MDY	Aa2	A1	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	01/12/2015	SYP	BBB+	BBB+	AAA
ES0359092030	SERIE B	27/02/2015	FCH	BB-	BB-	AA
ES0359092030	SERIE B	14/05/2016	MDY	Baa1	Baa3	Aa1
ES0359092030	SERIE B	01/12/2015	SYP	BBB	BBB	AA
ES0359092048	SERIE C	27/02/2015	FCH	B-	B-	A
ES0359092048	SERIE C	14/05/2016	MDY	B1	B2	A1
ES0359092048	SERIE C	20/03/2013	SYP	B-	B-	A
ES0359092055	SERIE D	18/03/2009	FCH	CCC	CCC	BBB
ES0359092055	SERIE D	11/09/2009	MDY	C	C	Baa2
ES0359092055	SERIE D	20/03/2013	SYP	CCC+	CCC+	BBB
ES0359092063	SERIE E	18/03/2009	FCH	CC	CC	BB+
ES0359092063	SERIE E	11/09/2009	MDY	C	C	Ba1
ES0359092063	SERIE E	20/03/2013	SYP	D	D	BB

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2016

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	23.390	1765	25.312	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	28.756	1766	29.461	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	29.882	1767	30.580	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	31.022	1768	31.711	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	31.876	1769	29.184	2769	41.891
Entre 5 y 10 años	0770	167.304	1770	166.901	2770	241.519
Superior a 10 años	0771	350.168	1771	397.631	2771	1.370.127
Total	0772	662.397	1772	710.780	2772	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	13,30	1773	14,81	2773	25,20

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 05/12/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	0	1775	0	2775	62.640
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	62.640	1776	62.640	2776	62.640
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	0,00	1777	0,00	2777	3,48
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Bankia	1778	Bankia	2778	Caja Madrid
1.4 Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781		1781		2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782		1782		2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784		1784		2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786		1786		2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787		1787		2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788		1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	72,83	1792	74,68	2792	90,00
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 05/12/2006	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap de Bases	BANCO SANTANDER	TRIMESTRAL	Media de los Euribor 12M en cada Fecha de Referencia	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	Tipo de Referencia de los Bonos - 0,055%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	-19.335	-11.589		
Total							0808 -19.335	0809 -11.589	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)			Valor en libros (miles de euros)			Otras características	
	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 05/12/2006	Situación actual 31/12/2016	Situación cierre anual anterior 31/12/2015	Situación inicial 05/12/2006		
Préstamos hipotecarios	0811	1811	2811	0829	1829	2829	3829	
Cédulas hipotecarias	0812	1812	2812	0830	1830	2830	3830	
Préstamos a promotores	0813	1813	2813	0831	1831	2831	3831	
Préstamos a PYMES	0814	1814	2814	0832	1832	2832	3832	
Préstamos a empresas	0815	1815	2815	0833	1833	2833	3833	
Préstamos corporativos	0816	1816	2816	0834	1834	2834	3834	
Cédulas territoriales	0817	1817	2817	0835	1835	2835	3835	
Bonos de tesorería	0818	1818	2818	0836	1836	2836	3836	
Deuda subordinada	0819	1819	2819	0837	1837	2837	3837	
Créditos AAPP	0820	1820	2820	0838	1838	2838	3838	
Préstamos consumo	0821	1821	2821	0839	1839	2839	3839	
Préstamos automoción	0822	1822	2822	0840	1840	2840	3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823	1823	2823	0841	1841	2841	3841	
Cuentas a cobrar	0824	1824	2824	0842	1842	2842	3842	
Derechos de crédito futuros	0825	1825	2825	0843	1843	2843	3843	
Bonos de titulización	0826	1826	2826	0844	1844	2844		
Total	0827	1827	2827	0845	1845	2845	3845	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	1.247	7006	3.582	7009	0,19	7012	0,52	7015	0,36		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.247	7008	3.582	7011	0,19	7014	0,52	7017	0,36	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	108.996	7024	114.652	7027	14,45	7030	14,28	7033	14,36		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	613	7025	927	7028	0,08	7031	0,12	7034	0,10		
Total Fallidos					7023	109.610	7026	115.579	7029	14,53	7032	14,39	7035	14,45	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
SERIE A1 - ES0359092006	25,00	6,09	6,12	4.9.4 Nota de Valores
SERIE E - ES0359092063	2,10	2,85	2,81	4.9.4 Nota de Valores
SERIE E - ES0359092063	1,25	0,19	0,36	4.9.4 Nota de Valores
SERIE E - ES0359092063	10,00	41,90	42,34	4.9.4 Nota de Valores
SERIE B - ES0359092030	7,00	9,51	9,38	4.9.4 Nota de Valores
SERIE B - ES0359092030	2,00	0,19	0,36	4.9.4 Nota de Valores
SERIE B - ES0359092030	10,00	41,90	42,34	4.9.4 Nota de Valores
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	6,09	6,12	4.9.4 Nota de Valores
SERIE C - ES0359092048	7,50	10,19	10,05	4.9.4 Nota de Valores
SERIE C - ES0359092048	1,75	0,19	0,36	4.9.4 Nota de Valores
SERIE C - ES0359092048	10,00	41,90	42,34	4.9.4 Nota de Valores
SERIE D - ES0359092055	3,40	4,62	4,55	4.9.4 Nota de Valores
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,19	0,36	4.9.4 Nota de Valores
SERIE D - ES0359092055	10,00	41,90	42,34	4.9.4 Nota de Valores
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	6,09	6,12	4.9.4 Nota de Valores
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE B - ES0359092030	18,30	7,97	7,97	3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE C - ES0359092048	13,20	7,97	7,97	3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE D - ES0359092055	9,40	7,97	7,97	3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE E - ES0359092063	8,00	7,97	7,97	3.4.6.2. Modulo Adicional
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		0,00	0,00	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862	9	2862	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,014	4862		5862		6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, S.E.	1864		2864	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3864	0,005	4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Bankia
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo Adicional 3.4.3.2

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo											Total		
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872														
Margen de intereses	0873														
Deterioro de activos financieros (neto)	0874														
Dotaciones a provisiones (neto)	0875														
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876														
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877														
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878														
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879														
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880														
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881														
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882														
Comisión variable pagada	0883														
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884														

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo				Total
		22/02/2016	23/05/2016	22/08/2016	22/11/2016	
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885					
Saldo inicial	0886	0	0	0	0	
Cobros del periodo	0887	14.643	14.261	13.457	10.380	
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-429	-439	-590	-294	
Pagos por derivados	0889	-539	-616	-588	-575	
Retención importe Fondo de Reserva	0890	0	0	0	0	
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-13.675	-13.206	-12.280	-9.511	
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0	0	
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0	0	
Saldo disponible	0894	0	0	0	0	
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	0	0	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2016

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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