

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: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2017

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)

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	604.821	1001	636.967
I. Activos financieros a largo plazo	0002	604.821	1002	636.967
1. Activos titulizados	0003	604.821	1003	636.967
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	585.306	1005	614.506
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	19.765	1025	22.909
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-249	1027	-447
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

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: 30/09/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	75.406	1041	78.030
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	26.750	1042	28.055
V. Activos financieros a corto plazo	0043	39.466	1043	40.417
1. Activos titulizados	0044	39.466	1044	40.417
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	36.269	1046	35.929
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	213	1065	227
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	25	1066	29
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	3.697	1067	4.972
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	98	1068	141
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-836	1069	-880
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	
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	9.189	1085	9.557
1. Tesorería	0086	9.189	1086	9.557
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	680.227	1088	714.997

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	624.285	1089	660.854
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	624.285	1094	660.854
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	588.454	1095	621.497
1.1 Series no subordinadas	0096	408.454	1096	441.497
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	18.645	1101	22.171
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	-50.295	1105	-46.769
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	17.186
3.1 Derivados de cobertura	0109	17.186	1109	17.186
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

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: 30/09/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2017		Periodo anterior 31/12/2016
B) PASIVO CORRIENTE	0117	75.144	1117	73.261
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	66.750	1123	66.570
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	41.832	1124	42.527
1.1 Series no subordinadas	0125	39.966	1125	40.900
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	40	1128	41
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	1.826	1129	1.586
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	22.765	1131	21.890
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	125	1136	126
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	22.640	1137	21.764
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	2.149	1139	2.149
3.1 Derivados de cobertura	0140	2.149	1140	2.149
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	4	1143	3
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	4	1146	3
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	8.394	1148	6.692
1. Comisiones	0149	19	1149	19
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	15	1150	15
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	8.375	1157	6.672
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-19.202	1158	-19.118
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-19.202	1160	-19.118
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	680.227	1162	714.997

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2017		Acumulado anterior 30/09/2016
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	1.191	1201	1.547	2201	3.878	3201	5.017
1.1 Activos titulizados	0202	1.191	1202	1.547	2202	3.878	3202	5.017
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-403	1204	-409	2204	-1.195	3204	-1.394
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-94	1205	-105	2205	-280	3205	-455
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-294	1206	-304	2206	-875	3206	-939
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-15	1207	0	2207	-40	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-437	1208	-563	2208	-1.430	3208	-1.687
A) MARGEN DE INTERESES	0209	350	1209	574	2209	1.253	3209	1.935
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	3	1216	0	2216	10	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-337	1217	-586	2217	-1.159	3217	-1.453
7.1 Servicios exteriores	0218	-292	1218	-539	2218	-1.024	3218	-1.311
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-292	1219	-539	2219	-1.024	3219	-1.311
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	-44	1224	-47	2224	-135	3224	-142
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-35	1225	-37	2225	-107	3225	-112
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-9	1227	-10	2227	-28	3227	-30
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	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-1.556	1231	-601	2231	-4.516	3231	-2.577
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-1.556	1232	-601	2232	-4.516	3232	-2.577
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	307	1238	-6	2238	885	3238	-25
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	1.232	1239	618	2239	3.526	3239	2.121
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: 30/09/2017

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2017		Acumulado anterior 30/09/2016
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	648	1300	907	2300	2.221	3300	2.943
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	688	1301	954	2301	2.345	3301	3.085
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	1.186	1302	1.568	2302	3.938	3302	5.101
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-13	1303	-26	2303	-41	3303	-273
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	-470	1305	-588	2305	-1.513	3305	-1.743
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	-15	1308	0	2308	-39	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-45	1309	-47	2309	-136	3309	-142
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-35	1310	-37	2310	-108	3310	-112
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-9	1312	-10	2312	-28	3312	-30
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	5	1315	0	2315	12	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	5	1321	0	2321	12	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-2.197	1322	-2.826	2322	-2.589	3322	-6.494
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	-1.905	1325	-2.281	2325	-1.560	3325	-5.177
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	7.828	1326	7.124	2326	20.450	3326	18.871
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.065	1327	1.974	2327	6.875	3327	9.069
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	324	1328	622	2328	1.233	3328	3.869
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	1.401	1330	253	2330	3.860	3330	1.901
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-12.523	1331	-12.254	2331	-33.977	3331	-38.887
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-292	1332	-544	2332	-1.030	3332	-1.317
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-292	1336	-544	2336	-1.030	3336	-1.317
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-1.549	1337	-1.918	2337	-368	3337	-3.551
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	10.738	1338	9.905	2338	9.557	3338	11.538
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	9.189	1339	7.987	2339	9.189	3339	7.987

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2017		Acumulado anterior 30/09/2016
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	-470	1357	-588	2357	-1.513	3357	-1.743
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-470	1358	-588	2358	-1.513	3358	-1.743
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	437	1360	563	2360	1.430	3360	1.687
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	32	1362	25	2362	84	3362	55
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: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2017								Situación cierre anual anterior 31/12/2016								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	3,64	0401	11,55	0421	0,09	0441	1,33	1381	4,11	1401	10,49	1421	0,00	1441	1,58	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: 30/09/2017

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	203	0467	70	0474	15	0481	0	0488	85	0495	25.956	0502	0	0509	26.041
De 1 a 3 meses	0461	51	0468	43	0475	10	0482	0	0489	53	0496	6.471	0503	0	0510	6.524
De 3 a 6 meses	0462	14	0469	32	0476	5	0483	3	0490	40	0497	1.936	0504	0	0511	1.976
De 6 a 9 meses	0463	5	0470	16	0477	2	0484	4	0491	22	0498	761	0505	0	0512	784
De 9 a 12 meses	0464	7	0471	27	0478	3	0485	7	0492	37	0499	959	0506	0	0513	996
Más de 12 meses	0465	124	0472	2.425	0479	88	0486	902	0493	3.416	0500	17.305	0507	0	0514	20.721
Total	0466	404	0473	2.614	0480	123	0487	916	0494	3.653	0501	53.389	0508	0	1515	57.042

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	203	0522	70	0529	15	0536	0	0543	85	0550	25.956	0557	0	0564	26.041	0571	37.378	0578	37.378	0584	69,67
De 1 a 3 meses	0516	51	0523	43	0530	10	0537	0	0544	53	0551	6.471	0558	0	0565	6.524	0572	9.295	0579	9.295	0585	70,19
De 3 a 6 meses	0517	14	0524	32	0531	5	0538	3	0545	40	0552	1.936	0559	0	0566	1.976	0573	2.774	0580	2.774	0586	71,23
De 6 a 9 meses	0518	5	0525	16	0532	2	0539	4	0546	22	0553	761	0560	0	0567	784	0574	1.019	0581	1.019	0587	76,90
De 9 a 12 meses	0519	7	0526	27	0533	3	0540	7	0547	37	0554	959	0561	0	0568	996	0575	1.297	0582	1.297	0588	76,85
Más de 12 meses	0520	124	0527	2.425	0534	88	0541	902	0548	3.416	0555	17.305	0562	0	0569	20.721	0576	24.987	0583	24.987	0589	82,92
Total	0521	404	0528	2.614	0535	123	0542	916	0549	3.653	0556	53.389	0563	0	0570	57.042	0577	76.750			0590	74,32

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: 30/09/2017

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 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	114	1600	59	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	105	1601	512	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	322	1602	257	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	446	1603	712	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	1.185	1604	952	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	20.730	1605	18.537	2605	241
Superior a 10 años	0606	622.135	1606	657.286	2606	1.799.759
Total	0607	645.037	1607	678.315	2607	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	17,53	1608	18,16	2608	27,35

Antigüedad	Situación actual 30/09/2017					
	Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 05/12/2006			
Antigüedad media ponderada (años)	0609	12,40	1609	11,67	2609	1,72

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: 30/09/2017

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 30/09/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				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	300	0630	12.572	1620	237	1630	10.066	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.106	0631	92.622	1621	959	1631	78.196	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	2.504	0632	356.036	1622	2.489	1632	346.126	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	996	0633	183.806	1623	1.327	1633	243.927	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	4.906	0638	645.037	1628	5.012	1638	678.315	2628	9.884	2638	1.800.000
Media ponderada (%)	0639	71,16	0649		1639	72,92	1649		2639	94,44	2649	

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: 30/09/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,85	1650	0,96	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	2,10	1651	3,79	2651	6,00
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,12	1652	0,20	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: 30/09/2017
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				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	230	0683	21.586	1660	238	1683	23.003	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	85	0684	8.161	1661	87	1684	8.649	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	44	0685	3.851	1662	46	1685	4.092	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	49	0686	6.146	1663	50	1686	6.570	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	37	0687	3.096	1664	38	1687	3.296	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	83	0688	7.527	1665	85	1688	8.091	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	122	0689	10.237	1666	123	1689	10.763	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	213	0690	22.839	1667	220	1690	24.324	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	533	0691	78.027	1668	542	1691	81.508	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	31	0692	1.296	1669	32	1692	1.433	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	30	0693	1.882	1670	30	1693	1.967	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	96	0694	9.251	1671	97	1694	9.685	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	2.995	0695	435.428	1672	3.054	1695	456.701	2672	6.243	2695	1.238.324
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	19	0697	1.573	1674	20	1697	1.731	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	19	0698	2.347	1675	20	1698	2.551	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	14	0699	1.501	1676	17	1699	1.748	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	198	0700	15.574	1677	205	1700	16.957	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	108	0701	14.714	1678	108	1701	15.245	2678	162	2701	31.874
Total España	0679	4.906	0702	645.037	1679	5.012	1702	678.315	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	4.906	0705	645.037	1682	5.012	1705	678.315	2682	9.884	2705	1.800.000

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: 30/09/2017
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 05/12/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,70			1710	0,67			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

Período de la declaración: 30/09/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2017			Situación cierre anual anterior 31/12/2016			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	Nominal unitario (€) 0721	0722	1720	Nominal unitario (€) 1721	1722	2720	Nominal unitario (€) 2721	2722			
ES0359092006	SERIE A1	4.140	0	0	4.140	0	0	4.140	100.000	414.000			
ES0359092014	SERIE A2	9.360	19.062	178.420	9.360	22.692	212.397	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	628.420	1723	18.000	1724	662.397	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: 30/09/2017

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	NO	0	0	0	0	0				
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	0	0	NO	178.420	0	0	178.420	0				
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	0,00	0	0	NO	270.000	0	0	270.000	0				
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	0,00	0	0	NO	63.000	0	0	63.000	0				
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	0,00	0	0	NO	67.500	0	0	67.500	0				
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	0,17	6	0	NO	30.600	0	0	30.606	0				
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	1,67	34	1.826	NO	18.900	0	0	20.760	0				
Total						0740	40	0741	1.826	0743	628.420	0744	0	0745	630.286	0746	0

	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,06	0748	0,07	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: 30/09/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2017								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2016							
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	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	23.408		
ES0359092014	SERIE A2	12.523	757.580	0	125.437	12.254	714.107	0	125.437	0	714.107	0	125.437	0	125.437		
ES0359092022	SERIE A3	0	0	0	42.820	0	0	0	42.820	0	0	0	42.820	0	42.820		
ES0359092030	SERIE B	0	0	0	10.352	0	0	0	10.352	0	0	0	10.352	0	10.352		
ES0359092048	SERIE C	0	0	0	11.422	0	0	7	11.422	0	0	7	11.422	0	11.422		
ES0359092055	SERIE D	0	0	13	5.835	0	0	19	5.835	0	0	19	5.835	0	5.779		
ES0359092063	SERIE E	0	0	0	4.849	0	0	0	4.849	0	0	0	4.849	0	4.849		
Total		0754	12.523	0755	1.171.580	0756	13	0757	224.123	1754	12.254	1755	1.128.107	1756	26	1757	224.066

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: 30/09/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/09/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 05/12/2006
				0760	0761	0762
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	Aa2	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	22/05/2017	SYP	AA	AA-	AAA
ES0359092022	SERIE A3	27/02/2015	FCH	BBB-	BBB-	AAA
ES0359092022	SERIE A3	14/05/2016	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	22/05/2017	SYP	A+	BBB+	AAA
ES0359092030	SERIE B	27/02/2015	FCH	BB-	BB-	AA
ES0359092030	SERIE B	14/05/2016	MDY	Baa1	Baa1	Aa1
ES0359092030	SERIE B	22/05/2017	SYP	BBB+	BBB	AA
ES0359092048	SERIE C	27/02/2015	FCH	B-	B-	A
ES0359092048	SERIE C	14/05/2016	MDY	B1	B1	A1
ES0359092048	SERIE C	22/05/2017	SYP	BB	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: 30/09/2017

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 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	24.026	1765	23.390	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	28.955	1766	28.756	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	30.071	1767	29.882	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	28.944	1768	31.022	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	30.250	1769	31.876	2769	41.891
Entre 5 y 10 años	0770	165.665	1770	167.304	2770	241.519
Superior a 10 años	0771	320.509	1771	350.168	2771	1.370.127
Total	0772	628.420	1772	662.397	2772	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	12,81	1773	13,30	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: 30/09/2017

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		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	71,15	1792	72,83	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: 30/09/2017

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 30/09/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	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	-19.335		
Total							0808 -19.335	0809 -19.335	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

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 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 05/12/2006		Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		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: 30/09/2017

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 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	1.873	7006	1.247	7009	0,30	7012	0,19	7015	0,20		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.873	7008	1.247	7011	0,30	7014	0,19	7017	0,20	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	100.389	7024	108.996	7027	14,01	7030	14,45	7033	14,12		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	154	7025	613	7028	0,02	7031	0,08	7034	0,06		
Total Fallidos					7023	100.542	7026	109.610	7029	14,03	7032	14,53	7035	14,18	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		
	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: 30/09/2017

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 C - ES0359092048	1,75	0,28	0,20	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	10,03	9,83	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	10,00	42,07	42,38	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	7,84	7,85	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359092006	25,00	7,84	7,85	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	7,50	10,74	10,53	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	1,25	0,28	0,20	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	2,00	0,28	0,20	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	10,00	42,07	42,38	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	4,87	4,77	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	42,07	42,38	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	3,01	2,95	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,28	0,20	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	7,84	7,85	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	10,00	42,07	42,38	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE E - ES0359092063	8,00	7,84	7,85	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE C - ES0359092048	13,20	7,84	7,85	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE D - ES0359092055	9,40	7,84	7,85	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE B - ES0359092030	18,30	7,84	7,85	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
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: 30/09/2017

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	10	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: 30/09/2017

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: 30/09/2017

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo							Total
		22/02/2017	22/05/2017	22/08/2017					
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885								
Saldo inicial	0886	0	0	0					
Cobros del periodo	0887	13.243	10.111	13.343					
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-386	-444	-337					
Pagos por derivados	0889	-543	-500	-470					
Retención importe Fondo de Reserva	0890	0	0	0					
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-12.314	-9.168	-12.536					
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0					
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0					
Saldo disponible	0894	0	0	0					
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	0					0

S.06

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2017

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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