

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 9724
NIF Fondo: V85981231
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: 30/09/2018

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 RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	364.685	1001	380.190
I. Activos financieros a largo plazo	0002	364.685	1002	380.190
1. Activos titulizados	0003	358.724	1003	374.229
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	353.016	1005	368.182
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	5.747	1025	6.117
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-39	1027	-71
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	5.961	1029	5.961
2.1 Derivados de cobertura	0030	5.961	1030	5.961
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 RESIDENCIAL II -FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	76.846	1041	76.976
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	5.566	1042	5.886
V. Activos financieros a corto plazo	0043	19.043	1043	18.762
1. Activos titulizados	0044	18.275	1044	18.159
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	17.456	1046	17.407
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	73	1065	81
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	8	1066	9
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	864	1067	817
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	20	1068	23
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-145	1069	-178
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	276	1071	276
2.1 Derivados de cobertura	0072	276	1072	276
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	492	1074	326
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	492	1077	326
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	52.237	1085	52.328
1. Tesorería	0086	52.237	1086	52.328
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	441.531	1088	457.166

S.01

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	414.347	1089	430.155
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	414.347	1094	430.155
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	212.373	1095	228.968
1.1 Series no subordinadas	0096	212.373	1096	228.968
1.2 Series subordinadas	0097	0	1097	0
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	201.975	1101	201.187
2.1 Préstamo subordinado	0102	60.291	1102	60.291
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	144.000	1104	144.000
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-2.316	1105	-3.104
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	0	1108	0
3.1 Derivados de cobertura	0109	0	1109	0
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 RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) PASIVO CORRIENTE	0117	21.035	1117	20.837
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	21.023	1123	20.820
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	18.340	1124	18.243
1.1 Series no subordinadas	0125	18.319	1125	18.224
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	20	1128	19
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	0	1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	2.677	1131	2.573
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	56	1136	54
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	2.620	1137	2.519
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	0	1139	0
3.1 Derivados de cobertura	0140	0	1140	0
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	7	1143	4
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	7	1146	4
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	12	1148	16
1. Comisiones	0149	12	1149	12
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	6	1150	5
1.2 Comisión administrador	0151	4	1151	4
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	1152	2
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	1	1157	4
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	6.148	1158	6.174
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	6.148	1160	6.174
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	441.531	1162	457.166

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2018		Acumulado anterior 30/09/2017
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	471	1201	564	2201	1.439	3201	1.770
1.1 Activos titulizados	0202	471	1202	564	2202	1.439	3202	1.770
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-188	1204	-160	2204	-545	3204	-491
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-46	1205	-46	2205	-133	3205	-145
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-118	1206	-115	2206	-346	3206	-346
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-23	1207	0	2207	-65	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	107	1208	35	2208	299	3208	54
A) MARGEN DE INTERESES	0209	390	1209	439	2209	1.193	3209	1.333
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	9	1216	2	2216	13	3216	10
7. Otros gastos de explotación	0217	-159	1217	-148	2217	-453	3217	-387
7.1 Servicios exteriores	0218	-127	1218	-115	2218	-357	3218	-290
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-127	1219	-115	2219	-357	3219	-290
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	-32	1224	-32	2224	-95	3224	-97
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-17	1225	-16	2225	-50	3225	-49
7.3.2 Comisión administrador	0226	-10	1226	-11	2226	-30	3226	-32
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-5	1227	-5	2227	-15	3227	-16
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	-58	1231	-145	2231	-341	3231	-1.333
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-58	1232	-145	2232	-341	3232	-1.333
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	191	1238	8	2238	376	3238	170
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-373	1239	-155	2239	-788	3239	208
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 RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2018		Acumulado anterior 30/09/2017
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	402	1300	413	2300	1.204	3300	1.278
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	425	1301	444	2301	1.287	3301	1.366
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	469	1302	558	2302	1.451	3302	1.789
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-45	1303	-45	2303	-132	3303	-151
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	107	1304	12	2304	273	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	3305	-26
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	-82	1307	-81	2307	-242	3307	-246
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-23	1308	0	2308	-63	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-32	1309	-32	2309	-96	3309	-97
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-17	1310	-16	2310	-50	3310	-49
2.2 Comisión administrador	0311	-10	1311	-11	2311	-31	3311	-32
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	-5	2312	-15	3312	-16
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	9	1315	2	2315	13	3315	10
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	9	1321	2	2321	13	3321	10
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-957	1322	43	2322	-1.295	3322	-895
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	-830	1325	159	2325	-934	3325	-600
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	3.091	1326	3.506	2326	9.783	3326	10.247
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.296	1327	1.735	2327	4.317	3327	3.000
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	124	1328	250	2328	483	3328	301
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	424	1330	332	2330	983	3330	1.001
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-5.765	1331	-5.664	2331	-16.500	3331	-15.149
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-127	1332	-115	2332	-361	3332	-295
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	-127	1336	-115	2336	-361	3336	-295
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-555	1337	457	2337	-91	3337	383
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	52.792	1338	51.323	2338	52.328	3338	51.396
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	52.237	1339	51.780	2339	52.237	3339	51.780

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2018		Acumulado anterior 30/09/2017
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	107	1357	-14	2357	273	3357	-26
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	107	1358	-14	2358	273	3358	-26
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	-107	1360	-35	2360	-299	3360	-54
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	0	1362	49	2362	25	3362	80
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 RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2018								Situación cierre anual anterior 31/12/2017								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	1,75	0401	3,56	0421	0,00	0441	1,55	1381	1,77	1401	3,33	1421	0,00	1441	1,16	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	6,00
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 RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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	95	0467	37	0474	6	0481	0	0488	43	0495	14.181	0502	0	0509	14.224
De 1 a 3 meses	0461	16	0468	13	0475	2	0482	0	0489	15	0496	2.640	0503	0	0510	2.656
De 3 a 6 meses	0462	3	0469	7	0476	1	0483	1	0490	9	0497	513	0504	0	0511	522
De 6 a 9 meses	0463	5	0470	24	0477	1	0484	2	0491	27	0498	893	0505	0	0512	920
De 9 a 12 meses	0464	4	0471	11	0478	1	0485	1	0492	13	0499	380	0506	0	0513	393
Más de 12 meses	0465	34	0472	521	0479	17	0486	213	0493	752	0500	4.262	0507	0	0514	5.014
Total	0466	157	0473	613	0480	28	0487	218	0494	859	0501	22.869	0508	0	1515	23.728

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	95	0522	37	0529	6	0536	0	0543	43	0550	14.181	0557	0	0564	14.224	0571	19.704	0578	19.704	0584	72,19
De 1 a 3 meses	0516	16	0523	13	0530	2	0537	0	0544	15	0551	2.640	0558	0	0565	2.656	0572	3.502	0579	3.502	0585	75,84
De 3 a 6 meses	0517	3	0524	7	0531	1	0538	1	0545	9	0552	513	0559	0	0566	522	0573	662	0580	662	0586	78,86
De 6 a 9 meses	0518	5	0525	24	0532	1	0539	2	0546	27	0553	893	0560	0	0567	920	0574	1.327	0581	1.327	0587	69,35
De 9 a 12 meses	0519	4	0526	11	0533	1	0540	1	0547	13	0554	380	0561	0	0568	393	0575	546	0582	546	0588	72,00
Más de 12 meses	0520	34	0527	521	0534	17	0541	213	0548	752	0555	4.262	0562	0	0569	5.014	0576	6.059	0583	6.059	0589	82,74
Total	0521	157	0528	613	0535	28	0542	218	0549	859	0556	22.869	0563	0	0570	23.728	0577	31.799			0590	74,62

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0600	1	1600	6	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	28	1601	0	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	0	1602	41	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	54	1603	26	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	228	1604	53	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	3.996	1605	3.474	2605	58
Superior a 10 años	0606	372.775	1606	388.923	2606	599.942
Total	0607	377.082	1607	392.524	2607	600.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	21,83	1608	22,53	2608	29,68

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 24/06/2010	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	11,55	1609	10,81	2609	3,22

MADRID RESIDENCIAL II -FTA

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2018
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 30/09/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 24/06/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	58	0630	4.179	1620	43	1630	3.024	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	404	0631	48.451	1621	235	1631	27.680	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	1.727	0632	269.952	1622	1.826	1632	286.812	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	252	0633	43.372	1623	347	1633	61.739	2623	2.918	2633	567.668
100% - 120%	0624	36	0634	3.587	1624	45	1634	4.502	2624	50	2634	5.203
120% - 140%	0625	30	0635	3.010	1625	35	1635	3.540	2625	62	2635	7.514
140% - 160%	0626	13	0636	1.663	1626	15	1636	1.887	2626	43	2636	5.469
superior al 160%	0627	18	0637	2.869	1627	21	1637	3.340	2627	90	2637	14.146
Total	0628	2.538	0638	377.082	1628	2.567	1638	392.524	2628	3.163	2638	600.000
Media ponderada (%)	0639	71,76	0649		1639	73,65	1649		2639	91,03	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 24/06/2010	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,52	1650	0,59	2650	2,03
Tipo de interés nominal máximo	0651	5,50	1651	5,50	2651	6,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,01	1652	0,07	2652	1,43

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 24/06/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	285	0683	31.434	1660	289	1683	32.958	2660	351	2683	51.156
Aragón	0661	35	0684	4.157	1661	35	1684	4.280	2661	38	2684	5.717
Asturias	0662	44	0685	4.555	1662	44	1685	4.667	2662	50	2685	6.714
Baleares	0663	42	0686	6.688	1663	45	1686	7.416	2663	65	2686	12.923
Canarias	0664	45	0687	4.660	1664	45	1687	4.810	2664	60	2687	7.971
Cantabria	0665	40	0688	4.498	1665	40	1688	4.663	2665	45	2688	6.748
Castilla-León	0666	90	0689	9.648	1666	92	1689	10.189	2666	112	2689	16.110
Castilla La Mancha	0667	207	0690	23.349	1667	207	1690	24.093	2667	285	2690	42.443
Cataluña	0668	242	0691	38.285	1668	245	1691	39.662	2668	330	2691	63.316
Ceuta	0669	6	0692	550	1669	6	1692	567	2669	7	2692	900
Extremadura	0670	26	0693	2.198	1670	27	1693	2.326	2670	36	2693	4.120
Galicia	0671	108	0694	13.340	1671	108	1694	13.657	2671	126	2694	18.967
Madrid	0672	1.110	0695	198.399	1672	1.124	1695	206.620	2672	1.339	2695	305.733
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	17	0697	1.992	1674	17	1697	2.060	2674	23	2697	3.585
Navarra	0675	8	0698	1.037	1675	8	1698	1.070	2675	10	2698	1.875
La Rioja	0676	10	0699	1.364	1676	10	1699	1.402	2676	11	2699	1.834
Comunidad Valenciana	0677	187	0700	24.587	1677	189	1700	25.604	2677	234	2700	40.478
País Vasco	0678	36	0701	6.341	1678	36	1701	6.481	2678	41	2701	9.409
Total España	0679	2.538	0702	377.082	1679	2.567	1702	392.524	2679	3.163	2702	600.000
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	2.538	0705	377.082	1682	2.567	1705	392.524	2682	3.163	2705	600.000

MADRID RESIDENCIAL II -FTA

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 24/06/2010			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,55			1710	1,52			2710	1,46		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2018			Situación cierre anual anterior 31/12/2017			Situación inicial 24/06/2010					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0358969006	Bono A	4.560	50.590	230.692	4.560	54.209	247.193	4.560	100.000	456.000			
Total		0723	4.560	0724	230.692	1723	4.560	1724	247.193	2723	4.560	2724	456.000

S.05.2
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2018
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		Intereses impagados		Serie devenga Intereses en el periodo		Principal no vencido		Principal impagado		0738	0739		
			0731	0732	0733	0734		0735		0742		0736		0737					
ES0358969006	Bono A	NS	EURIBOR 3 m	0,40	0,08	20		0		SI		230.692		0		230.712		0	
Total						0740	20	0741	0		0743	230.692	0744	0	0745	230.712	0746	0	

	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 24/06/2010	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,07	0748	0,07	0749	0,00

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2018								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2017							
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
ES0358969006	Bono A	5.765	225.308	45	21.524	5.664	204.199	45	21.346								
Total		0754	5.765	0755	225.308	0756	45	0757	21.524	1754	5.664	1755	204.199	1756	45	1757	21.346

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2018

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 30/09/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 24/06/2010
				0762	0763	0764
ES0358969006	Bono A	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa2	Aaa
ES0358969006	Bono A	05/11/2012	SYP	A	A	AAA

S.05.2
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2018
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 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0765	37.180	1765	11.815	2765	10.044
Entre 1 y 2 años	0766	62.301	1766	13.956	2766	12.488
Entre 2 y 3 años	0767	12.083	1767	14.339	2767	12.975
Entre 3 y 4 años	0768	12.303	1768	14.739	2768	13.480
Entre 4 y 5 años	0769	12.533	1769	15.151	2769	14.006
Entre 5 y 10 años	0770	65.629	1770	81.922	2770	78.664
Superior a 10 años	0771	28.663	1771	95.270	2771	314.344
Total	0772	230.692	1772	247.193	2772	456.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	12,21	1773	15,22	2773	29,41

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 24/06/2010	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	49.253	1775	48.801	2775	60.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	60.000	1776	60.000	2776	60.000
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	21,35	1777	19,74	2777	13,16
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	N	1791	N	2791	N
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	100,00	1792	100,00	2792	100,00
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 RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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 30/09/2018	Situación cierre anual anterior 31/12/2017	Situación inicial 24/06/2010	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap de Bases	BBVA	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 + 0,246%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	6.237	6.237		
Total							0808 6.237	0809 6.237	0810	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 24/06/2010		Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 24/06/2010			
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 RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	1.787	7006	2.272	7009	0,48	7012	0,59	7015	0,44		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.787	7008	2.272	7011	0,48	7014	0,59	7017	0,44	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	19.732	7024	20.674	7027	5,04	7030	5,06	7033	5,11		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	171	7025	398	7028	0,04	7031	0,10	7034	0,10		
Total Fallidos					7023	19.903	7026	21.072	7029	5,08	7032	5,16	7035	5,21	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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
Préstamo B	10,00	61,99	62,45	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	48,00	38,43	37,85	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	1,50	0,48	0,44	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	1,50	0,48	0,44	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	48,00	38,43	37,85	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	10,00	61,99	62,45	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Préstamo B	9,95	3,99	4,05	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		21,35	20,61	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



S.05.5

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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		2862	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados de Transmisión de Hipoteca en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,015	4862		5862	17	6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	Bankia	1863		2863	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Préstamos Hipotecarios en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3863	0,010	4863		5863		6863	TRIMESTRAL	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BBVA	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	

S.05.5
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2018

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 3.4.6.4.

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	

S.05.5

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
		22/02/2018	22/05/2018	22/08/2018									
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885												
Saldo inicial	0886	48.801	48.586	48.742									
Cobros del periodo	0887	5.492	5.730	6.565									
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-130	-168	-162									
Pagos por derivados	0889	0	0	0									
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-48.586	-48.742	-49.253									
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-5.496	-5.327	-5.810									
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-81	-79	-82									
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 RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

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