

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: 30/09/2018

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 RMBS 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	558.663	1001	591.464
I. Activos financieros a largo plazo	0002	558.663	1002	591.464
1. Activos titulizados	0003	558.663	1003	591.464
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	542.587	1005	573.767
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	16.140	1025	17.898
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-63	1027	-202
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	70.695	1041	73.890
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	22.993	1042	24.185
V. Activos financieros a corto plazo	0043	39.307	1043	39.342
1. Activos titulizados	0044	39.307	1044	39.342
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	36.222	1046	36.228
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	157	1065	176
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	31	1066	31
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	3.587	1067	3.633
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	78	1068	91
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-768	1069	-816
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	8.395	1085	10.362
1. Tesorería	0086	8.395	1086	10.362
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	629.359	1088	665.353

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: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	568.728	1089	605.878
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	568.728	1094	605.878
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	541.956	1095	578.402
1.1 Series no subordinadas	0096	361.956	1096	398.402
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	15.215	1101	15.919
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	-53.726	1105	-53.022
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	11.557	1108	11.557
3.1 Derivados de cobertura	0109	11.557	1109	11.557
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: 30/09/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) PASIVO CORRIENTE	0117	73.509	1117	72.307
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	67.304	1123	66.241
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	41.996	1124	41.807
1.1 Series no subordinadas	0125	39.809	1125	39.860
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	40
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	2.147	1129	1.907
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	23.934	1131	23.059
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133	0	1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134	0	1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	0	1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	126	1136	125
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	23.809	1137	22.934
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	1.371	1139	1.371
3.1 Derivados de cobertura	0140	1.371	1140	1.371
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	3	1143	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	3	1146	4
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	6.205	1148	6.066
1. Comisiones	0149	18	1149	19
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	14	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	6.188	1157	6.047
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-12.878	1158	-12.831
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-12.878	1160	-12.831
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	629.359	1162	665.353

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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	1.077	1201	1.191	2201	3.320	3201	3.878
1.1 Activos titulizados	0202	1.077	1202	1.191	2202	3.320	3202	3.878
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-404	1204	-403	2204	-1.196	3204	-1.195
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-95	1205	-94	2205	-280	3205	-280
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-295	1206	-294	2206	-875	3206	-875
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-14	1207	-15	2207	-41	3207	-40
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-288	1208	-437	2208	-909	3208	-1.430
A) MARGEN DE INTERESES	0209	385	1209	350	2209	1.215	3209	1.253
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	14	1216	3	2216	31	3216	10
7. Otros gastos de explotación	0217	-464	1217	-337	2217	-1.406	3217	-1.159
7.1 Servicios exteriores	0218	-422	1218	-292	2218	-1.278	3218	-1.024
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-422	1219	-292	2219	-1.278	3219	-1.024
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	-42	1224	-44	2224	-128	3224	-135
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-33	1225	-35	2225	-102	3225	-107
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-8	1227	-9	2227	-26	3227	-28
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	-214	1231	-1.556	2231	-1.477	3231	-4.516
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-214	1232	-1.556	2232	-1.477	3232	-4.516
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	338	1238	307	2238	933	3238	885
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-59	1239	1.232	2239	704	3239	3.526
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: 30/09/2018

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	727	1300	648	2300	2.216	3300	2.221
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	755	1301	688	2301	2.314	3301	2.345
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	1.074	1302	1.186	2302	3.351	3302	3.938
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-14	1303	-13	2303	-40	3303	-41
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	-292	1305	-470	2305	-956	3305	-1.513
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	-14	1308	-15	2308	-42	3308	-39
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-42	1309	-45	2309	-129	3309	-136
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-34	1310	-35	2310	-102	3310	-108
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-9	1312	-9	2312	-26	3312	-28
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	14	1315	5	2315	31	3315	12
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	14	1321	5	2321	31	3321	12
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-2.213	1322	-2.197	2322	-4.184	3322	-2.589
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	-1.792	1325	-1.905	2325	-2.901	3325	-1.560
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	6.165	1326	7.828	2326	19.292	3326	20.450
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	2.751	1327	1.065	2327	8.792	3327	6.875
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	710	1328	324	2328	2.315	3328	1.233
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	902	1330	1.401	2330	3.197	3330	3.860
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-12.320	1331	-12.523	2331	-36.498	3331	-33.977
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-422	1332	-292	2332	-1.282	3332	-1.030
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	-422	1336	-292	2336	-1.282	3336	-1.030
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-1.487	1337	-1.549	2337	-1.967	3337	-368
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	9.882	1338	10.738	2338	10.362	3338	9.557
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	8.395	1339	9.189	2339	8.395	3339	9.189

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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	-292	1357	-470	2357	-956	3357	-1.513
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-292	1358	-470	2358	-956	3358	-1.513
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	288	1360	437	2360	909	3360	1.430
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	3	1362	32	2362	47	3362	84
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: 30/09/2018

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	3,30	0401	12,96	0421	0,06	0441	2,16	1381	3,41	1401	12,16	1421	0,00	1441	1,76	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	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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	285	0467	118	0474	22	0481	0	0488	141	0495	35.586	0502	0	0509	35.726
De 1 a 3 meses	0461	45	0468	45	0475	9	0482	0	0489	54	0496	5.354	0503	0	0510	5.408
De 3 a 6 meses	0462	14	0469	24	0476	3	0483	2	0490	28	0497	1.765	0504	0	0511	1.793
De 6 a 9 meses	0463	3	0470	11	0477	1	0484	2	0491	14	0498	439	0505	0	0512	452
De 9 a 12 meses	0464	6	0471	28	0478	2	0485	10	0492	41	0499	957	0506	0	0513	998
Más de 12 meses	0465	106	0472	2.490	0479	72	0486	846	0493	3.409	0500	14.013	0507	0	0514	17.422
Total	0466	459	0473	2.717	0480	109	0487	860	0494	3.686	0501	58.114	0508	0	1515	61.800

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	285	0522	118	0529	22	0536	0	0543	141	0550	35.586	0557	0	0564	35.726	0571	53.022	0578	53.022	0584	67,38
De 1 a 3 meses	0516	45	0523	45	0530	9	0537	0	0544	54	0551	5.354	0558	0	0565	5.408	0572	8.131	0579	8.131	0585	66,51
De 3 a 6 meses	0517	14	0524	24	0531	3	0538	2	0545	28	0552	1.765	0559	0	0566	1.793	0573	2.694	0580	2.694	0586	66,54
De 6 a 9 meses	0518	3	0525	11	0532	1	0539	2	0546	14	0553	439	0560	0	0567	452	0574	674	0581	674	0587	67,18
De 9 a 12 meses	0519	6	0526	28	0533	2	0540	10	0547	41	0554	957	0561	0	0568	998	0575	1.307	0582	1.307	0588	76,37
Más de 12 meses	0520	106	0527	2.490	0534	72	0541	846	0548	3.409	0555	14.013	0562	0	0569	17.422	0576	21.068	0583	21.068	0589	82,69
Total	0521	459	0528	2.717	0535	109	0542	860	0549	3.686	0556	58.114	0563	0	0570	61.800	0577	86.896			0590	71,12

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: 30/09/2018

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 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	236	1600	351	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	187	1601	118	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	375	1602	276	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	866	1603	645	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	1.596	1604	1.314	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	35.308	1605	23.726	2605	241
Superior a 10 años	0606	559.968	1606	605.096	2606	1.799.759
Total	0607	598.536	1607	631.526	2607	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	16,66	1608	17,31	2608	27,35

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 05/12/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	13,38	1609	12,65	2609	1,72

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 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 05/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	435	0630	16.998	1620	353	1630	14.665	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.355	0631	119.536	1621	1.150	1631	97.594	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	2.471	0632	365.896	1622	2.499	1632	359.946	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	496	0633	96.105	1623	858	1633	159.321	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	4.757	0638	598.536	1628	4.860	1638	631.526	2628	9.884	2638	1.800.000
Media ponderada (%)	0639	68,70	0649		1639	70,52	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: 30/09/2018

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 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,75	1650	0,82	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	2,07	1651	2,10	2651	6,00
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,06	1652	0,09	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: 30/09/2018
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 05/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	215	0683	19.412	1660	227	1683	21.038	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	82	0684	7.325	1661	84	1684	7.954	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	44	0685	3.658	1662	44	1685	3.803	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	45	0686	5.390	1663	48	1686	5.931	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	37	0687	2.916	1664	37	1687	3.051	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	81	0688	6.889	1665	81	1688	7.183	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	120	0689	9.456	1666	122	1689	10.030	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	207	0690	20.917	1667	210	1690	22.278	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	516	0691	72.549	1668	526	1691	76.181	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	30	0692	1.157	1669	31	1692	1.266	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	29	0693	1.748	1670	30	1693	1.849	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	94	0694	8.645	1671	96	1694	9.052	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	2.911	0695	405.644	1672	2.972	1695	427.285	2672	6.243	2695	1.238.324
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	17	0697	1.379	1674	19	1697	1.550	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	18	0698	2.218	1675	19	1698	2.322	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	14	0699	1.438	1676	14	1699	1.485	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	194	0700	14.373	1677	195	1700	15.120	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	103	0701	13.421	1678	105	1701	14.151	2678	162	2701	31.874
Total España	0679	4.757	0702	598.536	1679	4.860	1702	631.526	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	4.757	0705	598.536	1682	4.860	1705	631.526	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: 30/09/2018

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 05/12/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,73			1710	0,71			2710	0,37		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 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 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	14.077	131.764	9.360	17.977	168.262	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	581.764	1723	18.000	1724	618.262	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: 30/09/2018

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		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	0			
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	0	0	NO	131.764	0	0	131.764	0	0			
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	0,00	0	0	NO	270.000	0	0	270.000	0	0			
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	0,00	0	0	NO	63.000	0	0	63.000	0	0			
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	0,00	0	0	NO	67.500	0	0	67.500	0	0			
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	0,18	6	0	NO	30.600	0	0	30.606	0	0			
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	1,68	34	2.147	NO	18.900	0	0	21.081	0	0			
Total						0740	40	0741	2.147	0743	581.764	0744	0	0745	583.951	0746	0

	Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,06	0748	0,06	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: 30/09/2018

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	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	12.320	804.236	0	125.437	12.523	757.580	0	125.437	0	757.580	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	0	11.422	0	0	0	11.422	0	11.422		
ES0359092055	SERIE D	0	0	14	5.889	0	0	13	5.889	0	0	13	5.889	0	5.889		
ES0359092063	SERIE E	0	0	0	4.849	0	0	0	4.849	0	0	0	4.849	0	4.849		
Total		0754	12.320	0755	1.218.236	0756	14	0757	224.176	1754	12.523	1755	1.171.580	1756	13	1757	224.123

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: 30/09/2018

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 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	22/12/2017	FCH	A-	A-	AAA
ES0359092014	SERIE A2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa2	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	04/05/2018	SYP	AAA	AA	AAA
ES0359092022	SERIE A3	22/12/2017	FCH	A-	A-	AAA
ES0359092022	SERIE A3	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa2	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	04/05/2018	SYP	AA	A+	AAA
ES0359092030	SERIE B	22/12/2017	FCH	BBB-	BBB-	AA
ES0359092030	SERIE B	29/06/2018	MDY	A1	A3	Aa1
ES0359092030	SERIE B	04/05/2018	SYP	A-	BBB+	AA
ES0359092048	SERIE C	22/12/2017	FCH	CCC	CCC	A
ES0359092048	SERIE C	29/06/2018	MDY	Ba3	B1	A1
ES0359092048	SERIE C	04/05/2018	SYP	BBB-	BB	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: 30/09/2018

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 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	22.981	1765	24.319	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	28.789	1766	29.026	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	28.489	1767	30.138	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	29.256	1768	30.175	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	30.558	1769	30.305	2769	41.891
Entre 5 y 10 años	0770	165.632	1770	165.646	2770	241.519
Superior a 10 años	0771	276.059	1771	308.653	2771	1.370.127
Total	0772	581.764	1772	618.262	2772	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	11,71	1773	12,48	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: 30/09/2018

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 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	68,80	1792	70,66	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: 30/09/2018

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 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	-12.929	-12.929		
Total							0808 -12.929	0809 -12.929	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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 05/12/2006		Situación actual 30/09/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		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: 30/09/2018

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	1.740	7006	822	7009	0,30	7012	0,14	7015	0,04		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.740	7008	822	7011	0,30	7014	0,14	7017	0,04	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	90.007	7024	98.219	7027	13,56	7030	13,99	7033	13,59		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	154	7025	154	7028	0,02	7031	0,02	7034	0,02		
Total Fallidos					7023	90.161	7026	98.372	7029	13,58	7032	14,01	7035	13,62	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 RMBS 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
SERIE E - ES0359092063	1,25	0,26	0,02	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	2,00	0,26	0,02	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359092006	25,00	7,62	7,65	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	7,50	11,60	11,36	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	10,00	39,48	39,87	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	10,00	39,48	39,87	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	3,25	3,18	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	5,26	5,15	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	10,00	39,48	39,87	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	7,62	7,65	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	10,83	10,60	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	39,48	39,87	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,26	0,02	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	7,62	7,65	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	1,75	0,26	0,02	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE B - ES0359092030	18,30	7,62	7,65	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE C - ES0359092048	13,20	7,62	7,65	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE E - ES0359092063	8,00	7,62	7,65	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE D - ES0359092055	9,40	7,62	7,65	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: 30/09/2018

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	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: 30/09/2018

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 3.4.3.2

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															

S.05.5

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

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	0	0	0					
Cobros del periodo	0887	13.841	11.977	13.104					
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-449	-500	-479					
Pagos por derivados	0889	-358	-306	-292					
Retención importe Fondo de Reserva	0890	0	0	0					
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-13.033	-11.171	-12.333					
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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2018

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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