

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: 31/03/2020

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: 31/03/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2020		Periodo anterior 31/12/2019
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	326.776	1001	332.808
I. Activos financieros a largo plazo	0002	326.776	1002	332.808
1. Activos titulizados	0003	322.632	1003	328.664
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	318.019	1005	323.849
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	4.623	1025	4.825
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-10	1027	-10
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	4.144	1029	4.144
2.1 Derivados de cobertura	0030	4.144	1030	4.144
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: 31/03/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	58.340	1041	59.317
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	5.392	1042	5.357
V. Activos financieros a corto plazo	0043	18.749	1043	19.188
1. Activos titulizados	0044	18.200	1044	18.184
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	17.358	1046	17.340
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	52	1065	59
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	9	1066	8
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	909	1067	906
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	15	1068	15
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-143	1069	-143
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	436	1071	436
2.1 Derivados de cobertura	0072	436	1072	436
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	113	1074	568
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	110	1077	565
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	3	1079	3
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	34.199	1085	34.772
1. Tesorería	0086	34.199	1086	34.772
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	385.115	1088	392.125

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: 31/03/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2020		Periodo anterior 31/12/2019
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	359.526	1089	366.558
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	359.526	1094	366.558
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	177.971	1095	184.859
1.1 Series no subordinadas	0096	177.971	1096	184.859
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	181.555	1101	181.699
2.1 Préstamo subordinado	0102	39.445	1102	39.625
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	-1.890	1105	-1.926
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

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: 31/03/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) PASIVO CORRIENTE	0117	21.121	1117	21.062
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	21.058	1123	21.024
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	18.268	1124	18.246
1.1 Series no subordinadas	0125	18.268	1125	18.246
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	0	1128	0
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	2.790	1131	2.778
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	208	1136	31
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	2.582	1137	2.747
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	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	63	1148	38
1. Comisiones	0149	11	1149	11
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	6	1150	6
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	52	1157	26
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	4.469	1158	4.506
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	4.469	1160	4.506
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	385.115	1162	392.125

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2020		Acumulado anterior 31/03/2019
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	332	1201	494	2201	332	3201	494
1.1 Activos titulizados	0202	332	1202	494	2202	332	3202	494
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-73	1204	-178	2204	-73	3204	-178
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	0	1205	-49	2205	0	3205	-49
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-66	1206	-121	2206	-66	3206	-121
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-7	1207	-8	2207	-7	3207	-8
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	112	1208	81	2208	112	3208	81
A) MARGEN DE INTERESES	0209	371	1209	397	2209	371	3209	397
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210	0	3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211	0	3211	0
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212	0	3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213	0	3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214	0	3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	3	1216	5	2216	3	3216	5
7. Otros gastos de explotación	0217	-162	1217	-97	2217	-162	3217	-97
7.1 Servicios exteriores	0218	-132	1218	-66	2218	-132	3218	-66
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-132	1219	-66	2219	-132	3219	-66
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	-30	1224	-31	2224	-30	3224	-31
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-17	1225	-17	2225	-17	3225	-17
7.3.2 Comisión administrador	0226	-9	1226	-10	2226	-9	3226	-10
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-5	1227	-5	2227	-5	3227	-5
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	-223	1231	-93	2231	-223	3231	-93
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-223	1232	-93	2232	-223	3232	-93
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	47	1238	86	2238	47	3238	86
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-36	1239	-297	2239	-36	3239	-297
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: 31/03/2020

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2020		Acumulado anterior 31/03/2019
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	146	1300	419	2300	146	3300	419
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	172	1301	445	2301	172	3301	445
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	338	1302	491	2302	338	3302	491
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	0	1303	-49	2303	0	3303	-49
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	75	1304	97	2304	75	3304	97
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	3305	0
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	-234	1307	-86	2307	-234	3307	-86
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-7	1308	-8	2308	-7	3308	-8
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-31	1309	-31	2309	-31	3309	-31
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-17	1310	-17	2310	-17	3310	-17
2.2 Comisión administrador	0311	-9	1311	-10	2311	-9	3311	-10
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	-5	2312	-5	3312	-5
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	4	1315	5	2315	4	3315	5
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	4	1321	5	2321	4	3321	5
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-718	1322	-495	2322	-718	3322	-495
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	-612	1325	-444	2325	-612	3325	-444
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	3.766	1326	3.261	2326	3.766	3326	3.261
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	2.044	1327	1.163	2327	2.044	3327	1.163
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	230	1328	141	2328	230	3328	141
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	214	1330	207	2330	214	3330	207
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-6.866	1331	-5.217	2331	-6.866	3331	-5.217
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-106	1332	-51	2332	-106	3332	-51
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	-106	1336	-51	2336	-106	3336	-51
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-573	1337	-76	2337	-573	3337	-76
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	34.772	1338	54.061	2338	34.772	3338	54.061
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	34.199	1339	53.985	2339	34.199	3339	53.985

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2020		Acumulado anterior 31/03/2019
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	75	1357	97	2357	75	3357	97
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	75	1358	97	2358	75	3358	97
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	-112	1360	-81	2360	-112	3360	-81
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	37	1362	-16	2362	37	3362	-16
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: 31/03/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/03/2020								Situación cierre anual anterior 31/12/2019								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	1,62	0401	4,32	0421	0,00	0441	2,87	1381	1,65	1401	4,19	1421	0,00	1441	2,59	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	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

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	111	0467	47	0474	7	0481	0	0488	54	0495	16.114	0502	0	0509	16.168
De 1 a 3 meses	0461	22	0468	20	0475	2	0482	0	0489	23	0496	3.315	0503	0	0510	3.337
De 3 a 6 meses	0462	5	0469	8	0476	1	0483	0	0490	9	0497	584	0504	0	0511	593
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	3	0477	0	0484	0	0491	3	0498	129	0505	0	0512	132
De 9 a 12 meses	0464	4	0471	25	0478	1	0485	2	0492	27	0499	705	0506	0	0513	732
Más de 12 meses	0465	30	0472	611	0479	13	0486	207	0493	832	0500	3.468	0507	0	0514	4.299
Total	0466	173	0473	714	0480	24	0487	209	0494	947	0501	24.315	0508	0	1515	25.261

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	111	0522	47	0529	7	0536	0	0543	54	0550	16.114	0557	0	0564	16.168	0571	23.678	0578	23.678	0584	68,28
De 1 a 3 meses	0516	22	0523	20	0530	2	0537	0	0544	23	0551	3.315	0558	0	0565	3.337	0572	4.918	0579	4.918	0585	67,85
De 3 a 6 meses	0517	5	0524	8	0531	1	0538	0	0545	9	0552	584	0559	0	0566	593	0573	845	0580	845	0586	70,16
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	3	0532	0	0539	0	0546	3	0553	129	0560	0	0567	132	0574	201	0581	201	0587	65,86
De 9 a 12 meses	0519	4	0526	25	0533	1	0540	2	0547	27	0554	705	0561	0	0568	732	0575	1.121	0582	1.121	0588	65,33
Más de 12 meses	0520	30	0527	611	0534	13	0541	207	0548	832	0555	3.468	0562	0	0569	4.299	0576	5.396	0583	5.396	0589	79,68
Total	0521	173	0528	714	0535	24	0542	209	0549	947	0556	24.315	0563	0	0570	25.261	0577	36.159			0590	69,86

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: 31/03/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0600	2	1600	5	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	0	1601	28	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	40	1602	44	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	361	1603	254	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	282	1604	296	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	7.215	1605	6.204	2605	58
Superior a 10 años	0606	333.010	1606	340.090	2606	599.942
Total	0607	340.910	1607	346.920	2607	600.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	20,41	1608	20,64	2608	29,68

Antigüedad	Situación actual 31/03/2020						Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 24/06/2010	
	Antigüedad media ponderada (años)	0609	13,05	1609	12,80	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: 31/03/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/03/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				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	94	0630	6.098	1620	88	1630	5.789	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	669	0631	77.114	1621	631	1631	73.775	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	1.424	0632	219.047	1622	1.473	1632	226.943	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	180	0633	30.364	1623	188	1633	31.824	2623	2.918	2633	567.668
100% - 120%	0624	35	0634	3.303	1624	36	1634	3.481	2624	50	2634	5.203
120% - 140%	0625	17	0635	1.834	1625	18	1635	1.925	2625	62	2635	7.514
140% - 160%	0626	9	0636	1.099	1626	9	1636	1.110	2626	43	2636	5.469
superior al 160%	0627	13	0637	2.050	1627	13	1637	2.073	2627	90	2637	14.146
Total	0628	2.441	0638	340.910	1628	2.456	1638	346.920	2628	3.163	2638	600.000
Media ponderada (%)	0639	67,95	0649		1639	68,55	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: 31/03/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 24/06/2010	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,50	1650	0,53	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	0,01	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: 31/03/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/03/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				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	270	0683	28.064	1660	273	1683	28.545	2660	351	2683	51.156
Aragón	0661	35	0684	3.902	1661	35	1684	3.945	2661	38	2684	5.717
Asturias	0662	42	0685	4.159	1662	42	1685	4.199	2662	50	2685	6.714
Baleares	0663	35	0686	5.163	1663	36	1686	5.566	2663	65	2686	12.923
Canarias	0664	44	0687	4.225	1664	45	1687	4.390	2664	60	2687	7.971
Cantabria	0665	40	0688	4.227	1665	40	1688	4.271	2665	45	2688	6.748
Castilla-León	0666	86	0689	8.249	1666	87	1689	8.516	2666	112	2689	16.110
Castilla La Mancha	0667	199	0690	20.775	1667	200	1690	21.242	2667	285	2690	42.443
Cataluña	0668	231	0691	35.090	1668	231	1691	35.429	2668	330	2691	63.316
Ceuta	0669	6	0692	513	1669	6	1692	519	2669	7	2692	900
Extremadura	0670	25	0693	1.948	1670	25	1693	1.973	2670	36	2693	4.120
Galicia	0671	104	0694	12.283	1671	105	1694	12.466	2671	126	2694	18.967
Madrid	0672	1.074	0695	180.578	1672	1.080	1695	183.397	2672	1.339	2695	305.733
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	16	0697	1.697	1674	16	1697	1.719	2674	23	2697	3.585
Navarra	0675	8	0698	957	1675	8	1698	974	2675	10	2698	1.875
La Rioja	0676	10	0699	1.287	1676	10	1699	1.300	2676	11	2699	1.834
Comunidad Valenciana	0677	180	0700	21.807	1677	181	1700	22.434	2677	234	2700	40.478
País Vasco	0678	36	0701	5.985	1678	36	1701	6.036	2678	41	2701	9.409
Total España	0679	2.441	0702	340.910	1679	2.456	1702	346.920	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	2.441	0705	340.910	1682	2.456	1705	346.920	2682	3.163	2705	600.000

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: 31/03/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/03/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 24/06/2010			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,63			1710	1,61			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: 31/03/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2020			Situación cierre anual anterior 31/12/2019			Situación inicial 24/06/2010		
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722
ES0358969006	Bono A	4.560	43.035	196.239	4.560	44.541	203.105	4.560	100.000	456.000
Total		0723 4.560		0724 196.239	1723 4.560		1724 203.105	2723 4.560		2724 456.000

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: 31/03/2020

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							
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738		0739				
ES0358969006	Bono A	NS	EURIBOR 3 m	0,40	0,00	0	0	SI	196.239	0	196.239		0				
Total						0740	0	0741	0	0743	196.239	0744	0	0745	196.239	0746	0

	Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 24/06/2010	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,03	0748	0,05	0749	0,00

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: 31/03/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2020								Situación periodo comparativo anterior 31/03/2019							
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	6.866	259.761	0	21.718	5.217	234.565	49	21.620								
Total		0754	6.866	0755	259.761	0756	0	0757	21.718	1754	5.217	1755	234.565	1756	49	1757	21.620

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: 31/03/2020

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 31/03/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 24/06/2010
				0762	0763	0764
ES0358969006	Bono A	28/01/2019	MDY	Aa2	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: 31/03/2020
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0765	65.493	1765	73.339	2765	10.044
Entre 1 y 2 años	0766	38.628	1766	41.369	2766	12.488
Entre 2 y 3 años	0767	4.792	1767	4.541	2767	12.975
Entre 3 y 4 años	0768	4.802	1768	4.555	2768	13.480
Entre 4 y 5 años	0769	4.802	1769	4.552	2769	14.006
Entre 5 y 10 años	0770	25.909	1770	23.900	2770	78.664
Superior a 10 años	0771	51.813	1771	50.849	2771	314.344
Total	0772	196.239	1772	203.105	2772	456.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	17,72	1773	17,97	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: 31/03/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 24/06/2010	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	30.000	1775	30.000	2775	60.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	30.000	1776	30.000	2776	60.000
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	15,29	1777	14,77	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	

S.05.3

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 31/03/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	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	4.580	4.580		
Total							0808 4.580	0809 4.580	0810	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 24/06/2010		Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		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: 31/03/2020

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	1.161	7006	1.201	7009	0,35	7012	0,35	7015	0,38		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.161	7008	1.201	7011	0,35	7014	0,35	7017	0,38	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	18.229	7024	18.527	7027	5,14	7030	5,13	7033	5,13		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	380	7025	380	7028	0,11	7031	0,11	7034	0,11		
Total Fallidos					7023	18.609	7026	18.907	7029	5,24	7032	5,24	7035	5,23	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		
	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: 31/03/2020

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
Bono A - ES0358969006	1,50	0,35	0,38	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	48,00	42,32	41,49	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	1,50	0,35	0,38	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	48,00	42,32	41,49	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	10,00	56,03	56,71	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	10,00	56,03	56,71	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Préstamo B	9,95	4,04	4,04	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		15,29	14,77	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 RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

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	Bankia	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 RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

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	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885	24/02/2020											
Saldo inicial	0886	30.000											
Cobros del periodo	0887	7.262											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-162											
Pagos por derivados	0889	0											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-30.000											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-6.866											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-234											
Resto pagos/retenciones	0893	0											
Saldo disponible	0894	0											
Liquidación de comisión variable	0895	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: 31/03/2020

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