

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 9724
NIF Fondo: V85981231
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2018

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	369.541	1001	380.190
I. Activos financieros a largo plazo	0002	369.541	1002	380.190
1. Activos titulizados	0003	363.580	1003	374.229
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	357.462	1005	368.182
1.3 Préstamos hipotecarios	0006	0	1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007	0	1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008	0	1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009	0	1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010	0	1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011	0	1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012	0	1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013	0	1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014	0	1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015	0	1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016	0	1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017	0	1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018	0	1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019	0	1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020	0	1020	0
1.18 Bonos de titulización	0021	0	1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022	0	1022	0
1.20 Otros	0023	0	1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024	0	1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	6.165	1025	6.117
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-47	1027	-71
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	5.961	1029	5.961
2.1 Derivados de cobertura	0030	5.961	1030	5.961
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	77.344	1041	76.976
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	5.798	1042	5.886
V. Activos financieros a corto plazo	0043	18.754	1043	18.762
1. Activos titulizados	0044	18.220	1044	18.159
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	17.424	1046	17.407
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048	0	1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049	0	1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050	0	1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051	0	1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052	0	1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053	0	1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054	0	1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055	0	1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056	0	1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057	0	1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058	0	1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060	0	1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061	0	1061	0
1.18 Bonos de titulización	0062	0	1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063	0	1063	0
1.20 Otros	0064	0	1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	73	1065	81
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	6	1066	9
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	837	1067	817
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	20	1068	23
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-140	1069	-178
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	276	1071	276
2.1 Derivados de cobertura	0072	276	1072	276
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	258	1074	326
3.1 Valores representativos de deuda	0075	0	1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076	0	1076	0
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	258	1077	326
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	52.792	1085	52.328
1. Tesorería	0086	52.792	1086	52.328
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	446.885	1088	457.166

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	419.797	1089	430.155
I. Provisiones a largo plazo	0090	0	1090	0
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	0	1092	0
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	419.797	1094	430.155
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	218.195	1095	228.968
1.1 Series no subordinadas	0096	218.195	1096	228.968
1.2 Series subordinadas	0097	0	1097	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	0	1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	201.601	1101	201.187
2.1 Préstamo subordinado	0102	60.291	1102	60.291
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	144.000	1104	144.000
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-2.690	1105	-3.104
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108	0	1108	0
3.1 Derivados de cobertura	0109	0	1109	0
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

S.01

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2018		Periodo anterior 31/12/2017
B) PASIVO CORRIENTE	0117	20.940	1117	20.837
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118	0	1118	0
V. Provisiones a corto plazo	0119	0	1119	0
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	0
2. Provisión por margen de intermediación	0121	0	1121	0
3. Otras provisiones	0122	0	1122	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	20.928	1123	20.820
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	18.281	1124	18.243
1.1 Series no subordinadas	0125	18.262	1125	18.224
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	19	1128	19
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	0	1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	2.641	1131	2.573
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133	0	1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134	0	1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	0	1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	55	1136	54
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	2.586	1137	2.519
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	0	1139	0
3.1 Derivados de cobertura	0140	0	1140	0
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	7	1143	4
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	7	1146	4
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	12	1148	16
1. Comisiones	0149	12	1149	12
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	6	1150	5
1.2 Comisión administrador	0151	4	1151	4
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	1152	2
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	1	1157	4
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	6.148	1158	6.174
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	6.148	1160	6.174
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	446.885	1162	457.166

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2018		Acumulado anterior 30/06/2017
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	474	1201	592	2201	968	3201	1.205
1.1 Activos titulizados	0202	474	1202	592	2202	968	3202	1.205
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-178	1204	-160	2204	-357	3204	-331
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-44	1205	-46	2205	-87	3205	-99
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-115	1206	-114	2206	-228	3206	-231
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-20	1207	0	2207	-42	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	103	1208	31	2208	192	3208	19
A) MARGEN DE INTERESES	0209	398	1209	463	2209	803	3209	894
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	2	1216	8	2216	4	3216	8
7. Otros gastos de explotación	0217	-165	1217	-133	2217	-294	3217	-239
7.1 Servicios exteriores	0218	-133	1218	-100	2218	-230	3218	-174
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-133	1219	-100	2219	-230	3219	-174
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-32	1224	-33	2224	-64	3224	-65
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-17	1225	-17	2225	-33	3225	-33
7.3.2 Comisión administrador	0226	-10	1226	-11	2226	-20	3226	-21
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-5	1227	-5	2227	-10	3227	-11
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	-184	1231	-775	2231	-283	3231	-1.188
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-184	1232	-775	2232	-283	3232	-1.188
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	163	1238	129	2238	185	3238	162
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-214	1239	307	2239	-414	3239	363
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2018		Acumulado anterior 30/06/2017
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	401	1300	436	2300	801	3300	865
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	431	1301	467	2301	861	3301	922
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	481	1302	603	2302	982	3302	1.231
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-42	1303	-46	2303	-87	3303	-105
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	93	1304	0	2304	166	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	-12	2305	0	3305	-38
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	-79	1307	-79	2307	-160	3307	-166
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-22	1308	0	2308	-40	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-32	1309	-32	2309	-64	3309	-65
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-17	1310	-16	2310	-33	3310	-33
2.2 Comisión administrador	0311	-10	1311	-11	2311	-20	3311	-22
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	-5	2312	-10	3312	-11
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	2	1315	2	2315	4	3315	8
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	2	1321	2	2321	4	3321	8
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	282	1322	16	2322	-338	3322	-938
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	418	1325	121	2325	-104	3325	-759
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	3.352	1326	3.316	2326	6.692	3326	6.742
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.659	1327	849	2327	3.022	3327	1.265
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	226	1328	85	2328	358	3328	51
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	466	1330	515	2330	560	3330	669
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-5.285	1331	-4.643	2331	-10.736	3331	-9.485
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-136	1332	-105	2332	-234	3332	-179
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	-136	1336	-105	2336	-234	3336	-179
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	683	1337	452	2337	464	3337	-73
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	52.108	1338	50.871	2338	52.328	3338	51.396
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	52.792	1339	51.323	2339	52.792	3339	51.323

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2018		Acumulado anterior 30/06/2017
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	93	1357	-12	2357	166	3357	-12
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	93	1358	-12	2358	166	3358	-12
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	-103	1360	-31	2360	-192	3360	-19
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	9	1362	43	2362	25	3362	31
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2018								Situación cierre anual anterior 31/12/2017								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	1,83	0401	3,50	0421	0,00	0441	1,64	1381	1,77	1401	3,33	1421	0,00	1441	1,16	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	6,00
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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	72	0467	29	0474	4	0481	0	0488	33	0495	10.810	0502	0	0509	10.843
De 1 a 3 meses	0461	9	0468	6	0475	1	0482	0	0489	7	0496	1.518	0503	0	0510	1.526
De 3 a 6 meses	0462	8	0469	18	0476	2	0483	2	0490	22	0497	1.341	0504	0	0511	1.363
De 6 a 9 meses	0463	5	0470	19	0477	1	0484	2	0491	22	0498	802	0505	0	0512	825
De 9 a 12 meses	0464	2	0471	5	0478	0	0485	1	0492	6	0499	165	0506	0	0513	171
Más de 12 meses	0465	33	0472	477	0479	17	0486	202	0493	696	0500	4.174	0507	0	0514	4.871
Total	0466	129	0473	555	0480	26	0487	207	0494	787	0501	18.810	0508	0	1515	19.597

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	72	0522	29	0529	4	0536	0	0543	33	0550	10.810	0557	0	0564	10.843	0571	15.095	0578	15.095	0584	71,83
De 1 a 3 meses	0516	9	0523	6	0530	1	0537	0	0544	7	0551	1.518	0558	0	0565	1.526	0572	2.077	0579	2.077	0585	73,45
De 3 a 6 meses	0517	8	0524	18	0531	2	0538	2	0545	22	0552	1.341	0559	0	0566	1.363	0573	1.813	0580	1.813	0586	75,17
De 6 a 9 meses	0518	5	0525	19	0532	1	0539	2	0546	22	0553	802	0560	0	0567	825	0574	1.218	0581	1.218	0587	67,72
De 9 a 12 meses	0519	2	0526	5	0533	0	0540	1	0547	6	0554	165	0561	0	0568	171	0575	237	0582	237	0588	72,25
Más de 12 meses	0520	33	0527	477	0534	17	0541	202	0548	696	0555	4.174	0562	0	0569	4.871	0576	5.874	0583	5.874	0589	82,93
Total	0521	129	0528	555	0535	26	0542	207	0549	787	0556	18.810	0563	0	0570	19.597	0577	26.312			0590	74,48

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0600	3	1600	6	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	32	1601	0	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	0	1602	41	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	23	1603	26	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	113	1604	53	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	3.910	1605	3.474	2605	58
Superior a 10 años	0606	377.807	1606	388.923	2606	599.942
Total	0607	381.888	1607	392.524	2607	600.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	22,06	1608	22,53	2608	29,68

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

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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 30/06/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 24/06/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	53	0630	3.923	1620	43	1630	3.024	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	339	0631	40.109	1621	235	1631	27.680	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	1.783	0632	279.645	1622	1.826	1632	286.812	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	268	0633	46.624	1623	347	1633	61.739	2623	2.918	2633	567.668
100% - 120%	0624	38	0634	3.786	1624	45	1634	4.502	2624	50	2634	5.203
120% - 140%	0625	29	0635	2.921	1625	35	1635	3.540	2625	62	2635	7.514
140% - 160%	0626	15	0636	1.856	1626	15	1636	1.887	2626	43	2636	5.469
superior al 160%	0627	19	0637	3.024	1627	21	1637	3.340	2627	90	2637	14.146
Total	0628	2.544	0638	381.888	1628	2.567	1638	392.524	2628	3.163	2638	600.000
Media ponderada (%)	0639	72,38	0649		1639	73,65	1649		2639	91,03	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 24/06/2010	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,54	1650	0,59	2650	2,03
Tipo de interés nominal máximo	0651	5,50	1651	5,50	2651	6,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,01	1652	0,07	2652	1,43

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 24/06/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	287	0683	32.113	1660	289	1683	32.958	2660	351	2683	51.156
Aragón	0661	35	0684	4.199	1661	35	1684	4.280	2661	38	2684	5.717
Asturias	0662	44	0685	4.593	1662	44	1685	4.667	2662	50	2685	6.714
Baleares	0663	42	0686	6.743	1663	45	1686	7.416	2663	65	2686	12.923
Canarias	0664	45	0687	4.709	1664	45	1687	4.810	2664	60	2687	7.971
Cantabria	0665	40	0688	4.579	1665	40	1688	4.663	2665	45	2688	6.748
Castilla-León	0666	91	0689	9.930	1666	92	1689	10.189	2666	112	2689	16.110
Castilla La Mancha	0667	207	0690	23.591	1667	207	1690	24.093	2667	285	2690	42.443
Cataluña	0668	243	0691	38.903	1668	245	1691	39.662	2668	330	2691	63.316
Ceuta	0669	6	0692	556	1669	6	1692	567	2669	7	2692	900
Extremadura	0670	26	0693	2.223	1670	27	1693	2.326	2670	36	2693	4.120
Galicia	0671	108	0694	13.446	1671	108	1694	13.657	2671	126	2694	18.967
Madrid	0672	1.112	0695	200.623	1672	1.124	1695	206.620	2672	1.339	2695	305.733
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	17	0697	2.015	1674	17	1697	2.060	2674	23	2697	3.585
Navarra	0675	8	0698	1.048	1675	8	1698	1.070	2675	10	2698	1.875
La Rioja	0676	10	0699	1.377	1676	10	1699	1.402	2676	11	2699	1.834
Comunidad Valenciana	0677	187	0700	24.852	1677	189	1700	25.604	2677	234	2700	40.478
País Vasco	0678	36	0701	6.389	1678	36	1701	6.481	2678	41	2701	9.409
Total España	0679	2.544	0702	381.888	1679	2.567	1702	392.524	2679	3.163	2702	600.000
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	2.544	0705	381.888	1682	2.567	1705	392.524	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: 30/06/2018
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2018				Situación cierre anual anterior 31/12/2017				Situación inicial 24/06/2010			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,54			1710	1,52			2710	1,46		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

MADRID RESIDENCIAL II -FTA

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2018			Situación cierre anual anterior 31/12/2017			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	51.855	236.457	4.560	54.209	247.193	4.560	100.000	456.000
Total		0723 4.560		0724 236.457	1723 4.560		1724 247.193	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: 30/06/2018

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado							
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738		0739				
ES0358969006	Bono A	NS	EURIBOR 3 m	0,40	0,07	19	0	SI	236.457	0	236.476		0				
Total						0740	19	0741	0	0743	236.457	0744	0	0745	236.476	0746	0

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

MADRID RESIDENCIAL II -FTA

S.05.2
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2018
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2018								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2017							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0358969006	Bono A	5.285	219.543	42	21.479	4.643	198.536	46	21.300								
Total		0754	5.285	0755	219.543	0756	42	0757	21.479	1754	4.643	1755	198.536	1756	46	1757	21.300

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2018

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

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2018

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 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0765	49.555	1765	11.815	2765	10.044
Entre 1 y 2 años	0766	50.965	1766	13.956	2766	12.488
Entre 2 y 3 años	0767	12.125	1767	14.339	2767	12.975
Entre 3 y 4 años	0768	12.343	1768	14.739	2768	13.480
Entre 4 y 5 años	0769	12.568	1769	15.151	2769	14.006
Entre 5 y 10 años	0770	65.797	1770	81.922	2770	78.664
Superior a 10 años	0771	33.106	1771	95.270	2771	314.344
Total	0772	236.457	1772	247.193	2772	456.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	12,46	1773	15,22	2773	29,41

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 24/06/2010	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	48.742	1775	48.801	2775	60.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	60.000	1776	60.000	2776	60.000
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	20,61	1777	19,74	2777	13,16
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Bankia	1778	Bankia	2778	Caja Madrid
1.4 Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781		1781		2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782		1782		2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784		1784		2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786		1786		2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787		1787		2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788		1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	N	1791	N	2791	N
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	100,00	1792	100,00	2792	100,00
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 24/06/2010		Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación inicial 24/06/2010			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		Situación actual 30/06/2018		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	2.310	7006	2.272	7009	0,61	7012	0,59	7015	0,53		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	2.310	7008	2.272	7011	0,61	7014	0,59	7017	0,53	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	20.071	7024	20.674	7027	5,05	7030	5,06	7033	5,15		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	398	7025	398	7028	0,10	7031	0,10	7034	0,10		
Total Fallidos					7023	20.469	7026	21.072	7029	5,15	7032	5,16	7035	5,24	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2018		Situación cierre anual anterior 31/12/2017		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

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
Bono A - ES0358969006	48,00	37,85	37,33	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	10,00	62,81	63,41	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	10,00	62,81	63,41	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	48,00	37,85	37,33	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	1,50	0,61	0,53	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	1,50	0,61	0,53	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Préstamo B	9,95	4,03	4,09	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		20,61	20,10	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



S.05.5

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862		2862	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados de Transmisión de Hipoteca en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,015	4862		5862	17	6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	Bankia	1863		2863	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Préstamos Hipotecarios en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3863	0,010	4863		5863		6863	TRIMESTRAL	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BBVA	1864		2864	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3864	0,005	4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2018

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Bankia
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo Adicional 3.4.6.4.

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

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
		22/02/2018	22/05/2018										
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885												
Saldo inicial	0886	48.801	48.586										
Cobros del periodo	0887	5.492	5.730										
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-130	-168										
Pagos por derivados	0889	0	0										
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-48.586	-48.742										
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-5.496	-5.327										
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-81	-79										
Resto pagos/retenciones	0893	0	0										
Saldo disponible	0894	0	0										
Liquidación de comisión variable	0895	0	0										0

S.06

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2018

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

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