

**MADRID RMBS II - Fondo de Titulización de Activos****LIQUIDACION DEL PERIODO 22/05/18 - 22/08/18**

|  | Euros                |
|--|----------------------|
| <b>I. Situación al 22/05/18:</b>                     | <b>32,75</b>         |
| Saldo Inicial Cuenta Tesorería                       | 32,75                |
| <b>II. Fondos recibidos del emisor</b>               | <b>13.117.609,72</b> |
| <b>Principal:</b>                                    |                      |
| Según calendario hasta 31/07/18:                     | 7.132.185,87         |
| Amort. Anticipada hasta 31/07/18:                    | 3.574.155,57         |
| <b>Intereses:</b>                                    | <b>1.103.483,52</b>  |
| Ingresos por inmuebles:                              | 1.307.784,76         |
| <b>III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):</b>  | <b>13.117.642,47</b> |
| <b>IV. Total intereses de la reinversión:</b>        | <b>-13.819,78</b>    |
| Intereses de la Cta. De Tesorería                    | -13.819,78           |
| <b>V. Recursos disponibles (III + IV):</b>           | <b>13.103.822,69</b> |
| <b>VI. Gastos:</b>                                   | <b>478.613,51</b>    |
| <b>VII. Liquidación SWAP:</b>                        | <b>-291.816,08</b>   |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):             | -289.744,08          |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (Banco Santander):   | -581.560,16          |
| <b>VIII. Pago a los Bonos:</b>                       | <b>12.333.333,42</b> |
| <b>Bonos A2 :</b>                                    |                      |
| Intereses correspondientes al 22/08/18:              | 0,00                 |
| Retenciones practicadas a los bonos:                 | 0,00                 |
| Amortización correspondiente al 22/08/18:            | 12.319.725,60        |
| <b>Bonos A3 :</b>                                    |                      |
| Intereses correspondientes al 22/08/18:              | 0,00                 |
| Retenciones practicadas a los bonos:                 | 0,00                 |
| Amortización correspondiente al 22/08/18:            | 0,00                 |
| <b>Bonos B:</b>                                      |                      |
| Intereses correspondientes al 22/08/18:              | 0,00                 |
| Retenciones practicadas a los bonos:                 | 0,00                 |
| Amortización correspondiente al 22/08/18:            | 0,00                 |
| <b>Bonos C:</b>                                      |                      |
| Intereses correspondientes al 22/08/18:              | 0,00                 |
| Retenciones practicadas a los bonos:                 | 0,00                 |
| Amortización correspondiente al 22/08/18:            | 0,00                 |
| <b>Bonos D:</b>                                      |                      |
| Intereses correspondientes al 22/08/18:              | 13.607,82            |
| Retenciones practicadas a los bonos:                 | 2.585,49             |
| Amortización correspondiente al 22/08/18:            | 0,00                 |
| <b>Bonos E:</b>                                      |                      |
| Intereses vencidos a 22/08/18:                       | 80.854,20            |
| Intereses pagados a 22/08/18:                        | 0,00                 |
| Retenciones practicadas a los bonos:                 | 0,00                 |
| Intereses impagados a 22/08/18:                      | 2.146.595,85         |
| Amortización correspondiente al 22/08/18:            | 0,00                 |
| <b>Reinversión o devolución de las retenciones:</b>  | <b>-2.585,49</b>     |
| <b>IX. Saldo disponible ( V - VI + VII - VIII ):</b> | <b>59,68</b>         |
| <b>Distribución del saldo disponible:</b>            |                      |
| Fondo de Reserva previo (22/05/18):                  | 0,00                 |
| Aportación al Fondo de Reserva                       | 0,00                 |
| Intereses préstamo subordinado Desfase pagados       | 0,00                 |
| Intereses préstamo subordinado G.I. pagados          | 0,00                 |
| Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada      | 0,00                 |
| Amortización préstamo subordinado Desfase            | 0,00                 |
| Amortización préstamo subordinado G.I.               | 0,00                 |
| Amortización Préstamo Participativo                  | 0,00                 |
| Otros recursos                                       | 59,68                |
| <b>Remuneración Variable Prést. Participativo</b>    | <b>0,00</b>          |
| <b>Fondo de Reserva (22/08/18):</b>                  | <b>0,00</b>          |

Destinatario: CNMV, AIAF.

**Nº: 3372/18**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.  
 Orense, 58  
 28020 Madrid  
 Tel.-917020808  
 http://www.tda-sgft.com  
 MADRID RMBS III liq.trim/Ago18

**MADRID RMBS II****INFORMACION A LOS INVERSORES****FECHA DE PAGO: 22 de Agosto de 2018**

| Importes en euros  |                         |                  |
|--|-------------------------|------------------|
| <b>I. BONOS A2 ES0359092014</b>  |                         |                  |
|  | <b>Sobre 9360 bonos</b> | <b>Por Bono</b>  |
| 1. Saldo inicial (18/12/06):   | 936.000.000,00 €        | 100.000,00 €     |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:                          | 144.083.908,80 €        | 15.393,58 €      |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:                           | 0,00 €                  | 0,00 €           |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:                            | 12.319.725,60 €         | 1.316,21 €       |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:                               | 131.764.183,20 €        | 14.077,37 €      |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento:  | 14,077370%              | 14,077370%       |
| <b>II. BONOS A3 ES0359092022</b>   |                         |                  |
|  | <b>Sobre 2700 bonos</b> | <b>Por Bono</b>  |
| 1. Saldo inicial (18/12/06):   | 270.000.000,00 €        | 100.000,00 €     |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:                          | 270.000.000,00 €        | 100.000,00 €     |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:                           | 0,00 €                  | 0,00 €           |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:                            | 0,00 €                  | 0,00 €           |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:                               | 270.000.000,00 €        | 100.000,00 €     |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento:  | 100,000000%             | 100,000000%      |
| <b>III. BONOS B ES0359092030</b>   |                         |                  |
|  | <b>Sobre 630 bonos</b>  | <b>Por Bono</b>  |
| 1. Saldo inicial (18/12/06):   | 63.000.000,00 €         | 100.000,00 €     |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:                          | 63.000.000,00 €         | 100.000,00 €     |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:                           | 0,00 €                  | 0,00 €           |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:                            | 0,00 €                  | 0,00 €           |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:                               | 63.000.000,00 €         | 100.000,00 €     |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento:  | 100,000000%             | 100,000000%      |
| <b>IV. BONOS C ES0359092048</b>  |                         |                  |
|  | <b>Sobre 675 bonos</b>  | <b>Por Bono</b>  |
| 1. Saldo inicial (18/12/06):   | 67.500.000,00 €         | 100.000,00 €     |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:                          | 67.500.000,00 €         | 100.000,00 €     |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:                           | 0,00 €                  | 0,00 €           |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:                            | 0,00 €                  | 0,00 €           |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:                               | 67.500.000,00 €         | 100.000,00 €     |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento:  | 100,000000%             | 100,000000%      |
| <b>V. BONOS D ES0359092055</b>   |                         |                  |
|  | <b>Sobre 306 bonos</b>  | <b>Por Bono</b>  |
| 1. Saldo inicial (18/12/06):   | 30.600.000,00 €         | 100.000,00 €     |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:                          | 30.600.000,00 €         | 100.000,00 €     |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:                           | 13.607,82 €             | 44,47 €          |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:                            | 0,00 €                  | 0,00 €           |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:                               | 30.600.000,00 €         | 100.000,00 €     |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento:  | 100,000000%             | 100,000000%      |
| <b>VI. BONOS E ES0359092063</b>  |                         |                  |
|  | <b>Sobre 189 bonos</b>  | <b>Por Bono</b>  |
| 1. Saldo inicial (18/12/06):   | 18.900.000,00 €         | 100.000,00 €     |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:                          | 18.900.000,00 €         | 100.000,00 €     |
| 3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:                                     | 80.854,20 €             | 427,80 €         |
| 4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:  | 0,00 €                  | 0,00 €           |
| 5. Intereses impagados en esta Fecha de Pago:                                      | 2.146.595,85 €          | 11.357,65 €      |
| 6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:                            | 0,00 €                  | 0,00 €           |
| 7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:                               | 18.900.000,00 €         | 100.000,00 €     |
| 8. Porcentaje pendiente de vencimiento:  | 100,000000%             | 100,000000%      |
| <b>VII. EL FONDO</b>   |                         |                  |
| Importes en euros  |                         |                  |
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/07/18:                               |                         |                  |
| a) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias No Fallidas: |                         | 579.741.997,35 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias Fallidas:    |                         | 84.796.995,56 €  |
| c) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias No Fallidas:       |                         | 579.882.475,74 € |
| d) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias Fallidas:          |                         | 137.754.531,65 € |
| 2. Amortización del periodo 30/04/18 a 31/07/18:                                   |                         |                  |
| a) Según calendario:   |                         | 7.132.185,87 €   |
| b) Amortización anticipada hasta 31/07/18:   |                         | 3.574.155,57 €   |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):                                   |                         |                  |
| a) Ultimo año:   |                         | 1,98%            |
| b) Ultimo semestre:  |                         | 1,96%            |
| c) Ultimo trimestre:   |                         | 2,40%            |
| 4. Porcentaje de fallidos (1):   |                         | 19,20%           |
| 5. Nivel de Impago(2):   |                         | 0,02%            |

(1) Saldo pendiente de las participaciones hipotecarias fallidas según definición del Folleto de Emisión (retraso de 6 meses y otras causas), sobre el saldo pendiente total.

(2) Importe de principal de las Participaciones Hipotecarias con morosidad superior a 90 días en la Fecha de Cobro inmediata anterior a la Fecha de Pago en curso, sobre el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias.

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF; Agencia de Calificación.



**Nº: 3373/18**

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

<http://www.tda-sgft.com>

MADRID RMBS II Infoliver.trimAgo18

**MADRID RMBS II , FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
**INFORMACION CORRESPONDIENTE AL PERÍODO: 22/05/18-22/08/18**
**I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO**

|   |   |
|---|---|
| Fecha de Constitución del Fondo   | 12 de diciembre de 2006   |
| Fecha Emisión BTH   | 12 de diciembre de 2006   |
| Fecha Final Amortización BTH (1,98% TAA)  | 24 de mayo de 2032  |
| Sociedad Gestora  | Titulización de Activos, SGFT,S.A.  |
| Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca | BANKIA (Caja Madrid)  |
| Agente de Pagos   | BNP Paribas, Sucursal en España   |
| Negociación Mercado   | Mercado AIAF  |
| Agencia de Calificación   | Moody's Investors Service/ Fitch Ibcra/Standard & Poor's  |
| Calificación  | Bonos A2: A-(sf) (F)/ Aa1(sf) (M)/ AA(sf) (S&P)<br>Bonos A3: A-(sf) (F)/ Aa1(sf) (M)/ A+(sf) (S&P)<br>Bonos B: BBB-(sf) (F)/A1(sf) (M)/ BBB+(sf) (S&P)<br>Bonos C: CCC(sf) (F)/ Ba3(sf) (M)/ BB(sf) (S&P)<br>Bonos D: CCC(sf) (F)/ C(sf) (M)/ CCC+(sf) (S&P)<br>Bonos E: CC(sf) (F)/ C(sf) (M)/ D(sf) (S&P) |

**II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO**

| Nombre                                    | Bonos de Titulización MADRID RMBS II |
|---|--------------------------------------|
| Serie A2:                                 |                                      |
| Código ISIN                               | ES0359092014                         |
| Nominal en circulación total (inicial)    | 936.000.000,00 Euros                 |
| Nominal en circulación total (actual)     | 131.764.183,20 Euros                 |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros                     |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 14.077,37 Euros                      |

## II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)

| Nombre                                    | Bonos de Titulización MADRID RMBS II |
|---|--------------------------------------|
| <b>Serie A3:</b>                          |                                      |
| Código ISIN                               | ES0359092022                         |
| Nominal en circulación total (inicial)    | 270.000.000,00 Euros                 |
| Nominal en circulación total (actual)     | 270.000.000,00 Euros                 |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros                     |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 100.000,00 Euros                     |
| <b>Serie B:</b>                           |                                      |
| Código ISIN                               | ES0359092030                         |
| Nominal en circulación total (inicial)    | 63.000.000,00 Euros                  |
| Nominal en circulación total (actual)     | 63.000.000,00 Euros                  |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros                     |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 100.000,00 Euros                     |
| <b>Serie C:</b>                           |                                      |
| Código ISIN                               | ES0359092048                         |
| Nominal en circulación total (inicial)    | 67.500.000,00 Euros                  |
| Nominal en circulación total (actual)     | 67.500.000,00 Euros                  |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros                     |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 100.000,00 Euros                     |
| <b>Serie D:</b>                           |                                      |
| Código ISIN                               | ES0359092055                         |
| Nominal en circulación total (inicial)    | 30.600.000,00 Euros                  |
| Nominal en circulación total (actual)     | 30.600.000,00 Euros                  |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros                     |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 100.000,00 Euros                     |
| <b>Serie E:</b>                           |                                      |
| Código ISIN                               | ES0359092063                         |
| Nominal en circulación total (inicial)    | 18.900.000,00 Euros                  |
| Nominal en circulación total (actual)     | 18.900.000,00 Euros                  |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros                     |
| Nominal en circulación unitario (actual)  | 100.000,00 Euros                     |

## III. INFORMACION INCLUIDA

|   |
|---|
| * Liquidación del Período: 22/05/18-22/08/18                        |
| * Flujos de Caja del Período: 22/05/18-22/08/18                     |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 22 de Agosto de 2018 |

**MADRID RMBS II***Fondo de Titulización de Activos***FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/05/18 - 22/08/18**

| <b>I. INVERSIONES/FINANCIACIONES</b>          | <b>Euros</b>         |                      |
|---|----------------------|----------------------|
|   | <u>Ingresos</u>      | <u>Pagos</u>         |
| Amortización Bonos Titulización Hip.          |                      | 12.319.725,60        |
| Amortización Participaciones Hip.             | 10.706.341,44        |                      |
| Amortización Ptmos. Subordinados              |                      | 0,00                 |
| Ingresos por inmuebles                        | 1.307.784,76         |                      |
| <b>II. INTERESES</b>                          |                      |                      |
| Intereses pagados a los BTH                   |                      | 13.607,82            |
| Intereses recibidos de las PHs                | 1.103.483,52         |                      |
| Intereses Ptmos. Subordinados                 |                      | 0,00                 |
| Intereses Inversiones Temporales              | -13.819,78           |                      |
| <b>III. GASTOS</b>                            |                      |                      |
| Comisiones y gastos periódicos:               |                      | 478.613,51           |
| Neto SWAP a favor de la Parte A (Contraparte) |                      | 291.816,08           |
| Remuneración Variable Préstamo Participativo  |                      | 0,00                 |
| <b>Total Ingresos/Pagos</b>                   | <b>13.103.789,94</b> | <b>13.103.763,01</b> |
| Saldo inicial 22/05/18                        | 32,75                |                      |
| A Inversiones Temporales                      |                      | 59,68                |
| <b>Total</b>                                  | <b>13.103.822,69</b> | <b>13.103.822,69</b> |
| Retenciones practicadas el 22/08/18           | 2.585,49             |                      |
| A Inversiones Temporales                      |                      | 2.585,49             |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 3378/18**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

<http://www.tda-sgft.com>

MADRID RMBS II\flujo.trim\Ago18