

**I. DATOS IDENTIFICATIVOS**

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS  
Número de registro del Fondo: 8591  
NIF Fondo: V84916956  
Denominación del compartimento:  
Número de registro del compartimento:  
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.  
NIF Gestora: A80352750  
Fondo Abierto: NO  
Fondo Privado: NO  
Estados agregados: NO  
Fecha: 30/06/2019

**II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA**

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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2019

| BALANCE (miles de euros)                                |      | Periodo actual<br>30/06/2019 |      | Periodo anterior<br>31/12/2018 |
|---|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>ACTIVO</b>   |      |                              |      |                                |
| <b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>                           | 0001 | 526.953                      | 1001 | 546.794                        |
| <b>I. Activos financieros a largo plazo</b>             | 0002 | 526.953                      | 1002 | 546.794                        |
| 1. Activos titulizados                                  | 0003 | 526.953                      | 1003 | 546.794                        |
| 1.1 Participaciones hipotecarias                        | 0004 | 0                            | 1004 | 0                              |
| 1.2 Certificados de transmisión hipotecaria             | 0005 | 513.183                      | 1005 | 532.400                        |
| 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 | 13.810                       | 1025 | 14.434                         |
| 1.23 Activos dudosos -intereses y otros-                | 0026 | 0                            | 1026 | 0                              |
| 1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-) | 0027 | -41                          | 1027 | -41                            |
| 1.25 Ajustes por operaciones de cobertura               | 0028 | 0                            | 1028 | 0                              |
| 2. Derivados  | 0029 | 0                            | 1029 | 0                              |
| 2.1 Derivados de cobertura                              | 0030 | 0                            | 1030 | 0                              |
| 2.2 Derivados de negociación                            | 0031 | 0                            | 1031 | 0                              |
| 3. Otros activos financieros                            | 0032 | 0                            | 1032 | 0                              |
| 3.1 Valores representativos de deuda                    | 0033 | 0                            | 1033 | 0                              |
| 3.2 Instrumentos de patrimonio                          | 0034 | 0                            | 1034 | 0                              |
| 3.3 Garantías financieras                               | 0035 | 0                            | 1035 | 0                              |
| 3.4 Otros   | 0036 | 0                            | 1036 | 0                              |
| 3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)  | 0037 | 0                            | 1037 | 0                              |
| Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía | 0038 | 0                            | 1038 | 0                              |
| <b>II. Activos por impuesto diferido</b>                | 0039 | 0                            | 1039 | 0                              |
| <b>III. Otros activos no corrientes</b>                 | 0040 | 0                            | 1040 | 0                              |

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2019

| BALANCE (miles de euros)                                   |      | Periodo actual<br>30/06/2019 |      | Periodo anterior<br>31/12/2018 |
|--|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>                                 | 0041 | 70.447                       | 1041 | 71.791                         |
| <b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>  | 0042 | 19.025                       | 1042 | 21.709                         |
| <b>V. Activos financieros a corto plazo</b>                | 0043 | 39.068                       | 1043 | 39.083                         |
| 1. Activos titulizados                                     | 0044 | 39.068                       | 1044 | 39.083                         |
| 1.1 Participaciones hipotecarias                           | 0045 | 0                            | 1045 | 0                              |
| 1.2 Certificados de transmisión hipotecaria                | 0046 | 35.964                       | 1046 | 36.078                         |
| 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 | 164                          | 1065 | 160                            |
| 1.22 Intereses vencidos e impagados                        | 0066 | 37                           | 1066 | 29                             |
| 1.23 Activos dudosos -principal-                           | 0067 | 3.521                        | 1067 | 3.429                          |
| 1.24 Activos dudosos -intereses-                           | 0068 | 65                           | 1068 | 70                             |
| 1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)    | 0069 | -683                         | 1069 | -683                           |
| 1.26 Ajustes por operaciones de cobertura                  | 0070 | 0                            | 1070 | 0                              |
| 2. Derivados   | 0071 | 0                            | 1071 | 0                              |
| 2.1 Derivados de cobertura                                 | 0072 | 0                            | 1072 | 0                              |
| 2.2 Derivados de negociación                               | 0073 | 0                            | 1073 | 0                              |
| 3. Otros activos financieros                               | 0074 | 0                            | 1074 | 0                              |
| 3.1 Valores representativos de deuda                       | 0075 | 0                            | 1075 | 0                              |
| 3.2 Instrumentos de patrimonio                             | 0076 | 0                            | 1076 | 0                              |
| 3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar                      | 0077 | 0                            | 1077 | 0                              |
| 3.4 Garantías financieras                                  | 0078 | 0                            | 1078 | 0                              |
| 3.5 Otros  | 0079 | 0                            | 1079 | 0                              |
| 3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)     | 0080 | 0                            | 1080 | 0                              |
| Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía    | 0081 |                              | 1081 |                                |
| <b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>                   | 0082 | 0                            | 1082 | 0                              |
| 1. Comisiones  | 0083 | 0                            | 1083 | 0                              |
| 2. Otros   | 0084 | 0                            | 1084 | 0                              |
| <b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b> | 0085 | 12.354                       | 1085 | 10.999                         |
| 1. Tesorería   | 0086 | 12.354                       | 1086 | 10.999                         |
| 2. Otros activos líquidos equivalentes                     | 0087 | 0                            | 1087 | 0                              |
| <b>TOTAL ACTIVO</b>  | 0088 | 597.400                      | 1088 | 618.585                        |

S.01

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2019

| BALANCE (miles de euros)                                  |      | Periodo actual<br>30/06/2019 |      | Periodo anterior<br>31/12/2018 |
|---|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>PASIVO</b>   |      |                              |      |                                |
| <b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>                             | 0089 | 536.913                      | 1089 | 556.783                        |
| <b>I. Provisiones a largo plazo</b>                       | 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                              |
| <b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>              | 0094 | 536.913                      | 1094 | 556.783                        |
| 1. Obligaciones y otros valores emitidos                  | 0095 | 510.214                      | 1095 | 530.625                        |
| 1.1 Series no subordinadas                                | 0096 | 330.214                      | 1096 | 350.625                        |
| 1.2 Series subordinadas                                   | 0097 | 180.000                      | 1097 | 180.000                        |
| 1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0098 | 0                            | 1098 | 0                              |
| 1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos             | 0099 | 0                            | 1099 | 0                              |
| 1.5 Ajustes por operaciones de cobertura                  | 0100 | 0                            | 1100 | 0                              |
| 2. Deudas con entidades de crédito                        | 0101 | 15.728                       | 1101 | 15.187                         |
| 2.1 Préstamo subordinado                                  | 0102 | 68.941                       | 1102 | 68.941                         |
| 2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta                   | 0103 | 0                            | 1103 | 0                              |
| 2.3 Otras deudas con entidades de crédito                 | 0104 | 0                            | 1104 | 0                              |
| 2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-) | 0105 | -53.212                      | 1105 | -53.754                        |
| 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 | 10.971                       | 1108 | 10.971                         |
| 3.1 Derivados de cobertura                                | 0109 | 10.971                       | 1109 | 10.971                         |
| 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                              |
| <b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>                 | 0116 | 0                            | 1116 | 0                              |

S.01

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2019

| BALANCE (miles de euros)   |      | Periodo actual<br>30/06/2019 |      | Periodo anterior<br>31/12/2018 |
|--|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>B) PASIVO CORRIENTE</b>   | 0117 | 72.667                       | 1117 | 74.037                         |
| <b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b> | 0118 | 0                            | 1118 | 0                              |
| <b>V. Provisiones a corto plazo</b>  | 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                              |
| <b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>                                     | 0123 | 65.669                       | 1123 | 67.332                         |
| 1. Obligaciones y otros valores emitidos   | 0124 | 39.526                       | 1124 | 41.775                         |
| 1.1 Series no subordinadas   | 0125 | 39.485                       | 1125 | 39.507                         |
| 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 | 41                           | 1128 | 41                             |
| 1.5 Intereses vencidos e impagados   | 0129 | 0                            | 1129 | 2.228                          |
| 1.6 Ajustes por operaciones de cobertura   | 0130 | 0                            | 1130 | 0                              |
| 2. Deudas con entidades de crédito   | 0131 | 24.816                       | 1131 | 24.230                         |
| 2.1 Préstamo subordinado   | 0132 | 0                            | 1132 | 0                              |
| 2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta  | 0133 | 0                            | 1133 | 0                              |
| 2.3 Otras deudas con entidades de crédito  | 0134 | 0                            | 1134 | 0                              |
| 2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0135 | 0                            | 1135 | 0                              |
| 2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos                                    | 0136 | 126                          | 1136 | 126                            |
| 2.6 Intereses vencidos e impagados   | 0137 | 24.690                       | 1137 | 24.105                         |
| 2.7 Ajustes por operaciones de cobertura   | 0138 | 0                            | 1138 | 0                              |
| 3. Derivados   | 0139 | 1.322                        | 1139 | 1.322                          |
| 3.1 Derivados de cobertura   | 0140 | 1.322                        | 1140 | 1.322                          |
| 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 | 5                            | 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 | 5                            | 1146 | 4                              |
| 4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0147 | 0                            | 1147 | 0                              |
| <b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>  | 0148 | 6.998                        | 1148 | 6.705                          |
| 1. Comisiones  | 0149 | 17                           | 1149 | 17                             |
| 1.1 Comisión sociedad gestora  | 0150 | 14                           | 1150 | 14                             |
| 1.2 Comisión administrador   | 0151 | 0                            | 1151 | 0                              |
| 1.3 Comisión agente financiero/pagos   | 0152 | 3                            | 1152 | 3                              |
| 1.4 Comisión variable  | 0153 | 0                            | 1153 | 0                              |
| 1.5 Otras comisiones del cedente   | 0154 | 0                            | 1154 | 0                              |
| 1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)                        | 0155 | 0                            | 1155 | 0                              |
| 1.7 Otras comisiones   | 0156 | 0                            | 1156 | 0                              |
| 2. Otros   | 0157 | 6.981                        | 1157 | 6.687                          |
| <b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>       | 0158 | -12.180                      | 1158 | -12.235                        |
| <b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>                       | 0159 | 0                            | 1159 | 0                              |
| <b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>                                      | 0160 | -12.180                      | 1160 | -12.235                        |
| <b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>                 | 0161 | 0                            | 1161 | 0                              |
| <b>TOTAL PASIVO</b>  | 0162 | 597.400                      | 1162 | 618.585                        |

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2019

| CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)                              |      | P. corriente actual (2. trimestre) |      | P. corriente anterior (2. trimestre) |      | Acumulado actual 30/06/2019 |      | Acumulado anterior 30/06/2018 |
|--|------|------------------------------------|------|--------------------------------------|------|-----------------------------|------|-------------------------------|
| <b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>                                | 0201 | 1.121                              | 1201 | 1.096                                | 2201 | 2.232                       | 3201 | 2.242                         |
| 1.1 Activos titulizados  | 0202 | 1.121                              | 1202 | 1.096                                | 2202 | 2.232                       | 3202 | 2.242                         |
| 1.2 Otros activos financieros  | 0203 | 0                                  | 1203 | 0                                    | 2203 | 0                           | 3203 | 0                             |
| <b>2. Intereses y cargas asimilados</b>                                      | 0204 | -406                               | 1204 | -398                                 | 2204 | -806                        | 3204 | -792                          |
| 2.1 Obligaciones y otros valores emitidos                                    | 0205 | -95                                | 1205 | -93                                  | 2205 | -189                        | 3205 | -185                          |
| 2.2 Deudas con entidades de crédito  | 0206 | -294                               | 1206 | -291                                 | 2206 | -585                        | 3206 | -579                          |
| 2.3 Otros pasivos financieros  | 0207 | -16                                | 1207 | -13                                  | 2207 | -31                         | 3207 | -27                           |
| <b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b> | 0208 | -346                               | 1208 | -296                                 | 2208 | -647                        | 3208 | -620                          |
| <b>A) MARGEN DE INTERESES</b>  | 0209 | 369                                | 1209 | 402                                  | 2209 | 779                         | 3209 | 830                           |
| <b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>                        | 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                             |
| <b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>                                       | 0215 | 0                                  | 1215 | 0                                    | 2215 | 0                           | 3215 | 0                             |
| <b>6. Otros ingresos de explotación</b>                                      | 0216 | 11                                 | 1216 | 5                                    | 2216 | 22                          | 3216 | 17                            |
| <b>7. Otros gastos de explotación</b>  | 0217 | -567                               | 1217 | -498                                 | 2217 | -932                        | 3217 | -942                          |
| 7.1 Servicios exteriores   | 0218 | -527                               | 1218 | -455                                 | 2218 | -851                        | 3218 | -856                          |
| 7.1.1 Servicios de profesionales independientes                              | 0219 | -527                               | 1219 | -455                                 | 2219 | -851                        | 3219 | -856                          |
| 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 | -40                                | 1224 | -43                                  | 2224 | -81                         | 3224 | -86                           |
| 7.3.1 Comisión sociedad gestora  | 0225 | -32                                | 1225 | -34                                  | 2225 | -65                         | 3225 | -68                           |
| 7.3.2 Comisión administrador   | 0226 | 0                                  | 1226 | 0                                    | 2226 | 0                           | 3226 | 0                             |
| 7.3.3 Comisión agente financiero/pagos                                       | 0227 | -8                                 | 1227 | -9                                   | 2227 | -16                         | 3227 | -17                           |
| 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                             |
| <b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>                            | 0231 | -317                               | 1231 | -346                                 | 2231 | -706                        | 3231 | -1.263                        |
| 8.1 Deterioro neto de activos titulizados                                    | 0232 | -317                               | 1232 | -346                                 | 2232 | -706                        | 3232 | -1.263                        |
| 8.2 Deterioro neto de otros activos financieros                              | 0233 | 0                                  | 1233 | 0                                    | 2233 | 0                           | 3233 | 0                             |
| <b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>                                    | 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                             |
| <b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>            | 0238 | 553                                | 1238 | 312                                  | 2238 | 1.378                       | 3238 | 595                           |
| <b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>                               | 0239 | -49                                | 1239 | 124                                  | 2239 | -541                        | 3239 | 763                           |
| <b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>                                       | 0240 | 0                                  | 1240 | 0                                    | 2240 | 0                           | 3240 | 0                             |
| <b>12. Impuesto sobre beneficios</b>   | 0241 | 0                                  | 1241 | 0                                    | 2241 | 0                           | 3241 | 0                             |
| <b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>  | 0242 | 0                                  | 1242 | 0                                    | 2242 | 0                           | 3242 | 0                             |

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2019

| ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)                                    |      | P. corriente actual (2. trimestre) |      | P. corriente anterior (2. trimestre) |      | Acumulado actual 30/06/2019 |      | Acumulado anterior 30/06/2018 |
|--|------|------------------------------------|------|--------------------------------------|------|-----------------------------|------|-------------------------------|
| <b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>                          | 0300 | 678                                | 1300 | 743                                  | 2300 | -874                        | 3300 | 1.490                         |
| <b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>                    | 0301 | 708                                | 1301 | 781                                  | 2301 | -815                        | 3301 | 1.559                         |
| 1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados                                | 0302 | 1.117                              | 1302 | 1.112                                | 2302 | 2.225                       | 3302 | 2.277                         |
| 1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos              | 0303 | -94                                | 1303 | -13                                  | 2303 | -2.417                      | 3303 | -26                           |
| 1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura                             | 0304 | 0                                  | 1304 | 0                                    | 2304 | 0                           | 3304 | 0                             |
| 1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura                              | 0305 | -301                               | 1305 | -306                                 | 2305 | -593                        | 3305 | -664                          |
| 1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros                              | 0306 | 0                                  | 1306 | 0                                    | 2306 | 0                           | 3306 | 0                             |
| 1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito                        | 0307 | 0                                  | 1307 | 0                                    | 2307 | 0                           | 3307 | 0                             |
| 1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)                                      | 0308 | -15                                | 1308 | -13                                  | 2308 | -30                         | 3308 | -27                           |
| <b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>                  | 0309 | -40                                | 1309 | -43                                  | 2309 | -81                         | 3309 | -86                           |
| 2.1 Comisión sociedad gestora  | 0310 | -32                                | 1310 | -34                                  | 2310 | -65                         | 3310 | -69                           |
| 2.2 Comisión administrador   | 0311 | 0                                  | 1311 | 0                                    | 2311 | 0                           | 3311 | 0                             |
| 2.3 Comisión agente financiero/pagos   | 0312 | -8                                 | 1312 | -9                                   | 2312 | -16                         | 3312 | -18                           |
| 2.4 Comisión variable  | 0313 | 0                                  | 1313 | 0                                    | 2313 | 0                           | 3313 | 0                             |
| 2.5 Otras comisiones   | 0314 | 0                                  | 1314 | 0                                    | 2314 | 0                           | 3314 | 0                             |
| <b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>        | 0315 | 11                                 | 1315 | 5                                    | 2315 | 22                          | 3315 | 17                            |
| 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 | 11                                 | 1321 | 5                                    | 2321 | 22                          | 3321 | 17                            |
| <b>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>                 | 0322 | 587                                | 1322 | 266                                  | 2322 | 2.229                       | 3322 | -1.971                        |
| <b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>            | 0323 | 0                                  | 1323 | 0                                    | 2323 | 0                           | 3323 | 0                             |
| <b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>                  | 0324 | 0                                  | 1324 | 0                                    | 2324 | 0                           | 3324 | 0                             |
| <b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b> | 0325 | 894                                | 1325 | 723                                  | 2325 | 2.741                       | 3325 | -1.110                        |
| 6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados                     | 0326 | 6.547                              | 1326 | 6.207                                | 2326 | 12.678                      | 3326 | 13.127                        |
| 6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados                    | 0327 | 1.931                              | 1327 | 3.789                                | 2327 | 4.568                       | 3327 | 6.041                         |
| 6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados          | 0328 | 569                                | 1328 | 679                                  | 2328 | 1.360                       | 3328 | 1.605                         |
| 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 | 1.579                              | 1330 | 1.206                                | 2330 | 4.568                       | 3330 | 2.295                         |
| 6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos              | 0331 | -9.732                             | 1331 | -11.158                              | 2331 | -20.433                     | 3331 | -24.178                       |
| <b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>                     | 0332 | -307                               | 1332 | -457                                 | 2332 | -512                        | 3332 | -861                          |
| 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 | -307                               | 1336 | -457                                 | 2336 | -512                        | 3336 | -861                          |
| <b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>              | 0337 | 1.265                              | 1337 | 1.010                                | 2337 | 1.354                       | 3337 | -481                          |
| Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo                                  | 0338 | 11.089                             | 1338 | 8.872                                | 2338 | 10.999                      | 3338 | 10.362                        |
| Efectivo o equivalentes al final del periodo                                     | 0339 | 12.354                             | 1339 | 9.882                                | 2339 | 12.354                      | 3339 | 9.882                         |

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2019

| INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)   |             | P. corriente actual (2. trimestre) |             | P. corriente anterior (2. trimestre) |             | Acumulado actual 30/06/2019 |             | Acumulado anterior 30/06/2018 |
|--|-------------|------------------------------------|-------------|--------------------------------------|-------------|-----------------------------|-------------|-------------------------------|
| <b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>  |             |                                    |             |                                      |             |                             |             |                               |
| 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                             |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>                   | <b>0356</b> | <b>0</b>                           | <b>1356</b> | <b>0</b>                             | <b>2356</b> | <b>0</b>                    | <b>3356</b> | <b>0</b>                      |
| <b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>  |             |                                    |             |                                      |             |                             |             |                               |
| 2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración  | 0357        | -301                               | 1357        | -306                                 | 2357        | -593                        | 3357        | -664                          |
| 2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración   | 0358        | -301                               | 1358        | -306                                 | 2358        | -593                        | 3358        | -664                          |
| 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        | 346                                | 1360        | 296                                  | 2360        | 647                         | 3360        | 620                           |
| 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        | -45                                | 1362        | 10                                   | 2362        | -55                         | 3362        | 44                            |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>  | <b>0363</b> | <b>0</b>                           | <b>1363</b> | <b>0</b>                             | <b>2363</b> | <b>0</b>                    | <b>3363</b> | <b>0</b>                      |
| <b>3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>   |             |                                    |             |                                      |             |                             |             |                               |
| 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                             |
| <b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>  | <b>0369</b> | <b>0</b>                           | <b>1369</b> | <b>0</b>                             | <b>2369</b> | <b>0</b>                    | <b>3369</b> | <b>0</b>                      |
| <b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>  | <b>0370</b> | <b>0</b>                           | <b>1370</b> | <b>0</b>                             | <b>2370</b> | <b>0</b>                    | <b>3370</b> | <b>0</b>                      |



Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

| Ratios (%)                                   | Situación actual 30/06/2019 |      |                 |       |                               |      |                                 |      | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |      |                 |       |                               |      |                                 |      | Hipótesis iniciales folleto/escritura |      |                 |      |                               |      |                                 |       |
|--|-----------------------------|------|-----------------|-------|-------------------------------|------|---------------------------------|------|--|------|-----------------|-------|-------------------------------|------|---------------------------------|------|---------------------------------------|------|-----------------|------|-------------------------------|------|---------------------------------|-------|
|  | Tasa de activos dudosos     |      | Tasa de fallido |       | Tasa de recuperación fallidos |      | Tasa de amortización anticipada |      | Tasa de activos dudosos                    |      | Tasa de fallido |       | Tasa de recuperación fallidos |      | Tasa de amortización anticipada |      | Tasa de activos dudosos               |      | Tasa de fallido |      | Tasa de recuperación fallidos |      | Tasa de amortización anticipada |       |
| Participaciones hipotecarias                 | 0380                        |      | 0400            |       | 0420                          |      | 0440                            |      | 1380                                       |      | 1400            |       | 1420                          |      | 1440                            |      | 2380                                  |      | 2400            |      | 2420                          |      | 2440                            |       |
| Certificados de transmisión de hipoteca      | 0381                        | 3,06 | 0401            | 13,81 | 0421                          | 0,00 | 0441                            | 1,90 | 1381                                       | 3,05 | 1401            | 13,31 | 1421                          | 0,00 | 1441                            | 2,07 | 2381                                  | 0,00 | 2401            | 0,00 | 2421                          | 0,00 | 2441                            | 17,00 |
| Préstamos hipotecarios                       | 0382                        |      | 0402            |       | 0422                          |      | 0442                            |      | 1382                                       |      | 1402            |       | 1422                          |      | 1442                            |      | 2382                                  |      | 2402            |      | 2422                          |      | 2442                            |       |
| Cédulas hipotecarias                         | 0383                        |      | 0403            |       | 0423                          |      | 0443                            |      | 1383                                       |      | 1403            |       | 1423                          |      | 1443                            |      | 2383                                  |      | 2403            |      | 2423                          |      | 2443                            |       |
| Préstamos a promotores                       | 0384                        |      | 0404            |       | 0424                          |      | 0444                            |      | 1384                                       |      | 1404            |       | 1424                          |      | 1444                            |      | 2384                                  |      | 2404            |      | 2424                          |      | 2444                            |       |
| Préstamos a PYMES                            | 0385                        |      | 0405            |       | 0425                          |      | 0445                            |      | 1385                                       |      | 1405            |       | 1425                          |      | 1445                            |      | 2385                                  |      | 2405            |      | 2425                          |      | 2445                            |       |
| Préstamos a empresas                         | 0386                        |      | 0406            |       | 0426                          |      | 0446                            |      | 1386                                       |      | 1406            |       | 1426                          |      | 1446                            |      | 2386                                  |      | 2406            |      | 2426                          |      | 2446                            |       |
| Préstamos corporativos                       | 0387                        |      | 0407            |       | 0427                          |      | 0447                            |      | 1387                                       |      | 1407            |       | 1427                          |      | 1447                            |      | 2387                                  |      | 2407            |      | 2427                          |      | 2447                            |       |
| Cédulas territoriales                        | 0388                        |      | 0408            |       | 0428                          |      | 0448                            |      | 1388                                       |      | 1408            |       | 1428                          |      | 1448                            |      | 2388                                  |      | 2408            |      | 2428                          |      | 2448                            |       |
| Bonos de tesorería                           | 0389                        |      | 0409            |       | 0429                          |      | 0449                            |      | 1389                                       |      | 1409            |       | 1429                          |      | 1449                            |      | 2389                                  |      | 2409            |      | 2429                          |      | 2449                            |       |
| Deuda subordinada                            | 0390                        |      | 0410            |       | 0430                          |      | 0450                            |      | 1390                                       |      | 1410            |       | 1430                          |      | 1450                            |      | 2390                                  |      | 2410            |      | 2430                          |      | 2450                            |       |
| Créditos AAPP                                | 0391                        |      | 0411            |       | 0431                          |      | 0451                            |      | 1391                                       |      | 1411            |       | 1431                          |      | 1451                            |      | 2391                                  |      | 2411            |      | 2431                          |      | 2451                            |       |
| Préstamos consumo                            | 0392                        |      | 0412            |       | 0432                          |      | 0452                            |      | 1392                                       |      | 1412            |       | 1432                          |      | 1452                            |      | 2392                                  |      | 2412            |      | 2432                          |      | 2452                            |       |
| Préstamos automoción                         | 0393                        |      | 0413            |       | 0433                          |      | 0453                            |      | 1393                                       |      | 1413            |       | 1433                          |      | 1453                            |      | 2393                                  |      | 2413            |      | 2433                          |      | 2453                            |       |
| Cuotas de arrendamiento financiero (leasing) | 0394                        |      | 0414            |       | 0434                          |      | 0454                            |      | 1394                                       |      | 1414            |       | 1434                          |      | 1454                            |      | 2394                                  |      | 2414            |      | 2434                          |      | 2454                            |       |
| Cuentas a cobrar                             | 0395                        |      | 0415            |       | 0435                          |      | 0455                            |      | 1395                                       |      | 1415            |       | 1435                          |      | 1455                            |      | 2395                                  |      | 2415            |      | 2435                          |      | 2455                            |       |
| Derechos de crédito futuros                  | 0396                        |      | 0416            |       | 0436                          |      | 0456                            |      | 1396                                       |      | 1416            |       | 1436                          |      | 1456                            |      | 2396                                  |      | 2416            |      | 2436                          |      | 2456                            |       |
| Bonos de titulización                        | 0397                        |      | 0417            |       | 0437                          |      | 0457                            |      | 1397                                       |      | 1417            |       | 1437                          |      | 1457                            |      | 2397                                  |      | 2417            |      | 2437                          |      | 2457                            |       |
| Cédulas internacionalización                 | 0398                        |      | 0418            |       | 0438                          |      | 0458                            |      | 1398                                       |      | 1418            |       | 1438                          |      | 1458                            |      | 2398                                  |      | 2418            |      | 2438                          |      | 2458                            |       |
| Otros  | 0399                        |      | 0419            |       | 0439                          |      | 0459                            |      | 1399                                       |      | 1419            |       | 1439                          |      | 1459                            |      | 2399                                  |      | 2419            |      | 2439                          |      | 2459                            |       |

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2019

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          | 305        | 0467                        | 127          | 0474                                 | 24         | 0481                                    | 0          | 0488  | 150          | 0495                           | 36.469        | 0502           | 0        | 0509        | 36.619        |
| De 1 a 3 meses                   | 0461          | 58         | 0468                        | 64           | 0475                                 | 13         | 0482                                    | 0          | 0489  | 77           | 0496                           | 7.851         | 0503           | 0        | 0510        | 7.927         |
| De 3 a 6 meses                   | 0462          | 13         | 0469                        | 28           | 0476                                 | 4          | 0483                                    | 2          | 0490  | 34           | 0497                           | 1.320         | 0504           | 0        | 0511        | 1.354         |
| De 6 a 9 meses                   | 0463          | 7          | 0470                        | 23           | 0477                                 | 1          | 0484                                    | 2          | 0491  | 26           | 0498                           | 1.203         | 0505           | 0        | 0512        | 1.229         |
| De 9 a 12 meses                  | 0464          | 2          | 0471                        | 8            | 0478                                 | 0          | 0485                                    | 1          | 0492  | 9            | 0499                           | 116           | 0506           | 0        | 0513        | 125           |
| Más de 12 meses                  | 0465          | 95         | 0472                        | 2.518        | 0479                                 | 60         | 0486                                    | 792        | 0493  | 3.370        | 0500                           | 12.116        | 0507           | 0        | 0514        | 15.486        |
| <b>Total</b>                     | 0466          | <b>480</b> | 0473                        | <b>2.766</b> | 0480                                 | <b>102</b> | 0487                                    | <b>798</b> | 0494  | <b>3.666</b> | 0501                           | <b>59.075</b> | 0508           | <b>0</b> | 1515        | <b>62.741</b> |

| 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          | 305        | 0522                        | 127          | 0529                                 | 24         | 0536                                    | 0          | 0543  | 150          | 0550                           | 36.469        | 0557           | 0        | 0564        | 36.619        | 0571           | 56.834        | 0578                                 | 56.834 | 0584                  | 64,43        |
| De 1 a 3 meses                               | 0516          | 58         | 0523                        | 64           | 0530                                 | 13         | 0537                                    | 0          | 0544  | 77           | 0551                           | 7.851         | 0558           | 0        | 0565        | 7.927         | 0572           | 11.944        | 0579                                 | 11.944 | 0585                  | 66,37        |
| De 3 a 6 meses                               | 0517          | 13         | 0524                        | 28           | 0531                                 | 4          | 0538                                    | 2          | 0545  | 34           | 0552                           | 1.320         | 0559           | 0        | 0566        | 1.354         | 0573           | 2.218         | 0580                                 | 2.218  | 0586                  | 61,06        |
| De 6 a 9 meses                               | 0518          | 7          | 0525                        | 23           | 0532                                 | 1          | 0539                                    | 2          | 0546  | 26           | 0553                           | 1.203         | 0560           | 0        | 0567        | 1.229         | 0574           | 1.601         | 0581                                 | 1.601  | 0587                  | 76,79        |
| De 9 a 12 meses                              | 0519          | 2          | 0526                        | 8            | 0533                                 | 0          | 0540                                    | 1          | 0547  | 9            | 0554                           | 116           | 0561           | 0        | 0568        | 125           | 0575           | 248           | 0582                                 | 248    | 0588                  | 50,51        |
| Más de 12 meses                              | 0520          | 95         | 0527                        | 2.518        | 0534                                 | 60         | 0541                                    | 792        | 0548  | 3.370        | 0555                           | 12.116        | 0562           | 0        | 0569        | 15.486        | 0576           | 18.975        | 0583                                 | 18.975 | 0589                  | 81,61        |
| <b>Total</b>                                 | 0521          | <b>480</b> | 0528                        | <b>2.766</b> | 0535                                 | <b>102</b> | 0542                                    | <b>798</b> | 0549  | <b>3.666</b> | 0556                           | <b>59.075</b> | 0563           | <b>0</b> | 0570        | <b>62.741</b> | 0577           | <b>91.818</b> |                                      |        | 0590                  | <b>68,33</b> |

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2019

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 30/06/2019 |                | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |                | Situación inicial 05/12/2006 |                  |
| Inferior a 1 año  | 0600                        | 164            | 1600                                       | 134            | 2600                         | 0                |
| Entre 1 y 2 años  | 0601                        | 250            | 1601                                       | 211            | 2601                         | 0                |
| Entre 2 y 3 años  | 0602                        | 519            | 1602                                       | 444            | 2602                         | 0                |
| Entre 3 y 4 años  | 0603                        | 1.081          | 1603                                       | 911            | 2603                         | 0                |
| Entre 4 y 5 años  | 0604                        | 1.984          | 1604                                       | 1.861          | 2604                         | 0                |
| Entre 5 y 10 años   | 0605                        | 51.497         | 1605                                       | 40.756         | 2605                         | 241              |
| Superior a 10 años  | 0606                        | 510.983        | 1606                                       | 542.026        | 2606                         | 1.799.759        |
| <b>Total</b>  | 0607                        | <b>566.479</b> | 1607                                       | <b>586.342</b> | 2607                         | <b>1.800.000</b> |
| <b>Vida residual media ponderada (años)</b>               | 0608                        | <b>16,00</b>   | 1608                                       | <b>16,44</b>   | 2608                         | <b>27,35</b>     |

| Antigüedad                        | Situación actual 30/06/2019                |       |                              |       |      |      |
|-----------------------------------|--|-------|------------------------------|-------|------|------|
|                                   | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |       | Situación inicial 05/12/2006 |       |      |      |
| Antigüedad media ponderada (años) | 0609                                       | 14,12 | 1609                         | 13,62 | 2609 | 1,72 |

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2019

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 30/06/2019 |              |                     |                | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |              |                     |                | Situación inicial 05/12/2006 |              |                     |                  |
|---|-----------------------------|--------------|---------------------|----------------|--|--------------|---------------------|----------------|------------------------------|--------------|---------------------|------------------|
|   | Nº de activos vivos         |              | Principal pendiente |                | Nº de activos vivos                        |              | Principal pendiente |                | Nº de activos vivos          |              | Principal pendiente |                  |
| 0% - 40%  | 0620                        | 524          | 0630                | 20.354         | 1620                                       | 470          | 1630                | 18.692         | 2620                         | 0            | 2630                | 0                |
| 40% - 60%   | 0621                        | 1.577        | 0631                | 145.388        | 1621                                       | 1.430        | 1631                | 129.009        | 2621                         | 0            | 2631                | 0                |
| 60% - 80%   | 0622                        | 2.213        | 0632                | 334.167        | 1622                                       | 2.380        | 1632                | 353.933        | 2622                         | 0            | 2632                | 0                |
| 80% - 100%  | 0623                        | 333          | 0633                | 66.569         | 1623                                       | 430          | 1633                | 84.709         | 2623                         | 9.439        | 2633                | 1.699.335        |
| 100% - 120%   | 0624                        | 0            | 0634                | 0              | 1624                                       | 0            | 1634                | 0              | 2624                         | 445          | 2634                | 100.665          |
| 120% - 140%   | 0625                        | 0            | 0635                | 0              | 1625                                       | 0            | 1635                | 0              | 2625                         | 0            | 2635                | 0                |
| 140% - 160%   | 0626                        | 0            | 0636                | 0              | 1626                                       | 0            | 1636                | 0              | 2626                         | 0            | 2636                | 0                |
| superior al 160%  | 0627                        | 0            | 0637                | 0              | 1627                                       | 0            | 1637                | 0              | 2627                         | 0            | 2637                | 0                |
| <b>Total</b>  | 0628                        | <b>4.647</b> | 0638                | <b>566.479</b> | 1628                                       | <b>4.710</b> | 1638                | <b>586.342</b> | 2628                         | <b>9.884</b> | 2638                | <b>1.800.000</b> |
| <b>Media ponderada (%)</b>  | 0639                        | <b>66,79</b> | 0649                |                | 1639                                       | <b>68,04</b> | 1649                |                | 2639                         | <b>94,44</b> | 2649                |                  |

S.05.1

**Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA**

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/06/2019**

**Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA**

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

| Tipos de interés de los activos titulizados (%) | Situación actual<br>30/06/2019 |      | Situación cierre anual anterior<br>31/12/2018 |      | Situación inicial 05/12/2006 |      |
|---|--------------------------------|------|---|------|------------------------------|------|
|   |                                |      |   |      |                              |      |
| Tipo de interés medio ponderado                 | 0650                           | 0,76 | 1650  | 0,74 | 2650                         | 4,60 |
| Tipo de interés nominal máximo                  | 0651                           | 2,50 | 1651  | 2,07 | 2651                         | 6,00 |
| Tipo de interés nominal mínimo                  | 0652                           | 0,10 | 1652  | 0,06 | 2652                         | 2,70 |

|  |
|--|
| <b>S.05.1</b>  |
| <b>Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA</b>                         |
| <b>Denominación del compartimento:</b>                                 |
| <b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b> |
| <b>Estados agregados: NO</b>   |
| <b>Fecha: 30/06/2019</b>   |
| <b>Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA</b>           |

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO F**

| Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros) | Situación actual 30/06/2019 |              |                     |                | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |              |                     |                | Situación inicial 05/12/2006 |              |                     |                  |
|--|-----------------------------|--------------|---------------------|----------------|--|--------------|---------------------|----------------|------------------------------|--------------|---------------------|------------------|
|  | Nº de activos vivos         |              | Principal pendiente |                | Nº de activos vivos                        |              | Principal pendiente |                | Nº de activos vivos          |              | Principal pendiente |                  |
| Andalucía  | 0660                        | 208          | 0683                | 18.144         | 1660                                       | 213          | 1683                | 19.050         | 2660                         | 413          | 2683                | 55.364           |
| Aragón   | 0661                        | 79           | 0684                | 6.963          | 1661                                       | 82           | 1684                | 7.209          | 2661                         | 176          | 2684                | 26.730           |
| Asturias   | 0662                        | 43           | 0685                | 3.449          | 1662                                       | 44           | 1685                | 3.609          | 2662                         | 71           | 2685                | 8.457            |
| Baleares   | 0663                        | 43           | 0686                | 4.966          | 1663                                       | 43           | 1686                | 5.142          | 2663                         | 73           | 2686                | 12.511           |
| Canarias   | 0664                        | 35           | 0687                | 2.730          | 1664                                       | 37           | 1687                | 2.871          | 2664                         | 84           | 2687                | 10.967           |
| Cantabria  | 0665                        | 79           | 0688                | 6.282          | 1665                                       | 81           | 1688                | 6.768          | 2665                         | 129          | 2688                | 18.240           |
| Castilla-León  | 0666                        | 117          | 0689                | 8.787          | 1666                                       | 117          | 1689                | 9.080          | 2666                         | 212          | 2689                | 27.344           |
| Castilla La Mancha   | 0667                        | 204          | 0690                | 19.985         | 1667                                       | 207          | 1690                | 20.629         | 2667                         | 489          | 2690                | 75.861           |
| Cataluña   | 0668                        | 504          | 0691                | 69.077         | 1668                                       | 510          | 1691                | 71.297         | 2668                         | 968          | 2691                | 187.210          |
| Ceuta  | 0669                        | 30           | 0692                | 1.069          | 1669                                       | 30           | 1692                | 1.128          | 2669                         | 59           | 2692                | 4.472            |
| Extremadura  | 0670                        | 26           | 0693                | 1.525          | 1670                                       | 29           | 1693                | 1.715          | 2670                         | 39           | 2693                | 3.661            |
| Galicia  | 0671                        | 94           | 0694                | 8.317          | 1671                                       | 94           | 1694                | 8.535          | 2671                         | 128          | 2694                | 17.541           |
| Madrid   | 0672                        | 2.846        | 0695                | 384.326        | 1672                                       | 2.877        | 1695                | 396.989        | 2672                         | 6.243        | 2695                | 1.238.324        |
| Melilla  | 0673                        | 0            | 0696                | 0              | 1673                                       | 0            | 1696                | 0              | 2673                         | 0            | 2696                | 0                |
| Murcia   | 0674                        | 17           | 0697                | 1.316          | 1674                                       | 17           | 1697                | 1.358          | 2674                         | 63           | 2697                | 8.031            |
| Navarra  | 0675                        | 18           | 0698                | 2.152          | 1675                                       | 18           | 1698                | 2.197          | 2675                         | 45           | 2698                | 7.831            |
| La Rioja   | 0676                        | 14           | 0699                | 1.388          | 1676                                       | 14           | 1699                | 1.421          | 2676                         | 48           | 2699                | 7.344            |
| Comunidad Valenciana   | 0677                        | 190          | 0700                | 13.333         | 1677                                       | 194          | 1700                | 14.127         | 2677                         | 482          | 2700                | 58.238           |
| País Vasco   | 0678                        | 100          | 0701                | 12.670         | 1678                                       | 103          | 1701                | 13.217         | 2678                         | 162          | 2701                | 31.874           |
| <b>Total España</b>  | 0679                        | <b>4.647</b> | 0702                | <b>566.479</b> | 1679                                       | <b>4.710</b> | 1702                | <b>586.342</b> | 2679                         | <b>9.884</b> | 2702                | <b>1.800.000</b> |
| 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                |
| <b>Total general</b>   | 0682                        | <b>4.647</b> | 0705                | <b>566.479</b> | 1682                                       | <b>4.710</b> | 1705                | <b>586.342</b> | 2682                         | <b>9.884</b> | 2705                | <b>1.800.000</b> |

|  |
|--|
| <b>S.05.1</b>  |
| <b>Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA</b>                         |
| <b>Denominación del compartimento:</b>                                 |
| <b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b> |
| <b>Estados agregados: NO</b>   |
| <b>Fecha: 30/06/2019</b>   |
| <b>Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA</b>           |

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

| Concentración   | Situación actual 30/06/2019 |      |      |  | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |      |      |  | Situación inicial 05/12/2006 |      |      |  |
|---|-----------------------------|------|------|--|--|------|------|--|------------------------------|------|------|--|
|   | Porcentaje                  |      | CNAE |  | Porcentaje                                 |      | CNAE |  | Porcentaje                   |      | CNAE |  |
| Diez primeros deudores/emisores con más concentración | 0710                        | 0,77 |      |  | 1710                                       | 0,74 |      |  | 2710                         | 0,37 |      |  |
| Sector  | 0711                        |      | 0712 |  | 1711                                       |      | 1712 |  | 2711                         |      | 2712 |  |

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Período de la declaración: 30/06/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

| (miles de euros) |                    | Situación actual 30/06/2019 |                              |                     | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |                              |                     | Situación inicial 05/12/2006 |                              |                     |        |      |           |
|------------------|--------------------|-----------------------------|------------------------------|---------------------|--|------------------------------|---------------------|------------------------------|------------------------------|---------------------|--------|------|-----------|
| Serie            | Denominación serie | Nº de pasivos emitidos      |                              | Principal pendiente | Nº de pasivos emitidos                     |                              | Principal pendiente | Nº de pasivos emitidos       |                              | Principal pendiente |        |      |           |
|                  |                    | 0720                        | Nominal unitario (€)<br>0721 | 0722                | 1720                                       | Nominal unitario (€)<br>1721 | 1722                | 2720                         | Nominal unitario (€)<br>2721 | 2722                |        |      |           |
| ES0359092006     | SERIE A1           | 4.140                       | 0                            | 0                   | 4.140                                      | 0                            | 0                   | 4.140                        | 100.000                      | 414.000             |        |      |           |
| ES0359092014     | SERIE A2           | 9.360                       | 10.652                       | 99.699              | 9.360                                      | 12.835                       | 120.132             | 9.360                        | 100.000                      | 936.000             |        |      |           |
| ES0359092022     | SERIE A3           | 2.700                       | 100.000                      | 270.000             | 2.700                                      | 100.000                      | 270.000             | 2.700                        | 100.000                      | 270.000             |        |      |           |
| ES0359092030     | SERIE B            | 630                         | 100.000                      | 63.000              | 630  | 100.000                      | 63.000              | 630                          | 100.000                      | 63.000              |        |      |           |
| ES0359092048     | SERIE C            | 675                         | 100.000                      | 67.500              | 675  | 100.000                      | 67.500              | 675                          | 100.000                      | 67.500              |        |      |           |
| ES0359092055     | SERIE D            | 306                         | 100.000                      | 30.600              | 306  | 100.000                      | 30.600              | 306                          | 100.000                      | 30.600              |        |      |           |
| ES0359092063     | SERIE E            | 189                         | 100.000                      | 18.900              | 189  | 100.000                      | 18.900              | 189                          | 100.000                      | 18.900              |        |      |           |
| <b>Total</b>     |                    | 0723                        | 18.000                       | 0724                | 549.699                                    | 1723                         | 18.000              | 1724                         | 570.132                      | 2723                | 18.000 | 2724 | 1.800.000 |



Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2019

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               |   |      |         |      |   |
| ES0359092006     | SERIE A1           | NS                     | EURIBOR 3 m          | 0,08   | 0,00          | 0                    | 0                   | NO                                    | 0                    | 0               | 0   | 0                  |   |      |         |      |   |
| ES0359092014     | SERIE A2           | NS                     | EURIBOR 3 m          | 0,15   | 0,00          | 0                    | 0                   | NO                                    | 99.699               | 0               | 99.699  | 0                  |   |      |         |      |   |
| ES0359092022     | SERIE A3           | NS                     | EURIBOR 3 m          | 0,19   | 0,00          | 0                    | 0                   | NO                                    | 270.000              | 0               | 270.000   | 0                  |   |      |         |      |   |
| ES0359092030     | SERIE B            | S                      | EURIBOR 3 m          | 0,25   | 0,00          | 0                    | 0                   | NO                                    | 63.000               | 0               | 63.000  | 0                  |   |      |         |      |   |
| ES0359092048     | SERIE C            | S                      | EURIBOR 3 m          | 0,30   | 0,00          | 0                    | 0                   | NO                                    | 67.500               | 0               | 67.500  | 0                  |   |      |         |      |   |
| ES0359092055     | SERIE D            | S                      | EURIBOR 3 m          | 0,50   | 0,19          | 6                    | 0                   | NO                                    | 30.600               | 0               | 30.606  | 0                  |   |      |         |      |   |
| ES0359092063     | SERIE E            | S                      | EURIBOR 3 m          | 2,00   | 1,69          | 35                   | 0                   | NO                                    | 18.900               | 0               | 18.935  | 0                  |   |      |         |      |   |
| <b>Total</b>     |                    |                        |                      |        |               | 0740                 | 41                  | 0741                                  | 0                    | 0743            | 549.699   | 0744               | 0 | 0745 | 549.739 | 0746 | 0 |

|  | Situación actual 30/06/2019 |      | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |      | Situación inicial 05/12/2006 |      |
|--|-----------------------------|------|--|------|------------------------------|------|
| Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%) | 0747                        | 0,07 | 0748                                       | 0,06 | 0749                         | 0,00 |

|  |
|--|
| <b>S.05.2</b>  |
| <b>Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA</b>                         |
| <b>Denominación del compartimento:</b>                                 |
| <b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b> |
| <b>Estados agregados: NO</b>   |
| <b>Periodo de la declaración: 30/06/2019</b>                           |
| <b>Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF</b>            |

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO C**

| (miles de euros) |                    | Situación actual 30/06/2019 |         |                  |           |                   |         |                  |         | Situación periodo comparativo anterior 30/06/2018 |         |                  |           |                   |         |                  |         |
|------------------|--------------------|-----------------------------|---------|------------------|-----------|-------------------|---------|------------------|---------|---|---------|------------------|-----------|-------------------|---------|------------------|---------|
| Serie            | Denominación serie | Amortización principal      |         |                  |           | Intereses         |         |                  |         | Amortización principal                            |         |                  |           | Intereses         |         |                  |         |
|                  |                    | Pagos del periodo           |         | Pagos acumulados |           | Pagos del periodo |         | Pagos acumulados |         | Pagos del periodo                                 |         | Pagos acumulados |           | Pagos del periodo |         | Pagos acumulados |         |
|                  |                    | 0750                        | 0751    | 0752             | 0753      | 1750              | 1751    | 1752             | 1753    |   |         |                  |           |                   |         |                  |         |
| ES0359092006     | SERIE A1           | 0                           | 414.000 | 0                | 23.408    | 0                 | 414.000 | 0                | 23.408  | 0   | 414.000 | 0                | 23.408    | 0                 | 23.408  |                  |         |
| ES0359092014     | SERIE A2           | 9.732                       | 836.301 | 0                | 125.437   | 11.158            | 791.916 | 0                | 125.437 | 0   | 791.916 | 0                | 125.437   | 0                 | 125.437 |                  |         |
| ES0359092022     | SERIE A3           | 0                           | 0       | 0                | 42.820    | 0                 | 0       | 0                | 42.820  | 0   | 0       | 0                | 42.820    | 0                 | 42.820  |                  |         |
| ES0359092030     | SERIE B            | 0                           | 0       | 0                | 10.352    | 0                 | 0       | 0                | 10.352  | 0   | 0       | 0                | 10.352    | 0                 | 10.352  |                  |         |
| ES0359092048     | SERIE C            | 0                           | 0       | 0                | 11.422    | 0                 | 0       | 0                | 11.422  | 0   | 0       | 0                | 11.422    | 0                 | 11.422  |                  |         |
| ES0359092055     | SERIE D            | 0                           | 0       | 15               | 5.932     | 0                 | 0       | 13               | 5.932   | 0   | 0       | 13               | 5.932     | 0                 | 5.875   |                  |         |
| ES0359092063     | SERIE E            | 0                           | 0       | 79               | 7.237     | 0                 | 0       | 0                | 7.237   | 0   | 0       | 0                | 7.237     | 0                 | 4.849   |                  |         |
| <b>Total</b>     |                    | 0754                        | 9.732   | 0755             | 1.250.301 | 0756              | 94      | 0757             | 226.607 | 1754  | 11.158  | 1755             | 1.205.916 | 1756              | 13      | 1757             | 224.162 |

**Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA**

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Periodo de la declaración: 30/06/2019**

**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 30/06/2019 | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 | Situación inicial 05/12/2006 |
|              |                    |  |  | 0760                        | 0761                                       | 0762                         |
| ES0359092006 | SERIE A1           | 12/12/2006                                     | FCH                                    | AAA                         | AAA  | AAA                          |
| ES0359092006 | SERIE A1           | 12/12/2006                                     | MDY                                    | Aaa                         | Aaa  | Aaa                          |
| ES0359092006 | SERIE A1           | 12/12/2006                                     | SYP                                    | AAA                         | AAA  | AAA                          |
| ES0359092014 | SERIE A2           | 22/12/2017                                     | FCH                                    | A-                          | A-   | AAA                          |
| ES0359092014 | SERIE A2           | 25/04/2018                                     | MDY                                    | Aa1                         | Aa1  | Aaa                          |
| ES0359092014 | SERIE A2           | 04/05/2018                                     | SYP                                    | AAA                         | AAA  | AAA                          |
| ES0359092022 | SERIE A3           | 22/12/2017                                     | FCH                                    | A-                          | A-   | AAA                          |
| ES0359092022 | SERIE A3           | 25/04/2018                                     | MDY                                    | Aa1                         | Aa1  | Aaa                          |
| ES0359092022 | SERIE A3           | 04/05/2018                                     | SYP                                    | AA                          | AA   | AAA                          |
| ES0359092030 | SERIE B            | 22/12/2017                                     | FCH                                    | BBB-                        | BBB-                                       | AA                           |
| ES0359092030 | SERIE B            | 29/06/2018                                     | MDY                                    | A1                          | A1   | Aa1                          |
| ES0359092030 | SERIE B            | 28/05/2019                                     | SYP                                    | AA-                         | A-   | AA                           |
| ES0359092048 | SERIE C            | 29/11/2018                                     | FCH                                    | B+                          | B+   | A                            |
| ES0359092048 | SERIE C            | 29/06/2018                                     | MDY                                    | Ba3                         | Ba3  | A1                           |
| ES0359092048 | SERIE C            | 28/05/2019                                     | SYP                                    | BBB                         | BBB-                                       | A                            |
| ES0359092055 | SERIE D            | 18/03/2009                                     | FCH                                    | CCC                         | CCC  | BBB                          |
| ES0359092055 | SERIE D            | 11/09/2009                                     | MDY                                    | C                           | C  | Baa2                         |
| ES0359092055 | SERIE D            | 28/05/2019                                     | SYP                                    | B-                          | CCC+                                       | BBB                          |
| ES0359092063 | SERIE E            | 18/03/2009                                     | FCH                                    | CC                          | CC   | BB+                          |
| ES0359092063 | SERIE E            | 11/09/2009                                     | MDY                                    | C                           | C  | Ba1                          |
| ES0359092063 | SERIE E            | 20/03/2013                                     | SYP                                    | D                           | D  | BB                           |

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2019

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 30/06/2019 |                | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |                | Situación inicial 05/12/2006 |                  |
| Inferior a 1 año   | 0765                        | 20.593         | 1765                                       | 24.740         | 2765                         | 31.918           |
| Entre 1 y 2 años   | 0766                        | 26.822         | 1766                                       | 26.868         | 2766                         | 36.413           |
| Entre 2 y 3 años   | 0767                        | 28.070         | 1767                                       | 28.035         | 2767                         | 38.154           |
| Entre 3 y 4 años   | 0768                        | 31.607         | 1768                                       | 29.306         | 2768                         | 39.979           |
| Entre 4 y 5 años   | 0769                        | 28.324         | 1769                                       | 30.579         | 2769                         | 41.891           |
| Entre 5 y 10 años  | 0770                        | 168.483        | 1770                                       | 165.409        | 2770                         | 241.519          |
| Superior a 10 años   | 0771                        | 245.799        | 1771                                       | 265.194        | 2771                         | 1.370.127        |
| <b>Total</b>   | <b>0772</b>                 | <b>549.699</b> | <b>1772</b>                                | <b>570.132</b> | <b>2772</b>                  | <b>1.800.000</b> |
| <b>Vida residual media ponderada (años)</b>  | <b>0773</b>                 | <b>10,66</b>   | <b>1773</b>                                | <b>11,65</b>   | <b>2773</b>                  | <b>25,20</b>     |

**Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA**

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/06/2019**

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

| Información sobre las mejoras crediticias del Fondo  | Situación actual 30/06/2019 |        | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |        | Situación inicial 05/12/2006 |             |
|--|-----------------------------|--------|--|--------|------------------------------|-------------|
|  | Código                      | Valor  | Código                                     | Valor  | Código                       | Valor       |
| 1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)  | 0775                        | 3.103  | 1775                                       | 0      | 2775                         | 62.640      |
| 1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)   | 0776                        | 62.640 | 1776                                       | 62.640 | 2776                         | 62.640      |
| 1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)               | 0777                        | 0,56   | 1777                                       | 0,00   | 2777                         | 3,48        |
| 1.3 Denominación de la contrapartida   | 0778                        | Bankia | 1778                                       | Bankia | 2778                         | Caja Madrid |
| 1.4 Rating de la contrapartida   | 0779                        |        | 1779                                       |        | 2779                         |             |
| 1.5 Rating requerido de la contrapartida   | 0780                        |        | 1780                                       |        | 2780                         |             |
| 2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)  | 0781                        |        | 1781                                       |        | 2781                         |             |
| 2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%) | 0782                        |        | 1782                                       |        | 2782                         |             |
| 2.2 Denominación de la contrapartida   | 0783                        |        | 1783                                       |        | 2783                         |             |
| 2.3 Rating de la contrapartida   | 0784                        |        | 1784                                       |        | 2784                         |             |
| 2.4 Rating requerido de la contrapartida   | 0785                        |        | 1785                                       |        | 2785                         |             |
| 3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)   | 0786                        |        | 1786                                       |        | 2786                         |             |
| 3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)                               | 0787                        |        | 1787                                       |        | 2787                         |             |
| 3.2 Denominación de la entidad avalista  | 0788                        |        | 1788                                       |        | 2788                         |             |
| 3.3 Rating del avalista  | 0789                        |        | 1789                                       |        | 2789                         |             |
| 3.4 Rating requerido del avalista  | 0790                        |        | 1790                                       |        | 2790                         |             |
| 4 Subordinación de series (S/N)  | 0791                        | S      | 1791                                       | S      | 2791                         | S           |
| 4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)  | 0792                        | 67,25  | 1792                                       | 68,16  | 2792                         | 90,00       |
| 5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)                          | 0793                        |        | 1793                                       |        | 2793                         |             |
| 5.1 Denominación de la contrapartida   | 0794                        |        | 1794                                       |        | 2794                         |             |
| 5.2 Rating de la contrapartida   | 0795                        |        | 1795                                       |        | 2795                         |             |
| 5.3 Rating requerido de la contrapartida   | 0796                        |        | 1796                                       |        | 2796                         |             |

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2019

**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 30/06/2019 | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 | Situación inicial 05/12/2006 |      |
|                      | 0800            | 0801                         | 0802   | 0803  | 0804                                     | 0805  | 0806                        | 1806                                       | 2806                         | 3806 |
| Swap de Bases        | BANCO SANTANDER | TRIMESTRAL                   | Media de los Euribor 12M en cada Fecha de Referencia | Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago | Tipo de Referencia de los Bonos - 0,055% | Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago | -12.294                     | -12.294                                    |                              |      |
| <b>Total</b>         |                 |                              |  |   |  |   | 0808 -12.294                | 0809 -12.294                               | 0810                         |      |

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2019

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO B**

| GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS<br>Naturaleza riesgo cubierto | Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros) |  |   |  |                              |  | Valor en libros (miles de euros) |  |   |  |                              |  | Otras características |  |
|--|---|--|---|--|------------------------------|--|----------------------------------|--|---|--|------------------------------|--|-----------------------|--|
|  | Situación actual<br>30/06/2019                      |  | Situación cierre anual<br>anterior 31/12/2018 |  | Situación inicial 05/12/2006 |  | Situación actual 30/06/2019      |  | Situación cierre anual<br>anterior 31/12/2018 |  | Situación inicial 05/12/2006 |  |                       |  |
| Préstamos hipotecarios                                       | 0811  |  | 1811  |  | 2811                         |  | 0829                             |  | 1829  |  | 2829                         |  | 3829                  |  |
| Cédulas hipotecarias   | 0812  |  | 1812  |  | 2812                         |  | 0830                             |  | 1830  |  | 2830                         |  | 3830                  |  |
| Préstamos a promotores                                       | 0813  |  | 1813  |  | 2813                         |  | 0831                             |  | 1831  |  | 2831                         |  | 3831                  |  |
| Préstamos a PYMES  | 0814  |  | 1814  |  | 2814                         |  | 0832                             |  | 1832  |  | 2832                         |  | 3832                  |  |
| Préstamos a empresas   | 0815  |  | 1815  |  | 2815                         |  | 0833                             |  | 1833  |  | 2833                         |  | 3833                  |  |
| Préstamos corporativos                                       | 0816  |  | 1816  |  | 2816                         |  | 0834                             |  | 1834  |  | 2834                         |  | 3834                  |  |
| Cédulas territoriales  | 0817  |  | 1817  |  | 2817                         |  | 0835                             |  | 1835  |  | 2835                         |  | 3835                  |  |
| Bonos de tesorería   | 0818  |  | 1818  |  | 2818                         |  | 0836                             |  | 1836  |  | 2836                         |  | 3836                  |  |
| Deuda subordinada  | 0819  |  | 1819  |  | 2819                         |  | 0837                             |  | 1837  |  | 2837                         |  | 3837                  |  |
| Créditos AAPP  | 0820  |  | 1820  |  | 2820                         |  | 0838                             |  | 1838  |  | 2838                         |  | 3838                  |  |
| Préstamos consumo  | 0821  |  | 1821  |  | 2821                         |  | 0839                             |  | 1839  |  | 2839                         |  | 3839                  |  |
| Préstamos automoción   | 0822  |  | 1822  |  | 2822                         |  | 0840                             |  | 1840  |  | 2840                         |  | 3840                  |  |
| Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)                 | 0823  |  | 1823  |  | 2823                         |  | 0841                             |  | 1841  |  | 2841                         |  | 3841                  |  |
| Cuentas a cobrar   | 0824  |  | 1824  |  | 2824                         |  | 0842                             |  | 1842  |  | 2842                         |  | 3842                  |  |
| Derechos de crédito futuros                                  | 0825  |  | 1825  |  | 2825                         |  | 0843                             |  | 1843  |  | 2843                         |  | 3843                  |  |
| Bonos de titulización  | 0826  |  | 1826  |  | 2826                         |  | 0844                             |  | 1844  |  | 2844                         |  |                       |  |
| <b>Total</b>   | 0827  |  | 1827  |  | 2827                         |  | 0845                             |  | 1845  |  | 2845                         |  | 3845                  |  |

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2019

**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 30/06/2019 |        | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |        | Situación actual 30/06/2019 |       | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |       |              |       | Última Fecha Pago |                      |
| 1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a  | 7000         |   | 7002        | 90 | 7003                        | 806    | 7006                                       | 1.010  | 7009                        | 0,15  | 7012                                       | 0,18  | 7015         | 0,29  |                   |                      |
| 2. Activos Morosos por otras razones                              |              |   |             |    | 7004                        |        | 7007                                       |        | 7010                        |       | 7013                                       |       | 7016         |       |                   |                      |
| Total Morosos   |              |   |             |    | 7005                        | 806    | 7008                                       | 1.010  | 7011                        | 0,15  | 7014                                       | 0,18  | 7017         | 0,29  | 7018              |                      |
| 3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a | 7019         | 6 | 7020        |    | 7021                        | 75.135 | 7024                                       | 84.574 | 7027                        | 12,15 | 7030                                       | 13,06 | 7033         | 12,29 |                   |                      |
| 4. Activos Fallidos por otras razones                             |              |   |             |    | 7022                        | 219    | 7025                                       | 154    | 7028                        | 0,04  | 7031                                       | 0,02  | 7034         | 0,02  |                   |                      |
| Total Fallidos  |              |   |             |    | 7023                        | 75.355 | 7026                                       | 84.727 | 7029                        | 12,19 | 7032                                       | 13,09 | 7035         | 12,31 | 7036              | Glosario de Términos |

| Otras ratios relevantes | Ratio                       |  |  | Ref. Folleto |      |
|-------------------------|-----------------------------|--|--|--------------|------|
|                         | Situación actual 30/06/2019 |  | Situación cierre anual anterior 31/12/2018 |              |      |
|                         | 0850                        |  | 1850                                       |              | 3850 |
|                         | 0851                        |  | 1851                                       |              | 3851 |
|                         | 0852                        |  | 1852                                       |              | 3852 |
|                         | 0853                        |  | 1853                                       |              | 3853 |



Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2019

**INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO**

**CUADRO B**

| TRIGGERS   | Límite | % Actual | Última Fecha Pago | Referencia Folleto                            |
|--|--------|----------|-------------------|---|
| <b>Amortización secuencial: series</b>               | 0854   | 0858     | 1858              | 2858  |
| SERIE B - ES0359092030                               | 10,00  | 37,45    | 37,84             | Nota de Valores 4.9.4                         |
| SERIE A3 - ES0359092022                              | 25,00  | 7,28     | 7,29              | Nota de Valores 4.9.4                         |
| SERIE C - ES0359092048                               | 7,50   | 12,28    | 12,07             | Nota de Valores 4.9.4                         |
| SERIE B - ES0359092030                               | 2,00   | 0,15     | 0,29              | Nota de Valores 4.9.4                         |
| SERIE D - ES0359092055                               | 3,40   | 5,57     | 5,47              | Nota de Valores 4.9.4                         |
| SERIE C - ES0359092048                               | 10,00  | 37,45    | 37,84             | Nota de Valores 4.9.4                         |
| SERIE A2 - ES0359092014                              | 25,00  | 7,28     | 7,29              | Nota de Valores 4.9.4                         |
| SERIE E - ES0359092063                               | 10,00  | 37,45    | 37,84             | Nota de Valores 4.9.4                         |
| SERIE D - ES0359092055                               | 1,50   | 0,15     | 0,29              | Nota de Valores 4.9.4                         |
| SERIE E - ES0359092063                               | 1,25   | 0,15     | 0,29              | Nota de Valores 4.9.4                         |
| SERIE D - ES0359092055                               | 10,00  | 37,45    | 37,84             | Nota de Valores 4.9.4                         |
| SERIE A1 - ES0359092006                              | 25,00  | 7,28     | 7,29              | Nota de Valores 4.9.4                         |
| SERIE E - ES0359092063                               | 2,40   | 3,44     | 3,38              | Nota de Valores 4.9.4                         |
| SERIE C - ES0359092048                               | 1,75   | 0,15     | 0,29              | Nota de Valores 4.9.4                         |
| SERIE B - ES0359092030                               | 7,00   | 11,46    | 11,26             | Nota de Valores 4.9.4                         |
| <b>Diferimiento/postergamiento intereses: series</b> | 0855   | 0859     | 1859              | 2859  |
| SERIE E - ES0359092063                               | 8,00   | 7,28     | 7,29              | Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2 |
| SERIE D - ES0359092055                               | 9,40   | 7,28     | 7,29              | Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2 |
| SERIE B - ES0359092030                               | 18,30  | 7,28     | 7,29              | Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2 |
| SERIE C - ES0359092048                               | 13,20  | 7,28     | 7,29              | Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2 |
| <b>No Reducción del Fondo de Reserva</b>             | 0856   | 0860     | 1860              | 2860  |
|  |        | 0,56     | 0,08              | 3.4.2.2. Modulo Adicional                     |
| <b>OTROS TRIGGERS</b>                                | 0857   | 0861     | 1861              | 2861  |

Cuadro de texto libre

**CUADRO C**

**Informe cumplimiento reglas de funcionamiento**

Contiene



Información adicional  
en fichero adjunto

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2019

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO A**

| Comisión                             | Contrapartida |                                       | Importe fijo (miles de euros) |    | Criterios determinación de la comisión |  |         |       | Máximo (miles de euros) |  | Mínimo (miles de euros) |  | Periodicidad pago según folleto / escritura |            | Condiciones iniciales folleto / escritura emisión |   | Otras consideraciones |  |
|--------------------------------------|---------------|---------------------------------------|-------------------------------|----|--|--|---------|-------|-------------------------|--|-------------------------|--|---|------------|---|---|-----------------------|--|
|                                      |               |                                       |                               |    | Base de cálculo                        |  | % anual |       |                         |  |                         |  |   |            |   |   |                       |  |
| Comisión sociedad gestora            | 0862          | Titulización de Activos, SGFT, S.A.   | 1862                          | 10 | 2862                                   | Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior | 3862    | 0,014 | 4862                    |  | 5862                    |  | 6862  | TRIMESTRAL | 7862  | S | 8862                  |  |
| Comisión administrador               | 0863          |                                       | 1863                          |    | 2863                                   |  | 3863    |       | 4863                    |  | 5863                    |  | 6863  |            | 7863  |   | 8863                  |  |
| Comisión del agente financiero/pagos | 0864          | BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, S.E. | 1864                          |    | 2864                                   | Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior | 3864    | 0,005 | 4864                    |  | 5864                    |  | 6864  | TRIMESTRAL | 7864  | S | 8864                  |  |
| Otras                                | 0865          |                                       | 1865                          |    | 2865                                   |  | 3865    |       | 4865                    |  | 5865                    |  | 6865  |            | 7865  |   | 8865                  |  |

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2019

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

| Forma de cálculo  |      |                          |
|---|------|--------------------------|
| 1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)                          | 0866 | N                        |
| 2 Diferencia cobros y pagos (S/N)                             | 0867 | S                        |
| 3 Otros (S/N)   | 0868 | N                        |
| 3.1 Descripción   | 0869 |                          |
| Contrapartida   | 0870 | Bankia                   |
| Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión) | 0871 | Módulo Adicional 3.4.3.2 |

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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2019

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

| Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)    |      | Fecha cálculo |            |  |  |  |  |  |  |  |  | Total |   |
|--|------|---------------|------------|--|--|--|--|--|--|--|--|-------|---|
|  |      | 22/02/2019    | 22/05/2019 |  |  |  |  |  |  |  |  |       |   |
| Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto             | 0885 |               |            |  |  |  |  |  |  |  |  |       |   |
| Saldo inicial  | 0886 | 0             | 466        |  |  |  |  |  |  |  |  |       |   |
| Cobros del periodo   | 0887 | 14.147        | 13.337     |  |  |  |  |  |  |  |  |       |   |
| Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable | 0888 | -366          | -572       |  |  |  |  |  |  |  |  |       |   |
| Pagos por derivados  | 0889 | -292          | -301       |  |  |  |  |  |  |  |  |       |   |
| Retención importe Fondo de Reserva                               | 0890 | -466          | -3.103     |  |  |  |  |  |  |  |  |       |   |
| Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos              | 0891 | -13.024       | -9.826     |  |  |  |  |  |  |  |  |       |   |
| Pagos por deudas con entidades de crédito                        | 0892 | 0             | 0          |  |  |  |  |  |  |  |  |       |   |
| Resto pagos/retenciones  | 0893 | 0             | 0          |  |  |  |  |  |  |  |  |       |   |
| Saldo disponible   | 0894 | 0             | 0          |  |  |  |  |  |  |  |  |       |   |
| Liquidación de comisión variable                                 | 0895 | 0             | 0          |  |  |  |  |  |  |  |  |       | 0 |

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2019

**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**