

**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: 31/12/2017

**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)

Reenvío por modificación de los siguientes informes:  
S.01, S.02 y S.03 comparativo

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2017		Periodo anterior 31/12/2016
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	591.464	1001	636.967
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	591.464	1002	636.967
1. Activos titulizados	0003	591.464	1003	636.967
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	573.767	1005	614.506
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	17.898	1025	22.909
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-202	1027	-447
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

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: 31/12/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2017		Periodo anterior 31/12/2016
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	73.890	1041	78.030
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042	24.185	1042	28.055
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	39.342	1043	40.417
1. Activos titulizados	0044	39.342	1044	40.417
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	36.228	1046	35.929
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	176	1065	227
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	31	1066	29
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	3.633	1067	4.972
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	91	1068	141
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-816	1069	-880
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	10.362	1085	9.557
1. Tesorería	0086	10.362	1086	9.557
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	665.353	1088	714.997

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: 31/12/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2017		Periodo anterior 31/12/2016
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	605.878	1089	660.854
<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	605.878	1094	660.854
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	578.402	1095	621.497
1.1 Series no subordinadas	0096	398.402	1096	441.497
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	15.919	1101	22.171
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	-53.022	1105	-46.769
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108	11.557	1108	17.186
3.1 Derivados de cobertura	0109	11.557	1109	17.186
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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2017		Periodo anterior 31/12/2016
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	72.307	1117	73.261
<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	66.241	1123	66.570
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	41.807	1124	42.527
1.1 Series no subordinadas	0125	39.860	1125	40.900
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	40	1128	41
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	1.907	1129	1.586
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	23.059	1131	21.890
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	125	1136	126
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	22.934	1137	21.764
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	1.371	1139	2.149
3.1 Derivados de cobertura	0140	1.371	1140	2.149
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	4	1143	3
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	4	1146	3
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	0148	6.066	1148	6.692
1. Comisiones	0149	19	1149	19
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	15	1150	15
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	4	1152	4
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	6.047	1157	6.672
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158	-12.831	1158	-19.118
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159	0	1159	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	-12.831	1160	-19.118
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161	0	1161	0
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	665.353	1162	714.997

S.02

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2017		Acumulado anterior 31/12/2016
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	1.218	1201	1.533	2201	5.096	3201	6.550
1.1 Activos titulizados	0202	1.218	1202	1.533	2202	5.096	3202	6.550
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-402	1204	-410	2204	-1.597	3204	-1.804
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-94	1205	-97	2205	-374	3205	-552
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-294	1206	-299	2206	-1.169	3206	-1.237
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-13	1207	-14	2207	-53	3207	-14
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0208	-376	1208	-548	2208	-1.806	3208	-2.235
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	440	1209	575	2209	1.694	3209	2.510
<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	6	1216	0	2216	16	3216	30
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0217	-360	1217	-299	2217	-1.519	3217	-1.753
7.1 Servicios exteriores	0218	-310	1218	-248	2218	-1.335	3218	-1.559
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-310	1219	-248	2219	-1.335	3219	-1.559
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	-50	1224	-51	2224	-185	3224	-193
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-35	1225	-36	2225	-142	3225	-148
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-9	1227	-10	2227	-37	3227	-40
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	-6	1230	-5	2230	-6	3230	-5
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0231	-3.066	1231	-541	2231	-7.582	3231	-3.118
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-3.066	1232	-541	2232	-7.582	3232	-3.118
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	253	1238	10	2238	1.139	3238	-15
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0239	2.727	1239	255	2239	6.253	3239	2.345
<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: 31/12/2017

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2017		Acumulado anterior 31/12/2016
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	807	1300	934	2300	3.028	3300	3.878
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	846	1301	950	2301	3.191	3301	4.035
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	1.285	1302	1.552	2302	5.223	3302	6.653
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-13	1303	-16	2303	-54	3303	-289
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	-412	1305	-575	2305	-1.925	3305	-2.317
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	-13	1308	-11	2308	-53	3308	-11
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	0309	-44	1309	-46	2309	-180	3309	-188
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-35	1310	-36	2310	-142	3310	-149
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-9	1312	-10	2312	-37	3312	-39
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	5	1315	30	2315	16	3315	30
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	5	1321	30	2321	16	3321	30
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>	0322	367	1322	636	2322	-2.222	3322	-5.858
<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	678	1325	884	2325	-882	3325	-4.293
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	4.207	1326	6.251	2326	24.657	3326	25.122
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	4.605	1327	1.983	2327	11.480	3327	11.052
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	776	1328	1.462	2328	2.009	3328	5.331
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	52	1329	75	2329	52	3329	75
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	1.196	1330	608	2330	5.056	3330	2.509
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-10.158	1331	-9.496	2331	-44.135	3331	-48.383
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	0332	-311	1332	-248	2332	-1.341	3332	-1.565
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	-1	2335	0	3335	-12
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-311	1336	-246	2336	-1.341	3336	-1.553
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	0337	1.174	1337	1.571	2337	805	3337	-1.980
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	9.189	1338	7.987	2338	9.557	3338	11.538
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	10.362	1339	9.557	2339	10.362	3339	9.557

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2017		Acumulado anterior 31/12/2016
<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	5.994	1357	-8.320	2357	4.481	3357	-10.063
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	5.994	1358	-8.320	2358	4.481	3358	-10.063
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	376	1360	548	2360	1.806	3360	2.235
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	-6.371	1362	7.772	2362	-6.287	3362	7.827
<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: 31/12/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2017								Situación cierre anual anterior 31/12/2016								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	3,41	0401	12,16	0421	0,00	0441	1,76	1381	4,11	1401	10,49	1421	0,00	1441	1,58	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: 31/12/2017

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	232	0467	86	0474	17	0481	0	0488	103	0495	28.906	0502	0	0509	29.009
De 1 a 3 meses	0461	37	0468	45	0475	14	0482	0	0489	59	0496	5.194	0503	0	0510	5.253
De 3 a 6 meses	0462	6	0469	14	0476	2	0483	1	0490	17	0497	715	0504	0	0511	732
De 6 a 9 meses	0463	10	0470	37	0477	3	0484	6	0491	46	0498	1.540	0505	0	0512	1.586
De 9 a 12 meses	0464	6	0471	28	0478	3	0485	8	0492	38	0499	870	0506	0	0513	908
Más de 12 meses	0465	116	0472	2.456	0479	83	0486	883	0493	3.422	0500	15.871	0507	0	0514	19.293
<b>Total</b>	0466	<b>407</b>	0473	<b>2.666</b>	0480	<b>122</b>	0487	<b>898</b>	0494	<b>3.686</b>	0501	<b>53.096</b>	0508	<b>0</b>	1515	<b>56.781</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	232	0522	86	0529	17	0536	0	0543	103	0550	28.906	0557	0	0564	29.009	0571	42.211	0578	42.211	0584	68,72
De 1 a 3 meses	0516	37	0523	45	0530	14	0537	0	0544	59	0551	5.194	0558	0	0565	5.253	0572	7.418	0579	7.418	0585	70,81
De 3 a 6 meses	0517	6	0524	14	0531	2	0538	1	0545	17	0552	715	0559	0	0566	732	0573	1.125	0580	1.125	0586	65,11
De 6 a 9 meses	0518	10	0525	37	0532	3	0539	6	0546	46	0553	1.540	0560	0	0567	1.586	0574	2.159	0581	2.159	0587	73,47
De 9 a 12 meses	0519	6	0526	28	0533	3	0540	8	0547	38	0554	870	0561	0	0568	908	0575	1.194	0582	1.194	0588	76,07
Más de 12 meses	0520	116	0527	2.456	0534	83	0541	883	0548	3.422	0555	15.871	0562	0	0569	19.293	0576	23.272	0583	23.272	0589	82,90
<b>Total</b>	0521	<b>407</b>	0528	<b>2.666</b>	0535	<b>122</b>	0542	<b>898</b>	0549	<b>3.686</b>	0556	<b>53.096</b>	0563	<b>0</b>	0570	<b>56.781</b>	0577	<b>77.378</b>			0590	<b>73,38</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: 31/12/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO C**

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	351	1600	59	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	118	1601	512	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	276	1602	257	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	645	1603	712	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	1.314	1604	952	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	23.726	1605	18.537	2605	241
Superior a 10 años	0606	605.096	1606	657.286	2606	1.799.759
<b>Total</b>	0607	<b>631.526</b>	1607	<b>678.315</b>	2607	<b>1.800.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	0608	<b>17,31</b>	1608	<b>18,16</b>	2608	<b>27,35</b>

Antigüedad	Situación actual 31/12/2017						Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 05/12/2006	
	Antigüedad media ponderada (años)	0609	12,65	1609	11,67	2609	1,72			

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO D**

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				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	353	0630	14.665	1620	237	1630	10.066	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.150	0631	97.594	1621	959	1631	78.196	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	2.499	0632	359.946	1622	2.489	1632	346.126	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	858	0633	159.321	1623	1.327	1633	243.927	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>4.860</b>	0638	<b>631.526</b>	1628	<b>5.012</b>	1638	<b>678.315</b>	2628	<b>9.884</b>	2638	<b>1.800.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>	0639	<b>70,52</b>	0649		1639	<b>72,92</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: 31/12/2017**

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

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,82	1650	0,96	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	2,10	1651	3,79	2651	6,00
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,09	1652	0,20	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: 31/12/2017</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 31/12/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				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	227	0683	21.038	1660	238	1683	23.003	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	84	0684	7.954	1661	87	1684	8.649	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	44	0685	3.803	1662	46	1685	4.092	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	48	0686	5.931	1663	50	1686	6.570	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	37	0687	3.051	1664	38	1687	3.296	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	81	0688	7.183	1665	85	1688	8.091	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	122	0689	10.030	1666	123	1689	10.763	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	210	0690	22.278	1667	220	1690	24.324	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	526	0691	76.181	1668	542	1691	81.508	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	31	0692	1.266	1669	32	1692	1.433	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	30	0693	1.849	1670	30	1693	1.967	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	96	0694	9.052	1671	97	1694	9.685	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	2.972	0695	427.285	1672	3.054	1695	456.701	2672	6.243	2695	1.238.324
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	19	0697	1.550	1674	20	1697	1.731	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	19	0698	2.322	1675	20	1698	2.551	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	14	0699	1.485	1676	17	1699	1.748	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	195	0700	15.120	1677	205	1700	16.957	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	105	0701	14.151	1678	108	1701	15.245	2678	162	2701	31.874
<b>Total España</b>	0679	<b>4.860</b>	0702	<b>631.526</b>	1679	<b>5.012</b>	1702	<b>678.315</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>4.860</b>	0705	<b>631.526</b>	1682	<b>5.012</b>	1705	<b>678.315</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: 31/12/2017</b>
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA</b>

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 31/12/2017				Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Situación inicial 05/12/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,71			1710	0,67			2710	0,37		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

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

**CUADRO A**

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2017			Situación cierre anual anterior 31/12/2016			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	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0359092006	SERIE A1	4.140	0	0	4.140	0	0	4.140	100.000	414.000			
ES0359092014	SERIE A2	9.360	17.977	168.262	9.360	22.692	212.397	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	618.262	1723	18.000	1724	662.397	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: 31/12/2017

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	168.262	0	168.262	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	0,17	6	0	NO	30.600	0	30.606	0					
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	1,67	34	1.907	NO	18.900	0	20.841	0					
<b>Total</b>						0740	40	0741	1.907	0743	618.262	0744	0	0745	620.209	0746	0

	Situación actual 31/12/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 05/12/2006			
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,06	0748	0,07	0749	0,00

S.05.2

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: 31/12/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

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

**CUADRO C**

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2017								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2016							
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	10.158	767.738	0	125.437	9.496	723.603	0	125.437	0	723.603	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	13	5.849	0	0	16	5.794	0	0	16	5.794	0	5.794		
ES0359092063	SERIE E	0	0	0	4.849	0	0	0	4.849	0	0	0	4.849	0	4.849		
<b>Total</b>		0754	10.158	0755	1.181.738	0756	13	0757	224.136	1754	9.496	1755	1.137.603	1756	16	1757	224.082

**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: 31/12/2017**

**Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF**

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

**CUADRO D**

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 31/12/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	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-	BBB-	AAA
ES0359092014	SERIE A2	14/05/2016	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	22/05/2017	SYP	AA	AA-	AAA
ES0359092022	SERIE A3	22/12/2017	FCH	A-	BBB-	AAA
ES0359092022	SERIE A3	14/05/2016	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	22/05/2017	SYP	A+	BBB+	AAA
ES0359092030	SERIE B	22/12/2017	FCH	BBB-	BB-	AA
ES0359092030	SERIE B	11/12/2017	MDY	A3	Baa1	Aa1
ES0359092030	SERIE B	22/05/2017	SYP	BBB+	BBB	AA
ES0359092048	SERIE C	22/12/2017	FCH	CCC	B-	A
ES0359092048	SERIE C	14/05/2016	MDY	B1	B1	A1
ES0359092048	SERIE C	22/05/2017	SYP	BB	B-	A
ES0359092055	SERIE D	18/03/2009	FCH	CCC	CCC	BBB
ES0359092055	SERIE D	11/09/2009	MDY	C	C	Baa2
ES0359092055	SERIE D	20/03/2013	SYP	CCC+	CCC+	BBB
ES0359092063	SERIE E	18/03/2009	FCH	CC	CC	BB+
ES0359092063	SERIE E	11/09/2009	MDY	C	C	Ba1
ES0359092063	SERIE E	20/03/2013	SYP	D	D	BB

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2017

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

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

**CUADRO E**

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	24.319	1765	23.390	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	29.026	1766	28.756	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	30.138	1767	29.882	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	30.175	1768	31.022	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	30.305	1769	31.876	2769	41.891
Entre 5 y 10 años	0770	165.646	1770	167.304	2770	241.519
Superior a 10 años	0771	308.653	1771	350.168	2771	1.370.127
<b>Total</b>	<b>0772</b>	<b>618.262</b>	<b>1772</b>	<b>662.397</b>	<b>2772</b>	<b>1.800.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>0773</b>	<b>12,48</b>	<b>1773</b>	<b>13,30</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: 31/12/2017

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación inicial 05/12/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	0	1775	0	2775	62.640
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	62.640	1776	62.640	2776	62.640
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	0,00	1777	0,00	2777	3,48
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Bankia	1778	Bankia	2778	Caja Madrid
1.4 Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781		1781		2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782		1782		2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784		1784		2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786		1786		2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787		1787		2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788		1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	70,66	1792	72,83	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: 31/12/2017

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO B**

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 31/12/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 05/12/2006	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap de Bases	BANCO SANTANDER	TRIMESTRAL	Media de los Euribor 12M en cada Fecha de Referencia	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	Tipo de Referencia de los Bonos - 0,055%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	-12.929	-19.335		
<b>Total</b>							0808 -12.929	0809 -19.335	0810	

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

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 31/12/2017**

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO B**

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)			Valor en libros (miles de euros)			Otras características	
	Situación actual 31/12/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	Situación inicial 05/12/2006	Situación actual 31/12/2017	Situación cierre anual anterior 31/12/2016	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>	<b>0827</b>	<b>1827</b>	<b>2827</b>	<b>0845</b>	<b>1845</b>	<b>2845</b>	<b>3845</b>	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

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

**CUADRO A**

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 31/12/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		Situación actual 31/12/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	822	7006	1.247	7009	0,14	7012	0,19	7015	0,26		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	822	7008	1.247	7011	0,14	7014	0,19	7017	0,26	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	98.219	7024	108.996	7027	13,99	7030	14,45	7033	14,02		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	154	7025	613	7028	0,02	7031	0,08	7034	0,02		
Total Fallidos					7023	98.372	7026	109.610	7029	14,01	7032	14,53	7035	14,04	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2017		Situación cierre anual anterior 31/12/2016		
	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: 31/12/2017

**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	41,34	41,84	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	4,95	4,87	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	7,81	7,83	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,11	0,26	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	10,19	10,03	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	41,34	41,84	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	10,00	41,34	41,84	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	2,00	0,11	0,26	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	7,50	10,92	10,74	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	10,00	41,34	41,84	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	7,81	7,83	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	1,75	0,11	0,26	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	3,06	3,01	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359092006	25,00	7,81	7,83	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	1,25	0,11	0,26	Nota de Valores 4.9.4
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series</b>	0855	0859	1859	2859
SERIE B - ES0359092030	18,30	7,81	7,83	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE C - ES0359092048	13,20	7,81	7,83	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE D - ES0359092055	9,40	7,81	7,83	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE E - ES0359092063	8,00	7,81	7,83	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
<b>No Reducción del Fondo de Reserva</b>	0856	0860	1860	2860
		0,00	0,00	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: 31/12/2017

**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: 31/12/2017

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

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

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

S.05.5

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo				Total
		22/02/2017	22/05/2017	22/08/2017	22/11/2017	
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885					
Saldo inicial	0886	0	0	0	0	
Cobros del periodo	0887	13.243	10.111	13.343	10.937	
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-386	-444	-337	-354	
Pagos por derivados	0889	-543	-500	-470	-412	
Retención importe Fondo de Reserva	0890	0	0	0	0	
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-12.314	-9.168	-12.536	-10.171	
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0	0	
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0	0	
Saldo disponible	0894	0	0	0	0	
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	0	0	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2017

**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**