

MADRID RMBS II - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 22/05/20 - 24/08/20

	Euros
I. Situación al 22/05/20:	5.204.815,57
Saldo Inicial Cuenta Tesorería	5.204.815,57
Resto Préstamo Gastos Iniciales	0,00
II. Fondos recibidos del emisor	9.600.476,18
Principal:	
Según calendario hasta 31/07/20:	6.803.758,56
Amort. Anticipada hasta 31/07/20:	1.603.837,39
Intereses:	817.713,62
Ingresos por inmuebles:	375.166,61
III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):	14.805.291,75
IV. Total intereses de la reinversión:	-3.739,03
Intereses de la Cta. De Tesorería	-3.739,03
V. Recursos disponibles (III + IV):	14.801.552,72
VI. Gastos:	225.210,57
VII. Liquidación SWAP:	-128.439,83
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	-322.046,39
Cantidad a Pagar por la Parte A (Banco Santander):	-450.486,22
VIII. Pago a los Bonos:	9.121.253,13
Bonos A1:	
Intereses correspondientes al 24/08/20:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 24/08/20:	0,00
Bonos A2 :	
Intereses correspondientes al 24/08/20:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 24/08/20:	9.015.271,20
Bonos A3 :	
Intereses correspondientes al 24/08/20:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 24/08/20:	0,00
Bonos B:	
Intereses correspondientes al 24/08/20:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 24/08/20:	0,00
Bonos C:	
Intereses correspondientes al 24/08/20:	3.523,50
Retenciones practicadas a los bonos:	669,47
Amortización correspondiente al 24/08/20:	0,00
Bonos D:	
Intereses correspondientes al 24/08/20:	17.576,64
Retenciones practicadas a los bonos:	3.339,56
Amortización correspondiente al 24/08/20:	0,00
Bonos E:	
Intereses correspondientes al 24/08/20:	84.881,79
Retenciones practicadas a los bonos:	16.127,54
Amortización correspondiente al 24/08/20:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones:	-20.136,57
IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII):	5.326.649,19
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva previo (22/05/20):	5.204.815,57
Aportación al Fondo de Reserva	121.833,62
Intereses préstamo subordinado Desfase pagados	0,00
Intereses préstamo subordinado G.I. pagados	0,00
Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada	0,00
Amortización préstamo subordinado Desfase	0,00
Amortización préstamo subordinado G.I.	0,00
Amortización Préstamo Participativo	0,00
Otros recursos	0,00
Remuneración Variable Prést. Participativo	0,00
Fondo de Reserva (24/08/20):	5.326.649,19

Destinatario: CNMV, AIAF.



Nº: 3104/20

Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

http://www.tda-sgft.com

MADRID RMBS III lq trim Ago20

MADRID RMBS II

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 24 de Agosto de 2020

Importes en euros

I. BONOS A2 ES0359092014		
	Sobre 9360 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/12/06):	936.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	58.586.954,40 €	6.259,29 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	9.015.271,20 €	963,17 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	49.571.683,20 €	5.296,12 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	5,296120%	5,296120%
II. BONOS A3 ES0359092022		
	Sobre 2700 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/12/06):	270.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	270.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	270.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
III. BONOS B ES0359092030		
	Sobre 630 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/12/06):	63.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	63.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	63.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
IV. BONOS C ES0359092048		
	Sobre 675 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/12/06):	67.500.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	67.500.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	3.523,50 €	5,22 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	67.500.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
V. BONOS D ES0359092055		
	Sobre 306 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/12/06):	30.600.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	30.600.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	17.576,64 €	57,44 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	30.600.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
VI. BONOS E ES0359092063		
	Sobre 189 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/12/06):	18.900.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	18.900.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	84.881,79 €	449,11 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	18.900.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
VII. EL FONDO		
Importes en euros		
1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/07/20:		
a) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias No Fallidas:		499.571.675,46 €
b) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias Fallidas:		64.582.924,46 €
c) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias No Fallidas:		499.763.959,93 €
d) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias Fallidas:		130.097.168,19 €
2. Amortización del periodo 30/04/20 a 31/07/20:		
a) Según calendario:		8.407.595,95 €
b) Amortización anticipada hasta 31/07/20:		1.603.837,39 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):		
a) Último año:		1,85%
b) Último semestre:		1,28%
c) Último trimestre:		1,26%
4. Porcentaje de fallidos (1):		20,65%
5. Nivel de Impago(2):		0,11%

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

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

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



Nº: 3105/20

Titulización de Activos, (SGFT),S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

http://www.tda-sgft.com

MADRID RMBS IIInfoinver.trimAgo20

MADRID RMBS II , FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL PERÍODO: 22/05/20-24/08/20
I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	12 de diciembre de 2006
Fecha Emisión BTH	12 de diciembre de 2006
Fecha Final Amortización BTH (1,85% TAA)	22 de febrero de 2030
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca	BANKIA (Caja Madrid)
Agente de Pagos	BNP Paribas, Sucursal en España
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Moody's Investors Service/ Fitch Ibcra/Standard & Poor's
Calificación	Bonos A2: A-(sf) (F)/ Aa1(sf) (M)/ AA(sf) (S&P) Bonos A3: A-(sf) (F)/ Aa1(sf) (M)/ A+(sf) (S&P) Bonos B: BBB-(sf) (F)/A1(sf) (M)/ BBB+(sf) (S&P) Bonos C: B+(sf) (F)/ Ba3(sf) (M)/ BB(sf) (S&P) Bonos D: CCC(sf) (F)/ C(sf) (M)/ CCC+(sf) (S&P) Bonos E: CC(sf) (F)/ C(sf) (M)/ D(sf) (S&P)

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

Nombre	Bonos de Titulización MADRID RMBS II
Serie A2:	
Código ISIN	ES0359092014
Nominal en circulación total (inicial)	936.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	49.571.683,20 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	5.296,12 Euros

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)

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

III. INFORMACION INCLUIDA

* Liquidación del Período: 22/05/20-24/08/20
* Flujos de Caja del Período: 22/05/20-24/08/20
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 24 de Agosto de 2020

MADRID RMBS II**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/05/20 - 24/08/20**

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip.		9.015.271,20
Amortización Participaciones Hip.	8.407.595,95	
Amortización Ptmos. Subordinados		0,00
Ingresos por inmuebles	375.166,61	
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH		105.981,93
Intereses recibidos de las PHs	817.713,62	
Intereses Ptmos. Subordinados		0,00
Intereses Inversiones Temporales	-3.739,03	
III. GASTOS		
Comisiones y gastos periódicos:		225.210,57
Neto SWAP a favor de la Parte A (Contraparte)		128.439,83
Remuneración Variable Préstamo Participativo		0,00
Total Ingresos/Pagos	9.596.737,15	9.474.903,53
Saldo inicial 22/05/20	5.204.815,57	
A Inversiones Temporales		5.326.649,19
Total	14.801.552,72	14.801.552,72
Retenciones practicadas el 24/08/20	20.136,57	
A Inversiones Temporales		20.136,57

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 3110/20**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

MADRID RMBS II\fluj.trim\Ago20