

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 9724
NIF Fondo: V85981231
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	317.490	1001	332.808
I. Activos financieros a largo plazo	0002	317.490	1002	332.808
1. Activos titulizados	0003	313.346	1003	328.664
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	308.344	1005	323.849
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	5.012	1025	4.825
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-10	1027	-10
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	4.144	1029	4.144
2.1 Derivados de cobertura	0030	4.144	1030	4.144
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

S.01

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	57.500	1041	59.317
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	5.300	1042	5.357
V. Activos financieros a corto plazo	0043	18.872	1043	19.188
1. Activos titulizados	0044	18.105	1044	18.184
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	17.119	1046	17.340
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	66	1065	59
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	8	1066	8
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	1.040	1067	906
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	16	1068	15
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-143	1069	-143
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	436	1071	436
2.1 Derivados de cobertura	0072	436	1072	436
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	332	1074	568
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	329	1077	565
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	3	1079	3
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	33.327	1085	34.772
1. Tesorería	0086	33.327	1086	34.772
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	374.990	1088	392.125

S.01

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	349.399	1089	366.558
I. Provisiones a largo plazo	0090	0	1090	0
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	0	1092	0
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	349.399	1094	366.558
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	167.489	1095	184.859
1.1 Series no subordinadas	0096	167.489	1096	184.859
1.2 Series subordinadas	0097	0	1097	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	0	1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	181.910	1101	181.699
2.1 Préstamo subordinado	0102	39.445	1102	39.625
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	144.000	1104	144.000
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-1.535	1105	-1.926
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108	0	1108	0
3.1 Derivados de cobertura	0109	0	1109	0
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

S.01

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) PASIVO CORRIENTE	0117	21.027	1117	21.062
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118	0	1118	0
V. Provisiones a corto plazo	0119	0	1119	0
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	0
2. Provisión por margen de intermediación	0121	0	1121	0
3. Otras provisiones	0122	0	1122	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	20.976	1123	21.024
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	18.159	1124	18.246
1.1 Series no subordinadas	0125	18.159	1125	18.246
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	0	1128	0
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	0	1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	2.817	1131	2.778
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	194	1136	31
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	2.623	1137	2.747
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	0	1139	0
3.1 Derivados de cobertura	0140	0	1140	0
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	51	1148	38
1. Comisiones	0149	11	1149	11
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	5	1150	6
1.2 Comisión administrador	0151	4	1151	4
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	1152	2
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	41	1157	26
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	4.564	1158	4.506
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	4.564	1160	4.506
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	374.990	1162	392.125

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2020		Acumulado anterior 30/09/2019
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	405	1201	488	2201	1.093	3201	1.485
1.1 Activos titulizados	0202	405	1202	488	2202	1.093	3202	1.485
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-129	1204	-138	2204	-324	3204	-500
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-35	1205	-27	2205	-60	3205	-126
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-87	1206	-100	2206	-244	3206	-344
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-7	1207	-11	2207	-21	3207	-30
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	57	1208	13	2208	305	3208	153
A) MARGEN DE INTERESES	0209	334	1209	363	2209	1.073	3209	1.138
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210	0	3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211	0	3211	0
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212	0	3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213	0	3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214	0	3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	4	1216	3	2216	12	3216	13
7. Otros gastos de explotación	0217	-108	1217	-218	2217	-452	3217	-479
7.1 Servicios exteriores	0218	-78	1218	-187	2218	-361	3218	-386
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-78	1219	-187	2219	-361	3219	-386
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	-30	1224	-31	2224	-91	3224	-94
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-17	1225	-17	2225	-51	3225	-51
7.3.2 Comisión administrador	0226	-9	1226	-9	2226	-27	3226	-29
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-4	1227	-5	2227	-13	3227	-14
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228	0	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-82	1231	-65	2231	-304	3231	-848
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-82	1232	-65	2232	-304	3232	-848
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234	0	2234	0	3234	0
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236	0	3236	0
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	10	1238	104	2238	63	3238	415
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-159	1239	-188	2239	-391	3239	-239
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2020		Acumulado anterior 30/09/2019
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	386	1300	368	2300	902	3300	1.192
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	412	1301	396	2301	982	3301	1.273
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	404	1302	491	2302	1.084	3302	1.485
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-60	1303	-47	2303	-60	3303	-146
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	176	1304	50	2304	363	3304	224
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	3305	0
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	-102	1307	-87	2307	-385	3307	-259
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-7	1308	-11	2308	-21	3308	-30
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-30	1309	-31	2309	-91	3309	-94
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-17	1310	-17	2310	-51	3310	-50
2.2 Comisión administrador	0311	-9	1311	-9	2311	-27	3311	-29
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-4	1312	-5	2312	-13	3312	-14
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	4	1315	3	2315	12	3315	13
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	4	1321	3	2321	12	3321	13
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-393	1322	-744	2322	-2.347	3322	-724
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	-313	1325	-519	2325	-2.000	3325	-328
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	3.028	1326	3.537	2326	9.918	3326	9.887
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.454	1327	1.968	2327	4.780	3327	6.041
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	27	1328	137	2328	408	3328	476
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	115	1330	264	2330	351	3330	945
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-4.937	1331	-6.426	2331	-17.457	3331	-17.677
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-80	1332	-224	2332	-347	3332	-396
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	-80	1336	-224	2336	-347	3336	-396
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-8	1337	-375	2337	-1.445	3337	468
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	33.334	1338	54.904	2338	34.772	3338	54.061
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	33.327	1339	54.529	2339	33.327	3339	54.529

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2020		Acumulado anterior 30/09/2019
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	176	1357	50	2357	363	3357	224
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	176	1358	50	2358	363	3358	224
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	-57	1360	-13	2360	-305	3360	-153
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	-118	1362	-37	2362	-58	3362	-70
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2020								Situación cierre anual anterior 31/12/2019								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	1,83	0401	4,46	0421	0,00	0441	2,35	1381	1,65	1401	4,19	1421	0,00	1441	2,59	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	6,00
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Prestamos 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	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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	91	0467	33	0474	6	0481	0	0488	39	0495	12.765	0502	0	0509	12.805
De 1 a 3 meses	0461	12	0468	12	0475	2	0482	0	0489	14	0496	1.806	0503	0	0510	1.819
De 3 a 6 meses	0462	5	0469	7	0476	1	0483	1	0490	8	0497	582	0504	0	0511	590
De 6 a 9 meses	0463	2	0470	7	0477	1	0484	1	0491	9	0498	267	0505	0	0512	276
De 9 a 12 meses	0464	5	0471	24	0478	1	0485	2	0492	27	0499	751	0506	0	0513	778
Más de 12 meses	0465	32	0472	712	0479	14	0486	224	0493	950	0500	3.703	0507	0	0514	4.653
Total	0466	147	0473	795	0480	24	0487	228	0494	1.047	0501	19.873	0508	0	1515	20.920

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	91	0522	33	0529	6	0536	0	0543	39	0550	12.765	0557	0	0564	12.805	0571	19.336	0578	19.336	0584	66,22
De 1 a 3 meses	0516	12	0523	12	0530	2	0537	0	0544	14	0551	1.806	0558	0	0565	1.819	0572	2.644	0579	2.644	0585	68,82
De 3 a 6 meses	0517	5	0524	7	0531	1	0538	1	0545	8	0552	582	0559	0	0566	590	0573	901	0580	901	0586	65,49
De 6 a 9 meses	0518	2	0525	7	0532	1	0539	1	0546	9	0553	267	0560	0	0567	276	0574	399	0581	399	0587	69,16
De 9 a 12 meses	0519	5	0526	24	0533	1	0540	2	0547	27	0554	751	0561	0	0568	778	0575	1.118	0582	1.118	0588	69,54
Más de 12 meses	0520	32	0527	712	0534	14	0541	224	0548	950	0555	3.703	0562	0	0569	4.653	0576	5.944	0583	5.944	0589	78,27
Total	0521	147	0528	795	0535	24	0542	228	0549	1.047	0556	19.873	0563	0	0570	20.920	0577	30.341			0590	68,95

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0600	16	1600	5	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	37	1601	28	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	101	1602	44	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	355	1603	254	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	469	1604	296	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	8.402	1605	6.204	2605	58
Superior a 10 años	0606	322.135	1606	340.090	2606	599.942
Total	0607	331.515	1607	346.920	2607	600.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	20,00	1608	20,64	2608	29,68

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 24/06/2010	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	13,55	1609	12,80	2609	3,22

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 24/06/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	114	0630	7.074	1620	88	1630	5.789	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	759	0631	86.470	1621	631	1631	73.775	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	1.327	0632	204.369	1622	1.473	1632	226.943	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	156	0633	25.892	1623	188	1633	31.824	2623	2.918	2633	567.668
100% - 120%	0624	33	0634	2.960	1624	36	1634	3.481	2624	50	2634	5.203
120% - 140%	0625	16	0635	1.783	1625	18	1635	1.925	2625	62	2635	7.514
140% - 160%	0626	10	0636	1.234	1626	9	1636	1.110	2626	43	2636	5.469
superior al 160%	0627	11	0637	1.733	1627	13	1637	2.073	2627	90	2637	14.146
Total	0628	2.426	0638	331.515	1628	2.456	1638	346.920	2628	3.163	2638	600.000
Media ponderada (%)	0639	66,77	0649		1639	68,55	1649		2639	91,03	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 24/06/2010	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,45	1650	0,53	2650	2,03
Tipo de interés nominal máximo	0651	5,50	1651	5,50	2651	6,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,01	1652	0,01	2652	1,43

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 24/06/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	268	0683	27.264	1660	273	1683	28.545	2660	351	2683	51.156
Aragón	0661	35	0684	3.816	1661	35	1684	3.945	2661	38	2684	5.717
Asturias	0662	41	0685	4.035	1662	42	1685	4.199	2662	50	2685	6.714
Baleares	0663	35	0686	5.069	1663	36	1686	5.566	2663	65	2686	12.923
Canarias	0664	44	0687	4.125	1664	45	1687	4.390	2664	60	2687	7.971
Cantabria	0665	40	0688	4.143	1665	40	1688	4.271	2665	45	2688	6.748
Castilla-León	0666	86	0689	8.037	1666	87	1689	8.516	2666	112	2689	16.110
Castilla La Mancha	0667	199	0690	20.296	1667	200	1690	21.242	2667	285	2690	42.443
Cataluña	0668	230	0691	34.169	1668	231	1691	35.429	2668	330	2691	63.316
Ceuta	0669	6	0692	502	1669	6	1692	519	2669	7	2692	900
Extremadura	0670	25	0693	1.902	1670	25	1693	1.973	2670	36	2693	4.120
Galicia	0671	102	0694	11.893	1671	105	1694	12.466	2671	126	2694	18.967
Madrid	0672	1.069	0695	176.117	1672	1.080	1695	183.397	2672	1.339	2695	305.733
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	15	0697	1.484	1674	16	1697	1.719	2674	23	2697	3.585
Navarra	0675	7	0698	802	1675	8	1698	974	2675	10	2698	1.875
La Rioja	0676	9	0699	925	1676	10	1699	1.300	2676	11	2699	1.834
Comunidad Valenciana	0677	179	0700	21.068	1677	181	1700	22.434	2677	234	2700	40.478
País Vasco	0678	36	0701	5.870	1678	36	1701	6.036	2678	41	2701	9.409
Total España	0679	2.426	0702	331.515	1679	2.456	1702	346.920	2679	3.163	2702	600.000
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	2.426	0705	331.515	1682	2.456	1705	346.920	2682	3.163	2705	600.000

MADRID RESIDENCIAL II -FTA

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 24/06/2010			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,65			1710	1,61			2710	1,46		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2020			Situación cierre anual anterior 31/12/2019			Situación inicial 24/06/2010		
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722
ES0358969006	Bono A	4.560	40.712	185.648	4.560	44.541	203.105	4.560	100.000	456.000
Total		0723 4.560		0724 185.648	1723 4.560		1724 203.105	2723 4.560		2724 456.000

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado							
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738		0739				
ES0358969006	Bono A	NS	EURIBOR 3 m	0,40	0,00	0	0	SI	185.648	0	185.648		0				
Total						0740	0	0741	0	0743	185.648	0744	0	0745	185.648	0746	0

	Situación actual 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 24/06/2010
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,03	0748
			0,05
			0749
			0,00

MADRID RESIDENCIAL II -FTA

S.05.2
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2020
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2020								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2019							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0358969006	Bono A	4.937	270.352	60	21.777	6.426	247.025	47	21.718								
Total		0754	4.937	0755	270.352	0756	60	0757	21.777	1754	6.426	1755	247.025	1756	47	1757	21.718

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2020

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 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 24/06/2010
				0762	0763	0764
ES0358969006	Bono A	28/01/2019	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0358969006	Bono A	05/11/2012	SYP	A	A	AAA

S.05.2
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2020
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 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0765	54.149	1765	73.339	2765	10.044
Entre 1 y 2 años	0766	47.815	1766	41.369	2766	12.488
Entre 2 y 3 años	0767	4.509	1767	4.541	2767	12.975
Entre 3 y 4 años	0768	4.509	1768	4.555	2768	13.480
Entre 4 y 5 años	0769	4.514	1769	4.552	2769	14.006
Entre 5 y 10 años	0770	31.045	1770	23.900	2770	78.664
Superior a 10 años	0771	39.106	1771	50.849	2771	314.344
Total	0772	185.648	1772	203.105	2772	456.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	17,22	1773	17,97	2773	29,41

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 24/06/2010	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	29.893	1775	30.000	2775	60.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	30.000	1776	30.000	2776	60.000
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	16,10	1777	14,77	2777	13,16
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Bankia	1778	Bankia	2778	Caja Madrid
1.4 Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781		1781		2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782		1782		2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784		1784		2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786		1786		2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787		1787		2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788		1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	N	1791	N	2791	N
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	100,00	1792	100,00	2792	100,00
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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 30/09/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 24/06/2010	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap de Bases	BBVA	TRIMESTRAL	Media de los Euribor 12M en cada Fecha de Referencia	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	Tipo de Referencia de los Bonos + 0,246%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	4.580	4.580		
Total							0808 4.580	0809 4.580	0810	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 24/06/2010		Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 24/06/2010			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	1.585	7006	1.201	7009	0,49	7012	0,35	7015	0,63		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.585	7008	1.201	7011	0,49	7014	0,35	7017	0,63	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	18.683	7024	18.527	7027	5,41	7030	5,13	7033	5,39		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	266	7025	380	7028	0,08	7031	0,11	7034	0,08		
Total Fallidos					7023	18.949	7026	18.907	7029	5,49	7032	5,24	7035	5,46	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
Préstamo B	1,50	0,39	0,44	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	48,00	43,68	43,04	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	48,00	43,68	43,04	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	10,00	54,38	54,94	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	10,00	54,38	54,94	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	1,50	0,39	0,44	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Préstamo B	9,95	4,13	4,13	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		16,10	15,69	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862		2862	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados de Transmisión de Hipoteca en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,015	4862		5862	17	6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	Bankia	1863		2863	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Préstamos Hipotecarios en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3863	0,010	4863		5863		6863	TRIMESTRAL	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	Bankia	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 RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

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

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo				Total
		24/02/2020	22/05/2020	24/08/2020		
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885					
Saldo inicial	0886	30.000	30.000	29.897		
Cobros del periodo	0887	7.262	5.787	5.029		
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-162	-187	-110		
Pagos por derivados	0889	0	0	176		
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-30.000	-29.897	-29.893		
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-6.866	-5.654	-4.997		
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-234	-49	-102		
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0		
Saldo disponible	0894	0	0	0		
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	0		0

S.06

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2020

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