

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8591
NIF Fondo: V84916956
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2019

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

S.01

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	516.604	1001	546.794
I. Activos financieros a largo plazo	0002	516.604	1002	546.794
1. Activos titulizados	0003	516.604	1003	546.794
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	502.419	1005	532.400
1.3 Préstamos hipotecarios	0006	0	1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007	0	1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008	0	1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009	0	1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010	0	1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011	0	1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012	0	1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013	0	1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014	0	1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015	0	1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016	0	1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017	0	1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018	0	1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019	0	1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020	0	1020	0
1.18 Bonos de titulización	0021	0	1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022	0	1022	0
1.20 Otros	0023	0	1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024	0	1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	14.226	1025	14.434
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-41	1027	-41
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	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: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	70.766	1041	71.791
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	18.395	1042	21.709
V. Activos financieros a corto plazo	0043	39.122	1043	39.083
1. Activos titulizados	0044	39.122	1044	39.083
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	35.955	1046	36.078
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048	0	1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049	0	1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050	0	1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051	0	1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052	0	1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053	0	1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054	0	1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055	0	1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056	0	1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057	0	1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058	0	1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060	0	1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061	0	1061	0
1.18 Bonos de titulización	0062	0	1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063	0	1063	0
1.20 Otros	0064	0	1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	154	1065	160
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	35	1066	29
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	3.596	1067	3.429
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	65	1068	70
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-683	1069	-683
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	0	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075	0	1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076	0	1076	0
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
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	13.250	1085	10.999
1. Tesorería	0086	13.250	1086	10.999
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	587.370	1088	618.585

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	526.301	1089	556.783
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	526.301	1094	556.783
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	500.146	1095	530.625
1.1 Series no subordinadas	0096	320.146	1096	350.625
1.2 Series subordinadas	0097	180.000	1097	180.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	0	1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	15.184	1101	15.187
2.1 Préstamo subordinado	0102	68.941	1102	68.941
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-53.757	1105	-53.754
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108	10.971	1108	10.971
3.1 Derivados de cobertura	0109	10.971	1109	10.971
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

S.01

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) PASIVO CORRIENTE	0117	73.210	1117	74.037
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	66.019	1123	67.332
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	39.586	1124	41.775
1.1 Series no subordinadas	0125	39.551	1125	39.507
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	35	1128	41
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	0	1129	2.228
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	25.105	1131	24.230
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133	0	1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134	0	1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	0	1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	118	1136	126
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	24.987	1137	24.105
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	1.322	1139	1.322
3.1 Derivados de cobertura	0140	1.322	1140	1.322
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	6	1143	4
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	6	1146	4
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	7.191	1148	6.705
1. Comisiones	0149	17	1149	17
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	13	1150	14
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	3	1152	3
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	7.174	1157	6.687
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-12.141	1158	-12.235
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-12.141	1160	-12.235
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	587.370	1162	618.585

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2019		Acumulado anterior 30/09/2018
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	1.076	1201	1.077	2201	3.308	3201	3.320
1.1 Activos titulizados	0202	1.076	1202	1.077	2202	3.308	3202	3.320
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-398	1204	-404	2204	-1.204	3204	-1.196
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-90	1205	-95	2205	-280	3205	-280
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-289	1206	-295	2206	-874	3206	-875
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-19	1207	-14	2207	-50	3207	-41
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-390	1208	-288	2208	-1.038	3208	-909
A) MARGEN DE INTERESES	0209	288	1209	385	2209	1.066	3209	1.215
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	18	1216	14	2216	40	3216	31
7. Otros gastos de explotación	0217	-847	1217	-464	2217	-1.779	3217	-1.406
7.1 Servicios exteriores	0218	-807	1218	-422	2218	-1.659	3218	-1.278
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-807	1219	-422	2219	-1.659	3219	-1.278
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	-39	1224	-42	2224	-120	3224	-128
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-32	1225	-33	2225	-96	3225	-102
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-8	1227	-8	2227	-24	3227	-26
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	-438	1231	-214	2231	-1.143	3231	-1.477
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-438	1232	-214	2232	-1.143	3232	-1.477
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	435	1238	338	2238	1.813	3238	933
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	544	1239	-59	2239	3	3239	704
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 RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2019		Acumulado anterior 30/09/2018
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	602	1300	727	2300	-272	3300	2.216
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	624	1301	755	2301	-191	3301	2.314
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	1.089	1302	1.074	2302	3.314	3302	3.351
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-96	1303	-14	2303	-2.513	3303	-40
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	-351	1305	-292	2305	-944	3305	-956
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	-17	1308	-14	2308	-47	3308	-42
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-40	1309	-42	2309	-121	3309	-129
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-32	1310	-34	2310	-97	3310	-102
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-8	1312	-9	2312	-24	3312	-26
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	18	1315	14	2315	40	3315	31
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	18	1321	14	2321	40	3321	31
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	294	1322	-2.213	2322	2.522	3322	-4.184
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	1.101	1325	-1.792	2325	3.842	3325	-2.901
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	6.580	1326	6.165	2326	19.258	3326	19.292
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	2.498	1327	2.751	2327	7.066	3327	8.792
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	601	1328	710	2328	1.961	3328	2.315
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	1.425	1330	902	2330	5.992	3330	3.197
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-10.002	1331	-12.320	2331	-30.435	3331	-36.498
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-807	1332	-422	2332	-1.319	3332	-1.282
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	-807	1336	-422	2336	-1.319	3336	-1.282
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	896	1337	-1.487	2337	2.251	3337	-1.967
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	12.354	1338	9.882	2338	10.999	3338	10.362
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	13.250	1339	8.395	2339	13.250	3339	8.395

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2019		Acumulado anterior 30/09/2018
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	-351	1357	-292	2357	-944	3357	-956
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-351	1358	-292	2358	-944	3358	-956
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	390	1360	288	2360	1.038	3360	909
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	-39	1362	3	2362	-94	3362	47
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 RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2019								Situación cierre anual anterior 31/12/2018								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	3,20	0401	14,09	0421	0,00	0441	1,89	1381	3,05	1401	13,31	1421	0,00	1441	2,07	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	17,00
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	315	0467	127	0474	23	0481	0	0488	150	0495	37.252	0502	0	0509	37.403
De 1 a 3 meses	0461	55	0468	59	0475	11	0482	0	0489	70	0496	6.958	0503	0	0510	7.028
De 3 a 6 meses	0462	18	0469	43	0476	5	0483	4	0490	52	0497	2.602	0504	0	0511	2.654
De 6 a 9 meses	0463	3	0470	14	0477	1	0484	1	0491	16	0498	470	0505	0	0512	486
De 9 a 12 meses	0464	5	0471	21	0478	1	0485	3	0492	25	0499	887	0506	0	0513	912
Más de 12 meses	0465	91	0472	2.542	0479	58	0486	792	0493	3.391	0500	11.243	0507	0	0514	14.634
Total	0466	487	0473	2.805	0480	99	0487	800	0494	3.705	0501	59.413	0508	0	1515	63.117

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	315	0522	127	0529	23	0536	0	0543	150	0550	37.252	0557	0	0564	37.403	0571	57.913	0578	57.913	0584	64,58
De 1 a 3 meses	0516	55	0523	59	0530	11	0537	0	0544	70	0551	6.958	0558	0	0565	7.028	0572	10.969	0579	10.969	0585	64,07
De 3 a 6 meses	0517	18	0524	43	0531	5	0538	4	0545	52	0552	2.602	0559	0	0566	2.654	0573	3.888	0580	3.888	0586	68,28
De 6 a 9 meses	0518	3	0525	14	0532	1	0539	1	0546	16	0553	470	0560	0	0567	486	0574	755	0581	755	0587	64,38
De 9 a 12 meses	0519	5	0526	21	0533	1	0540	3	0547	25	0554	887	0561	0	0568	912	0575	1.111	0582	1.111	0588	82,08
Más de 12 meses	0520	91	0527	2.542	0534	58	0541	792	0548	3.391	0555	11.243	0562	0	0569	14.634	0576	17.939	0583	17.939	0589	81,58
Total	0521	487	0528	2.805	0535	99	0542	800	0549	3.705	0556	59.413	0563	0	0570	63.117	0577	92.574			0590	68,18

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	156	1600	134	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	223	1601	211	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	549	1602	444	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	1.407	1603	911	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	1.793	1604	1.861	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	55.264	1605	40.756	2605	241
Superior a 10 años	0606	496.804	1606	542.026	2606	1.799.759
Total	0607	556.195	1607	586.342	2607	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	15,78	1608	16,44	2608	27,35

Antigüedad	Situación actual 30/09/2019					
	Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 05/12/2006			
Antigüedad media ponderada (años)	0609	14,36	1609	13,62	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: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 05/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	575	0630	22.647	1620	470	1630	18.692	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.661	0631	155.029	1621	1.430	1631	129.009	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	2.103	0632	322.291	1622	2.380	1632	353.933	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	277	0633	56.229	1623	430	1633	84.709	2623	9.439	2633	1.699.335
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	445	2634	100.665
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	4.616	0638	556.195	1628	4.710	1638	586.342	2628	9.884	2638	1.800.000
Media ponderada (%)	0639	66,14	0649		1639	68,04	1649		2639	94,44	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,78	1650	0,74	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	2,50	1651	2,07	2651	6,00
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,03	1652	0,06	2652	2,70

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2019
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 05/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	204	0683	17.777	1660	213	1683	19.050	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	79	0684	6.853	1661	82	1684	7.209	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	43	0685	3.400	1662	44	1685	3.609	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	42	0686	4.811	1663	43	1686	5.142	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	34	0687	2.588	1664	37	1687	2.871	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	79	0688	6.186	1665	81	1688	6.768	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	117	0689	8.641	1666	117	1689	9.080	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	204	0690	19.699	1667	207	1690	20.629	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	500	0691	67.778	1668	510	1691	71.297	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	30	0692	1.040	1669	30	1692	1.128	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	26	0693	1.498	1670	29	1693	1.715	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	94	0694	8.200	1671	94	1694	8.535	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	2.828	0695	377.556	1672	2.877	1695	396.989	2672	6.243	2695	1.238.324
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	16	0697	1.199	1674	17	1697	1.358	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	18	0698	2.131	1675	18	1698	2.197	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	14	0699	1.372	1676	14	1699	1.421	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	189	0700	13.050	1677	194	1700	14.127	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	99	0701	12.417	1678	103	1701	13.217	2678	162	2701	31.874
Total España	0679	4.616	0702	556.195	1679	4.710	1702	586.342	2679	9.884	2702	1.800.000
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	4.616	0705	556.195	1682	4.710	1705	586.342	2682	9.884	2705	1.800.000

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2019
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 05/12/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,78			1710	0,74			2710	0,37		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2019			Situación cierre anual anterior 31/12/2018			Situación inicial 05/12/2006					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente			
		0720	Nominal unitario (€) 0721	0722	1720	Nominal unitario (€) 1721	1722	2720	Nominal unitario (€) 2721	2722			
ES0359092006	SERIE A1	4.140	0	0	4.140	0	0	4.140	100.000	414.000			
ES0359092014	SERIE A2	9.360	9.583	89.697	9.360	12.835	120.132	9.360	100.000	936.000			
ES0359092022	SERIE A3	2.700	100.000	270.000	2.700	100.000	270.000	2.700	100.000	270.000			
ES0359092030	SERIE B	630	100.000	63.000	630	100.000	63.000	630	100.000	63.000			
ES0359092048	SERIE C	675	100.000	67.500	675	100.000	67.500	675	100.000	67.500			
ES0359092055	SERIE D	306	100.000	30.600	306	100.000	30.600	306	100.000	30.600			
ES0359092063	SERIE E	189	100.000	18.900	189	100.000	18.900	189	100.000	18.900			
Total		0723	18.000	0724	539.697	1723	18.000	1724	570.132	2723	18.000	2724	1.800.000

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses					Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas				
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado							
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739					
ES0359092006	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	0	0	NO	0	0	0	0					
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	0	0	NO	89.697	0	89.697	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	0,08	3	0	NO	30.600	0	30.603	0					
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	1,58	32	0	NO	18.900	0	18.932	0					
Total						0740	35	0741	0	0743	539.697	0744	0	0745	539.731	0746	0

	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,07	0748	0,06	0749	0,00

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: 30/09/2019
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2019								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2018							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	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	414.000	0	23.408
ES0359092014	SERIE A2	10.002	846.303	0	125.437	0	846.303	0	125.437	12.320	804.236	0	125.437	0	804.236	0	125.437
ES0359092022	SERIE A3	0	0	0	42.820	0	0	0	42.820	0	0	0	42.820	0	0	0	42.820
ES0359092030	SERIE B	0	0	0	10.352	0	0	0	10.352	0	0	0	10.352	0	0	0	10.352
ES0359092048	SERIE C	0	0	0	11.422	0	0	0	11.422	0	0	0	11.422	0	0	0	11.422
ES0359092055	SERIE D	0	0	15	5.946	0	0	15	5.946	0	0	14	5.889	0	0	14	5.889
ES0359092063	SERIE E	0	0	81	7.319	0	0	81	7.319	0	0	0	7.319	0	0	0	7.319
Total		0754	10.002	0755	1.260.303	0756	96	0757	226.703	1754	12.320	1755	1.218.236	1756	14	1757	224.176

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 05/12/2006
				0760	0761	0762
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092014	SERIE A2	22/12/2017	FCH	A-	A-	AAA
ES0359092014	SERIE A2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	04/05/2018	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092022	SERIE A3	22/12/2017	FCH	A-	A-	AAA
ES0359092022	SERIE A3	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	04/05/2018	SYP	AA	AA	AAA
ES0359092030	SERIE B	11/07/2019	FCH	BBB	BBB-	AA
ES0359092030	SERIE B	29/06/2018	MDY	A1	A1	Aa1
ES0359092030	SERIE B	28/05/2019	SYP	AA-	A-	AA
ES0359092048	SERIE C	11/07/2019	FCH	BB-	B+	A
ES0359092048	SERIE C	29/06/2018	MDY	Ba3	Ba3	A1
ES0359092048	SERIE C	28/05/2019	SYP	BBB	BBB-	A
ES0359092055	SERIE D	11/07/2019	FCH	B-	CCC	BBB
ES0359092055	SERIE D	11/09/2009	MDY	C	C	Baa2
ES0359092055	SERIE D	28/05/2019	SYP	B-	CCC+	BBB
ES0359092063	SERIE E	18/03/2009	FCH	CC	CC	BB+
ES0359092063	SERIE E	11/09/2009	MDY	C	C	Ba1
ES0359092063	SERIE E	20/03/2013	SYP	D	D	BB

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: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	20.928	1765	24.740	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	26.956	1766	26.868	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	28.223	1767	28.035	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	29.484	1768	29.306	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	30.681	1769	30.579	2769	41.891
Entre 5 y 10 años	0770	168.083	1770	165.409	2770	241.519
Superior a 10 años	0771	235.341	1771	265.194	2771	1.370.127
Total	0772	539.696	1772	570.132	2772	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	10,48	1773	11,65	2773	25,20

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 05/12/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	3.969	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	0,74	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	66,64	1792	68,16	2792	90,00
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 05/12/2006	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap de Bases	BANCO SANTANDER	TRIMESTRAL	Media de los Euribor 12M en cada Fecha de Referencia	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	Tipo de Referencia de los Bonos - 0,055%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	-12.294	-12.294		
Total							0808 -12.294	0809 -12.294	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

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 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 05/12/2006		Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 05/12/2006			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	2.129	7006	1.010	7009	0,40	7012	0,18	7015	0,34		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	2.129	7008	1.010	7011	0,40	7014	0,18	7017	0,34	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	72.913	7024	84.574	7027	12,02	7030	13,06	7033	12,12		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	66	7025	154	7028	0,01	7031	0,02	7034	0,01		
Total Fallidos					7023	72.979	7026	84.727	7029	12,03	7032	13,09	7035	12,13	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

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
SERIE C - ES0359092048	7,50	12,51	12,28	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	1,75	0,40	0,32	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,40	0,32	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	10,00	36,84	37,25	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	36,84	37,25	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	10,00	36,84	37,25	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	1,25	0,40	0,32	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	7,21	7,25	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	2,00	0,40	0,32	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	11,67	11,46	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359092006	25,00	7,21	7,25	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	7,21	7,25	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	3,50	3,44	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	5,67	5,57	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	10,00	36,84	37,25	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE B - ES0359092030	18,30	7,21	7,26	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE D - ES0359092055	9,40	7,21	7,26	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE C - ES0359092048	13,20	7,21	7,26	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE E - ES0359092063	8,00	7,21	7,26	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		0,74	0,56	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo								Total
		22/02/2019	22/05/2019	22/08/2019						
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885									
Saldo inicial	0886	0	466	3.103						
Cobros del periodo	0887	14.147	13.337	11.764						
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-366	-572	-450						
Pagos por derivados	0889	-292	-301	-351						
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-466	-3.103	-3.969						
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-13.024	-9.826	-10.098						
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0						
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0						
Saldo disponible	0894	0	0	0						
Liquidación de comisión variable	0895	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: 30/09/2019

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

INFORME SOBRE EL CUMPLIMIENTO DE LAS POLÍTICAS DE GESTIÓN DE ACTIVOS Y DE RIESGOS