

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8591
NIF Fondo: V84916956
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2023

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: 31/12/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	308.002	1001	371.665
I. Activos financieros a largo plazo	0002	308.002	1002	371.665
1. Activos titulizados	0003	308.002	1003	371.665
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	292.021	1005	359.261
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	16.032	1025	12.444
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-50	1027	-40
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: 31/12/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	79.365	1041	95.199
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	13.573	1042	15.300
V. Activos financieros a corto plazo	0043	29.588	1043	35.523
1. Activos titulizados	0044	29.512	1044	35.294
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	24.041	1046	30.602
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	627	1065	320
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	103	1066	44
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	5.230	1067	4.971
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	153	1068	75
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-641	1069	-717
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	186
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	186
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	76	1074	43
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	76	1079	43
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	36.204	1085	44.376
1. Tesorería	0086	36.204	1086	44.376
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	387.367	1088	466.865

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	308.479	1089	376.419
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	308.479	1094	376.419
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	293.514	1095	358.592
1.1 Series no subordinadas	0096	113.514	1096	178.592
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	13.380	1101	14.350
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	-55.561	1105	-54.591
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	1.585	1108	3.477
3.1 Derivados de cobertura	0109	1.585	1109	3.477
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: 31/12/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) PASIVO CORRIENTE	0117	80.033	1117	93.693
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	73.561	1123	86.991
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	30.783	1124	36.491
1.1 Series no subordinadas	0125	29.271	1125	35.573
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	1.511	1128	918
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	32.510	1131	28.911
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	445	1136	285
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	32.065	1137	28.625
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	399	1139	0
3.1 Derivados de cobertura	0140	399	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	9.870	1143	21.590
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	9.870	1146	21.590
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	6.471	1148	6.702
1. Comisiones	0149	13	1149	14
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	11	1150	12
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
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	6.459	1157	6.688
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-1.144	1158	-3.247
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-1.144	1160	-3.247
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	387.367	1162	466.865

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2023		Acumulado anterior 31/12/2022
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	4.322	1201	2.068	2201	15.770	3201	4.168
1.1 Activos titulizados	0202	4.051	1202	2.011	2202	14.898	3202	4.150
1.2 Otros activos financieros	0203	272	1203	56	2203	872	3203	18
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-4.634	1204	-1.875	2204	-16.196	3204	-3.257
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-3.599	1205	-1.347	2205	-12.596	3205	-1.863
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1.036	1206	-528	2206	-3.599	3206	-1.394
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-92	1208	-29	2208	-388	3208	-418
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-404	1209	164	2209	-813	3209	492
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	0	1216	15	2216	0	3216	15
7. Otros gastos de explotación	0217	-185	1217	-183	2217	-944	3217	-589
7.1 Servicios exteriores	0218	-149	1218	-149	2218	-812	3218	-453
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-149	1219	-149	2219	-812	3219	-453
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	-36	1224	-34	2224	-131	3224	-136
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-25	1225	-27	2225	-104	3225	-110
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-5	1227	0	2227	-21	3227	-19
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228	0	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-6	1230	-6	2230	-6	3230	-6
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-162	1231	-575	2231	-538	3231	-588
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-162	1232	-575	2232	-538	3232	-588
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	571	1238	56	2238	1.324	3238	111
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	180	1239	522	2239	970	3239	558
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: 31/12/2023

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2023		Acumulado anterior 31/12/2022
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	608	1300	1.138	2300	3.573	3300	2.438
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	638	1301	1.166	2301	3.699	3301	2.568
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	4.017	1302	1.831	2302	14.455	3302	3.873
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-3.623	1303	-744	2303	-12.003	3303	-974
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	54	2304	409	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-23	1305	0	2305	0	3305	-306
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	267	1306	25	2306	839	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	0	1308	0	2308	0	3308	-25
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-30	1309	-27	2309	-126	3309	-130
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-25	1310	-27	2310	-105	3310	-111
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	0	2312	-22	3312	-19
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	0	1315	0	2315	0	3315	0
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	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-4.911	1322	2.145	2322	-11.745	3322	9.271
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	-422	1325	3.094	2325	846	3325	2.679
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	5.185	1326	6.320	2326	22.261	3326	25.122
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	9.662	1327	8.092	2327	42.946	3327	23.145
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.021	1328	1.216	2328	4.094	3328	2.903
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	1.123	1330	162	2330	2.926	3330	370
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-17.413	1331	-12.696	2331	-71.380	3331	-48.862
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-4.489	1332	-949	2332	-12.591	3332	6.591
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	6.800
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	-4.489	1336	-949	2336	-12.591	3336	-209
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-4.303	1337	3.283	2337	-8.172	3337	11.709
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	40.507	1338	41.092	2338	44.376	3338	32.667
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	36.204	1339	44.376	2339	36.204	3339	44.376

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2023		Acumulado anterior 31/12/2022
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	1.284	1357	895	2357	1.716	3357	535
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	1.284	1358	895	2358	1.716	3358	535
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	92	1360	29	2360	388	3360	418
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	-1.376	1362	-924	2362	-2.103	3362	-953
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: 31/12/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2023								Situación cierre anual anterior 31/12/2022								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	6,30	0401	21,65	0421	0,00	0441	11,16	1381	4,28	1401	18,53	1421	0,00	1441	5,34	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: 31/12/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

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	128	0467	73	0474	52	0481	0	0488	125	0495	11.833	0502	0	0509	11.959
De 1 a 3 meses	0461	48	0468	67	0475	50	0482	0	0489	118	0496	6.342	0503	0	0510	6.460
De 3 a 6 meses	0462	31	0469	106	0476	49	0483	22	0490	178	0497	3.721	0504	0	0511	3.899
De 6 a 9 meses	0463	16	0470	73	0477	20	0484	38	0491	132	0498	1.953	0505	0	0512	2.085
De 9 a 12 meses	0464	21	0471	136	0478	27	0485	88	0492	250	0499	3.156	0506	0	0513	3.407
Más de 12 meses	0465	85	0472	3.584	0479	57	0486	1.210	0493	4.851	0500	8.533	0507	0	0514	13.384
Total	0466	329	0473	4.039	0480	255	0487	1.360	0494	5.654	0501	35.539	0508	0	1515	41.192

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	128	0522	73	0529	52	0536	0	0543	125	0550	11.833	0557	0	0564	11.959	0571	23.943	0578	23.943	0584	49,94
De 1 a 3 meses	0516	48	0523	67	0530	50	0537	0	0544	118	0551	6.342	0558	0	0565	6.460	0572	10.495	0579	10.495	0585	61,55
De 3 a 6 meses	0517	31	0524	106	0531	49	0538	22	0545	178	0552	3.721	0559	0	0566	3.899	0573	7.051	0580	7.051	0586	55,29
De 6 a 9 meses	0518	16	0525	73	0532	20	0539	38	0546	132	0553	1.953	0560	0	0567	2.085	0574	3.387	0581	3.387	0587	61,55
De 9 a 12 meses	0519	21	0526	136	0533	27	0540	88	0547	250	0554	3.156	0561	0	0568	3.407	0575	5.121	0582	5.121	0588	66,53
Más de 12 meses	0520	85	0527	3.584	0534	57	0541	1.210	0548	4.851	0555	8.533	0562	0	0569	13.384	0576	16.662	0583	16.662	0589	80,33
Total	0521	329	0528	4.039	0535	255	0542	1.360	0549	5.654	0556	35.539	0563	0	0570	41.192	0577	66.660			0590	61,80

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	529	1600	448	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	730	1601	526	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.324	1602	1.195	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	3.655	1603	1.781	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	8.895	1604	4.801	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	49.204	1605	57.978	2605	241
Superior a 10 años	0606	272.987	1606	340.549	2606	1.799.759
Total	0607	337.324	1607	407.278	2607	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	12,29	1608	13,06	2608	27,35

Antigüedad	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 05/12/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	18,52	1609	17,53	2609	1,72

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				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	1.332	0630	59.281	1620	1.144	1630	49.184	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.269	0631	130.795	1621	1.459	1631	148.430	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	851	0632	119.659	1622	1.245	1632	177.427	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	137	0633	27.589	1623	158	1633	32.237	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	3.589	0638	337.324	1628	4.006	1638	407.278	2628	9.884	2638	1.800.000
Media ponderada (%)	0639	55,02	0649		1639	57,78	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: 31/12/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	4,14	1650	0,93	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,16	1651	4,63	2651	6,00
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,90	1652	0,25	2652	2,70

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				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	146	0683	9.416	1660	173	1683	12.343	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	60	0684	4.155	1661	65	1684	4.744	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	30	0685	2.030	1662	36	1685	2.431	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	27	0686	2.061	1663	30	1686	2.700	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	21	0687	1.258	1664	25	1687	1.681	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	58	0688	3.237	1665	64	1688	3.857	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	92	0689	5.004	1666	97	1689	5.671	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	152	0690	11.017	1667	170	1690	13.819	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	370	0691	39.913	1668	430	1691	49.924	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	18	0692	421	1669	23	1692	496	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	16	0693	754	1670	22	1693	1.009	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	73	0694	4.998	1671	82	1694	5.997	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	2.271	0695	235.971	1672	2.506	1695	281.856	2672	6.243	2695	1.238.324
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	9	0697	615	1674	11	1697	773	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	14	0698	1.297	1675	16	1698	1.622	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	12	0699	996	1676	13	1699	1.095	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	146	0700	7.281	1677	161	1700	8.953	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	74	0701	6.902	1678	82	1701	8.308	2678	162	2701	31.874
Total España	0679	3.589	0702	337.324	1679	4.006	1702	407.278	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	3.589	0705	337.324	1682	4.006	1705	407.278	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: 31/12/2023
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 05/12/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,03			1710	0,94			2710	0,37		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			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	0	0	9.360	0	0	9.360	100.000	936.000			
ES0359092022	SERIE A3	2.700	52.883	142.785	2.700	79.320	214.165	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	322.785	1723	18.000	1724	394.165	2723	18.000	2724	1.800.000

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2023

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		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
									0730	0731	0732	0733			0734	0735	0742
ES0359092006	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	4,15	642	0	NO	142.785	0	0	143.427	0	0			
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	4,21	287	0	NO	63.000	0	0	63.287	0	0			
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	4,26	312	0	NO	67.500	0	0	67.812	0	0			
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	4,46	148	0	NO	30.600	0	0	30.748	0	0			
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	5,96	122	0	NO	18.900	0	0	19.022	0	0			
Total						0740	1.511	0741	0	0743	322.785	0744	0	0745	324.296	0746	0

	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	3,58	0748	0,56	0749	0,00

S.05.2
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/12/2023
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2023								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2022							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0359092006	SERIE A1	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408
ES0359092014	SERIE A2	0	936.000	0	125.437	0	936.000	0	125.437	0	936.000	0	125.437	0	936.000	0	125.437
ES0359092022	SERIE A3	17.413	127.215	1.640	48.926	12.696	55.835	337	43.157	17.413	127.215	1.640	48.926	12.696	55.835	337	43.157
ES0359092030	SERIE B	0	0	655	12.481	0	0	103	10.455	0	0	655	12.481	0	0	103	10.455
ES0359092048	SERIE C	0	0	710	13.749	0	0	119	11.544	0	0	710	13.749	0	0	119	11.544
ES0359092055	SERIE D	0	0	338	7.128	0	0	70	6.066	0	0	338	7.128	0	0	70	6.066
ES0359092063	SERIE E	0	0	281	9.259	0	0	115	8.316	0	0	281	9.259	0	0	115	8.316
Total		0754	17.413	0755	1.477.215	0756	3.623	0757	240.387	1754	12.696	1755	1.405.835	1756	744	1757	228.384

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	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	29/09/2021	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	29/09/2021	FCH	A+	A+	AAA
ES0359092022	SERIE A3	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	01/06/2022	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092030	SERIE B	27/03/2023	FCH	A+	A	AA
ES0359092030	SERIE B	22/06/2022	MDY	Aa1	Aa1	Aa1
ES0359092030	SERIE B	01/06/2022	SYP	AA+	AA+	AA
ES0359092048	SERIE C	27/03/2023	FCH	BB+	BB	A
ES0359092048	SERIE C	26/10/2023	MDY	A1	Baa1	A1
ES0359092048	SERIE C	01/06/2022	SYP	AA	AA	A
ES0359092055	SERIE D	27/03/2023	FCH	B	B-	BBB
ES0359092055	SERIE D	26/10/2023	MDY	B3	Caa1	Baa2
ES0359092055	SERIE D	01/06/2022	SYP	BB+	BB+	BBB
ES0359092063	SERIE E	18/03/2009	FCH	CC	CC	BB+
ES0359092063	SERIE E	11/09/2009	MDY	C	C	Ba1
ES0359092063	SERIE E	01/06/2022	SYP	CCC-	CCC-	BB

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	23.162	1765	26.465	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	24.243	1766	26.829	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	25.224	1767	28.097	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	25.263	1768	29.368	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	193.159	1769	29.960	2769	41.891
Entre 5 y 10 años	0770	31.733	1770	253.446	2770	241.519
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	1.370.127
Total	0772	322.785	1772	394.165	2772	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	6,65	1773	7,65	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: 31/12/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 05/12/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	11.450	1775	8.724	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	3,55	1777	2,21	2777	3,48
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	CaixaBank	1778	CaixaBank	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	44,23	1792	54,33	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	

S.05.3

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	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	-1.984	-3.291		
Total							0808 -1.984	0809 -3.291	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 05/12/2006		Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		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: 31/12/2023

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	3.043	7006	1.104	7009	0,97	7012	0,29	7015	0,85		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	3.043	7008	1.104	7011	0,97	7014	0,29	7017	0,85	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	61.088	7024	64.467	7027	16,33	7030	14,37	7033	16,13		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	426	7025	598	7028	0,11	7031	0,13	7034	0,15		
Total Fallidos					7023	61.515	7026	65.065	7029	16,44	7032	14,50	7035	16,28	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

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 B - ES0359092030	2,00	0,97	0,85	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	1,25	0,97	0,85	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,97	0,85	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	24,38	25,00	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359092006	25,00	7,01	7,06	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	19,52	18,52	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	1,75	0,97	0,85	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	10,00	24,38	25,00	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	10,00	24,38	25,00	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	7,01	7,06	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	10,00	24,38	25,00	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	5,86	5,56	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	7,01	7,06	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	9,48	8,99	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	7,50	20,91	19,84	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE B - ES0359092030	18,30	7,01	7,06	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE C - ES0359092048	13,20	7,01	7,06	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE D - ES0359092055	9,40	7,01	7,06	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE E - ES0359092063	8,00	7,01	7,06	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		3,55	3,65	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

S.05.5

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

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	11	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	

S.05.5
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2023

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	Integrado en el pago de los intereses de los bonistas
Contrapartida	0870	Bonista
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Cláusula 13.4 Intereses de los Bonos Iniciales

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: 31/12/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo					Total
		22/02/2023	22/05/2023	22/08/2023	22/11/2023		
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885						
Saldo inicial	0886	8.724	10.354	11.607	12.421		
Cobros del periodo	0887	19.825	23.018	23.561	20.300		
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-135	-447	-210	-212		
Pagos por derivados	0889	363	68	0	-23		
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-10.354	-11.607	-12.421	-11.450		
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-18.424	-21.387	-22.537	-21.036		
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0	0		
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0	0		
Saldo disponible	0894	0	0	0	0		
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	0	0		0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

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