

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: TITULACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.

NIF Gestora: A80352750

Fondo Abierto: NO

Fondo Privado: NO

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2025

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: 30/09/2025				

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2025		Periodo anterior 31/12/2024
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE				
I. Activos financieros a largo plazo				
1. Activos titulizados	0001	221.983	1001	257.623
1.1 Participaciones hipotecarias	0002	221.983	1002	257.623
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0003	0	1003	0
1.3 Préstamos hipotecarios	0004	208.123	1005	241.807
1.4 Cédulas hipotecarias	0005	0	1006	0
1.5 Préstamos a promotores	0006	0	1007	0
1.6 Préstamos a PYMES	0007	0	1008	0
1.7 Préstamos a empresas	0008	0	1009	0
1.8 Préstamos corporativos	0009	0	1010	0
1.9 Cédulas territoriales	0010	0	1011	0
1.10 Bonos de tesorería	0011	0	1012	0
1.11 Deuda subordinada	0012	0	1013	0
1.12 Créditos AAPP	0013	0	1014	0
1.13 Préstamos consumo	0014	0	1015	0
1.14 Préstamos automoción	0015	0	1016	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0016	0	1017	0
1.16 Cuentas a cobrar	0017	0	1018	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0018	0	1019	0
1.18 Bonos de titulización	0019	0	1020	0
1.19 Cédulas internacionalización	0020	0	1021	0
1.20 Otros	0021	0	1022	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0022	0	1023	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0023	0	1024	0
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0024	13.900	1025	15.855
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0025	-40	1026	-40
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0026	0	1027	0
2. Derivados	0027	0	1028	0
2.1 Derivados de cobertura	0028	0	1029	0
2.2 Derivados de negociación	0029	0	1030	0
3. Otros activos financieros	0030	0	1031	0
3.1 Valores representativos de deuda	0031	0	1032	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0032	0	1033	0
3.3 Garantías financieras	0033	0	1034	0
3.4 Otros	0034	0	1035	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0035	0	1036	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0036	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0037	0	1038	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1039	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1040	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: 30/09/2025

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2025		Periodo anterior 31/12/2024
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	67.512	1041	65.329
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	12.367	1042	12.934
V. Activos financieros a corto plazo	0043	28.958	1043	29.024
1. Activos titulizados	0044	28.921	1044	28.972
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	23.285	1046	23.338
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	270	1065	422
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	32	1066	50
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	5.818	1067	5.621
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	152	1068	177
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-636	1069	-636
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	37	1074	52
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	37	1079	52
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	26.187	1085	23.371
1. Tesorería	0086	26.187	1086	23.371
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	289.495	1088	322.952

				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: 30/09/2025				

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2025		Periodo anterior 31/12/2024
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	214.634	1089	249.705
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	214.634	1094	249.705
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	203.953	1095	238.120
1.1 Series no subordinadas	0096	23.953	1096	58.120
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	9.942	1101	10.846
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	-58.998	1105	-58.095
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	739	1108	739
3.1 Derivados de cobertura	0109	739	1109	739
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: 30/09/2025				

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2025		Periodo anterior 31/12/2024
B) PASIVO CORRIENTE	0117	75.830	1117	73.946
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	69.168	1123	67.087
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	29.723	1124	29.941
1.1 Series no subordinadas	0125	29.102	1125	28.959
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	621	1128	982
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	38.813	1131	36.514
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	301	1136	373
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	38.511	1137	36.141
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	632	1139	632
3.1 Derivados de cobertura	0140	632	1140	632
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	6.662	1148	6.859
1. Comisiones	0149	11	1149	12
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	9	1150	10
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	6.651	1157	6.847
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-969	1158	-698
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-969	1160	-698
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	289.495	1162	322.952

							S.02
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA							
Denominación del compartimento:							
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.							
Estados agregados: NO							
Fecha: 30/09/2025							

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2025		Acumulado anterior 30/09/2024
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	2.053	1201	3.502	2201	7.026	3201	11.405
1.1 Activos titulizados	0202	1.923	1202	3.271	2202	6.589	3202	10.649
1.2 Otros activos financieros	0203	130	1203	231	2203	437	3203	756
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-2.227	1204	-3.991	2204	-7.672	3204	-12.740
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.513	1205	-2.986	2205	-5.373	3205	-9.671
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-713	1206	-1.005	2206	-2.299	3206	-3.069
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	-171	1208	22	2208	-373	3208	21
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-345	1209	-467	2209	-1.019	3209	-1.315
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	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-89	1217	-174	2217	-360	3217	-638
7.1 Servicios exteriores	0218	-64	1218	-146	2218	-280	3218	-552
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-64	1219	-146	2219	-280	3219	-552
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	-26	1224	-28	2224	-80	3224	-86
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-22	1225	-24	2225	-68	3225	-73
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-4	1227	-4	2227	-12	3227	-14
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228	0	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-34	1231	-149	2231	-63	3231	-232
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-34	1232	-149	2232	-63	3232	-232
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	12	1238	40	2238	537	3238	237
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	456	1239	751	2239	904	3239	1.948
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 PERÍODO	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: 30/09/2025

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2025		Acumulado anterior 30/09/2024
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	253	1300	431	2300	778	3300	1.315
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	279	1301	459	2301	858	3301	1.402
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	1.966	1302	3.319	2302	6.784	3302	10.767
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-1.549	1303	-3.130	2303	-5.734	3303	-9.999
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	32	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-270	1305	0	2305	-644	3305	-138
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	132	1306	239	2306	452	3306	772
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	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-26	1309	-28	2309	-80	3309	-87
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-22	1310	-24	2310	-69	3310	-73
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-4	1312	-4	2312	-12	3312	-14
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	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	-489	1322	-2.499	2322	2.038	3322	-14.876
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	-425	1325	-2.354	2325	2.324	3325	-4.447
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	4.718	1326	5.335	2326	14.886	3326	15.954
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	5.484	1327	4.016	2327	16.557	3327	20.245
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.148	1328	1.545	2328	3.779	3328	3.231
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	5	1329	0	2329	21	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	100	1330	135	2330	1.104	3330	689
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-11.881	1331	-13.385	2331	-34.023	3331	-44.566
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-64	1332	-146	2332	-286	3332	-10.429
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	-64	1336	-146	2336	-286	3336	-10.429
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-236	1337	-2.068	2337	2.816	3337	-13.561
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	26.422	1338	24.711	2338	23.371	3338	36.204
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	26.187	1339	22.643	2339	26.187	3339	22.643

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2025

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2025		Acumulado anterior 30/09/2024
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 periodo	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	-270	1357	32	2357	-644	3357	-138
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-270	1358	32	2358	-644	3358	-138
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	171	1360	-22	2360	373	3360	-21
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361	0	3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0362	98	1362	-10	2362	271	3362	158
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 periodo	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 periodo	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

	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: 30/09/2025	
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2025					Situación cierre anual anterior 31/12/2024					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	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	7,85	0401	27,25	0421	0,00	0441	7,70	1381	7,49	1401	24,66	1421	0,00	1441	7,92
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446	
Prestamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459	

	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: 30/09/2025	
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	81	0474	26	0481	0	0488	107	0495	10.195	0502	0	0509	10.302
De 1 a 3 meses	0461	10	0468	14	0475	7	0482	0	0489	20	0496	1.188	0503	0	0510	1.208
De 3 a 6 meses	0462	16	0469	46	0476	14	0483	7	0490	67	0497	1.565	0504	0	0511	1.632
De 6 a 9 meses	0463	12	0470	42	0477	12	0484	19	0491	73	0498	1.231	0505	0	0512	1.304
De 9 a 12 meses	0464	12	0471	70	0478	11	0485	24	0492	105	0499	1.182	0506	0	0513	1.287
Más de 12 meses	0465	109	0472	4.234	0479	115	0486	1.780	0493	6.130	0500	11.347	0507	0	0514	17.477
Total	0466	287	0473	4.487	0480	184	0487	1.830	0494	6.502	0501	26.709	0508	0	1515	33.211

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	81	0529	26	0536	0	0543	107	0550	10.195	0557	0	0564	10.302
De 1 a 3 meses	0516	10	0523	14	0530	7	0537	0	0544	20	0551	1.188	0558	0	0565	1.208
De 3 a 6 meses	0517	16	0524	46	0531	14	0538	7	0545	67	0552	1.565	0559	0	0566	1.632
De 6 a 9 meses	0518	12	0525	42	0532	12	0539	19	0546	73	0553	1.231	0560	0	0567	1.304
De 9 a 12 meses	0519	12	0526	70	0533	11	0540	24	0547	105	0554	1.182	0561	0	0568	1.287
Más de 12 meses	0520	109	0527	4.234	0534	115	0541	1.780	0548	6.130	0555	11.347	0562	0	0569	17.477
Total	0521	287	0528	4.487	0535	184	0542	1.830	0549	6.502	0556	26.709	0563	0	0570	33.211

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: 30/09/2025
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 30/09/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	429	1600	492	2600
Entre 1 y 2 años	0601	1.108	1601	762	2601
Entre 2 y 3 años	0602	4.111	1602	2.362	2602
Entre 3 y 4 años	0603	7.783	1603	6.857	2603
Entre 4 y 5 años	0604	9.306	1604	9.666	2604
Entre 5 y 10 años	0605	105.217	1605	59.706	2605
Superior a 10 años	0606	123.172	1606	206.777	2606
Total	0607	251.125	1607	286.621	2607
Vida residual media ponderada (años)	0608	10,94	1608	11,57	2608
					27,35

Antigüedad	Situación actual 30/09/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 05/12/2006
Antigüedad media ponderada (años)	0609	20,24	1609
			19,50
			2609
			1,72

	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: 30/09/2025	
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 30/09/2025				Situación cierre anual anterior 31/12/2024				Situación inicial 05/12/2006			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente
0% - 40%	0620	1.540	0630	68.023	1620	1.446	1630	63.891	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.186	0631	131.680	1621	1.319	1631	142.462	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	222	0632	35.014	1622	392	1632	57.885	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	85	0633	16.409	1623	113	1633	22.384	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	3.033	0638	251.125	1628	3.270	1638	286.621	2628	9.884	2638	1.800.000
Media ponderada (%)	0639	50,40	0649		1639	52,45	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: 30/09/2025
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,69	1650	4,64	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	5,38	1651	5,68	2651	6,00
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,75	1652	0,75	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: 30/09/2025	
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2025				Situación cierre anual anterior 31/12/2024				Situación inicial 05/12/2006			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente
Andalucía	0660	118	0683	6.314	1660	128	1683	7.416	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	53	0684	3.059	1661	58	1684	3.697	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	27	0685	1.503	1662	28	1685	1.759	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	25	0686	1.571	1663	26	1686	1.776	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	21	0687	1.035	1664	21	1687	1.147	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	49	0688	2.221	1665	54	1688	2.769	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	74	0689	3.439	1666	83	1689	4.198	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	109	0690	7.169	1667	128	1690	8.932	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	301	0691	28.634	1668	334	1691	33.535	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	11	0692	230	1669	13	1692	339	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	12	0693	530	1670	13	1693	601	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	67	0694	3.883	1671	69	1694	4.261	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	1.955	0695	179.214	1672	2.082	1695	201.816	2672	6.243	2695	1.238.324
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	9	0697	431	1674	9	1697	465	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	12	0698	914	1675	12	1698	969	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	11	0699	773	1676	11	1699	823	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	120	0700	5.368	1677	132	1700	6.287	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	59	0701	4.839	1678	69	1701	5.832	2678	162	2701	31.874
Total España	0679	3.033	0702	251.125	1679	3.270	1702	286.621	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	3.033	0705	251.125	1682	3.270	1705	286.621	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: 30/09/2025	
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2025			Situación cierre anual anterior 31/12/2024			Situación inicial 05/12/2006		
	Porcentaje		CNAE	Porcentaje		CNAE	Porcentaje		CNAE
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,25		1710	1,16		2710	0,37	
Sector	0711		0712	1711		1712	2711		2712

	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: 30/09/2025	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2025			Situación cierre anual anterior 31/12/2024			Situación inicial 05/12/2006					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
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	19.650	53.055	2.700	32.251	87.079	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	233.055	1723	18.000	1724	267.079	2723	18.000	2724	1.800.000

	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: 30/09/2025	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Intereses						Principal pendiente		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas				
			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	0			
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0			
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	2,22	128	0	NO	53.055	0	53.183	0	0			
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	2,28	156	0	NO	63.000	0	63.156	0	0			
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	2,33	171	0	NO	67.500	0	67.671	0	0			
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	2,53	84	0	NO	30.600	0	30.684	0	0			
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	4,03	83	0	NO	18.900	0	18.983	0	0			
Total					0740	621	0741	0	0743	233.055	0744	0	0745	233.676	0746	0

Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	Situación actual 30/09/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 05/12/2006	
	0747	2,96	0748	4,05	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: 30/09/2025
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

	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: 30/09/2025	
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 30/09/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 05/12/2006
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	13/03/2024	FCH	AA+	AA+	AAA
ES0359092022	SERIE A3	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	01/06/2022	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092030	SERIE B	05/02/2025	FCH	AA+	AA	AA
ES0359092030	SERIE B	22/06/2022	MDY	Aa1	Aa1	Aa1
ES0359092030	SERIE B	01/06/2022	SYP	AA+	AA+	AA
ES0359092048	SERIE C	05/02/2025	FCH	A+	BBB-	A
ES0359092048	SERIE C	07/05/2025	MDY	Aa1	A1	A1
ES0359092048	SERIE C	03/12/2024	SYP	AA+	AA+	A
ES0359092055	SERIE D	05/02/2025	FCH	BBB-	BB	BBB
ES0359092055	SERIE D	07/05/2025	MDY	Baa1	B3	Baa2
ES0359092055	SERIE D	03/12/2024	SYP	A	A	BBB
ES0359092063	SERIE E	05/02/2025	FCH	B+	CC	BB+
ES0359092063	SERIE E	07/05/2025	MDY	Caa2	C	Ba1
ES0359092063	SERIE E	03/12/2024	SYP	B+	B+	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: 30/09/2025	
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 30/09/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 05/12/2006			
Inferior a 1 año	0765	20.467	1765	21.774	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	21.059	1766	20.879	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	21.419	1767	20.943	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	20.834	1768	21.545	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	19.918	1769	21.635	2769	41.891
Entre 5 y 10 años	0770	129.358	1770	160.303	2770	241.519
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	1.370.127
Total	0772	233.055	1772	267.079	2772	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	8,90	1773	5,64	2773	25,20

	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: 30/09/2025	

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo		Situación actual 30/09/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 05/12/2006	
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	17.008	1775	12.768	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	7,30	1777	4,78	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	22,76	1792	32,60	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: 30/09/2025	

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 30/09/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 05/12/2006		
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806		
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	-1.370	-1.370			
Total							0808	-1.370	0809	-1.370	0810

	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: 30/09/2025	

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)				Valor en libros (miles de euros)			Otras características	
	Situación actual 30/09/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 05/12/2006	Situación actual 30/09/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	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		

	S.05.4
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/09/2025	

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 30/09/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación actual 30/09/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación actual 30/09/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	1.595	7006	1.505	
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		
Total Morosos					7005	1.595	7008	1.505	7011
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	57.694	7024	60.999	7027
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	426	7025	426	7028
Total Fallidos					7023	58.121	7026	61.425	7029
									Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024			
0850		1850		2850		3850
0851		1851		2851		3851
0852		1852		2852		3852
0853		1853		2853		3853

	S.05.4
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/09/2025	

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 D - ES0359092055	10,00	19,52	19,89	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	2,00	0,55	0,41	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	8,11	7,72	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	10,00	19,52	19,89	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	1,75	0,55	0,41	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	6,91	6,94	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	1,25	0,55	0,41	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	7,50	28,96	27,56	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	27,03	25,72	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	6,91	6,94	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	13,13	12,49	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,55	0,41	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	10,00	19,52	19,89	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359092006	25,00	6,91	6,94	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	19,52	19,89	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE C - ES0359092048	13,20	6,91	6,94	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE D - ES0359092055	9,40	6,91	6,94	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE E - ES0359092063	8,00	6,91	6,94	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE B - ES0359092030	18,30	6,91	6,94	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		7,30	6,22	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: 30/09/2025	

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)	Periodidad 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	12	2862	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,014	4862		5862	6862
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863	6863
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
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865	6865

	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: 30/09/2025	

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	CAIXABANK
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo Adicional 3.4.3.2

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

	S.05.5
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/09/2025	

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Determinada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)	0885	Fecha cálculo										Total
		24/02/2025	22/05/2025	22/08/2025								
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885											
Saldo inicial	0886	12.768	14.077	15.227								
Cobros del periodo	0887	15.100	14.360	15.562								
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-153	-147	-81								
Pagos por derivados	0889	-175	-199	-270								
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-14.077	-15.227	-17.008								
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-13.463	-12.865	-13.430								
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: 30/09/2025

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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