

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8591
NIF Fondo: V84916956
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2025

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: 30/06/2025	

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2025		Periodo anterior 31/12/2024
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	233.592	1001	257.623
I. Activos financieros a largo plazo	0002	233.592	1002	257.623
1. Activos titulizados	0003	233.592	1003	257.623
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	219.628	1005	241.807
1.3 Préstamos hipotecarios	0006	0	1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007	0	1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008	0	1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009	0	1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010	0	1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011	0	1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012	0	1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013	0	1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014	0	1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015	0	1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016	0	1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017	0	1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018	0	1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019	0	1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020	0	1020	0
1.18 Bonos de titulización	0021	0	1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022	0	1022	0
1.20 Otros	0023	0	1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024	0	1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	14.003	1025	15.855
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-40	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: 30/06/2025	

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2025		Periodo anterior 31/12/2024
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	67.925	1041	65.329
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	12.455	1042	12.934
V. Activos financieros a corto plazo	0043	29.048	1043	29.024
1. Activos titulizados	0044	29.010	1044	28.972
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	23.486	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	301	1065	422
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	42	1066	50
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	5.661	1067	5.621
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	155	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	39	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	39	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	26.422	1085	23.371
1. Tesorería	0086	26.422	1086	23.371
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	301.517	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: 30/06/2025

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2025		Periodo anterior 31/12/2024
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	226.926	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	226.926	1094	249.705
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	215.789	1095	238.120
1.1 Series no subordinadas	0096	35.789	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	10.398	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	-58.543	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: 30/06/2025	

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2025		Periodo anterior 31/12/2024
B) PASIVO CORRIENTE	0117	75.462	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	68.535	1123	67.087
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	29.804	1124	29.941
1.1 Series no subordinadas	0125	29.147	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	657	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	38.099	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	303	1136	373
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	37.796	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	6.927	1148	6.859
1. Comisiones	0149	11	1149	12
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	10	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	6.915	1157	6.847
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-870	1158	-698
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-870	1160	-698
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	301.517	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: 30/06/2025	

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2025		Acumulado anterior 30/06/2024
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	2.298	1201	3.768	2201	4.974	3201	7.903
1.1 Activos titulizados	0202	2.158	1202	3.512	2202	4.666	3202	7.378
1.2 Otros activos financieros	0203	140	1203	256	2203	307	3203	525
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-2.498	1204	-4.263	2204	-5.445	3204	-8.749
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.743	1205	-3.236	2205	-3.860	3205	-6.685
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-755	1206	-1.027	2206	-1.585	3206	-2.064
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	-135	1208	65	2208	-202	3208	-1
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-335	1209	-430	2209	-673	3209	-847
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	-147	1217	-240	2217	-270	3217	-465
7.1 Servicios exteriores	0218	-119	1218	-212	2218	-216	3218	-406
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-119	1219	-212	2219	-216	3219	-406
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	-28	1224	-29	2224	-54	3224	-58
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-23	1225	-24	2225	-46	3225	-49
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-4	1227	-5	2227	-8	3227	-9
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	23	1231	-83	2231	-29	3231	-83
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	23	1232	-83	2232	-29	3232	-83
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	404	1238	33	2238	525	3238	197
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	56	1239	720	2239	448	3239	1.197
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

S.03

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2025

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2025		Acumulado anterior 30/06/2024
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	326	1300	445	2300	525	3300	884
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	353	1301	474	2301	579	3301	942
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	2.220	1302	3.568	2302	4.818	3302	7.448
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-1.818	1303	-3.304	2303	-4.186	3303	-6.869
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-199	1305	-53	2305	-374	3305	-170
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	150	1306	263	2306	321	3306	533
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	-27	1309	-29	2309	-54	3309	-59
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-23	1310	-24	2310	-46	3310	-49
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-4	1312	-5	2312	-8	3312	-9
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	849	1322	-11.523	2322	2.527	3322	-12.376
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	972	1325	-838	2325	2.750	3325	-2.094
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	5.332	1326	5.060	2326	10.169	3326	10.619
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	5.047	1327	7.696	2327	11.073	3327	16.229
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	851	1328	1.213	2328	2.631	3328	1.687
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	14	1329	0	2329	16	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	774	1330	82	2330	1.004	3330	554
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-11.047	1331	-14.890	2331	-22.142	3331	-31.182
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-123	1332	-10.685	2332	-223	3332	-10.283
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	-123	1336	-10.685	2336	-223	3336	-10.283
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	1.175	1337	-11.077	2337	3.052	3337	-11.493
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	25.248	1338	35.789	2338	23.371	3338	36.204
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	26.422	1339	24.711	2339	26.422	3339	24.711

	S.04
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2025	

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2025		Acumulado anterior 30/06/2024
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	-199	1357	-53	2357	-374	3357	-170
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-199	1358	-53	2358	-374	3358	-170
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	135	1360	-65	2360	202	3360	1
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	64	1362	118	2362	172	3362	168
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: 30/06/2025

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2025								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		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	7,48	0401	26,35	0421	0,00	0441	6,90	1381	7,49	1401	24,66	1421	0,00	1441	7,92	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	
Prestamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1															
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA															
Denominación del compartimento:															
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.															
Estados agregados: NO															
Fecha: 30/06/2025															
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	78	0474	27	0481	0	0488	106	0495	10.265	0502	0	0509	10.370
De 1 a 3 meses	0461	20	0468	28	0475	10	0482	0	0489	38	0496	1.819	0503	0	0510	1.857
De 3 a 6 meses	0462	13	0469	35	0476	12	0483	8	0490	55	0497	1.227	0504	0	0511	1.282
De 6 a 9 meses	0463	13	0470	53	0477	14	0484	19	0491	86	0498	1.374	0505	0	0512	1.460
De 9 a 12 meses	0464	12	0471	62	0478	14	0485	29	0492	104	0499	1.219	0506	0	0513	1.323
Más de 12 meses	0465	110	0472	4.142	0479	116	0486	1.729	0493	5.987	0500	11.551	0507	0	0514	17.538
Total	0466	296	0473	4.399	0480	192	0487	1.784	0494	6.375	0501	27.456	0508	0	1515	33.831

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	78	0529	27	0536	0	0543	106	0550	10.265	0557	0	0564	10.370	0571	24.461	0578	24.461	0584	42,39
De 1 a 3 meses	0516	20	0523	28	0530	10	0537	0	0544	38	0551	1.819	0558	0	0565	1.857	0572	3.791	0579	3.791	0585	48,99
De 3 a 6 meses	0517	13	0524	35	0531	12	0538	8	0545	55	0552	1.227	0559	0	0566	1.282	0573	2.794	0580	2.794	0586	45,89
De 6 a 9 meses	0518	13	0525	53	0532	14	0539	19	0546	86	0553	1.374	0560	0	0567	1.460	0574	2.548	0581	2.548	0587	57,27
De 9 a 12 meses	0519	12	0526	62	0533	14	0540	29	0547	104	0554	1.219	0561	0	0568	1.323	0575	2.260	0582	2.260	0588	58,55
Más de 12 meses	0520	110	0527	4.142	0534	116	0541	1.729	0548	5.987	0555	11.551	0562	0	0569	17.538	0576	22.893	0583	22.893	0589	76,61
Total	0521	296	0528	4.399	0535	192	0542	1.784	0549	6.375	0556	27.456	0563	0	0570	33.831	0577	58.747			0590	57,59

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: 30/06/2025
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 30/06/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	504	1600	492	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	823	1601	762	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	3.734	1602	2.362	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	7.770	1603	6.857	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	9.167	1604	9.666	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	87.769	1605	59.706	2605	241
Superior a 10 años	0606	153.010	1606	206.777	2606	1.799.759
Total	0607	262.778	1607	286.621	2607	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	11,18	1608	11,57	2608	27,35

Antigüedad	Situación actual 30/06/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 05/12/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	19,99	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: 30/06/2025	
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 30/06/2025				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	
0% - 40%	0620	1.508	0630	67.186	1620	1.446	1630	63.891	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.237	0631	136.095	1621	1.319	1631	142.462	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	264	0632	40.586	1622	392	1632	57.885	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	97	0633	18.912	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	3.106	0638	262.778	1628	3.270	1638	286.621	2628	9.884	2638	1.800.000
Media ponderada (%)	0639	51,13	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: 30/06/2025	
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	4,03	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: 30/06/2025	
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2025				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	
Andalucía	0660	120	0683	6.650	1660	128	1683	7.416	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	55	0684	3.231	1661	58	1684	3.697	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	27	0685	1.571	1662	28	1685	1.759	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	26	0686	1.693	1663	26	1686	1.776	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	21	0687	1.062	1664	21	1687	1.147	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	50	0688	2.289	1665	54	1688	2.769	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	77	0689	3.652	1666	83	1689	4.198	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	113	0690	7.584	1667	128	1690	8.932	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	310	0691	29.945	1668	334	1691	33.535	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	12	0692	241	1669	13	1692	339	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	12	0693	542	1670	13	1693	601	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	67	0694	3.970	1671	69	1694	4.261	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	1.995	0695	186.967	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	443	1674	9	1697	465	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	12	0698	932	1675	12	1698	969	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	11	0699	790	1676	11	1699	823	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	124	0700	5.766	1677	132	1700	6.287	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	65	0701	5.452	1678	69	1701	5.832	2678	162	2701	31.874
Total España	0679	3.106	0702	262.778	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	3.106	0705	262.778	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: 30/06/2025	
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2025				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	1,21			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: 30/06/2025									
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF									

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2025				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		24.051	64.936		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	244.936	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: 30/06/2025											
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF											

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses							Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses Impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado							
		0730											0731					0732
ES0359092006	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	0	0	NO	0	0	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	0	0		
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	2,25	158	0	NO	64.936	0	65.095	0	0	0	0	0		
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	2,31	158	0	NO	63.000	0	63.158	0	0	0	0	0		
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	2,36	173	0	NO	67.500	0	67.673	0	0	0	0	0		
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	2,56	85	0	NO	30.600	0	30.685	0	0	0	0	0		
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	4,06	83	0	NO	18.900	0	18.983	0	0	0	0	0		
Total						0740	657	0741	0		0743	244.936	0744	0	0745	245.593	0746	0

	Situación actual 30/06/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	3,36	0748	4,05	0749	0,00

MADRID RMBS II, FTA

		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: 30/06/2025		
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF		

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2025								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2024							
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	
ES0359092014	SERIE A2	0		936.000		0		125.437		0		936.000		0		125.437	
ES0359092022	SERIE A3	11.047		205.064		500		55.054		14.890		158.397		1.307		51.748	
ES0359092030	SERIE B	0		0		424		16.043		0		0		660		13.819	
ES0359092048	SERIE C	0		0		462		17.617		0		0		716		15.200	
ES0359092055	SERIE D	0		0		224		8.974		0		0		340		7.816	
ES0359092063	SERIE E	0		0		207		10.830		0		0		281		9.828	
Total		0754	11.047	0755	1.555.064	0756	1.818	0757	257.363	1754	14.890	1755	1.508.397	1756	3.304	1757	247.256

	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: 30/06/2025	
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 30/06/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 05/12/2006
		0760	0761	0762	0763	0764
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: 30/06/2025	
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 30/06/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	19.864	1765	21.774	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	20.359	1766	20.879	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	20.382	1767	20.943	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	19.340	1768	21.545	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	13.246	1769	21.635	2769	41.891
Entre 5 y 10 años	0770	151.746	1770	160.303	2770	241.519
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	1.370.127
Total	0772	244.936	1772	267.079	2772	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	5,15	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: 30/06/2025	

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo		Situación actual 30/06/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 05/12/2006	
1	Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	15.227	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	6,22	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	26,51	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: 30/06/2025									

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 30/06/2025		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: 30/06/2025													

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	
Naturaleza riesgo cubierto	Situación actual 30/06/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 05/12/2006		Situación actual 30/06/2025		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: 30/06/2025															

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

					Importe impagado acumulado				Ratio						Ref. Folleto	
Concepto	Meses impago		Días impago		Situación actual 30/06/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación actual 30/06/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Última Fecha Pago			
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	806	7006	1.505	7009	0,34	7012	0,58	7015	0,38		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	806	7008	1.505	7011	0,34	7014	0,58	7017	0,38	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	58.782	7024	60.999	7027	19,79	7030	18,95	7033	19,57		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	426	7025	426	7028	0,14	7031	0,13	7034	0,14		
Total Fallidos					7023	59.208	7026	61.425	7029	19,93	7032	19,08	7035	19,70	7036	Glosario de Términos

	Ratio						Ref. Folleto	
Otras ratios relevantes	Situación actual 30/06/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Última Fecha Pago			
	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: 30/06/2025	

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 A3 - ES0359092022	25,00	6,96	7,02	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359092006	25,00	6,96	7,02	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	7,72	7,38	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	7,50	27,56	26,37	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	10,00	20,17	20,63	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	12,49	11,95	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	20,17	20,63	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	25,72	24,61	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	6,96	7,02	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	2,00	0,34	0,38	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	10,00	20,17	20,63	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	1,25	0,34	0,38	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	1,75	0,34	0,38	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	10,00	20,17	20,63	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,34	0,38	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE C - ES0359092048	13,20	6,96	7,02	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE E - ES0359092063	8,00	6,96	7,02	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE D - ES0359092055	9,40	6,96	7,02	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE B - ES0359092030	18,30	6,96	7,02	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		6,22	5,50	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: 30/06/2025																

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)		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	12	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: 30/06/2025	

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	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													

	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: 30/06/2025	

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo												Total
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885	24/02/2025	22/05/2025											
Saldo inicial	0886	12.768	14.077											
Cobros del periodo	0887	15.100	14.360											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-153	-147											
Pagos por derivados	0889	-175	-199											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-14.077	-15.227											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-13.463	-12.865											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0											
Resto pagos/retenciones	0893	0	0											
Saldo disponible	0894	0	0											
Liquidación de comisión variable	0895	0	0											0

	S.06
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2025	

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
