

**I. DATOS IDENTIFICATIVOS**

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS  
Número de registro del Fondo: 8591  
NIF Fondo: V84916956  
Denominación del compartimento:  
Número de registro del compartimento:  
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.  
NIF Gestora: A80352750  
Fondo Abierto: NO  
Fondo Privado: NO  
Estados agregados: NO  
Fecha: 31/03/2025

**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)

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2025

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2025		Periodo anterior 31/12/2024
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	244.575	1001	257.623
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	244.575	1002	257.623
1. Activos titulizados	0003	244.575	1003	257.623
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	229.681	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	14.934	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
<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0039	0	1039	0
<b>III. Otros activos no corrientes</b>	0040	0	1040	0

S.01

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2025

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2025		Periodo anterior 31/12/2024
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	67.144	1041	65.329
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042	12.825	1042	12.934
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	29.071	1043	29.024
1. Activos titulizados	0044	29.023	1044	28.972
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	23.463	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	356	1065	422
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	42	1066	50
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	5.636	1067	5.621
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	162	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	48	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	48	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	
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
<b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b>	0085	25.248	1085	23.371
1. Tesorería	0086	25.248	1086	23.371
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	311.719	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: 31/03/2025

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2025		Periodo anterior 31/12/2024
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	238.077	1089	249.705
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	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
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0094	238.077	1094	249.705
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	226.885	1095	238.120
1.1 Series no subordinadas	0096	46.885	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	10.454	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	-58.487	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
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	0116	0	1116	0

S.01

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2025

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2025		Periodo anterior 31/12/2024
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	74.449	1117	73.946
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0118	0	1118	0
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	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
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	0123	67.806	1123	67.087
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	29.830	1124	29.941
1.1 Series no subordinadas	0125	29.099	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	731	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	37.345	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	304	1136	373
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	37.041	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
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	0148	6.642	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	6.631	1157	6.847
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158	-807	1158	-698
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159	0	1159	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	-807	1160	-698
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161	0	1161	0
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	311.719	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: 31/03/2025

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2025		Acumulado anterior 31/03/2024
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	2.675	1201	4.136	2201	2.675	3201	4.136
1.1 Activos titulizados	0202	2.509	1202	3.866	2202	2.509	3202	3.866
1.2 Otros activos financieros	0203	167	1203	270	2203	167	3203	270
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-2.947	1204	-4.487	2204	-2.947	3204	-4.487
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-2.117	1205	-3.449	2205	-2.117	3205	-3.449
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-831	1206	-1.038	2206	-831	3206	-1.038
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0208	-66	1208	-67	2208	-66	3208	-67
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	-338	1209	-417	2209	-338	3209	-417
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	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
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0217	-123	1217	-224	2217	-123	3217	-224
7.1 Servicios exteriores	0218	-97	1218	-195	2218	-97	3218	-195
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-97	1219	-195	2219	-97	3219	-195
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	-27	1224	-29	2224	-27	3224	-29
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-23	1225	-25	2225	-23	3225	-25
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	-4	3227	-5
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
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0231	-52	1231	0	2231	-52	3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-52	1232	0	2232	-52	3232	0
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	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
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0238	121	1238	164	2238	121	3238	164
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0239	392	1239	478	2239	392	3239	478
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2025

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2025		Acumulado anterior 31/03/2024
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	199	1300	438	2300	199	3300	438
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	226	1301	468	2301	226	3301	468
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	2.598	1302	3.880	2302	2.598	3302	3.880
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-2.368	1303	-3.565	2303	-2.368	3303	-3.565
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	-175	1305	-117	2305	-175	3305	-117
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	171	1306	270	2306	171	3306	270
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
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	0309	-27	1309	-30	2309	-27	3309	-30
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-23	1310	-25	2310	-23	3310	-25
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-4	1312	-5	2312	-4	3312	-5
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>	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>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>	0322	1.678	1322	-854	2322	1.678	3322	-854
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b>	0325	1.778	1325	-1.256	2325	1.778	3325	-1.256
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	4.837	1326	5.559	2326	4.837	3326	5.559
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	6.025	1327	8.533	2327	6.025	3327	8.533
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.779	1328	473	2328	1.779	3328	473
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	2	1329	0	2329	2	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	230	1330	472	2330	230	3330	472
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-11.095	1331	-16.292	2331	-11.095	3331	-16.292
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	0332	-100	1332	402	2332	-100	3332	402
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	600	2333	0	3333	600
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	-100	1336	-198	2336	-100	3336	-198
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	0337	1.877	1337	-415	2337	1.877	3337	-415
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	23.371	1338	36.204	2338	23.371	3338	36.204
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	25.248	1339	35.789	2339	25.248	3339	35.789

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2025

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2025		Acumulado anterior 31/03/2024
<b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>0356</b>	<b>0</b>	<b>1356</b>	<b>0</b>	<b>2356</b>	<b>0</b>	<b>3356</b>	<b>0</b>
<b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-175	1357	-117	2357	-175	3357	-117
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-175	1358	-117	2358	-175	3358	-117
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	66	1360	67	2360	66	3360	67
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361	0	3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	109	1362	50	2362	109	3362	50
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>0363</b>	<b>0</b>	<b>1363</b>	<b>0</b>	<b>2363</b>	<b>0</b>	<b>3363</b>	<b>0</b>
<b>3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>0369</b>	<b>0</b>	<b>1369</b>	<b>0</b>	<b>2369</b>	<b>0</b>	<b>3369</b>	<b>0</b>
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>0370</b>	<b>0</b>	<b>1370</b>	<b>0</b>	<b>2370</b>	<b>0</b>	<b>3370</b>	<b>0</b>

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2025

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 31/03/2025								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	7,52	0401	25,54	0421	0,00	0441	7,46	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	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2025

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	111	0467	70	0474	29	0481	0	0488	98	0495	9.525	0502	0	0509	9.623
De 1 a 3 meses	0461	21	0468	29	0475	13	0482	0	0489	42	0496	2.294	0503	0	0510	2.336
De 3 a 6 meses	0462	17	0469	44	0476	15	0483	7	0490	66	0497	1.647	0504	0	0511	1.713
De 6 a 9 meses	0463	13	0470	53	0477	17	0484	23	0491	93	0498	1.615	0505	0	0512	1.708
De 9 a 12 meses	0464	17	0471	88	0478	18	0485	39	0492	145	0499	1.560	0506	0	0513	1.706
Más de 12 meses	0465	107	0472	4.046	0479	113	0486	1.687	0493	5.846	0500	11.516	0507	0	0514	17.362
<b>Total</b>	0466	<b>286</b>	0473	<b>4.330</b>	0480	<b>204</b>	0487	<b>1.756</b>	0494	<b>6.290</b>	0501	<b>28.157</b>	0508	<b>0</b>	1515	<b>34.448</b>

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	111	0522	70	0529	29	0536	0	0543	98	0550	9.525	0557	0	0564	9.623	0571	21.443	0578	21.443	0584	44,88
De 1 a 3 meses	0516	21	0523	29	0530	13	0537	0	0544	42	0551	2.294	0558	0	0565	2.336	0572	4.404	0579	4.404	0585	53,04
De 3 a 6 meses	0517	17	0524	44	0531	15	0538	7	0545	66	0552	1.647	0559	0	0566	1.713	0573	3.320	0580	3.320	0586	51,61
De 6 a 9 meses	0518	13	0525	53	0532	17	0539	23	0546	93	0553	1.615	0560	0	0567	1.708	0574	2.721	0581	2.721	0587	62,78
De 9 a 12 meses	0519	17	0526	88	0533	18	0540	39	0547	145	0554	1.560	0561	0	0568	1.706	0575	3.131	0582	3.131	0588	54,47
Más de 12 meses	0520	107	0527	4.046	0534	113	0541	1.687	0548	5.846	0555	11.516	0562	0	0569	17.362	0576	22.447	0583	22.447	0589	77,35
<b>Total</b>	0521	<b>286</b>	0528	<b>4.330</b>	0535	<b>204</b>	0542	<b>1.756</b>	0549	<b>6.290</b>	0556	<b>28.157</b>	0563	<b>0</b>	0570	<b>34.448</b>	0577	<b>57.465</b>			0590	<b>59,95</b>

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2025

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 31/03/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	501	1600	492	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	806	1601	762	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	2.988	1602	2.362	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	7.557	1603	6.857	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	9.460	1604	9.666	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	68.389	1605	59.706	2605	241
Superior a 10 años	0606	184.013	1606	206.777	2606	1.799.759
<b>Total</b>	0607	<b>273.713</b>	1607	<b>286.621</b>	2607	<b>1.800.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	0608	<b>11,35</b>	1608	<b>11,57</b>	2608	<b>27,35</b>

Antigüedad	Situación actual 31/03/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 05/12/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	19,75	1609	19,50	2609	1,72

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2025

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 31/03/2025				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	1.478	0630	65.587	1620	1.446	1630	63.891	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.269	0631	136.914	1621	1.319	1631	142.462	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	341	0632	51.288	1622	392	1632	57.885	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	101	0633	19.924	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
<b>Total</b>	0628	<b>3.189</b>	0638	<b>273.713</b>	1628	<b>3.270</b>	1638	<b>286.621</b>	2628	<b>9.884</b>	2638	<b>1.800.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>	0639	<b>51,73</b>	0649		1639	<b>52,45</b>	1649		2639	<b>94,44</b>	2649	

S.05.1

**Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA**

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 31/03/2025**

**Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK**

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/03/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	4,36	1650	4,64	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	5,53	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: 31/03/2025

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/03/2025				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	126	0683	7.175	1660	128	1683	7.416	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	57	0684	3.598	1661	58	1684	3.697	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	28	0685	1.717	1662	28	1685	1.759	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	26	0686	1.735	1663	26	1686	1.776	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	21	0687	1.116	1664	21	1687	1.147	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	52	0688	2.599	1665	54	1688	2.769	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	78	0689	3.756	1666	83	1689	4.198	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	120	0690	8.142	1667	128	1690	8.932	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	323	0691	31.708	1668	334	1691	33.535	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	13	0692	327	1669	13	1692	339	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	12	0693	556	1670	13	1693	601	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	69	0694	4.172	1671	69	1694	4.261	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	2.038	0695	193.322	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	454	1674	9	1697	465	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	12	0698	951	1675	12	1698	969	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	11	0699	806	1676	11	1699	823	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	127	0700	5.921	1677	132	1700	6.287	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	67	0701	5.659	1678	69	1701	5.832	2678	162	2701	31.874
<b>Total España</b>	0679	<b>3.189</b>	0702	<b>273.713</b>	1679	<b>3.270</b>	1702	<b>286.621</b>	2679	<b>9.884</b>	2702	<b>1.800.000</b>
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
<b>Total general</b>	0682	<b>3.189</b>	0705	<b>273.713</b>	1682	<b>3.270</b>	1705	<b>286.621</b>	2682	<b>9.884</b>	2705	<b>1.800.000</b>

<b>S.05.1</b>
<b>Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 31/03/2025</b>
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK</b>

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 31/03/2025				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	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2025

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO A**

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2025			Situación cierre anual anterior 31/12/2024			Situación inicial 05/12/2006					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente			
		0720	Nominal unitario (€) 0721	0722	1720	Nominal unitario (€) 1721	1722	2720	Nominal unitario (€) 2721	2722			
ES0359092006	SERIE A1	4.140	0	0	4.140	0	0	4.140	100.000	414.000			
ES0359092014	SERIE A2	9.360	0	0	9.360	0	0	9.360	100.000	936.000			
ES0359092022	SERIE A3	2.700	28.142	75.983	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			
<b>Total</b>		0723	18.000	0724	255.983	1723	18.000	1724	267.079	2723	18.000	2724	1.800.000

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2025

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	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739					
ES0359092006	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	0	0	NO	0	0	0	0					
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	0	0	NO	0	0	0	0					
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	2,72	201	0	NO	75.983	0	76.184	0					
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	2,78	171	0	NO	63.000	0	63.171	0					
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	2,83	186	0	NO	67.500	0	67.686	0					
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	3,03	90	0	NO	30.600	0	30.690	0					
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	4,53	83	0	NO	18.900	0	18.983	0					
<b>Total</b>						0740	731	0741	0	0743	255.983	0744	0	0745	256.715	0746	0

	Situación actual 31/03/2025		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	3,75	0748	4,05	0749	0,00

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2025

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO C**

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2025								Situación periodo comparativo anterior 31/03/2024							
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	0	414.000	0	23.408	0	23.408		
ES0359092014	SERIE A2	0	936.000	0	125.437	0	936.000	0	125.437	0	936.000	0	125.437	0	125.437		
ES0359092022	SERIE A3	11.095	194.017	725	54.553	16.292	143.507	1.515	50.441	16.292	143.507	1.515	50.441	1.515	50.441		
ES0359092030	SERIE B	0	0	535	15.619	0	0	678	13.159	0	0	678	13.159	678	13.159		
ES0359092048	SERIE C	0	0	582	17.155	0	0	735	14.484	0	0	735	14.484	735	14.484		
ES0359092055	SERIE D	0	0	280	8.750	0	0	349	7.476	0	0	349	7.476	349	7.476		
ES0359092063	SERIE E	0	0	247	10.623	0	0	288	9.547	0	0	288	9.547	288	9.547		
<b>Total</b>		0754	11.095	0755	1.544.017	0756	2.368	0757	255.545	1754	16.292	1755	1.493.507	1756	3.565	1757	243.952

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2025

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 31/03/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 05/12/2006
				0760	0761	0762
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092014	SERIE A2	29/09/2021	FCH	A+	A+	AAA
ES0359092014	SERIE A2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	04/05/2018	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092022	SERIE A3	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	26/10/2023	MDY	A1	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	26/10/2023	MDY	B3	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	11/09/2009	MDY	C	C	Ba1
ES0359092063	SERIE E	03/12/2024	SYP	B+	B+	BB

<b>S.05.2</b>
<b>Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Periodo de la declaración: 31/03/2025</b>
<b>Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF</b>

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO E**

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/03/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	20.381	1765	21.774	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	20.400	1766	20.879	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	20.955	1767	20.943	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	21.011	1768	21.545	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	19.930	1769	21.635	2769	41.891
Entre 5 y 10 años	0770	153.306	1770	160.303	2770	241.519
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	1.370.127
<b>Total</b>	<b>0772</b>	<b>255.983</b>	<b>1772</b>	<b>267.079</b>	<b>2772</b>	<b>1.800.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>0773</b>	<b>5,40</b>	<b>1773</b>	<b>5,64</b>	<b>2773</b>	<b>25,20</b>

**Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA**

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 31/03/2025**

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/03/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 05/12/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	14.077	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	5,50	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	29,68	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: 31/03/2025

**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 31/03/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 05/12/2006	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap de Bases	BANCO SANTANDER	TRIMESTRAL	Media de los Euribor 12M en cada Fecha de Referencia	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	Tipo de Referencia de los Bonos - 0,055%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	-1.370	-1.370		
<b>Total</b>							0808 -1.370	0809 -1.370	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2025

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO B**

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 31/03/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 05/12/2006		Situación actual 31/03/2025		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			
<b>Total</b>	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2025

**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 31/03/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación actual 31/03/2025		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	1.058	7006	1.505	7009	0,43	7012	0,58	7015	0,53		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.058	7008	1.505	7011	0,43	7014	0,58	7017	0,53	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	59.879	7024	60.999	7027	19,40	7030	18,95	7033	19,09		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	426	7025	426	7028	0,14	7031	0,13	7034	0,13		
Total Fallidos					7023	60.305	7026	61.425	7029	19,54	7032	19,08	7035	19,23	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/03/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2025

**INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO**

**CUADRO B**

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
<b>Amortización secuencial: series</b>	0854	0858	1858	2858
SERIE D - ES0359092055	10,00	20,82	21,28	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	2,00	0,37	0,53	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	7,02	7,05	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	24,61	23,59	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	11,95	11,46	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	7,02	7,05	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	20,82	21,28	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	10,00	20,82	21,28	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,37	0,53	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359092006	25,00	7,02	7,05	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	10,00	20,82	21,28	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	7,50	26,37	25,27	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	7,38	7,08	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	1,25	0,37	0,53	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	1,75	0,37	0,53	Nota de Valores 4.9.4
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series</b>	0855	0859	1859	2859
SERIE C - ES0359092048	13,20	7,03	7,06	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE B - ES0359092030	18,30	7,03	7,06	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE E - ES0359092063	8,00	7,03	7,06	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE D - ES0359092055	9,40	7,03	7,06	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
<b>No Reducción del Fondo de Reserva</b>	0856	0860	1860	2860
		5,50	4,78	3.4.2.2. Modulo Adicional
<b>OTROS TRIGGERS</b>	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

**CUADRO C**

**Informe cumplimiento reglas de funcionamiento**

Contiene



Información adicional  
en fichero adjunto

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2025

**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	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2025

**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														

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2025

**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												
Saldo inicial	0886	12.768												
Cobros del periodo	0887	15.100												
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-153												
Pagos por derivados	0889	-175												
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-14.077												
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-13.463												
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0												
Resto pagos/retenciones	0893	0												
Saldo disponible	0894	0												
Liquidación de comisión variable	0895	0												0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2025

**NOTAS EXPLICATIVAS**



**INFORME DE AUDITOR**

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