

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8591
NIF Fondo: V84916956
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2021

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: 30/09/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	433.447	1001	467.069
I. Activos financieros a largo plazo	0002	433.447	1002	467.069
1. Activos titulizados	0003	433.447	1003	467.069
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	422.180	1005	455.007
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	11.330	1025	12.125
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-63	1027	-63
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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	66.051	1041	70.501
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	16.864	1042	17.463
V. Activos financieros a corto plazo	0043	35.129	1043	38.468
1. Activos titulizados	0044	35.128	1044	38.468
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	31.577	1046	34.950
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	78	1065	117
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	16	1066	23
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	3.917	1067	3.831
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	53	1068	60
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-513	1069	-513
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	2	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075	0	1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076	0	1076	0
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	2	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	14.057	1085	14.571
1. Tesorería	0086	14.057	1086	14.571
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	499.498	1088	537.571

S.01

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	437.714	1089	471.807
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	437.714	1094	471.807
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	417.698	1095	451.249
1.1 Series no subordinadas	0096	237.698	1096	271.249
1.2 Series subordinadas	0097	180.000	1097	180.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	0	1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	13.637	1101	14.179
2.1 Préstamo subordinado	0102	68.941	1102	68.941
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-55.304	1105	-54.761
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	6.379	1108	6.379
3.1 Derivados de cobertura	0109	6.379	1109	6.379
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

S.01
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) PASIVO CORRIENTE	0117	69.122	1117	72.930
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	63.657	1123	66.186
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	35.523	1124	38.811
1.1 Series no subordinadas	0125	35.494	1125	38.781
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	29	1128	29
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	27.262	1131	26.500
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	106	1136	107
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	27.157	1137	26.392
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	872	1139	872
3.1 Derivados de cobertura	0140	872	1140	872
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	3
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	3
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	5.464	1148	6.744
1. Comisiones	0149	15	1149	15
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	12	1150	12
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	3	1152	3
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	5.450	1157	6.729
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-7.338	1158	-7.167
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-7.338	1160	-7.167
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	499.498	1162	537.571

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2021		Acumulado anterior 30/09/2020
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	547	1201	881	2201	1.713	3201	2.558
1.1 Activos titulizados	0202	547	1202	881	2202	1.713	3202	2.558
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-340	1204	-385	2204	-1.007	3204	-1.136
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-70	1205	-92	2205	-209	3205	-266
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-256	1206	-288	2206	-762	3206	-852
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-13	1207	-5	2207	-36	3207	-18
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-138	1208	-286	2208	-505	3208	-701
A) MARGEN DE INTERESES	0209	69	1209	211	2209	201	3209	721
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	19	1216	30	2216	57	3216	48
7. Otros gastos de explotación	0217	-255	1217	-237	2217	-831	3217	-1.048
7.1 Servicios exteriores	0218	-220	1218	-200	2218	-724	3218	-935
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-220	1219	-200	2219	-724	3219	-935
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	-35	1224	-37	2224	-107	3224	-113
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-29	1225	-30	2225	-86	3225	-91
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-7	1227	-7	2227	-20	3227	-22
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	-228	1231	-456	2231	-526	3231	-809
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-228	1232	-456	2232	-526	3232	-809
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	215	1238	21	2238	557	3238	348
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	180	1239	432	2239	542	3239	740
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2021		Acumulado anterior 30/09/2020
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	328	1300	648	2300	788	3300	1.559
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	344	1301	669	2301	839	3301	1.624
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	551	1302	905	2302	1.766	3302	2.544
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-70	1303	-106	2303	-209	3303	-272
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	-124	1305	-128	2305	-676	3305	-627
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-14	1308	-2	2308	-41	3308	-21
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-35	1309	-37	2309	-108	3309	-114
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-29	1310	-30	2310	-87	3310	-92
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-7	1312	-7	2312	-21	3312	-22
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	19	1315	17	2315	57	3315	48
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	19	1321	17	2321	57	3321	48
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-1.430	1322	-230	2322	-1.302	3322	-3.342
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	-1.272	1325	-43	2325	-635	3325	-2.400
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	6.403	1326	6.008	2326	17.435	3326	18.472
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	3.298	1327	2.080	2327	14.678	3327	5.635
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	942	1328	708	2328	2.483	3328	1.992
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	647	1330	177	2330	1.606	3330	1.187
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-12.562	1331	-9.015	2331	-36.838	3331	-29.686
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-158	1332	-187	2332	-667	3332	-942
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	-158	1336	-187	2336	-667	3336	-942
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-1.102	1337	418	2337	-514	3337	-1.783
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	15.159	1338	13.072	2338	14.571	3338	15.273
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	14.057	1339	13.490	2339	14.057	3339	13.490

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2021		Acumulado anterior 30/09/2020
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-124	1357	-128	2357	-676	3357	-627
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-124	1358	-128	2358	-676	3358	-627
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	138	1360	286	2360	505	3360	701
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	-14	1362	-157	2362	171	3362	-74
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2021								Situación cierre anual anterior 31/12/2020								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	3,25	0401	16,64	0421	0,00	0441	3,57	1381	3,15	1401	15,54	1421	0,00	1441	1,64	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	17,00
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

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	213	0467	106	0474	10	0481	0	0488	117	0495	22.429	0502	0	0509	22.545
De 1 a 3 meses	0461	40	0468	46	0475	6	0482	0	0489	52	0496	5.541	0503	0	0510	5.593
De 3 a 6 meses	0462	7	0469	19	0476	1	0483	1	0490	21	0497	773	0504	0	0511	793
De 6 a 9 meses	0463	7	0470	35	0477	1	0484	2	0491	37	0498	805	0505	0	0512	842
De 9 a 12 meses	0464	12	0471	78	0478	2	0485	7	0492	87	0499	1.256	0506	0	0513	1.343
Más de 12 meses	0465	81	0472	2.762	0479	49	0486	726	0493	3.536	0500	9.520	0507	0	0514	13.056
Total	0466	360	0473	3.046	0480	69	0487	735	0494	3.850	0501	40.323	0508	0	1515	44.173

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	213	0522	106	0529	10	0536	0	0543	117	0550	22.429	0557	0	0564	22.545	0571	39.021	0578	39.021	0584	57,78
De 1 a 3 meses	0516	40	0523	46	0530	6	0537	0	0544	52	0551	5.541	0558	0	0565	5.593	0572	8.849	0579	8.849	0585	63,21
De 3 a 6 meses	0517	7	0524	19	0531	1	0538	1	0545	21	0552	773	0559	0	0566	793	0573	1.352	0580	1.352	0586	58,69
De 6 a 9 meses	0518	7	0525	35	0532	1	0539	2	0546	37	0553	805	0560	0	0567	842	0574	1.448	0581	1.448	0587	58,15
De 9 a 12 meses	0519	12	0526	78	0533	2	0540	7	0547	87	0554	1.256	0561	0	0568	1.343	0575	2.273	0582	2.273	0588	59,11
Más de 12 meses	0520	81	0527	2.762	0534	49	0541	726	0548	3.536	0555	9.520	0562	0	0569	13.056	0576	16.383	0583	16.383	0589	79,69
Total	0521	360	0528	3.046	0535	69	0542	735	0549	3.850	0556	40.323	0563	0	0570	44.173	0577	69.326			0590	63,72

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	208	1600	154	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	697	1601	388	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	901	1602	1.069	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	1.409	1603	1.420	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	2.315	1604	2.178	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	68.070	1605	71.442	2605	241
Superior a 10 años	0606	395.404	1606	429.262	2606	1.799.759
Total	0607	469.004	1607	505.913	2607	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	14,09	1608	14,77	2608	27,35

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 05/12/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	16,31	1609	15,58	2609	1,72

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				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	891	0630	36.634	1620	798	1630	32.970	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.645	0631	160.080	1621	1.703	1631	163.107	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	1.572	0632	234.922	1622	1.755	1632	268.830	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	181	0633	37.368	1623	198	1633	41.006	2623	9.439	2633	1.699.335
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	445	2634	100.665
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	4.289	0638	469.004	1628	4.454	1638	505.913	2628	9.884	2638	1.800.000
Media ponderada (%)	0639	61,08	0649		1639	63,01	1649		2639	94,44	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,53	1650	0,67	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	2,50	1651	2,50	2651	6,00
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,00	2652	2,70

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				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	191	0683	15.168	1660	200	1683	16.229	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	74	0684	5.835	1661	76	1684	6.240	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	39	0685	2.870	1662	41	1685	3.112	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	35	0686	3.492	1663	38	1686	4.061	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	33	0687	2.191	1664	34	1687	2.381	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	68	0688	4.708	1665	74	1688	5.244	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	104	0689	6.935	1666	110	1689	7.552	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	190	0690	16.284	1667	198	1690	17.779	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	461	0691	57.244	1668	478	1691	61.482	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	28	0692	664	1669	28	1692	751	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	24	0693	1.224	1670	25	1693	1.307	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	86	0694	6.977	1671	90	1694	7.490	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	2.650	0695	320.711	1672	2.746	1695	345.688	2672	6.243	2695	1.238.324
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	13	0697	952	1674	14	1697	1.047	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	16	0698	1.738	1675	16	1698	1.801	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	14	0699	1.234	1676	14	1699	1.287	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	173	0700	10.564	1677	179	1700	11.590	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	90	0701	10.213	1678	93	1701	10.873	2678	162	2701	31.874
Total España	0679	4.289	0702	469.004	1679	4.454	1702	505.913	2679	9.884	2702	1.800.000
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	4.289	0705	469.004	1682	4.454	1705	505.913	2682	9.884	2705	1.800.000

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 05/12/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,86			1710	0,82			2710	0,37		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2021			Situación cierre anual anterior 31/12/2020			Situación inicial 05/12/2006					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal 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	341	3.192	9.360	4.277	40.031	9.360	100.000	936.000			
ES0359092022	SERIE A3	2.700	100.000	270.000	2.700	100.000	270.000	2.700	100.000	270.000			
ES0359092030	SERIE B	630	100.000	63.000	630	100.000	63.000	630	100.000	63.000			
ES0359092048	SERIE C	675	100.000	67.500	675	100.000	67.500	675	100.000	67.500			
ES0359092055	SERIE D	306	100.000	30.600	306	100.000	30.600	306	100.000	30.600			
ES0359092063	SERIE E	189	100.000	18.900	189	100.000	18.900	189	100.000	18.900			
Total		0723	18.000	0724	453.192	1723	18.000	1724	490.031	2723	18.000	2724	1.800.000

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2021

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	3.192	0	3.192	0					
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	0,00	0	0	NO	270.000	0	270.000	0					
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	0,00	0	0	NO	63.000	0	63.000	0					
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	0,00	0	0	NO	67.500	0	67.500	0					
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	0,00	0	0	NO	30.600	0	30.600	0					
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	1,45	29	0	NO	18.900	0	18.929	0					
Total						0740	29	0741	0	0743	453.192	0744	0	0745	453.221	0746	0

	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,06	0748	0,06	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: 30/09/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2021								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2020							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0359092006	SERIE A1	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408
ES0359092014	SERIE A2	12.562	932.808	0	125.437	0	125.437	9.015	886.428	0	125.437	0	125.437	0	125.437	0	125.437
ES0359092022	SERIE A3	0	0	0	42.820	0	42.820	0	42.820	0	42.820	0	42.820	0	42.820	0	42.820
ES0359092030	SERIE B	0	0	0	10.352	0	10.352	0	10.352	0	10.352	0	10.352	0	10.352	0	10.352
ES0359092048	SERIE C	0	0	0	11.425	0	11.425	0	11.425	0	11.425	0	11.425	4	11.425	0	11.425
ES0359092055	SERIE D	0	0	0	5.985	0	5.985	0	5.985	0	5.985	0	5.985	18	5.985	0	5.985
ES0359092063	SERIE E	0	0	70	7.914	0	7.914	0	7.914	0	7.914	0	7.914	85	7.914	0	7.914
Total		0754	12.562	0755	1.346.808	0756	70	0757	227.340	1754	9.015	1755	1.300.428	1756	106	1757	227.058

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/09/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 05/12/2006
				0760	0761	0762
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092014	SERIE A2	29/09/2021	FCH	A+	A-	AAA
ES0359092014	SERIE A2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	04/05/2018	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092022	SERIE A3	29/09/2021	FCH	A+	A-	AAA
ES0359092022	SERIE A3	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	15/03/2021	SYP	AA+	AA	AAA
ES0359092030	SERIE B	29/09/2021	FCH	A	BBB	AA
ES0359092030	SERIE B	27/11/2020	MDY	Aa2	Aa2	Aa1
ES0359092030	SERIE B	15/03/2021	SYP	AA	AA-	AA
ES0359092048	SERIE C	29/09/2021	FCH	BB	BB-	A
ES0359092048	SERIE C	27/11/2020	MDY	Ba1	Ba1	A1
ES0359092048	SERIE C	15/03/2021	SYP	A	BBB	A
ES0359092055	SERIE D	11/07/2019	FCH	B-	B-	BBB
ES0359092055	SERIE D	27/11/2020	MDY	Caa3	Caa3	Baa2
ES0359092055	SERIE D	15/03/2021	SYP	B+	B-	BBB
ES0359092063	SERIE E	18/03/2009	FCH	CC	CC	BB+
ES0359092063	SERIE E	11/09/2009	MDY	C	C	Ba1
ES0359092063	SERIE E	20/03/2013	SYP	D	D	BB

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	20.870	1765	21.557	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	27.349	1766	27.343	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	28.424	1767	28.552	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	29.540	1768	29.687	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	30.621	1769	30.860	2769	41.891
Entre 5 y 10 años	0770	316.388	1770	161.661	2770	241.519
Superior a 10 años	0771	0	1771	190.370	2771	1.370.127
Total	0772	453.192	1772	490.031	2772	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	9,19	1773	9,55	2773	25,20

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 05/12/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	6.847	1775	5.901	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	1,51	1777	1,20	2777	3,48
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	CaixaBank	1778	Bankia	2778	Caja Madrid
1.4 Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781		1781		2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782		1782		2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784		1784		2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786		1786		2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787		1787		2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788		1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	60,28	1792	63,26	2792	90,00
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/09/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	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	-7.251	-7.251		
Total							0808 -7.251	0809 -7.251	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 05/12/2006		Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 05/12/2006			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	530	7006	920	7009	0,12	7012	0,19	7015	0,10		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	530	7008	920	7011	0,12	7014	0,19	7017	0,10	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	66.154	7024	68.534	7027	12,88	7030	12,40	7033	12,86		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	598	7025	654	7028	0,12	7031	0,12	7034	0,11		
Total Fallidos					7023	66.752	7026	69.188	7029	12,99	7032	12,51	7035	12,97	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
SERIE C - ES0359092048	7,50	14,89	14,49	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	10,00	31,97	32,35	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	13,90	13,53	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	7,15	7,17	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	4,17	4,06	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	6,75	6,57	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	1,75	0,12	0,03	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	31,97	32,35	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	1,25	0,12	0,03	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	2,00	0,12	0,03	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	10,00	31,97	32,35	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,12	0,03	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	10,00	31,97	32,35	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359092006	25,00	7,15	7,17	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	7,15	7,17	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE C - ES0359092048	13,20	7,15	7,17	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE E - ES0359092063	8,00	7,15	7,17	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE D - ES0359092055	9,40	7,15	7,17	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE B - ES0359092030	18,30	7,15	7,17	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		1,51	1,34	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

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: 30/09/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo								Total	
		22/02/2021	24/05/2021	23/08/2021							
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885										
Saldo inicial	0886	5.901	6.309	6.249							
Cobros del periodo	0887	11.340	14.615	13.608							
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-255	-384	-254							
Pagos por derivados	0889	-357	-195	-124							
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-6.309	-6.249	-6.847							
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-10.320	-14.097	-12.631							
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0							
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0							
Saldo disponible	0894	0	0	0							
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	0							0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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