

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Número de registro del Fondo: 8591

NIF Fondo: V84916956

Denominación del compartimento:

Número de registro del compartimento:

Denominación de la gestora: TITULACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.

NIF Gestora: A80352750

Fondo Abierto: NO

Fondo Privado: NO

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2025

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:

(sólo se cumplimentará en el supuesto de que se produzca el reenvío con alguna modificación de la información periódica)

				S.01
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.				
Estados agregados: NO				
Fecha: 31/12/2025				

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2025		Periodo anterior 31/12/2024
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	211.619	1001	257.623
I. Activos financieros a largo plazo	0002	211.619	1002	257.623
1. Activos titulizados	0003	211.619	1003	257.623
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	199.868	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	11.777	1025	15.855
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-25	1027	-40
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

S.01
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2025

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2025		Periodo anterior 31/12/2024
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	68.642	1041	65.329
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	12.261	1042	12.934
V. Activos financieros a corto plazo	0043	28.422	1043	29.024
1. Activos titulizados	0044	28.381	1044	28.972
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	23.168	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	253	1065	422
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	40	1066	50
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	5.359	1067	5.621
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	142	1068	177
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-581	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	41	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	41	1079	52
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	27.958	1085	23.371
1. Tesorería	0086	27.958	1086	23.371
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	280.261	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: 31/12/2025				

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2025		Periodo anterior 31/12/2024
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	204.939	1089	249.705
I. Provisiones a largo plazo	0090	0	1090	0
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	0	1092	0
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	204.939	1094	249.705
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	194.902	1095	238.120
1.1 Series no subordinadas	0096	14.902	1096	58.120
1.2 Series subordinadas	0097	180.000	1097	180.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	0	1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	9.445	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	-59.495	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	591	1108	739
3.1 Derivados de cobertura	0109	591	1109	739
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

				S.01
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.				
Estados agregados: NO				
Fecha: 31/12/2025				

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2025		Periodo anterior 31/12/2024
B) PASIVO CORRIENTE	0117	76.026	1117	73.946
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118	0	1118	0
V. Provisiones a corto plazo	0119	0	1119	0
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	0
2. Provisión por margen de intermediación	0121	0	1121	0
3. Otras provisiones	0122	0	1122	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	69.092	1123	67.087
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	29.099	1124	29.941
1.1 Series no subordinadas	0125	28.527	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	572	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	39.525	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	287	1136	373
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	39.238	1137	36.141
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	468	1139	632
3.1 Derivados de cobertura	0140	468	1140	632
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	6.935	1148	6.859
1. Comisiones	0149	10	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	1	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	6.924	1157	6.847
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-704	1158	-698
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-704	1160	-698
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	280.261	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: 31/12/2025							

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2025		Acumulado anterior 31/12/2024
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	1.964	1201	3.147	2201	8.990	3201	14.552
1.1 Activos titulizados	0202	1.832	1202	2.957	2202	8.422	3202	13.606
1.2 Otros activos financieros	0203	131	1203	190	2203	568	3203	946
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-2.160	1204	-3.526	2204	-9.831	3204	-16.266
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.447	1205	-2.590	2205	-6.820	3205	-12.261
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-712	1206	-936	2206	-3.011	3206	-4.004
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-82	1208	-94	2208	-455	3208	-74
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-278	1209	-473	2209	-1.296	3209	-1.788
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210	0	3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211	0	3211	0
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212	0	3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213	0	3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214	0	3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	98	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-186	1217	-35	2217	-545	3217	-576
7.1 Servicios exteriores	0218	-157	1218	-2	2218	-437	3218	-456
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-157	1219	-2	2219	-437	3219	-456
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-28	1224	-33	2224	-108	3224	-119
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-22	1225	-23	2225	-90	3225	-95
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-4	1227	-4	2227	-15	3227	-18
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	-3	1230	-6	2230	-3	3230	-6
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-137	1231	-250	2231	-200	3231	-482
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-137	1232	-250	2232	-200	3232	-482
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	103	1238	75	2238	641	3238	312
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	497	1239	586	2239	1.401	3239	2.534
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERÍODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2025

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2025		Acumulado anterior 31/12/2024
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	328	1300	348	2300	1.106	3300	1.663
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	354	1301	376	2301	1.212	3301	1.778
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	1.852	1302	3.073	2302	8.636	3302	13.840
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-1.497	1303	-2.791	2303	-7.231	3303	-12.790
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	-129	1305	-104	2305	-773	3305	-242
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	127	1306	198	2306	580	3306	970
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-26	1309	-28	2309	-106	3309	-114
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-22	1310	-23	2310	-90	3310	-96
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-4	1312	-4	2312	-16	3312	-18
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	0	1315	0	2315	0	3315	0
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	1.443	1322	380	2322	3.481	3322	-14.496
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	1.600	1325	499	2325	3.925	3325	-3.948
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	5.202	1326	5.189	2326	20.088	3326	21.143
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	4.103	1327	4.849	2327	20.660	3327	25.095
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.708	1328	1.388	2328	5.487	3328	4.619
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	4	1329	3	2329	25	3329	3
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	209	1330	210	2330	1.313	3330	899
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-9.626	1331	-11.140	2331	-43.649	3331	-55.706
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-157	1332	-119	2332	-443	3332	-10.548
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	-157	1336	-119	2336	-443	3336	-10.548
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	1.771	1337	728	2337	4.587	3337	-12.833
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	26.187	1338	22.643	2338	23.371	3338	36.204
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	27.958	1339	23.371	2339	27.958	3339	23.371

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2025

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2025		Acumulado anterior 31/12/2024
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	183	1357	510	2357	-461	3357	372
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	183	1358	510	2358	-461	3358	372
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	82	1360	94	2360	455	3360	74
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361	0	3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0362	-265	1362	-604	2362	6	3362	-446
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el periodo	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

	S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2025	
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2025					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	7,13	0401	28,20	0421	0,01	0441	7,75	1381	7,49	1401	24,66	1421	0,00	1441	7,92	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426	
Prestamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439	

	S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2025	
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	105	0467	68	0474	21	0481	0	0488	88	0495	8.005	0502	0	0509	8.093
De 1 a 3 meses	0461	19	0468	38	0475	17	0482	0	0489	54	0496	2.069	0503	0	0510	2.123
De 3 a 6 meses	0462	9	0469	29	0476	7	0483	3	0490	39	0497	870	0504	0	0511	909
De 6 a 9 meses	0463	7	0470	36	0477	7	0484	12	0491	56	0498	858	0505	0	0512	914
De 9 a 12 meses	0464	13	0471	77	0478	11	0485	25	0492	113	0499	1.046	0506	0	0513	1.158
Más de 12 meses	0465	100	0472	4.034	0479	116	0486	1.677	0493	5.827	0500	10.187	0507	0	0514	16.013
Total	0466	253	0473	4.281	0480	179	0487	1.717	0494	6.178	0501	23.034	0508	0	1515	29.212

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	105	0522	68	0529	21	0536	0	0543	88	0550	8.005	0557	0	0564	8.093
De 1 a 3 meses	0516	19	0523	38	0530	17	0537	0	0544	54	0551	2.069	0558	0	0565	2.123
De 3 a 6 meses	0517	9	0524	29	0531	7	0538	3	0545	39	0552	870	0559	0	0566	909
De 6 a 9 meses	0518	7	0525	36	0532	7	0539	12	0546	56	0553	858	0560	0	0567	914
De 9 a 12 meses	0519	13	0526	77	0533	11	0540	25	0547	113	0554	1.046	0561	0	0568	1.158
Más de 12 meses	0520	100	0527	4.034	0534	116	0541	1.677	0548	5.827	0555	10.187	0562	0	0569	16.013
Total	0521	253	0528	4.281	0535	179	0542	1.717	0549	6.178	0556	23.034	0563	0	0570	29.212

	S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2025	
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 31/12/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	359	1600	492	2600
Entre 1 y 2 años	0601	1.473	1601	762	2601
Entre 2 y 3 años	0602	4.851	1602	2.362	2602
Entre 3 y 4 años	0603	7.040	1603	6.857	2603
Entre 4 y 5 años	0604	8.583	1604	9.666	2604
Entre 5 y 10 años	0605	126.198	1605	59.706	2605
Superior a 10 años	0606	91.668	1606	206.777	2606
Total	0607	240.172	1607	286.621	2607
Vida residual media ponderada (años)	0608	10,77	1608	11,57	2608
					27,35

Antigüedad	Situación actual 31/12/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 05/12/2006
Antigüedad media ponderada (años)	0609	20,48	1609
			19,50
			2609
			1,72

	S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2025	
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 31/12/2025				Situación cierre anual anterior 31/12/2024				Situación inicial 05/12/2006			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente
0% - 40%	0620	1.566	0630	68.860	1620	1.446	1630	63.891	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.130	0631	124.817	1621	1.319	1631	142.462	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	198	0632	32.342	1622	392	1632	57.885	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	74	0633	14.153	1623	113	1633	22.384	2623	9.439	2633	1.699.335
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	445	2634	100.665
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	2.968	0638	240.172	1628	3.270	1638	286.621	2628	9.884	2638	1.800.000
Media ponderada (%)	0639	49,63	0649		1639	52,45	1649		2639	94,44	2649	

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2025
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,36	1650	4,64	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,19	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: 31/12/2025	
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2025				Situación cierre anual anterior 31/12/2024				Situación inicial 05/12/2006			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente
Andalucía	0660	116	0683	5.936	1660	128	1683	7.416	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	49	0684	2.748	1661	58	1684	3.697	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	25	0685	1.397	1662	28	1685	1.759	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	25	0686	1.529	1663	26	1686	1.776	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	21	0687	1.007	1664	21	1687	1.147	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	49	0688	2.159	1665	54	1688	2.769	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	72	0689	3.274	1666	83	1689	4.198	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	108	0690	6.925	1667	128	1690	8.932	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	290	0691	27.133	1668	334	1691	33.535	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	10	0692	220	1669	13	1692	339	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	12	0693	518	1670	13	1693	601	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	67	0694	3.771	1671	69	1694	4.261	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	1.920	0695	171.963	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	7	0697	258	1674	9	1697	465	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	12	0698	895	1675	12	1698	969	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	11	0699	757	1676	11	1699	823	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	116	0700	4.988	1677	132	1700	6.287	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	58	0701	4.694	1678	69	1701	5.832	2678	162	2701	31.874
Total España	0679	2.968	0702	240.172	1679	3.270	1702	286.621	2679	9.884	2702	1.800.000
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	2.968	0705	240.172	1682	3.270	1705	286.621	2682	9.884	2705	1.800.000

	S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2025	
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2025				Situación cierre anual anterior 31/12/2024				Situación inicial 05/12/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
	0710	1,29	0712		1710	1,16	1711		2710	0,37	2712	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,29			1710	1,16			2710	0,37		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

	S.05.2
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Periodo de la declaración: 31/12/2025	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2025			Situación cierre anual anterior 31/12/2024			Situación inicial 05/12/2006					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0359092006	SERIE A1	4.140	0	0	4.140	0	0	4.140	100.000	414.000			
ES0359092014	SERIE A2	9.360	0	0	9.360	0	0	9.360	100.000	936.000			
ES0359092022	SERIE A3	2.700	16.085	43.430	2.700	32.251	87.079	2.700	100.000	270.000			
ES0359092030	SERIE B	630	100.000	63.000	630	100.000	63.000	630	100.000	63.000			
ES0359092048	SERIE C	675	100.000	67.500	675	100.000	67.500	675	100.000	67.500			
ES0359092055	SERIE D	306	100.000	30.600	306	100.000	30.600	306	100.000	30.600			
ES0359092063	SERIE E	189	100.000	18.900	189	100.000	18.900	189	100.000	18.900			
Total		0723	18.000	0724	223.430	1723	18.000	1724	267.079	2723	18.000	2724	1.800.000

	S.05.2
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Periodo de la declaración: 31/12/2025	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Intereses						Principal pendiente		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas				
			Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado						
			0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739			
ES0359092006	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0			
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0			
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	2,24	100	0	NO	43.430	0	43.530	0	0			
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	2,30	149	0	NO	63.000	0	63.149	0	0			
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	2,35	163	0	NO	67.500	0	67.663	0	0			
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	2,55	80	0	NO	30.600	0	30.680	0	0			
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	4,05	79	0	NO	18.900	0	18.979	0	0			
Total					0740	572	0741	0	0743	223.430	0744	0	0745	224.002	0746	0

Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	Situación actual 31/12/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 05/12/2006	
	0747	2,68	0748	4,05	0749	0,00

	S.05.2
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Periodo de la declaración: 31/12/2025	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

Serie	Denominación serie	Situación actual 31/12/2025				Situación periodo comparativo anterior 31/12/2024											
		Amortización principal		Intereses		Amortización principal		Intereses									
		Pagos del periodo	Pagos acumulados	Pagos del periodo	Pagos acumulados	Pagos del periodo	Pagos acumulados	Pagos del periodo	Pagos acumulados								
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0359092006	SERIE A1	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408								
ES0359092014	SERIE A2	0	936.000	0	125.437	0	936.000	0	125.437								
ES0359092022	SERIE A3	9.626	226.570	308	55.735	11.140	182.921	936	53.828								
ES0359092030	SERIE B	0	0	376	16.791	0	0	610	15.085								
ES0359092048	SERIE C	0	0	411	18.435	0	0	662	16.573								
ES0359092055	SERIE D	0	0	202	9.377	0	0	316	8.470								
ES0359092063	SERIE E	0	0	199	11.226	0	0	267	10.377								
Total		0754	9.626	0755	1.576.570	0756	1.497	0757	260.408	1754	11.140	1755	1.532.921	1756	2.791	1757	253.177

	S.05.2
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Periodo de la declaración: 31/12/2025	
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 31/12/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 05/12/2006
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092014	SERIE A2	29/09/2021	FCH	A+	A+	AAA
ES0359092014	SERIE A2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	04/05/2018	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092022	SERIE A3	13/03/2024	FCH	AA+	AA+	AAA
ES0359092022	SERIE A3	12/12/2025	MDY	Aaa	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	12/12/2025	MDY	Aaa	Aa1	Aa1
ES0359092030	SERIE B	01/06/2022	SYP	AA+	AA+	AA
ES0359092048	SERIE C	09/12/2025	FCH	AA+	BBB-	A
ES0359092048	SERIE C	12/12/2025	MDY	Aaa	A1	A1
ES0359092048	SERIE C	03/12/2024	SYP	AA+	AA+	A
ES0359092055	SERIE D	09/12/2025	FCH	A	BB	BBB
ES0359092055	SERIE D	12/12/2025	MDY	Aa1	B3	Baa2
ES0359092055	SERIE D	03/12/2024	SYP	A	A	BBB
ES0359092063	SERIE E	09/12/2025	FCH	BBB+	CC	BB+
ES0359092063	SERIE E	12/12/2025	MDY	Ba1	C	Ba1
ES0359092063	SERIE E	03/12/2024	SYP	B+	B+	BB

	S.05.2
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Periodo de la declaración: 31/12/2025	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 05/12/2006			
Inferior a 1 año	0765	20.825	1765	21.774	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	20.828	1766	20.879	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	20.941	1767	20.943	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	20.188	1768	21.545	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	19.282	1769	21.635	2769	41.891
Entre 5 y 10 años	0770	121.367	1770	160.303	2770	241.519
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	1.370.127
Total	0772	223.430	1772	267.079	2772	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	8,65	1773	5,64	2773	25,20

	S.05.3
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2025	

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo		Situación actual 31/12/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 05/12/2006	
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	18.059	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	8,08	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	19,43	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: 31/12/2025	

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 31/12/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 05/12/2006		
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806		
Swap de Bases	BANCO SANTANDER	TRIMESTRAL	Media de los Euribor 12M en cada Fecha de Referencia	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	Tipo de Referencia de los Bonos - 0,055%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	-1.059	-1.370		3806	
Total							0808	-1.059	0809	-1.370	0810

	S.05.3
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2025	

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)				Valor en libros (miles de euros)			Otras características	
	Situación actual 31/12/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 05/12/2006	Situación actual 31/12/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 05/12/2006			
Préstamos hipotecarios	0811	1811	2811	0829	1829	2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812	1812	2812	0830	1830	2830		3830	
Préstamos a promotores	0813	1813	2813	0831	1831	2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814	1814	2814	0832	1832	2832		3832	
Préstamos a empresas	0815	1815	2815	0833	1833	2833		3833	
Préstamos corporativos	0816	1816	2816	0834	1834	2834		3834	
Cédulas territoriales	0817	1817	2817	0835	1835	2835		3835	
Bonos de tesorería	0818	1818	2818	0836	1836	2836		3836	
Deuda subordinada	0819	1819	2819	0837	1837	2837		3837	
Créditos AAPP	0820	1820	2820	0838	1838	2838		3838	
Préstamos consumo	0821	1821	2821	0839	1839	2839		3839	
Préstamos automoción	0822	1822	2822	0840	1840	2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823	1823	2823	0841	1841	2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824	1824	2824	0842	1842	2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825	1825	2825	0843	1843	2843		3843	
Bonos de titulización	0826	1826	2826	0844	1844	2844			
Total	0827	1827	2827	0845	1845	2845		3845	

	S.05.4
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2025	

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 31/12/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación actual 31/12/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación actual 31/12/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024		
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	982	7006	1.505	7009	0,45
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010	
Total Morosos					7005	982	7008	1.505	7011	0,45
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	55.880	7024	60.999	7027	20,39
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	426	7025	426	7028	0,16
Total Fallidos					7023	56.307	7026	61.425	7029	20,54
										Glosario de Términos

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

	S.05.4
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2025	

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
SERIE B - ES0359092030	10,00	18,92	19,31	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	10,00	18,92	19,31	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	8,46	8,11	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	7,50	30,21	28,96	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	13,70	13,13	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	1,25	0,36	0,33	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	6,82	6,90	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	18,92	19,31	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359092006	25,00	6,82	6,90	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	1,75	0,36	0,33	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	6,82	6,90	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,36	0,33	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	2,00	0,36	0,33	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	10,00	18,92	19,31	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	28,20	27,03	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE D - ES0359092055	9,40	6,82	6,90	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE C - ES0359092048	13,20	6,82	6,90	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE B - ES0359092030	18,30	6,82	6,90	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE E - ES0359092063	8,00	6,82	6,90	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		8,08	7,30	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

														S.05.5
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA														
Denominación del compartimento:														
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.														
Estados agregados: NO														
Fecha: 31/12/2025														

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida	Importe fijo (miles de euros)	Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)	Mínimo (miles de euros)	Periodidad pago según folleto / escritura	Condiciones iniciales folleto / escritura emisión	Otras consideraciones						
			Base de cálculo		% anual												
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862	12	2862	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,014	4862		5862	6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863	6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, S.E.	1864		2864	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3864	0,005	4864		5864	6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865	6865		7865		8865	

	S.05.5
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2025	

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	CAIXABANK
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo Adicional 3.4.3.2

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

	S.05.5
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2025	

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Determinada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)	0885	Fecha cálculo						Total
		24/02/2025	22/05/2025	22/08/2025	24/11/2025			
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885							
Saldo inicial	0886	12.768	14.077	15.227	17.008			
Cobros del periodo	0887	15.100	14.360	15.562	12.465			
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-153	-147	-81	-162			
Pagos por derivados	0889	-175	-199	-270	-129			
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-14.077	-15.227	-17.008	-18.059			
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-13.463	-12.865	-13.430	-11.122			
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0	0			
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0	0			
Saldo disponible	0894	0	0	0	0			
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	0	0			0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2025

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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