Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

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: 30/09/2026

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:
(sólo se cumplimentará en el supuesto de que se produzca el reenvío con alguna modificación de la información periódica)

S.01

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2026		Periodo anterior 31/12/2025
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	183.393	1001	211.619
I. Activos financieros a largo plazo	0002	183.393	1002	211.619
1. Activos titulizados	0003	183.393	1003	211.619
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	173.575	1005	199.868
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	9.843	1025	11.777
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-25	1027	-25
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

S.01

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2026		Periodo anterior 31/12/2025
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	70.469	1041	68.642
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	11.526	1042	12.261
V. Activos financieros a corto plazo	0043	26.819	1043	28.422
1. Activos titulizados	0044	26.763	1044	28.381
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	21.854	1046	23.168
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	257	1065	253
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	36	1066	40
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	5.079	1067	5.359
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	118	1068	142
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-581	1069	-581
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	56	1074	41
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	56	1079	41
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	32.124	1085	27.958
1. Tesorería	0086	32.124	1086	27.958
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	253.862	1088	280.261

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: 30/09/2026

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2026		Periodo anterior 31/12/2025
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	177.731	1089	204.939
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	177.731	1094	204.939
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	168.194	1095	194.902
1.1 Series no subordinadas	0096	0	1096	14.902
1.2 Series subordinadas	0097	168.194	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	8.946	1101	9.445
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	-59.995	1105	-59.495
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	591
3.1 Derivados de cobertura	0109	591	1109	591
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: 30/09/2026

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2026		Periodo anterior 31/12/2025
B) PASIVO CORRIENTE	0117	76.805	1117	76.026
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	69.693	1123	69.092
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	27.531	1124	29.099
1.1 Series no subordinadas	0125	15.128	1125	28.527
1.2 Series subordinadas	0126	11.806	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	597	1128	572
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	41.694	1131	39.525
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	319	1136	287
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	41.375	1137	39.238
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	468	1139	468
3.1 Derivados de cobertura	0140	468	1140	468
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	7.113	1148	6.935
1. Comisiones	0149	10	1149	10
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	9	1150	9
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	1	1152	1
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	7.103	1157	6.924
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-674	1158	-704
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-674	1160	-704
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	253.862	1162	280.261

S.02

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2026		Acumulado anterior 30/09/2025
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	2.077	1201	2.053	2201	5.892	3201	7.026
1.1 Activos titulizados	0202	1.897	1202	1.923	2202	5.433	3202	6.589
1.2 Otros activos financieros	0203	180	1203	130	2203	459	3203	437
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-2.186	1204	-2.227	2204	-6.316	3204	-7.672
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.426	1205	-1.513	2205	-4.147	3205	-5.373
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-760	1206	-713	2206	-2.169	3206	-2.299
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	-150	1208	-171	2208	-380	3208	-373
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-259	1209	-345	2209	-804	3209	-1.019
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210	0	3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211	0	3211	0
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212	0	3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213	0	3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214	0	3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-189	1217	-89	2217	-487	3217	-360
7.1 Servicios exteriores	0218	-165	1218	-64	2218	-412	3218	-280
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-165	1219	-64	2219	-412	3219	-280
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	-24	1224	-26	2224	-75	3224	-80
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-21	1225	-22	2225	-64	3225	-68
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-3	1227	-4	2227	-10	3227	-12
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	-26	1231	-34	2231	773	3231	-63
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-26	1232	-34	2232	773	3232	-63
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	0	1238	12	2238	18	3238	537
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	474	1239	456	2239	499	3239	904
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

S.03

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2026		Acumulado anterior 30/09/2025
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	511	1300	253	2300	1.355	3300	778
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	536	1301	279	2301	1.430	3301	858
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	1.898	1302	1.966	2302	5.458	3302	6.784
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-1.417	1303	-1.549	2303	-4.121	3303	-5.734
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	-117	1305	-270	2305	-350	3305	-644
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	172	1306	132	2306	444	3306	452
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	-24	1309	-26	2309	-75	3309	-80
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-21	1310	-22	2310	-65	3310	-69
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-3	1312	-4	2312	-10	3312	-12
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	-88	1322	-489	2322	2.810	3322	2.038
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	76	1325	-425	2325	3.052	3325	2.324
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	4.801	1326	4.718	2326	14.475	3326	14.886
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	3.554	1327	5.484	2327	12.177	3327	16.557
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	2.244	1328	1.148	2328	4.604	3328	3.779
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	6	1329	5	2329	11	3329	21
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	100	2330	87	3330	1.104
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-10.528	1331	-11.881	2331	-28.302	3331	-34.023
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-165	1332	-64	2332	-241	3332	-286
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	-165	1336	-64	2336	-241	3336	-286
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	423	1337	-236	2337	4.166	3337	2.816
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	31.701	1338	26.422	2338	27.958	3338	23.371
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	32.124	1339	26.187	2339	32.124	3339	26.187

S.04

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2026		Acumulado anterior 30/09/2025
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	-117	1357	-270	2357	-350	3357	-644
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-117	1358	-270	2358	-350	3358	-644
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	150	1360	171	2360	380	3360	373
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	-33	1362	98	2362	-30	3362	271
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 directemente 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 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

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

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: 30/09/2026

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

	Situación actual 30/09/2026								Situación cierre anual anterior 31/12/2025								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
Ratios (%)	**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	7,09	0401	30,78	0421	0,02	0441	7,03	1381	7,13	1401	28,20	1421	0,01	1441	7,75	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	17,00
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Prestamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

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: 30/09/2026

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	121	0467	80	0474	27	0481	0	0488	106	0495	9.011	0502	0	0509	9.117
De 1 a 3 meses	0461	21	0468	31	0475	9	0482	0	0489	40	0496	1.355	0503	0	0510	1.394
De 3 a 6 meses	0462	10	0469	26	0476	8	0483	3	0490	38	0497	1.020	0504	0	0511	1.058
De 6 a 9 meses	0463	5	0470	26	0477	5	0484	10	0491	41	0498	626	0505	0	0512	667
De 9 a 12 meses	0464	11	0471	53	0478	7	0485	13	0492	73	0499	707	0506	0	0513	780
Más de 12 meses	0465	91	0472	3.959	0479	97	0486	1.591	0493	5.647	0500	8.505	0507	0	0514	14.153
Total	0466	**259**	0473	**4.174**	0480	**153**	0487	**1.617**	0494	**5.945**	0501	**21.224**	0508	**0**	1515	**27.169**

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	121	0522	80	0529	27	0536	0	0543	106	0550	9.011	0557	0	0564	9.117	0571	23.390	0578	23.390	0584	38,98
De 1 a 3 meses	0516	21	0523	31	0530	9	0537	0	0544	40	0551	1.355	0558	0	0565	1.394	0572	3.655	0579	3.655	0585	38,15
De 3 a 6 meses	0517	10	0524	26	0531	8	0538	3	0545	38	0552	1.020	0559	0	0566	1.058	0573	2.175	0580	2.175	0586	48,62
De 6 a 9 meses	0518	5	0525	26	0532	5	0539	10	0546	41	0553	626	0560	0	0567	667	0574	1.160	0581	1.160	0587	57,49
De 9 a 12 meses	0519	11	0526	53	0533	7	0540	13	0547	73	0554	707	0561	0	0568	780	0575	1.570	0582	1.570	0588	49,68
Más de 12 meses	0520	91	0527	3.959	0534	97	0541	1.591	0548	5.647	0555	8.505	0562	0	0569	14.153	0576	18.634	0583	18.634	0589	75,95
Total	0521	259	0528	4.174	0535	153	0542	1.617	0549	5.945	0556	21.224	0563	0	0570	27.169	0577	50.583			0590	53,71

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: 30/09/2026

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 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	460	1600	359	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	2.434	1601	1.473	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	5.249	1602	4.851	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	7.223	1603	7.040	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	3.477	1604	8.583	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	141.629	1605	126.198	2605	241
Superior a 10 años	0606	49.880	1606	91.668	2606	1.799.759
Total	0607	**210.352**	1607	**240.172**	2607	**1.800.000**
Vida residual media ponderada (años)	0608	**10,19**	1608	**10,77**	2608	**27,35**

Antigüedad	Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	21,21	1609	20,48	2609	1,72

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

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: 30/09/2026

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 30/09/2026				Situación cierre anual anterior 31/12/2025				Situación inicial 05/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.563	0630	66.326	1620	1.566	1630	68.860	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	988	0631	106.407	1621	1.130	1631	124.817	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	193	0632	32.546	1622	198	1632	32.342	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	27	0633	5.072	1623	74	1633	14.153	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	**2.771**	0638	**210.352**	1628	**2.968**	1638	**240.172**	2628	**9.884**	2638	**1.800.000**
Media ponderada (%)	0639	**47,58**	0649		1639	**49,63**	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: 30/09/2026

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,20	1650	3,36	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,88	1651	4,19	2651	6,00
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,75	1652	0,75	2652	2,70

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

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: 30/09/2026

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2026				Situación cierre anual anterior 31/12/2025				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	107	0683	5.270	1660	116	1683	5.936	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	45	0684	2.456	1661	49	1684	2.748	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	25	0685	1.251	1662	25	1685	1.397	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	24	0686	1.351	1663	25	1686	1.529	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	20	0687	893	1664	21	1687	1.007	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	47	0688	1.974	1665	49	1688	2.159	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	64	0689	2.700	1666	72	1689	3.274	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	102	0690	6.000	1667	108	1690	6.925	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	278	0691	24.169	1668	290	1691	27.133	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	10	0692	183	1669	10	1692	220	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	12	0693	482	1670	12	1693	518	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	64	0694	3.324	1671	67	1694	3.771	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	1.782	0695	149.908	1672	1.920	1695	171.963	2672	6.243	2695	1.238.324
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	7	0697	235	1674	7	1697	258	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	11	0698	738	1675	12	1698	895	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	11	0699	705	1676	11	1699	757	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	106	0700	4.449	1677	116	1700	4.988	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	56	0701	4.262	1678	58	1701	4.694	2678	162	2701	31.874
Total España	0679	**2.771**	0702	**210.352**	1679	**2.968**	1702	**240.172**	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	**2.771**	0705	**210.352**	1682	**2.968**	1705	**240.172**	2682	**9.884**	2705	**1.800.000**

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

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: 30/09/2026

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2026				Situación cierre anual anterior 31/12/2025				Situación inicial 05/12/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,38			1710	1,29			2710	0,37		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2026

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2026					Situación cierre anual anterior 31/12/2025					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	5.603	15.128			2.700	16.085	43.430			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	195.128	1723	18.000		1724	223.430	2723	18.000		2724	1.800.000

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2026

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado		
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739
ES0359092006	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	0	0	NO	0	0	0	0
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	0	0	NO	0	0	0	0
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	2,70	42	0	NO	15.128	0	15.170	0
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	2,76	179	0	NO	63.000	0	63.179	0
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	2,81	195	0	NO	67.500	0	67.695	0
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	3,01	95	0	NO	30.600	0	30.695	0
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	4,51	88	0	NO	18.900	0	18.988	0
Total						0740 597	0741 0		0743 195.128	0744 0	0745 195.725	0746 0

	Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	2,59	0748	2,68	0749	0,00

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

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: 30/09/2026

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2026								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2025							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750		0751		0752		0753		1750		1751		1752		1753	
ES0359092006	SERIE A1	0		414.000		0		23.408		0		414.000		0		23.408	
ES0359092014	SERIE A2	0		936.000		0		125.437		0		936.000		0		125.437	
ES0359092022	SERIE A3	10.528		254.872		159		56.331		11.881		216.945		373		55.427	
ES0359092030	SERIE B	0		0		400		17.908		0		0		372		16.415	
ES0359092048	SERIE C	0		0		437		19.658		0		0		407		18.024	
ES0359092055	SERIE D	0		0		214		9.977		0		0		200		9.174	
ES0359092063	SERIE E	0		0		206		11.812		0		0		196		11.027	
Total		0754	10.528	0755	1.604.872	0756	1.417	0757	264.530	1754	11.881	1755	1.566.945	1756	1.549	1757	258.912

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: 30/09/2026

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

				Calificación		
Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Situación actual 30/09/2026	Situación cierre anual anterior 31/12/2025	Situación inicial 05/12/2006
		0760	0761	0762	0763	0764
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092014	SERIE A2	29/09/2021	FCH	A+	A+	AAA
ES0359092014	SERIE A2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	04/05/2018	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092022	SERIE A3	25/05/2026	FCH	AAA	AA+	AAA
ES0359092022	SERIE A3	12/12/2025	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	01/06/2022	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092030	SERIE B	25/05/2026	FCH	AAA	AA+	AA
ES0359092030	SERIE B	12/12/2025	MDY	Aaa	Aaa	Aa1
ES0359092030	SERIE B	26/02/2026	SYP	AAA	AA+	AA
ES0359092048	SERIE C	25/05/2026	FCH	AAA	AA+	A
ES0359092048	SERIE C	12/12/2025	MDY	Aaa	Aaa	A1
ES0359092048	SERIE C	03/12/2024	SYP	AA+	AA+	A
ES0359092055	SERIE D	25/05/2026	FCH	A+	A	BBB
ES0359092055	SERIE D	12/12/2025	MDY	Aa1	Aa1	Baa2
ES0359092055	SERIE D	26/02/2026	SYP	AA	A	BBB
ES0359092063	SERIE E	25/05/2026	FCH	A	BBB+	BB+
ES0359092063	SERIE E	12/12/2025	MDY	Ba1	Ba1	Ba1
ES0359092063	SERIE E	03/12/2024	SYP	B+	B+	BB

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

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: 30/09/2026

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 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	19.888	1765	20.825	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	19.744	1766	20.828	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	19.189	1767	20.941	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	136.307	1768	20.188	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769	19.282	2769	41.891
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770	121.367	2770	241.519
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	1.370.127
Total	0772	**195.128**	1772	**223.430**	2772	**1.800.000**
Vida residual media ponderada (años)	0773	**3,75**	1773	**8,65**	2773	**25,20**

S.05.3

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006	
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	22.056	1775	18.059	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	11,30	1777	8,08	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	7,75	1792	19,43	2792	90,00
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

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 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006		
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806		1806		2806		3806
Swap de Bases	BANCO SANTANDER	TRIMESTRAL	Media de los Euribor 12M en cada Fecha de Referencia	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	Tipo de Referencia de los Bonos - 0,055%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago		-1.059		-1.059			
Total							0808	-1.059	0809	-1.059	0810		

S.05.3

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
Naturaleza riesgo cubierto	Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006		Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		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	

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

S.05.4

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

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 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Última Fecha Pago			
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	404	7006	982	7009	0,21	7012	0,45	7015	0,34		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	404	7008	982	7011	0,21	7014	0,45	7017	0,34	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	52.126	7024	55.880	7027	21,50	7030	20,39	7033	21,66		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	426	7025	426	7028	0,18	7031	0,16	7034	0,17		
Total Fallidos					7023	52.552	7026	56.307	7029	21,67	7032	20,54	7035	21,83	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio						Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Última Fecha Pago			
	0850		1850		2850		3850	
	0851		1851		2851		3851	
	0852		1852		2852		3852	
	0853		1853		2853		3853	

S.05.4

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

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 E - ES0359092063	1,25	0,21	0,34	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	17,18	17,58	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	32,29	30,63	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	15,68	14,88	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359092006	25,00	6,63	6,73	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	6,63	6,73	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	1,75	0,21	0,34	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	10,00	17,18	17,58	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	2,00	0,21	0,34	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	10,00	17,18	17,58	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	9,69	9,19	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	7,50	34,59	32,82	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	10,00	17,18	17,58	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	6,63	6,73	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,21	0,34	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE C - ES0359092048	13,20	6,63	6,73	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE E - ES0359092063	8,00	6,63	6,73	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE B - ES0359092030	18,30	6,63	6,73	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE D - ES0359092055	9,40	6,63	6,73	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		11,30	10,07	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional en fichero adjunto

S.05.5

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Minimo (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: 30/09/2026

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	Multicedente
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo Adicional 3.4.6.4

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													

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

S.05.5

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo												Total
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885	23/02/2026	22/05/2026	24/08/2026										
Saldo inicial	0886	18.059	19.824	20.709										
Cobros del periodo	0887	11.712	11.982	13.606										
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-196	-137	-197										
Pagos por derivados	0889	-91	-141	-117										
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-19.824	-20.709	-22.056										
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-9.660	-10.819	-11.944										
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

S.06
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2026

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene
Información adicional en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

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