

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8591
NIF Fondo: V84916956
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2022

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	397.995	1001	423.126
I. Activos financieros a largo plazo	0002	397.995	1002	423.126
1. Activos titulizados	0003	397.995	1003	423.126
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	385.131	1005	410.193
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	12.937	1025	13.006
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-73	1027	-73
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	94.178	1041	84.118
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	15.839	1042	15.899
V. Activos financieros a corto plazo	0043	37.101	1043	35.552
1. Activos titulizados	0044	37.099	1044	35.552
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	32.655	1046	31.416
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	87	1065	76
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	14	1066	11
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	5.002	1067	4.705
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	71	1068	74
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-730	1069	-730
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	2	1074	0
3.1 Valores representativos de deuda	0075	0	1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076	0	1076	0
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	2	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	41.239	1085	32.667
1. Tesorería	0086	41.239	1086	32.667
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	492.173	1088	507.245

S.01

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	400.539	1089	425.271
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	400.539	1094	425.271
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	382.378	1095	406.905
1.1 Series no subordinadas	0096	202.378	1096	226.905
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	14.703	1101	14.908
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	-54.238	1105	-54.033
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	3.458	1108	3.458
3.1 Derivados de cobertura	0109	3.458	1109	3.458
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

S.01

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
B) PASIVO CORRIENTE	0117	95.851	1117	86.175
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	88.755	1123	79.141
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	37.695	1124	36.151
1.1 Series no subordinadas	0125	37.657	1125	36.122
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	38	1128	29
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	0	1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	28.036	1131	27.517
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	120	1136	107
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	27.916	1137	27.409
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	674	1139	674
3.1 Derivados de cobertura	0140	674	1140	674
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	22.350	1143	14.800
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	22.350	1146	14.800
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	7.096	1148	7.034
1. Comisiones	0149	14	1149	15
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	12	1150	12
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	3	1152	3
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	7.082	1157	7.019
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-4.216	1158	-4.201
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-4.216	1160	-4.201
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	492.173	1162	507.245

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2022		Acumulado anterior 30/06/2021
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	583	1201	533	2201	1.114	3201	1.166
1.1 Activos titulizados	0202	583	1202	533	2202	1.114	3202	1.166
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-362	1204	-332	2204	-697	3204	-668
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-79	1205	-70	2205	-147	3205	-139
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-270	1206	-254	2206	-520	3206	-507
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-14	1207	-9	2207	-30	3207	-22
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-126	1208	-141	2208	-258	3208	-367
A) MARGEN DE INTERESES	0209	95	1209	60	2209	160	3209	131
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	18	2216	0	3216	38
7. Otros gastos de explotación	0217	-38	1217	-347	2217	-370	3217	-576
7.1 Servicios exteriores	0218	-4	1218	-311	2218	-301	3218	-504
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-4	1219	-311	2219	-301	3219	-504
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	-34	1224	-36	2224	-68	3224	-71
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-28	1225	-29	2225	-56	3225	-58
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-6	1227	-7	2227	-12	3227	-14
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	-6	1231	-179	2231	-6	3231	-297
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-6	1232	-179	2232	-6	3232	-297
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	10	1238	137	2238	10	3238	341
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-62	1239	311	2239	205	3239	363
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2022		Acumulado anterior 30/06/2021
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	325	1300	248	2300	591	3300	461
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	359	1301	266	2301	660	3301	495
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	564	1302	545	2302	1.103	3302	1.214
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-70	1303	-70	2303	-139	3303	-140
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	-121	1305	-195	2305	-273	3305	-552
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-15	1308	-15	2308	-31	3308	-27
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-34	1309	-36	2309	-69	3309	-72
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-28	1310	-29	2310	-56	3310	-58
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-6	1312	-7	2312	-13	3312	-14
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	18	2315	0	3315	38
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	18	2321	0	3321	38
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	10.781	1322	-3.250	2322	7.981	3322	128
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	-319	1325	-2.937	2325	488	3325	636
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	6.269	1326	5.067	2326	12.854	3326	11.032
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	4.599	1327	4.948	2327	9.395	3327	11.380
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	470	1328	680	2328	1.159	3328	1.542
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	71	1330	395	2330	71	3330	959
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-11.728	1331	-14.027	2331	-22.992	3331	-24.276
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	11.100	1332	-313	2332	7.493	3332	-509
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	11.120	1333	0	2333	7.550	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	-20	1336	-313	2336	-57	3336	-509
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	11.105	1337	-3.003	2337	8.572	3337	588
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	30.133	1338	18.162	2338	32.667	3338	14.571
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	41.239	1339	15.159	2339	41.239	3339	15.159

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2022		Acumulado anterior 30/06/2021
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-121	1357	-195	2357	-273	3357	-552
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-121	1358	-195	2358	-273	3358	-552
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	126	1360	141	2360	258	3360	367
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	-5	1362	54	2362	15	3362	185
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2022								Situación cierre anual anterior 31/12/2021								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	4,12	0401	17,46	0421	0,28	0441	3,77	1381	3,86	1401	16,72	1421	0,28	1441	3,98	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	17,00
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

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	152	0467	85	0474	10	0481	0	0488	94	0495	15.712	0502	0	0509	15.806
De 1 a 3 meses	0461	21	0468	31	0475	4	0482	0	0489	35	0496	2.933	0503	0	0510	2.968
De 3 a 6 meses	0462	15	0469	40	0476	3	0483	2	0490	45	0497	1.645	0504	0	0511	1.690
De 6 a 9 meses	0463	11	0470	43	0477	2	0484	3	0491	49	0498	1.168	0505	0	0512	1.216
De 9 a 12 meses	0464	8	0471	51	0478	1	0485	3	0492	56	0499	708	0506	0	0513	764
Más de 12 meses	0465	94	0472	3.649	0479	65	0486	1.042	0493	4.756	0500	10.634	0507	0	0514	15.390
Total	0466	301	0473	3.899	0480	85	0487	1.050	0494	5.035	0501	32.799	0508	0	1515	37.834

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	152	0522	85	0529	10	0536	0	0543	94	0550	15.712	0557	0	0564	15.806	0571	28.565	0578	28.565	0584	55,33
De 1 a 3 meses	0516	21	0523	31	0530	4	0537	0	0544	35	0551	2.933	0558	0	0565	2.968	0572	4.701	0579	4.701	0585	63,13
De 3 a 6 meses	0517	15	0524	40	0531	3	0538	2	0545	45	0552	1.645	0559	0	0566	1.690	0573	2.844	0580	2.844	0586	59,43
De 6 a 9 meses	0518	11	0525	43	0532	2	0539	3	0546	49	0553	1.168	0560	0	0567	1.216	0574	1.969	0581	1.969	0587	61,74
De 9 a 12 meses	0519	8	0526	51	0533	1	0540	3	0547	56	0554	708	0561	0	0568	764	0575	1.467	0582	1.467	0588	52,07
Más de 12 meses	0520	94	0527	3.649	0534	65	0541	1.042	0548	4.756	0555	10.634	0562	0	0569	15.390	0576	19.063	0583	19.063	0589	80,73
Total	0521	301	0528	3.899	0535	85	0542	1.050	0549	5.035	0556	32.799	0563	0	0570	37.834	0577	58.609			0590	64,55

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	350	1600	154	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	589	1601	773	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.061	1602	883	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	1.707	1603	1.498	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	2.602	1604	2.347	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	63.958	1605	66.884	2605	241
Superior a 10 años	0606	365.458	1606	386.781	2606	1.799.759
Total	0607	435.725	1607	459.321	2607	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	13,47	1608	13,88	2608	27,35

Antigüedad	Situación actual 30/06/2022					
	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 05/12/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	17,04	1609	16,56	2609	1,72

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				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	1.009	0630	42.703	1620	929	1630	38.313	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.566	0631	156.718	1621	1.611	1631	157.667	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	1.385	0632	201.401	1622	1.522	1632	225.348	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	170	0633	34.904	1623	184	1633	37.993	2623	9.439	2633	1.699.335
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	445	2634	100.665
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	4.130	0638	435.725	1628	4.246	1638	459.321	2628	9.884	2638	1.800.000
Media ponderada (%)	0639	59,26	0649		1639	60,56	1649		2639	94,44	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,47	1650	0,47	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	2,50	1651	2,50	2651	6,00
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,00	2652	2,70

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2022
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				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	181	0683	13.831	1660	190	1683	14.865	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	69	0684	5.181	1661	73	1684	5.595	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	38	0685	2.557	1662	38	1685	2.722	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	31	0686	2.927	1663	33	1686	3.247	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	28	0687	1.911	1664	30	1687	1.986	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	66	0688	4.340	1665	68	1688	4.630	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	99	0689	6.035	1666	102	1689	6.659	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	180	0690	14.909	1667	188	1690	15.886	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	445	0691	53.539	1668	458	1691	56.150	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	23	0692	580	1669	26	1692	631	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	22	0693	1.059	1670	23	1693	1.181	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	82	0694	6.303	1671	84	1694	6.773	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	2.571	0695	299.884	1672	2.632	1695	315.099	2672	6.243	2695	1.238.324
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	12	0697	889	1674	13	1697	933	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	16	0698	1.669	1675	16	1698	1.715	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	14	0699	1.171	1676	14	1699	1.215	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	166	0700	9.562	1677	169	1700	10.119	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	87	0701	9.378	1678	89	1701	9.914	2678	162	2701	31.874
Total España	0679	4.130	0702	435.725	1679	4.246	1702	459.321	2679	9.884	2702	1.800.000
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	4.130	0705	435.725	1682	4.246	1705	459.321	2682	9.884	2705	1.800.000

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2022
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				Situación inicial 05/12/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,90			1710	0,88			2710	0,37		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2022			Situación cierre anual anterior 31/12/2021			Situación inicial 05/12/2006					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente			
		0720	Nominal unitario (€) 0721	0722	1720	Nominal unitario (€) 1721	1722	2720	Nominal unitario (€) 2721	2722			
ES0359092006	SERIE A1	4.140	0	0	4.140	0	0	4.140	100.000	414.000			
ES0359092014	SERIE A2	9.360	0	0	9.360	0	0	9.360	100.000	936.000			
ES0359092022	SERIE A3	2.700	88.902	240.035	2.700	97.417	263.027	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	420.035	1723	18.000	1724	443.027	2723	18.000	2724	1.800.000

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2022

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		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		0738	0739			
						0730	0731		0732	0733	0734	0735			0742	0736	0737
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	0,00	0	0	NO	240.035	0	0	240.035					
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	0,00	0	0	NO	63.000	0	0	63.000					
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	0,00	0	0	NO	67.500	0	0	67.500					
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	0,15	5	0	NO	30.600	0	0	30.605					
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	1,65	33	0	NO	18.900	0	0	18.933					
Total						0740	38	0741	0	0743	420.035	0744	0	0745	420.073	0746	

	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,07	0748	0,06	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: 30/06/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2022								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2021							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0359092006	SERIE A1	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408	0	23.408		
ES0359092014	SERIE A2	0	936.000	0	125.437	14.027	920.246	0	125.437	0	920.246	0	125.437	0	125.437		
ES0359092022	SERIE A3	11.728	29.965	0	42.820	0	0	0	42.820	0	0	0	42.820	0	42.820		
ES0359092030	SERIE B	0	0	0	10.352	0	0	0	10.352	0	0	0	10.352	0	10.352		
ES0359092048	SERIE C	0	0	0	11.425	0	0	0	11.425	0	0	0	11.425	0	11.425		
ES0359092055	SERIE D	0	0	0	5.985	0	0	0	5.985	0	0	0	5.985	0	5.985		
ES0359092063	SERIE E	0	0	70	8.122	0	0	70	8.122	0	0	70	8.122	70	8.122		
Total		0754	11.728	0755	1.379.965	0756	70	0757	227.549	1754	14.027	1755	1.334.246	1756	70	1757	227.271

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/06/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	Situación inicial 05/12/2006
				0760	0761	0762
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092014	SERIE A2	29/09/2021	FCH	A+	A+	AAA
ES0359092014	SERIE A2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	04/05/2018	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092022	SERIE A3	29/09/2021	FCH	A+	A+	AAA
ES0359092022	SERIE A3	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	01/06/2022	SYP	AAA	AA+	AAA
ES0359092030	SERIE B	29/09/2021	FCH	A	A	AA
ES0359092030	SERIE B	22/06/2022	MDY	Aa1	Aa2	Aa1
ES0359092030	SERIE B	01/06/2022	SYP	AA+	AA	AA
ES0359092048	SERIE C	29/09/2021	FCH	BB	BB	A
ES0359092048	SERIE C	22/06/2022	MDY	Baa1	Ba1	A1
ES0359092048	SERIE C	01/06/2022	SYP	AA	A	A
ES0359092055	SERIE D	11/07/2019	FCH	B-	B-	BBB
ES0359092055	SERIE D	22/06/2022	MDY	Caa1	Caa3	Baa2
ES0359092055	SERIE D	01/06/2022	SYP	BB+	B+	BBB
ES0359092063	SERIE E	18/03/2009	FCH	CC	CC	BB+
ES0359092063	SERIE E	11/09/2009	MDY	C	C	Ba1
ES0359092063	SERIE E	01/06/2022	SYP	CCC-	D	BB

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	22.747	1765	22.529	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	27.015	1766	27.286	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	28.104	1767	28.346	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	29.169	1768	29.466	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	30.232	1769	30.515	2769	41.891
Entre 5 y 10 años	0770	144.703	1770	304.885	2770	241.519
Superior a 10 años	0771	138.064	1771	0	2771	1.370.127
Total	0772	420.035	1772	443.027	2772	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	12,90	1773	9,00	2773	25,20

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 05/12/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	8.415	1775	7.546	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	2,00	1777	1,70	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	57,14	1792	59,37	2792	90,00
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/06/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	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	-4.132	-4.132		
Total							0808 -4.132	0809 -4.132	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 05/12/2006		Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 05/12/2006			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

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 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	1.197	7006	1.579	7009	0,29	7012	0,36	7015	0,34		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.197	7008	1.579	7011	0,29	7014	0,36	7017	0,34	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	65.325	7024	65.126	7027	13,68	7030	12,99	7033	13,40		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	598	7025	598	7028	0,13	7031	0,12	7034	0,12		
Total Fallidos					7023	65.923	7026	65.724	7029	13,81	7032	13,11	7035	13,52	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

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 A1 - ES0359092006	25,00	7,12	7,11	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	15,00	14,59	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	7,12	7,11	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	1,25	0,21	0,26	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	7,50	16,07	15,63	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	29,98	30,45	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	1,75	0,21	0,26	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	7,29	7,09	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	10,00	29,98	30,45	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	2,00	0,21	0,26	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	7,12	7,11	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	4,50	4,38	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	10,00	29,98	30,45	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	10,00	29,98	30,45	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,21	0,26	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE B - ES0359092030	18,30	7,12	7,11	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE C - ES0359092048	13,20	7,12	7,11	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE D - ES0359092055	9,40	7,12	7,11	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE E - ES0359092063	8,00	7,12	7,11	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		2,00	1,91	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total		
		22/02/2022	23/05/2022											
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885													
Saldo inicial	0886	7.546	8.259											
Cobros del periodo	0887	12.511	12.114											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-313	-40											
Pagos por derivados	0889	-152	-121											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-8.259	-8.415											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-11.333	-11.798											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0											
Resto pagos/retenciones	0893	0	0											
Saldo disponible	0894	0	0											
Liquidación de comisión variable	0895	0	0											0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

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