

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8591
NIF Fondo: V84916956
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2026

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: 31/03/2026

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2026		Periodo anterior 31/12/2025
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	202.689	1001	211.619
I. Activos financieros a largo plazo	0002	202.689	1002	211.619
1. Activos titulizados	0003	202.689	1003	211.619
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	191.446	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	11.268	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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2026

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2026		Periodo anterior 31/12/2025
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	69.203	1041	68.642
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	12.261	1042	12.261
V. Activos financieros a corto plazo	0043	28.029	1043	28.422
1. Activos titulizados	0044	27.986	1044	28.381
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	22.876	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	248	1065	253
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	27	1066	40
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	5.286	1067	5.359
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	130	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	43	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	43	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	28.914	1085	27.958
1. Tesorería	0086	28.914	1086	27.958
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	271.892	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: 31/03/2026

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2026		Periodo anterior 31/12/2025
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	196.473	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	196.473	1094	204.939
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	187.015	1095	194.902
1.1 Series no subordinadas	0096	7.015	1096	14.902
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	8.867	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	-60.073	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: 31/03/2026

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2026		Periodo anterior 31/12/2025
B) PASIVO CORRIENTE	0117	76.120	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	69.382	1123	69.092
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	28.693	1124	29.099
1.1 Series no subordinadas	0125	28.161	1125	28.527
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	531	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	40.222	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	277	1136	287
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	39.944	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	6.739	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	6.728	1157	6.924
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-701	1158	-704
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-701	1160	-704
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	271.892	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: 31/03/2026

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2026		Acumulado anterior 31/03/2025
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	1.852	1201	2.675	2201	1.852	3201	2.675
1.1 Activos titulizados	0202	1.719	1202	2.509	2202	1.719	3202	2.509
1.2 Otros activos financieros	0203	133	1203	167	2203	133	3203	167
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-2.062	1204	-2.947	2204	-2.062	3204	-2.947
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.366	1205	-2.117	2205	-1.366	3205	-2.117
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-697	1206	-831	2206	-697	3206	-831
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	-94	1208	-66	2208	-94	3208	-66
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-305	1209	-338	2209	-305	3209	-338
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	-178	1217	-123	2217	-178	3217	-123
7.1 Servicios exteriores	0218	-153	1218	-97	2218	-153	3218	-97
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-153	1219	-97	2219	-153	3219	-97
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	-25	1224	-27	2224	-25	3224	-27
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-22	1225	-23	2225	-22	3225	-23
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	-3	3227	-4
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	-95	1231	-52	2231	-95	3231	-52
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-95	1232	-52	2232	-95	3232	-52
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	121	2238	0	3238	121
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	578	1239	392	2239	578	3239	392
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: 31/03/2026

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2026		Acumulado anterior 31/03/2025
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	357	1300	199	2300	357	3300	199
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	382	1301	226	2301	382	3301	226
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	1.748	1302	2.598	2302	1.748	3302	2.598
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-1.406	1303	-2.368	2303	-1.406	3303	-2.368
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	-91	1305	-175	2305	-91	3305	-175
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	131	1306	171	2306	131	3306	171
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	-25	1309	-27	2309	-25	3309	-27
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-22	1310	-23	2310	-22	3310	-23
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-4	1312	-4	2312	-4	3312	-4
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	599	1322	1.678	2322	599	3322	1.678
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	755	1325	1.778	2325	755	3325	1.778
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	4.702	1326	4.837	2326	4.702	3326	4.837
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	3.309	1327	6.025	2327	3.309	3327	6.025
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	995	1328	1.779	2328	995	3328	1.779
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	2	1329	2	2329	2	3329	2
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	230	2330	0	3330	230
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-8.254	1331	-11.095	2331	-8.254	3331	-11.095
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-156	1332	-100	2332	-156	3332	-100
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	-156	1336	-100	2336	-156	3336	-100
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	956	1337	1.877	2337	956	3337	1.877
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	27.958	1338	23.371	2338	27.958	3338	23.371
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	28.914	1339	25.248	2339	28.914	3339	25.248

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2026

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2026		Acumulado anterior 31/03/2025
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 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	-91	1357	-175	2357	-91	3357	-175
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-91	1358	-175	2358	-91	3358	-175
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	94	1360	66	2360	94	3360	66
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	-3	1362	109	2362	-3	3362	109
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: 31/03/2026

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/03/2026								Situación cierre anual anterior 31/12/2025								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	7,17	0401	29,02	0421	0,03	0441	7,07	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	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2026

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	105	0467	67	0474	21	0481	0	0488	88	0495	7.951	0502	0	0509	8.039
De 1 a 3 meses	0461	16	0468	21	0475	7	0482	0	0489	27	0496	1.373	0503	0	0510	1.401
De 3 a 6 meses	0462	9	0469	20	0476	7	0483	3	0490	29	0497	931	0504	0	0511	961
De 6 a 9 meses	0463	10	0470	55	0477	13	0484	14	0491	81	0498	1.198	0505	0	0512	1.279
De 9 a 12 meses	0464	9	0471	51	0478	5	0485	11	0492	67	0499	540	0506	0	0513	607
Más de 12 meses	0465	99	0472	4.026	0479	105	0486	1.660	0493	5.792	0500	9.733	0507	0	0514	15.524
Total	0466	248	0473	4.239	0480	157	0487	1.687	0494	6.084	0501	21.726	0508	0	1515	27.811

Impagados con garantía real (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total		Valor garantía		Valor Garantía con Tasación > 2 años		% Deuda / v. Tasación	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total													
Hasta 1 mes	0515	105	0522	67	0529	21	0536	0	0543	88	0550	7.951	0557	0	0564	8.039	0571	19.714	0578	19.714	0584	40,78
De 1 a 3 meses	0516	16	0523	21	0530	7	0537	0	0544	27	0551	1.373	0558	0	0565	1.401	0572	3.203	0579	3.203	0585	43,73
De 3 a 6 meses	0517	9	0524	20	0531	7	0538	3	0545	29	0552	931	0559	0	0566	961	0573	1.816	0580	1.816	0586	52,89
De 6 a 9 meses	0518	10	0525	55	0532	13	0539	14	0546	81	0553	1.198	0560	0	0567	1.279	0574	2.152	0581	2.152	0587	59,44
De 9 a 12 meses	0519	9	0526	51	0533	5	0540	11	0547	67	0554	540	0561	0	0568	607	0575	1.415	0582	1.415	0588	42,90
Más de 12 meses	0520	99	0527	4.026	0534	105	0541	1.660	0548	5.792	0555	9.733	0562	0	0569	15.524	0576	20.542	0583	20.542	0589	75,57
Total	0521	248	0528	4.239	0535	157	0542	1.687	0549	6.084	0556	21.726	0563	0	0570	27.811	0577	48.842			0590	56,94

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2026

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 31/03/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	380	1600	359	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	1.764	1601	1.473	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	5.537	1602	4.851	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	7.150	1603	7.040	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	7.132	1604	8.583	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	145.118	1605	126.198	2605	241
Superior a 10 años	0606	63.794	1606	91.668	2606	1.799.759
Total	0607	230.875	1607	240.172	2607	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	10,59	1608	10,77	2608	27,35

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 31/03/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	20,72	1609	20,48	2609	1,72

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2026

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 31/03/2026				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	1.566	0630	68.618	1620	1.566	1630	68.860	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.081	0631	118.262	1621	1.130	1631	124.817	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	214	0632	35.498	1622	198	1632	32.342	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	45	0633	8.497	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	2.906	0638	230.875	1628	2.968	1638	240.172	2628	9.884	2638	1.800.000
Media ponderada (%)	0639	48,99	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: 31/03/2026

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/03/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,18	1650	3,36	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,27	1651	4,19	2651	6,00
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,75	1652	0,75	2652	2,70

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2026
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/03/2026				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	112	0683	5.728	1660	116	1683	5.936	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	49	0684	2.675	1661	49	1684	2.748	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	25	0685	1.358	1662	25	1685	1.397	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	24	0686	1.478	1663	25	1686	1.529	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	21	0687	978	1664	21	1687	1.007	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	48	0688	2.098	1665	49	1688	2.159	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	69	0689	3.176	1666	72	1689	3.274	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	108	0690	6.713	1667	108	1690	6.925	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	286	0691	25.974	1668	290	1691	27.133	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	10	0692	211	1669	10	1692	220	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	12	0693	506	1670	12	1693	518	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	66	0694	3.573	1671	67	1694	3.771	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	1.876	0695	165.190	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	250	1674	7	1697	258	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	12	0698	876	1675	12	1698	895	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	11	0699	741	1676	11	1699	757	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	113	0700	4.845	1677	116	1700	4.988	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	57	0701	4.505	1678	58	1701	4.694	2678	162	2701	31.874
Total España	0679	2.906	0702	230.875	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	2.906	0705	230.875	1682	2.968	1705	240.172	2682	9.884	2705	1.800.000

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2026
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/03/2026				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	1,33			1710	1,29			2710	0,37		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2026

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2026			Situación cierre anual anterior 31/12/2025			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	13.028	35.176	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	215.176	1723	18.000	1724	223.430	2723	18.000	2724	1.800.000

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2026

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		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado	Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas				
						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	0			
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	2,21	78	0	NO	35.176	0	0	35.254	0	0			
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	2,27	143	0	NO	63.000	0	0	63.143	0	0			
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	2,32	157	0	NO	67.500	0	0	67.657	0	0			
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	2,52	77	0	NO	30.600	0	0	30.677	0	0			
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	4,02	76	0	NO	18.900	0	0	18.976	0	0			
Total						0740	531	0741	0	0743	215.176	0744	0	0745	215.707	0746	0

	Situación actual 31/03/2026		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	2,52	0748	2,68	0749	0,00

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2026

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2026								Situación periodo comparativo anterior 31/03/2025							
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	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0359092006	SERIE A1	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408
ES0359092014	SERIE A2	0	936.000	0	125.437	0	936.000	0	125.437	0	936.000	0	125.437	0	936.000	0	125.437
ES0359092022	SERIE A3	8.254	234.824	246	55.981	11.095	194.017	725	54.553	8.254	234.824	246	55.981	11.095	194.017	725	54.553
ES0359092030	SERIE B	0	0	367	17.158	0	0	535	15.619	0	0	367	17.158	0	0	535	15.619
ES0359092048	SERIE C	0	0	402	18.837	0	0	582	17.155	0	0	402	18.837	0	0	582	17.155
ES0359092055	SERIE D	0	0	198	9.574	0	0	280	8.750	0	0	198	9.574	0	0	280	8.750
ES0359092063	SERIE E	0	0	194	11.419	0	0	247	10.623	0	0	194	11.419	0	0	247	10.623
Total		0754	8.254	0755	1.584.824	0756	1.406	0757	261.814	1754	11.095	1755	1.544.017	1756	2.368	1757	255.545

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2026

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 31/03/2026	Situación cierre anual anterior 31/12/2025	Situación inicial 05/12/2006
				0760	0761	0762
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092014	SERIE A2	29/09/2021	FCH	A+	A+	AAA
ES0359092014	SERIE A2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	04/05/2018	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092022	SERIE A3	13/03/2024	FCH	AA+	AA+	AAA
ES0359092022	SERIE A3	12/12/2025	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	01/06/2022	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092030	SERIE B	05/02/2025	FCH	AA+	AA+	AA
ES0359092030	SERIE B	12/12/2025	MDY	Aaa	Aaa	Aa1
ES0359092030	SERIE B	26/02/2026	SYP	AAA	AA+	AA
ES0359092048	SERIE C	09/12/2025	FCH	AA+	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	09/12/2025	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	09/12/2025	FCH	BBB+	BBB+	BB+
ES0359092063	SERIE E	12/12/2025	MDY	Ba1	Ba1	Ba1
ES0359092063	SERIE E	03/12/2024	SYP	B+	B+	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: 31/03/2026

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 31/03/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	21.166	1765	20.825	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	20.585	1766	20.828	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	20.489	1767	20.941	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	19.619	1768	20.188	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	133.318	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	215.176	1772	223.430	2772	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	8,40	1773	8,65	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: 31/03/2026

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/03/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	19.824	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	9,21	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	16,34	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: 31/03/2026

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 31/03/2026	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	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2026

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 31/03/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006		Situación actual 31/03/2026		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	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2026

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 31/03/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación actual 31/03/2026		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	569	7006	982	7009	0,27	7012	0,45	7015	0,58		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	569	7008	982	7011	0,27	7014	0,45	7017	0,58	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	55.454	7024	55.880	7027	20,94	7030	20,39	7033	20,56		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	426	7025	426	7028	0,16	7031	0,16	7034	0,16		
Total Fallidos					7023	55.880	7026	56.307	7029	21,10	7032	20,54	7035	20,71	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/03/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2026

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 C - ES0359092048	10,00	18,41	18,77	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	2,00	0,27	0,58	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	10,00	18,41	18,77	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359092006	25,00	6,80	6,81	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	14,22	13,70	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	6,80	6,81	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	6,80	6,81	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	1,25	0,27	0,58	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	1,75	0,27	0,58	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	29,28	28,20	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	8,78	8,46	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	18,41	18,77	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,27	0,58	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	7,50	31,37	30,21	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	10,00	18,41	18,77	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE C - ES0359092048	13,20	6,80	6,81	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE E - ES0359092063	8,00	6,80	6,81	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE D - ES0359092055	9,40	6,80	6,81	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE B - ES0359092030	18,30	6,80	6,81	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		9,21	8,08	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: 31/03/2026

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

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

S.05.5
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2026

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	CAIXABANK
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo Adicional 3.4.3.2

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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2026

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												
Saldo inicial	0886	18.059												
Cobros del periodo	0887	11.712												
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-196												
Pagos por derivados	0889	-91												
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-19.824												
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-9.660												
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0												
Resto pagos/retenciones	0893	0												
Saldo disponible	0894	0												
Liquidación de comisión variable	0895	0												0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2026

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