

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: 30/06/2026

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

	S.01
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2026		Periodo anterior 31/12/2025
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	193.119	1001	211.619
I. Activos financieros a largo plazo	0002	193.119	1002	211.619
1. Activos titulizados	0003	193.119	1003	211.619
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	182.045	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	11.099	1025	11.777
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-25	1027	-25
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

	S.01
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2026		Periodo anterior 31/12/2025
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	70.887	1041	68.642
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	11.526	1042	12.261
V. Activos financieros a corto plazo	0043	27.660	1043	28.422
1. Activos titulizados	0044	27.611	1044	28.381
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	22.368	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	249	1065	253
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	36	1066	40
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	5.414	1067	5.359
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	126	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	48	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	48	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	31.701	1085	27.958
1. Tesorería	0086	31.701	1086	27.958
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	264.005	1088	280.261

S.01
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2026

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2026		Periodo anterior 31/12/2025
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	187.885	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	187.885	1094	204.939
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	177.874	1095	194.902
1.1 Series no subordinadas	0096	0	1096	14.902
1.2 Series subordinadas	0097	177.874	1097	180.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	0	1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	9.420	1101	9.445
2.1 Préstamo subordinado	0102	68.941	1102	68.941
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-59.521	1105	-59.495
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108	591	1108	591
3.1 Derivados de cobertura	0109	591	1109	591
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

	S.01
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2026		Periodo anterior 31/12/2025
B) PASIVO CORRIENTE	0117	76.828	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	69.771	1123	69.092
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	28.369	1124	29.099
1.1 Series no subordinadas	0125	25.656	1125	28.527
1.2 Series subordinadas	0126	2.126	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	588	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	40.935	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	312	1136	287
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	40.622	1137	39.238
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	468	1139	468
3.1 Derivados de cobertura	0140	468	1140	468
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	7.057	1148	6.935
1. Comisiones	0149	10	1149	10
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	9	1150	9
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	1	1152	1
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	7.046	1157	6.924
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-707	1158	-704
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-707	1160	-704
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	264.005	1162	280.261

	S.02
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2026		Acumulado anterior 30/06/2025
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	1.964	1201	2.298	2201	3.815	3201	4.974
1.1 Activos titulizados	0202	1.817	1202	2.158	2202	3.536	3202	4.666
1.2 Otros activos financieros	0203	146	1203	140	2203	280	3203	307
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-2.068	1204	-2.498	2204	-4.130	3204	-5.445
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.355	1205	-1.743	2205	-2.721	3205	-3.860
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-713	1206	-755	2206	-1.410	3206	-1.585
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	-135	1208	-135	2208	-229	3208	-202
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-240	1209	-335	2209	-544	3209	-673
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	-120	1217	-147	2217	-298	3217	-270
7.1 Servicios exteriores	0218	-94	1218	-119	2218	-247	3218	-216
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-94	1219	-119	2219	-247	3219	-216
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	-28	2224	-51	3224	-54
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-22	1225	-23	2225	-44	3225	-46
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	-7	3227	-8
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	894	1231	23	2231	799	3231	-29
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	894	1232	23	2232	799	3232	-29
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	18	1238	404	2238	18	3238	525
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-552	1239	56	2239	26	3239	448
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

	S.03
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2026		Acumulado anterior 30/06/2025
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	488	1300	326	2300	844	3300	525
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	513	1301	353	2301	895	3301	579
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	1.811	1302	2.220	2302	3.560	3302	4.818
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-1.299	1303	-1.818	2303	-2.705	3303	-4.186
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	-141	1305	-199	2305	-232	3305	-374
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	141	1306	150	2306	272	3306	321
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	-50	3309	-54
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-22	1310	-23	2310	-43	3310	-46
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-3	1312	-4	2312	-7	3312	-8
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	2.300	1322	849	2322	2.899	3322	2.527
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	2.220	1325	972	2325	2.975	3325	2.750
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	4.972	1326	5.332	2326	9.674	3326	10.169
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	5.313	1327	5.047	2327	8.623	3327	11.073
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.365	1328	851	2328	2.361	3328	2.631
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	3	1329	14	2329	5	3329	16
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	87	1330	774	2330	87	3330	1.004
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-9.521	1331	-11.047	2331	-17.774	3331	-22.142
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	79	1332	-123	2332	-76	3332	-223
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	79	1336	-123	2336	-76	3336	-223
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	2.788	1337	1.175	2337	3.743	3337	3.052
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	28.914	1338	25.248	2338	27.958	3338	23.371
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	31.701	1339	26.422	2339	31.701	3339	26.422

	S.04
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2026		Acumulado anterior 30/06/2025
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-141	1357	-199	2357	-232	3357	-374
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-141	1358	-199	2358	-232	3358	-374
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	135	1360	135	2360	229	3360	202
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361	0	3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0362	6	1362	64	2362	3	3362	172
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el periodo	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2026

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2026								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	7,47	0401	29,74	0421	0,02	0441	7,49	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	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1															
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA															
Denominación del compartimento:															
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.															
Estados agregados: NO															
Fecha: 30/06/2026															
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	129	0467	85	0474	29	0481	0	0488	113	0495	9.642	0502	0	0509	9.756
De 1 a 3 meses	0461	16	0468	23	0475	7	0482	0	0489	30	0496	1.296	0503	0	0510	1.326
De 3 a 6 meses	0462	7	0469	17	0476	7	0483	3	0490	27	0497	820	0504	0	0511	847
De 6 a 9 meses	0463	8	0470	42	0477	5	0484	8	0491	55	0498	685	0505	0	0512	740
De 9 a 12 meses	0464	10	0471	61	0478	10	0485	16	0492	86	0499	840	0506	0	0513	926
Más de 12 meses	0465	100	0472	3.979	0479	104	0486	1.671	0493	5.754	0500	10.069	0507	0	0514	15.823
Total	0466	270	0473	4.207	0480	161	0487	1.697	0494	6.065	0501	23.351	0508	0	1515	29.417

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	129	0522	85	0529	29	0536	0	0543	113	0550	9.642	0557	0	0564	9.756	0571	24.481	0578	24.481	0584	39,85
De 1 a 3 meses	0516	16	0523	23	0530	7	0537	0	0544	30	0551	1.296	0558	0	0565	1.326	0572	3.460	0579	3.460	0585	38,31
De 3 a 6 meses	0517	7	0524	17	0531	7	0538	3	0545	27	0552	820	0559	0	0566	847	0573	1.470	0580	1.470	0586	57,62
De 6 a 9 meses	0518	8	0525	42	0532	5	0539	8	0546	55	0553	685	0560	0	0567	740	0574	1.519	0581	1.519	0587	48,71
De 9 a 12 meses	0519	10	0526	61	0533	10	0540	16	0547	86	0554	840	0561	0	0568	926	0575	1.766	0582	1.766	0588	52,43
Más de 12 meses	0520	100	0527	3.979	0534	104	0541	1.671	0548	5.754	0555	10.069	0562	0	0569	15.823	0576	20.510	0583	20.510	0589	77,15
Total	0521	270	0528	4.207	0535	161	0542	1.697	0549	6.065	0556	23.351	0563	0	0570	29.417	0577	53.206			0590	55,29

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: 30/06/2026
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	473	1600	359	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	2.115	1601	1.473	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	5.594	1602	4.851	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	7.267	1603	7.040	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	5.585	1604	8.583	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	145.751	1605	126.198	2605	241
Superior a 10 años	0606	54.139	1606	91.668	2606	1.799.759
Total	0607	220.925	1607	240.172	2607	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	10,35	1608	10,77	2608	27,35

Antigüedad	Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	20,97	1609	20,48	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: 30/06/2026	
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2026				Situación cierre anual anterior 31/12/2025				Situación inicial 05/12/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.563	0630	67.809	1620	1.566	1630	68.860	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.030	0631	111.901	1621	1.130	1631	124.817	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	205	0632	34.409	1622	198	1632	32.342	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	35	0633	6.806	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	2.833	0638	220.925	1628	2.968	1638	240.172	2628	9.884	2638	1.800.000
Media ponderada (%)	0639	48,47	0649		1639	49,63	1649		2639	94,44	2649	

	S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,13	1650	3,36	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,75	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: 30/06/2026	
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2026				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	108	0683	5.459	1660	116	1683	5.936	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	47	0684	2.575	1661	49	1684	2.748	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	25	0685	1.319	1662	25	1685	1.397	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	24	0686	1.433	1663	25	1686	1.529	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	20	0687	920	1664	21	1687	1.007	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	47	0688	2.039	1665	49	1688	2.159	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	67	0689	2.981	1666	72	1689	3.274	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	105	0690	6.362	1667	108	1690	6.925	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	282	0691	25.070	1668	290	1691	27.133	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	10	0692	202	1669	10	1692	220	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	12	0693	494	1670	12	1693	518	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	65	0694	3.429	1671	67	1694	3.771	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	1.825	0695	157.724	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	243	1674	7	1697	258	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	12	0698	857	1675	12	1698	895	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	11	0699	723	1676	11	1699	757	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	110	0700	4.717	1677	116	1700	4.988	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	56	0701	4.380	1678	58	1701	4.694	2678	162	2701	31.874
Total España	0679	2.833	0702	220.925	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	2.833	0705	220.925	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: 30/06/2026	
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2026				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	1,39			1710	1,29			2710	0,37		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

S.05.2									
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA									
Denominación del compartimento:									
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.									
Estados agregados: NO									
Periodo de la declaración: 30/06/2026									
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF									

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2026				Situación cierre anual anterior 31/12/2025				Situación inicial 05/12/2006						
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Principal pendiente		Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Principal pendiente		Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Principal pendiente	
		0720		0721	0722		1720		1721	1722		2720		2721	2722	
ES0359092006	SERIE A1	4.140		0	0		4.140		0	0		4.140		100.000	414.000	
ES0359092014	SERIE A2	9.360		0	0		9.360		0	0		9.360		100.000	936.000	
ES0359092022	SERIE A3	2.700		9.502	25.656		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	205.656	1723	18.000		1724	223.430	2723	18.000		2724	1.800.000

S.05.2											
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA											
Denominación del compartimento:											
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.											
Estados agregados: NO											
Periodo de la declaración: 30/06/2026											
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF											

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados		Intereses impagados		Serie devenga Intereses en el periodo		Principal no vencido					Principal impagado	
		0730												0731	0732	0733		
ES0359092006	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	0		0		NO		0		0		0		
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	0		0		NO		0		0		0		
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	2,37	66		0		NO		25.656		0		25.721		
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	2,43	166		0		NO		63.000		0		63.166		
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	2,48	181		0		NO		67.500		0		67.681		
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	2,68	89		0		NO		30.600		0		30.689		
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	4,18	86		0		NO		18.900		0		18.986		
Total						0740	588	0741	0		0743	205.656	0744	0	0745	206.243	0746	

	Situación actual 30/06/2026		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	2,50	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: 30/06/2026		
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF		

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2026								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2025							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750		0751		0752		0753		1750		1751		1752		1753	
ES0359092006	SERIE A1	0		414.000		0		23.408		0		414.000		0		23.408	
ES0359092014	SERIE A2	0		936.000		0		125.437		0		936.000		0		125.437	
ES0359092022	SERIE A3	9.521		244.344		190		56.172		11.047		205.064		500		55.054	
ES0359092030	SERIE B	0		0		350		17.508		0		0		424		16.043	
ES0359092048	SERIE C	0		0		383		19.220		0		0		462		17.617	
ES0359092055	SERIE D	0		0		189		9.763		0		0		224		8.974	
ES0359092063	SERIE E	0		0		186		11.605		0		0		207		10.830	
Total		0754	9.521	0755	1.594.344	0756	1.299	0757	263.113	1754	11.047	1755	1.555.064	1756	1.818	1757	257.363

	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: 30/06/2026	
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 30/06/2026	Situación cierre anual anterior 31/12/2025	Situación inicial 05/12/2006
		0760	0761	0762	0763	0764
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092014	SERIE A2	29/09/2021	FCH	A+	A+	AAA
ES0359092014	SERIE A2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	04/05/2018	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092022	SERIE A3	25/05/2026	FCH	AAA	AA+	AAA
ES0359092022	SERIE A3	12/12/2025	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	01/06/2022	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092030	SERIE B	25/05/2026	FCH	AAA	AA+	AA
ES0359092030	SERIE B	12/12/2025	MDY	Aaa	Aaa	Aa1
ES0359092030	SERIE B	26/02/2026	SYP	AAA	AA+	AA
ES0359092048	SERIE C	25/05/2026	FCH	AAA	AA+	A
ES0359092048	SERIE C	12/12/2025	MDY	Aaa	Aaa	A1
ES0359092048	SERIE C	03/12/2024	SYP	AA+	AA+	A
ES0359092055	SERIE D	25/05/2026	FCH	A+	A	BBB
ES0359092055	SERIE D	12/12/2025	MDY	Aa1	Aa1	Baa2
ES0359092055	SERIE D	26/02/2026	SYP	AA	A	BBB
ES0359092063	SERIE E	25/05/2026	FCH	A	BBB+	BB+
ES0359092063	SERIE E	12/12/2025	MDY	Ba1	Ba1	Ba1
ES0359092063	SERIE E	03/12/2024	SYP	B+	B+	BB

	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: 30/06/2026	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	21.450	1765	20.825	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	20.192	1766	20.828	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	19.824	1767	20.941	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	18.947	1768	20.188	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	125.242	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	205.656	1772	223.430	2772	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	8,15	1773	8,65	2773	25,20

	S.05.3
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo		Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006	
1	Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	20.709	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	10,07	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	12,47	1792	19,43	2792	90,00
5	Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1	Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2	Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3	Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3									
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA									
Denominación del compartimento:									
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.									
Estados agregados: NO									
Fecha: 30/06/2026									

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS			Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)						Otras características
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006		
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806		1806		2806		
Swap de Bases	BANCO SANTANDER	TRIMESTRAL	Media de los Euribor 12M en cada Fecha de Referencia	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	Tipo de Referencia de los Bonos - 0,055%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	-1.059		-1.059				
Total							0808	-1.059	0809	-1.059	0810		

S.05.3

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2026

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
Naturaleza riesgo cubierto	Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 05/12/2006		Situación actual 30/06/2026		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	

S.05.4															
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA															
Denominación del compartimento:															
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.															
Estados agregados: NO															
Fecha: 30/06/2026															

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

					Importe impagado acumulado				Ratio						Ref. Folleto	
Concepto	Meses impago		Días impago		Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación actual 30/06/2026		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	449	7006	982	7009	0,23	7012	0,45	7015	0,18		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	449	7008	982	7011	0,23	7014	0,45	7017	0,18	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	54.165	7024	55.880	7027	21,41	7030	20,39	7033	21,11		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	426	7025	426	7028	0,17	7031	0,16	7034	0,16		
Total Fallidos					7023	54.592	7026	56.307	7029	21,57	7032	20,54	7035	21,28	7036	Glosario de Términos

	Ratio						Ref. Folleto	
Otras ratios relevantes	Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Última Fecha Pago			
	0850		1850		2850		3850	
	0851		1851		2851		3851	
	0852		1852		2852		3852	
	0853		1853		2853		3853	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2026

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 B - ES0359092030	2,00	0,23	0,22	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	30,63	29,28	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	9,19	8,78	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	14,88	14,22	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	17,76	18,21	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	7,50	32,82	31,37	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	1,75	0,23	0,22	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	1,25	0,23	0,22	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359092006	25,00	6,74	6,78	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,23	0,22	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	6,74	6,78	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	10,00	17,76	18,21	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	6,74	6,78	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	10,00	17,76	18,21	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	10,00	17,76	18,21	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE B - ES0359092030	18,30	6,74	6,78	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE E - ES0359092063	8,00	6,74	6,78	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE C - ES0359092048	13,20	6,74	6,78	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE D - ES0359092055	9,40	6,74	6,78	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		10,07	9,21	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

S.05.5																
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA																
Denominación del compartimento:																
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.																
Estados agregados: NO																
Fecha: 30/06/2026																

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: 30/06/2026	

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	Multicedente
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo Adicional 3.4.6.4

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

	S.05.5
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

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

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
