MADRID RMBS II - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 22/08/22 - 22/11/22

	Euros
I. Situación al 22/08/22:	**8.507.799,15**
Saldo Inicial Cuenta Tesorería	8.507.799,15
II. Fondos recibidos del emisor	**13.655.047,39**
Principal:	
Según calendario hasta 31/10/22:	6.873.292,53
Amort. Anticipada hasta 31/10/22:	5.601.819,18
Intereses:	1.179.935,68
Ingresos por inmuebles:	0,00
III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):	**22.162.846,54**
IV. Total intereses de la reinversión:	**4.257,03**
Intereses de la Cta. De Tesoreria	4.257,03
V. Recursos disponibles (III + IV):	**22.167.103,57**
VI. Gastos:	**57.620,54**
VII. Liquidación SWAP:	**54.351,38**
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	300.041,38
Cantidad a Pagar por la Parte A (Caixabank):	354.392,76
VIII. Pago a los Bonos:	**13.440.054,42**
Bonos A3 :	
Intereses correspondientes al 22/11/22:	336.825,00
Retenciones practicadas a los bonos:	63.996,75
Amortización correspondiente al 22/11/22:	12.695.670,00
Bonos B:	
Intereses correspondientes al 22/11/22:	103.200,30
Retenciones practicadas a los bonos:	19.608,06
Amortización correspondiente al 22/11/22:	0,00
Bonos C:	
Intereses correspondientes al 22/11/22:	119.198,25
Retenciones practicadas a los bonos:	22.647,67
Amortización correspondiente al 22/11/22:	0,00
Bonos D:	
Intereses correspondientes al 22/11/22:	69.676,20
Retenciones practicadas a los bonos:	13.238,48
Amortización correspondiente al 22/11/22:	0,00
Bonos E:	
Intereses correspondientes al 22/11/22:	115.484,67
Retenciones practicadas a los bonos:	21.942,09
Amortización correspondiente al 22/11/22:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones:	-141.433,05
IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII):	**8.723.779,99**
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva previo (22/08/22):	8.507.799,15
Aportación al Fondo de Reserva	215.980,84
Intereses préstamo subordinado Desfase pagados	0,00
Intereses préstamo subordinado G.I. pagados	0,00
Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada	0,00
Amortización préstamo subordinado Desfase	0,00
Amortización préstamo subordinado G.I.	0,00
Amortización Préstamo Participativo	0,00
Remuneración Variable Prést.Participativo	**0,00**
Fondo de Reserva (22/11/22):	**8.723.779,99**

Destinatarios: CNMV, AIAF

Nº: 4288/22

Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.:917020808

MADRID RMBS II

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 22 de Noviembre de 2022

Importes en euros

I. BONOS A3 ES0359092022	Sobre 2700 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/12/06):	270.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	226.860.642,00 €	84.022,46 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	336.825,00 €	124,75 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	12.695.670,00 €	4.702,10 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	214.164.972,00 €	79.320,36 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	79,320360%	79,320360%

II. BONOS B ES0359092030	Sobre 630 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/12/06):	63.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	63.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	103.200,30 €	163,81 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	63.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

III. BONOS C ES0359092048	Sobre 675 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/12/06):	67.500.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	67.500.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	119.198,25 €	176,59 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	67.500.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

IV. BONOS D ES0359092055	Sobre 306 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/12/06):	30.600.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	30.600.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	69.676,20 €	227,70 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	30.600.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

V. BONOS E ES0359092063	Sobre 189 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/12/06):	18.900.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	18.900.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	115.484,67 €	611,03 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	18.900.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

VI. EL FONDO	Importes en euros
1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/10/22:	
a) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias No Fallidas:	394.164.966,75 €
b) Saldo pendiente de vencimiento de las participaciones hipotecarias Fallidas:	58.698.851,54 €
c) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias No Fallidas:	394.290.268,68 €
d) Saldo pendiente de cobro de las participaciones hipotecarias Fallidas:	128.479.817,67 €
2. Amortización del período 31/07/22 a 31/10/22:	12.475.111,71 €
a) Según calendario:	6.873.292,53 €
b) Amortización anticipada hasta 31/10/22:	5.601.819,18 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):	
a) Ultimo año:	4,51%
b) Ultimo semestre:	5,33%
c) Ultimo trimestre:	5,39%
4. Porcentaje de fallidos (1):	24,58%
5. Nivel de Impago(2):	0,36%

(1) Saldo pendiente de las participaciones hipotecarias fallidas según definición del Folleto de Emisión (retraso de 6 meses y otras causas), sobre el saldo pendiente total.

(2) Importe de principal de las Participaciones Hipotecarias con morosidad superior a 90 días en la Fecha de Cobro inmediata anterior a la Fecha de Pago en curso, sobre el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias.

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF; Agencia de Calificación.

Nº: 4289/22

Titulización de Activos, (SGFT),S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.:917020808
http:\\www.tda-sgft.com
MADRID RMBS II\Infoinver.trim\Nov22

TdA Titulización de Activos

MADRID RMBS II , FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL PERÍODO: 22/08/22-22/11/22

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO	
Fecha de Constitución del Fondo	12 de diciembre de 2006
Fecha Emisión BTH	12 de diciembre de 2006
Fecha Final Amortización BTH (3,83% TAA)	22 de febrero de 2033
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca	Caixabank (Bankia)
Agente de Pagos	Société Générale, Sucursal en España
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Moody's Investors Service/ Fitch Ibca/Standard & Poor´s
Calificación	Bonos A3: A+(sf) (F)/ Aa1(sf) (M)/ AAA(sf) (S&P) Bonos B: A(sf) (F)/Aa1(sf) (M)/ AA+(sf) (S&P) Bonos C: BB(sf) (F)/ Baa1(sf) (M)/ AA(sf) (S&P) Bonos D: B-(sf) (F)/ Caa1(sf) (M)/ BB+(sf) (S&P) Bonos E: CC(sf) (F)/ C(sf) (M)/ CCC-(sf) (S&P)

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)	
Nombre	**Bonos de Titulización MADRID RMBS II**
Serie A3:	
Código ISIN	ES0359092022
Nominal en circulación total (inicial)	270.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	214.164.972,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	79.320,36 Euros
Serie B:	
Código ISIN	ES0359092030
Nominal en circulación total (inicial)	63.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	63.000.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie C:	
Código ISIN	ES0359092048
Nominal en circulación total (inicial)	67.500.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	67.500.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie D:	
Código ISIN	ES0359092055
Nominal en circulación total (inicial)	30.600.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	30.600.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie E:	
Código ISIN	ES0359092063
Nominal en circulación total (inicial)	18.900.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	18.900.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA
* Liquidación del Período:22/08/22-22/11/22
* Flujos de Caja del Período:22/08/22-22/11/22
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 22 de Noviembre de 2022

MADRID RMBS II

Fondo de Titulización de Activos

FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/08/22 - 22/11/22

	Euros	
I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Ingresos	Pagos
Amortización Bonos Titulización Hip.		12.695.670,00
Amortización Participaciones Hip.	12.475.111,71	
Amortización Ptmos. Subordinados		0,00
Ingresos por inmuebles	0,00	
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH		744.384,42
Intereses recibidos de las PHs	1.179.935,68	
Intereses Ptmos. Subordinados		0,00
Intereses Inversiones Temporales	4.257,03	
III. GASTOS		
Comisiones y gastos periódicos:		57.620,54
Neto SWAP a favor de la Parte B (Fondo)	54.351,38	
Remuneración Variable Préstamo Participativo		0,00
Total Ingresos/Pagos	13.713.655,80	13.497.674,96
Saldo inicial 22/08/22	8.507.799,15	
A Inversiones Temporales		8.723.779,99
Total	22.221.454,95	22.221.454,95
Retenciones practicadas el 22/11/22	141.433,05	
A Inversiones Temporales		141.433,05

Destinatarios: CNMV; AIAF.

Nº: 4294/22

Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.:917020808
http:\\www.tda-sgft.com
MADRID RMBS II\fluj.trim\Nov22