

**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: 30/06/2024

**II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA**

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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	279.906	1001	308.002
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	279.906	1002	308.002
1. Activos titulizados	0003	279.906	1003	308.002
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	262.884	1005	292.021
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	17.073	1025	16.032
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-50	1027	-50
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
<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0039	0	1039	0
<b>III. Otros activos no corrientes</b>	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: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	67.213	1041	79.365
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042	13.216	1042	13.573
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	29.286	1043	29.588
1. Activos titulizados	0044	29.217	1044	29.512
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	23.384	1046	24.041
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	525	1065	627
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	97	1066	103
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	5.663	1067	5.230
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	189	1068	153
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-641	1069	-641
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	68	1074	76
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	68	1079	76
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
<b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b>	0085	24.711	1085	36.204
1. Tesorería	0086	24.711	1086	36.204
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	347.119	1088	387.367

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: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	276.324	1089	308.479
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	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
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0094	276.324	1094	308.479
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	262.556	1095	293.514
1.1 Series no subordinadas	0096	82.556	1096	113.514
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	12.182	1101	13.380
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	-56.758	1105	-55.561
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	1.585	1108	1.585
3.1 Derivados de cobertura	0109	1.585	1109	1.585
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
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	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: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	72.107	1117	80.033
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0118	0	1118	0
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	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
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	0123	65.346	1123	73.561
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	30.374	1124	30.783
1.1 Series no subordinadas	0125	29.047	1125	29.271
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	1.327	1128	1.511
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	34.574	1131	32.510
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	435	1136	445
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	34.139	1137	32.065
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	399	1139	399
3.1 Derivados de cobertura	0140	399	1140	399
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	9.870
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	9.870
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	0148	6.761	1148	6.471
1. Comisiones	0149	12	1149	13
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	10	1150	11
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	1152	2
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	6.748	1157	6.459
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158	-1.312	1158	-1.144
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159	0	1159	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	-1.312	1160	-1.144
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161	0	1161	0
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	347.119	1162	387.367

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: 30/06/2024

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2024		Acumulado anterior 30/06/2023
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	3.768	1201	4.002	2201	7.903	3201	7.194
1.1 Activos titulizados	0202	3.512	1202	3.802	2202	7.378	3202	6.856
1.2 Otros activos financieros	0203	256	1203	200	2203	525	3203	338
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-4.263	1204	-3.948	2204	-8.749	3204	-7.074
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-3.236	1205	-3.082	2205	-6.685	3205	-5.491
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1.027	1206	-865	2206	-2.064	3206	-1.583
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0208	65	1208	-178	2208	-1	3208	-212
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	-430	1209	-124	2209	-847	3209	-92
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	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
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0216	0	1216	200	2216	0	3216	0
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0217	-240	1217	-504	2217	-465	3217	-547
7.1 Servicios exteriores	0218	-212	1218	-472	2218	-406	3218	-482
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-212	1219	-472	2219	-406	3219	-482
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	-29	1224	-32	2224	-58	3224	-64
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-24	1225	-26	2225	-49	3225	-53
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-5	1227	-5	2227	-9	3227	-11
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
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0231	-83	1231	-5	2231	-83	3231	-286
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-83	1232	-5	2232	-83	3232	-286
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	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
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0238	33	1238	170	2238	197	3238	714
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0239	720	1239	264	2239	1.197	3239	211
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2024		Acumulado anterior 30/06/2023
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	445	1300	1.076	2300	884	3300	2.238
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	474	1301	1.108	2301	942	3301	2.303
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	3.568	1302	3.636	2302	7.448	3302	6.517
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-3.304	1303	-2.793	2303	-6.869	3303	-4.959
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	68	2304	0	3304	432
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-53	1305	0	2305	-170	3305	0
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	263	1306	197	2306	533	3306	314
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
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	0309	-29	1309	-32	2309	-59	3309	-65
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-24	1310	-27	2310	-49	3310	-54
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	-6	2312	-9	3312	-11
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>	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>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>	0322	-11.523	1322	139	2322	-12.376	3322	-2.641
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b>	0325	-838	1325	1.366	2325	-2.094	3325	4.356
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	5.060	1326	5.981	2326	10.619	3326	11.799
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	7.696	1327	12.612	2327	16.229	3327	23.675
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.213	1328	777	2328	1.687	3328	2.079
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	82	1330	591	2330	554	3330	1.655
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-14.890	1331	-18.594	2331	-31.182	3331	-34.852
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	0332	-10.685	1332	-1.227	2332	-10.283	3332	-6.997
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	-10.685	1336	-1.227	2336	-10.283	3336	-6.997
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	0337	-11.077	1337	1.215	2337	-11.493	3337	-402
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	35.789	1338	42.758	2338	36.204	3338	44.376
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	24.711	1339	43.973	2339	24.711	3339	43.973

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2024		Acumulado anterior 30/06/2023
<b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>								
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
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>0356</b>	<b>0</b>	<b>1356</b>	<b>0</b>	<b>2356</b>	<b>0</b>	<b>3356</b>	<b>0</b>
<b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-53	1357	68	2357	-170	3357	432
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-53	1358	68	2358	-170	3358	432
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	-65	1360	178	2360	1	3360	212
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	118	1362	-247	2362	168	3362	-644
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>0363</b>	<b>0</b>	<b>1363</b>	<b>0</b>	<b>2363</b>	<b>0</b>	<b>3363</b>	<b>0</b>
<b>3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>								
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
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>0369</b>	<b>0</b>	<b>1369</b>	<b>0</b>	<b>2369</b>	<b>0</b>	<b>3369</b>	<b>0</b>
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>0370</b>	<b>0</b>	<b>1370</b>	<b>0</b>	<b>2370</b>	<b>0</b>	<b>3370</b>	<b>0</b>



Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2024								Situación cierre anual anterior 31/12/2023								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	7,36	0401	23,21	0421	0,00	0441	10,19	1381	6,30	1401	21,65	1421	0,00	1441	11,16	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	17,00
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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	137	0467	79	0474	44	0481	0	0488	123	0495	11.799	0502	0	0509	11.923
De 1 a 3 meses	0461	45	0468	71	0475	53	0482	0	0489	123	0496	5.619	0503	0	0510	5.743
De 3 a 6 meses	0462	28	0469	74	0476	34	0483	22	0490	130	0497	3.034	0504	0	0511	3.164
De 6 a 9 meses	0463	19	0470	81	0477	32	0484	36	0491	150	0498	2.366	0505	0	0512	2.516
De 9 a 12 meses	0464	17	0471	121	0478	21	0485	54	0492	196	0499	1.654	0506	0	0513	1.850
Más de 12 meses	0465	102	0472	3.940	0479	101	0486	1.502	0493	5.543	0500	11.465	0507	0	0514	17.008
<b>Total</b>	0466	<b>348</b>	0473	<b>4.365</b>	0480	<b>286</b>	0487	<b>1.614</b>	0494	<b>6.265</b>	0501	<b>35.938</b>	0508	<b>0</b>	1515	<b>42.204</b>

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	137	0522	79	0529	44	0536	0	0543	123	0550	11.799	0557	0	0564	11.923	0571	25.707	0578	25.707	0584	46,38
De 1 a 3 meses	0516	45	0523	71	0530	53	0537	0	0544	123	0551	5.619	0558	0	0565	5.743	0572	10.206	0579	10.206	0585	56,27
De 3 a 6 meses	0517	28	0524	74	0531	34	0538	22	0545	130	0552	3.034	0559	0	0566	3.164	0573	5.625	0580	5.625	0586	56,25
De 6 a 9 meses	0518	19	0525	81	0532	32	0539	36	0546	150	0553	2.366	0560	0	0567	2.516	0574	4.327	0581	4.327	0587	58,15
De 9 a 12 meses	0519	17	0526	121	0533	21	0540	54	0547	196	0554	1.654	0561	0	0568	1.850	0575	3.449	0582	3.449	0588	53,63
Más de 12 meses	0520	102	0527	3.940	0534	101	0541	1.502	0548	5.543	0555	11.465	0562	0	0569	17.008	0576	21.450	0583	21.450	0589	79,29
<b>Total</b>	0521	<b>348</b>	0528	<b>4.365</b>	0535	<b>286</b>	0542	<b>1.614</b>	0549	<b>6.265</b>	0556	<b>35.938</b>	0563	<b>0</b>	0570	<b>42.204</b>	0577	<b>70.765</b>			0590	<b>59,64</b>

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: 30/06/2024

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 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	552	1600	529	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	847	1601	730	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.521	1602	1.324	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	5.315	1603	3.655	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	10.153	1604	8.895	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	50.692	1605	49.204	2605	241
Superior a 10 años	0606	239.923	1606	272.987	2606	1.799.759
<b>Total</b>	0607	<b>309.003</b>	1607	<b>337.324</b>	2607	<b>1.800.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	0608	<b>11,95</b>	1608	<b>12,29</b>	2608	<b>27,35</b>

Antigüedad	Situación actual 30/06/2024					
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	19,01	1609	18,52	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: 30/06/2024

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 30/06/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				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	1.398	0630	62.153	1620	1.332	1630	59.281	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.301	0631	138.422	1621	1.269	1631	130.795	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	586	0632	83.954	1622	851	1632	119.659	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	122	0633	24.474	1623	137	1633	27.589	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
<b>Total</b>	0628	<b>3.407</b>	0638	<b>309.003</b>	1628	<b>3.589</b>	1638	<b>337.324</b>	2628	<b>9.884</b>	2638	<b>1.800.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>	0639	<b>53,74</b>	0649		1639	<b>55,02</b>	1649		2639	<b>94,44</b>	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: 30/06/2024**

**Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK**

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	4,78	1650	4,14	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,02	1651	6,16	2651	6,00
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,75	1652	1,90	2652	2,70

<b>S.05.1</b>
<b>Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/06/2024</b>
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK</b>

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO F**

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				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	134	0683	8.067	1660	146	1683	9.416	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	59	0684	3.864	1661	60	1684	4.155	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	30	0685	1.948	1662	30	1685	2.030	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	27	0686	1.982	1663	27	1686	2.061	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	21	0687	1.204	1664	21	1687	1.258	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	54	0688	2.922	1665	58	1688	3.237	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	88	0689	4.648	1666	92	1689	5.004	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	142	0690	9.984	1667	152	1690	11.017	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	348	0691	36.099	1668	370	1691	39.913	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	16	0692	389	1669	18	1692	421	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	16	0693	718	1670	16	1693	754	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	70	0694	4.570	1671	73	1694	4.998	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	2.160	0695	217.132	1672	2.271	1695	235.971	2672	6.243	2695	1.238.324
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	10	0697	591	1674	9	1697	615	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	12	0698	1.004	1675	14	1698	1.297	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	12	0699	962	1676	12	1699	996	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	137	0700	6.657	1677	146	1700	7.281	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	71	0701	6.262	1678	74	1701	6.902	2678	162	2701	31.874
<b>Total España</b>	0679	<b>3.407</b>	0702	<b>309.003</b>	1679	<b>3.589</b>	1702	<b>337.324</b>	2679	<b>9.884</b>	2702	<b>1.800.000</b>
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
<b>Total general</b>	0682	<b>3.407</b>	0705	<b>309.003</b>	1682	<b>3.589</b>	1705	<b>337.324</b>	2682	<b>9.884</b>	2705	<b>1.800.000</b>

<b>S.05.1</b>
<b>Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/06/2024</b>
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK</b>

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 30/06/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 05/12/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,10			1710	1,03			2710	0,37		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

**Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA**

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Periodo de la declaración: 30/06/2024**

**Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF**

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO A**

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2024			Situación cierre anual anterior 31/12/2023			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	41.334	111.603	2.700	52.883	142.785	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			
<b>Total</b>		0723	18.000	0724	291.603	1723	18.000	1724	322.785	2723	18.000	2724	1.800.000



Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2024

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		0738	0739		
						0730	0731			0732	0733	0734	0735			0742	0736
ES0359092006	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	0	0	0	NO	0	0	0	0	0	0		
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	0	0	0	NO	0	0	0	0	0	0		
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	4,01	485	0	0	NO	111.603	0	0	112.088	0	0		
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	4,07	278	0	0	NO	63.000	0	0	63.278	0	0		
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	4,12	301	0	0	NO	67.500	0	0	67.801	0	0		
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	4,32	143	0	0	NO	30.600	0	0	30.743	0	0		
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	5,82	119	0	0	NO	18.900	0	0	19.019	0	0		
<b>Total</b>						0740	1.327	0741	0	0743	291.603	0744	0	0745	292.930	0746	0

	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	4,20	0748	3,58	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: 30/06/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO C**

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2024								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2023							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0359092006	SERIE A1	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408	0	414.000	0	23.408	0	23.408		
ES0359092014	SERIE A2	0	936.000	0	125.437	0	936.000	0	125.437	0	936.000	0	125.437	0	125.437		
ES0359092022	SERIE A3	14.890	158.397	1.307	51.748	18.594	90.687	1.391	45.649	18.594	90.687	1.391	45.649	1.391	45.649		
ES0359092030	SERIE B	0	0	660	13.819	0	0	452	11.241	0	0	452	11.241	452	11.241		
ES0359092048	SERIE C	0	0	716	15.200	0	0	493	12.403	0	0	493	12.403	493	12.403		
ES0359092055	SERIE D	0	0	340	7.816	0	0	239	6.486	0	0	239	6.486	239	6.486		
ES0359092063	SERIE E	0	0	281	9.828	0	0	217	8.718	0	0	217	8.718	217	8.718		
<b>Total</b>		0754	14.890	0755	1.508.397	0756	3.304	0757	247.256	1754	18.594	1755	1.440.687	1756	2.793	1757	233.342

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: 30/06/2024

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 30/06/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	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+	A+	AAA
ES0359092022	SERIE A3	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	01/06/2022	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092030	SERIE B	13/03/2024	FCH	AA	A+	AA
ES0359092030	SERIE B	22/06/2022	MDY	Aa1	Aa1	Aa1
ES0359092030	SERIE B	01/06/2022	SYP	AA+	AA+	AA
ES0359092048	SERIE C	13/03/2024	FCH	BBB-	BB+	A
ES0359092048	SERIE C	26/10/2023	MDY	A1	A1	A1
ES0359092048	SERIE C	01/06/2022	SYP	AA	AA	A
ES0359092055	SERIE D	13/03/2024	FCH	BB	B	BBB
ES0359092055	SERIE D	26/10/2023	MDY	B3	B3	Baa2
ES0359092055	SERIE D	01/06/2022	SYP	BB+	BB+	BBB
ES0359092063	SERIE E	18/03/2009	FCH	CC	CC	BB+
ES0359092063	SERIE E	11/09/2009	MDY	C	C	Ba1
ES0359092063	SERIE E	01/06/2022	SYP	CCC-	CCC-	BB

<b>S.05.2</b>
<b>Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Periodo de la declaración: 30/06/2024</b>
<b>Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF</b>

**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 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	23.507	1765	23.162	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	23.510	1766	24.243	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	22.718	1767	25.224	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	21.815	1768	25.263	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	136.334	1769	193.159	2769	41.891
Entre 5 y 10 años	0770	63.719	1770	31.733	2770	241.519
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	1.370.127
<b>Total</b>	<b>0772</b>	<b>291.603</b>	<b>1772</b>	<b>322.785</b>	<b>2772</b>	<b>1.800.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>0773</b>	<b>6,15</b>	<b>1773</b>	<b>6,65</b>	<b>2773</b>	<b>25,20</b>

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	12.235	1775	11.450	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	4,20	1777	3,55	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	38,26	1792	44,23	2792	90,00
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

**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 30/06/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	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	-1.984	-1.984		
<b>Total</b>							0808 -1.984	0809 -1.984	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO B**

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006		Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		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			
<b>Total</b>	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

**INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO**

**CUADRO A**

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	2.544	7006	3.043	7009	0,90	7012	0,97	7015	1,38		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	2.544	7008	3.043	7011	0,90	7014	0,97	7017	1,38	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	62.273	7024	61.088	7027	18,06	7030	16,33	7033	17,42		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	426	7025	426	7028	0,12	7031	0,11	7034	0,12		
Total Fallidos					7023	62.699	7026	61.515	7029	18,18	7032	16,44	7035	17,54	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853



Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

**INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO**

**CUADRO B**

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
<b>Amortización secuencial: series</b>	0854	0858	1858	2858
SERIE C - ES0359092048	1,75	0,90	1,38	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	22,79	23,28	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	7,11	7,07	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359092006	25,00	7,11	7,07	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	2,00	0,90	1,38	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	6,48	6,17	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	7,11	7,07	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	1,25	0,90	1,38	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	10,49	9,98	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	10,00	22,79	23,28	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	10,00	22,79	23,28	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	10,00	22,79	23,28	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	21,60	20,56	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,90	1,38	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	7,50	23,15	22,02	Nota de Valores 4.9.4
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series</b>	0855	0859	1859	2859
SERIE E - ES0359092063	8,00	7,12	7,07	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE B - ES0359092030	18,30	7,12	7,07	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE C - ES0359092048	13,20	7,12	7,07	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE D - ES0359092055	9,40	7,12	7,07	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
<b>No Reducción del Fondo de Reserva</b>	0856	0860	1860	2860
		4,20	3,89	3.4.2.2. Modulo Adicional
<b>OTROS TRIGGERS</b>	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

**CUADRO C**

**Informe cumplimiento reglas de funcionamiento**

Contiene



Información adicional  
en fichero adjunto

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

**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	11	2862	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,014	4862		5862		6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, S.E.	1864		2864	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3864	0,005	4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

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

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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
		22/02/2024	22/05/2024										
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885												
Saldo inicial	0886	11.450	11.921										
Cobros del periodo	0887	20.640	18.773										
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-195	-212										
Pagos por derivados	0889	-117	-53										
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-11.921	-12.235										
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-19.857	-18.194										
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0										
Resto pagos/retenciones	0893	0	0										
Saldo disponible	0894	0	0										
Liquidación de comisión variable	0895	0	0										0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

**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**