

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: 30/09/2023

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: 30/09/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	323.330	1001	371.665
I. Activos financieros a largo plazo	0002	323.330	1002	371.665
1. Activos titulizados	0003	323.330	1003	371.665
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	307.784	1005	359.261
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	15.587	1025	12.444
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-40	1027	-40
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: 30/09/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	85.283	1041	95.199
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	14.280	1042	15.300
V. Activos financieros a corto plazo	0043	30.496	1043	35.523
1. Activos titulizados	0044	30.239	1044	35.294
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	24.930	1046	30.602
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	620	1065	320
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	97	1066	44
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	5.178	1067	4.971
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	132	1068	75
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-717	1069	-717
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	186	1071	186
2.1 Derivados de cobertura	0072	186	1072	186
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	71	1074	43
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	71	1079	43
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	40.507	1085	44.376
1. Tesorería	0086	40.507	1086	44.376
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	408.613	1088	466.865

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: 30/09/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	327.127	1089	376.419
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	327.127	1094	376.419
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	310.090	1095	358.592
1.1 Series no subordinadas	0096	130.090	1096	178.592
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	13.560	1101	14.350
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	-55.381	1105	-54.591
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108	3.477	1108	3.477
3.1 Derivados de cobertura	0109	3.477	1109	3.477
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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) PASIVO CORRIENTE	0117	84.006	1117	93.693
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	77.327	1123	86.991
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	31.643	1124	36.491
1.1 Series no subordinadas	0125	30.107	1125	35.573
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	1.536	1128	918
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	31.474	1131	28.911
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	434	1136	285
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	31.040	1137	28.625
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	0	1139	0
3.1 Derivados de cobertura	0140	0	1140	0
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	14.210	1143	21.590
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	14.210	1146	21.590
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	6.678	1148	6.702
1. Comisiones	0149	13	1149	14
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	11	1150	12
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	6.665	1157	6.688
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-2.520	1158	-3.247
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-2.520	1160	-3.247
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	408.613	1162	466.865

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	4.254	1201	1.024	2201	11.448	3201	2.138
1.1 Activos titulizados	0202	3.992	1202	1.024	2202	10.848	3202	2.138
1.2 Otros activos financieros	0203	262	1203	0	2203	601	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-4.488	1204	-724	2204	-11.561	3204	-1.420
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-3.507	1205	-368	2205	-8.998	3205	-516
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-981	1206	-346	2206	-2.564	3206	-866
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	-9	2207	0	3207	-39
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-83	1208	-132	2208	-296	3208	-389
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-317	1209	169	2209	-409	3209	329
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	-212	1217	-36	2217	-759	3217	-406
7.1 Servicios exteriores	0218	-181	1218	-3	2218	-664	3218	-304
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-181	1219	-3	2219	-664	3219	-304
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	-31	1224	-34	2224	-95	3224	-102
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-26	1225	-27	2225	-79	3225	-83
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-5	1227	-6	2227	-16	3227	-18
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	-89	1231	-8	2231	-376	3231	-13
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-89	1232	-8	2232	-376	3232	-13
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	39	1238	45	2238	753	3238	55
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	579	1239	-169	2239	790	3239	35
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	727	1300	709	2300	2.965	3300	1.300
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	758	1301	742	2301	3.061	3301	1.402
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	3.920	1302	938	2302	10.437	3302	2.041
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-3.421	1303	-91	2303	-8.380	3303	-230
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	432	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	-87	2305	0	3305	-360
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	258	1306	0	2306	572	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	-18	2308	0	3308	-49
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-31	1309	-34	2309	-96	3309	-102
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-26	1310	-27	2310	-80	3310	-84
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	-6	2312	-17	3312	-19
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	-4.193	1322	-855	2322	-6.834	3322	7.126
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	-3.088	1325	-902	2325	1.268	3325	-415
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	5.276	1326	5.949	2326	17.075	3326	18.803
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	9.610	1327	5.659	2327	33.284	3327	15.053
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	993	1328	527	2328	3.073	3328	1.687
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	148	1330	137	2330	1.803	3330	208
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-19.115	1331	-13.175	2331	-53.968	3331	-36.166
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-1.105	1332	47	2332	-8.102	3332	7.540
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	50	2333	0	3333	7.600
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	-1.105	1336	-3	2336	-8.102	3336	-59
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-3.466	1337	-147	2337	-3.869	3337	8.425
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	43.973	1338	41.239	2338	44.376	3338	32.667
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	40.507	1339	41.092	2339	40.507	3339	41.092

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	0	1357	-87	2357	432	3357	-360
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	0	1358	-87	2358	432	3358	-360
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	83	1360	132	2360	296	3360	389
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	-84	1362	-45	2362	-728	3362	-29
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2023								Situación cierre anual anterior 31/12/2022								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	5,87	0401	20,81	0421	0,00	0441	10,35	1381	4,28	1401	18,53	1421	0,00	1441	5,34	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: 30/09/2023

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	144	0467	79	0474	51	0481	0	0488	130	0495	14.236	0502	0	0509	14.365
De 1 a 3 meses	0461	42	0468	70	0475	46	0482	0	0489	116	0496	5.060	0503	0	0510	5.176
De 3 a 6 meses	0462	26	0469	73	0476	38	0483	24	0490	135	0497	3.721	0504	0	0511	3.855
De 6 a 9 meses	0463	26	0470	125	0477	32	0484	60	0491	217	0498	3.745	0505	0	0512	3.963
De 9 a 12 meses	0464	8	0471	39	0478	4	0485	16	0492	59	0499	648	0506	0	0513	706
Más de 12 meses	0465	86	0472	3.693	0479	57	0486	1.183	0493	4.934	0500	8.721	0507	0	0514	13.655
Total	0466	332	0473	4.078	0480	229	0487	1.283	0494	5.590	0501	36.130	0508	0	1515	41.721

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	144	0522	79	0529	51	0536	0	0543	130	0550	14.236	0557	0	0564	14.365	0571	27.907	0578	27.907	0584	51,47
De 1 a 3 meses	0516	42	0523	70	0530	46	0537	0	0544	116	0551	5.060	0558	0	0565	5.176	0572	8.897	0579	8.897	0585	58,18
De 3 a 6 meses	0517	26	0524	73	0531	38	0538	24	0545	135	0552	3.721	0559	0	0566	3.855	0573	6.300	0580	6.300	0586	61,19
De 6 a 9 meses	0518	26	0525	125	0532	32	0539	60	0546	217	0553	3.745	0560	0	0567	3.963	0574	6.243	0581	6.243	0587	63,47
De 9 a 12 meses	0519	8	0526	39	0533	4	0540	16	0547	59	0554	648	0561	0	0568	706	0575	1.231	0582	1.231	0588	57,38
Más de 12 meses	0520	86	0527	3.693	0534	57	0541	1.183	0548	4.934	0555	8.721	0562	0	0569	13.655	0576	16.961	0583	16.961	0589	80,51
Total	0521	332	0528	4.078	0535	229	0542	1.283	0549	5.590	0556	36.130	0563	0	0570	41.721	0577	67.540			0590	61,77

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: 30/09/2023

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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	460	1600	448	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	660	1601	526	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.443	1602	1.195	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	2.405	1603	1.781	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	8.109	1604	4.801	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	50.682	1605	57.978	2605	241
Superior a 10 años	0606	289.718	1606	340.549	2606	1.799.759
Total	0607	353.477	1607	407.278	2607	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	12,49	1608	13,06	2608	27,35

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 05/12/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	18,28	1609	17,53	2609	1,72

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

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 30/09/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				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	1.273	0630	56.273	1620	1.144	1630	49.184	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.295	0631	132.202	1621	1.459	1631	148.430	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	972	0632	136.317	1622	1.245	1632	177.427	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	142	0633	28.685	1623	158	1633	32.237	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	3.682	0638	353.477	1628	4.006	1638	407.278	2628	9.884	2638	1.800.000
Media ponderada (%)	0639	55,73	0649		1639	57,78	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: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,38	1650	0,93	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,15	1651	4,63	2651	6,00
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,90	1652	0,25	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: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				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	152	0683	9.850	1660	173	1683	12.343	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	60	0684	4.244	1661	65	1684	4.744	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	31	0685	2.163	1662	36	1685	2.431	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	28	0686	2.268	1663	30	1686	2.700	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	23	0687	1.466	1664	25	1687	1.681	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	59	0688	3.334	1665	64	1688	3.857	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	93	0689	5.157	1666	97	1689	5.671	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	156	0690	11.694	1667	170	1690	13.819	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	377	0691	41.758	1668	430	1691	49.924	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	20	0692	438	1669	23	1692	496	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	18	0693	921	1670	22	1693	1.009	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	76	0694	5.347	1671	82	1694	5.997	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	2.327	0695	246.773	1672	2.506	1695	281.856	2672	6.243	2695	1.238.324
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	9	0697	627	1674	11	1697	773	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	14	0698	1.318	1675	16	1698	1.622	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	12	0699	1.015	1676	13	1699	1.095	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	152	0700	7.898	1677	161	1700	8.953	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	75	0701	7.205	1678	82	1701	8.308	2678	162	2701	31.874
Total España	0679	3.682	0702	353.477	1679	4.006	1702	407.278	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	3.682	0705	353.477	1682	4.006	1705	407.278	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: 30/09/2023
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 05/12/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,98			1710	0,94			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

Período de la declaración: 30/09/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			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	59.332	160.197	2.700	79.320	214.165	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	340.197	1723	18.000	1724	394.165	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: 30/09/2023

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		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
									0730	0731	0732	0733			0734	0735	0742
ES0359092006	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	4,01	695	0	NO	160.197	0	0	160.893	0	0			
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	4,07	278	0	NO	63.000	0	0	63.278	0	0			
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	4,12	301	0	NO	67.500	0	0	67.801	0	0			
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	4,32	143	0	NO	30.600	0	0	30.743	0	0			
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	5,82	119	0	NO	18.900	0	0	19.019	0	0			
Total						0740	1.536	0741	0	0743	340.197	0744	0	0745	341.733	0746	0

	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	2,92	0748	0,56	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: 30/09/2023
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2023								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2022							
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	19.115	109.803	1.637	47.286	13.175	43.139	0	42.820	0	42.820	0	42.820	0	42.820		
ES0359092030	SERIE B	0	0	585	11.826	0	0	0	10.352	0	0	0	10.352	0	10.352		
ES0359092048	SERIE C	0	0	635	13.039	0	0	0	11.425	0	0	0	11.425	0	11.425		
ES0359092055	SERIE D	0	0	304	6.790	0	0	12	5.997	0	0	12	5.997	0	5.997		
ES0359092063	SERIE E	0	0	260	8.978	0	0	79	8.201	0	0	79	8.201	0	8.201		
Total		0754	19.115	0755	1.459.803	0756	3.421	0757	236.764	1754	13.175	1755	1.393.139	1756	91	1757	227.639

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: 30/09/2023

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 30/09/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 05/12/2006
				0760	0761	0762
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092014	SERIE A2	29/09/2021	FCH	A+	A+	AAA
ES0359092014	SERIE A2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	04/05/2018	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092022	SERIE A3	29/09/2021	FCH	A+	A+	AAA
ES0359092022	SERIE A3	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	01/06/2022	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092030	SERIE B	27/03/2023	FCH	A+	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	27/03/2023	FCH	BB+	BB	A
ES0359092048	SERIE C	16/05/2023	MDY	A3	Baa1	A1
ES0359092048	SERIE C	01/06/2022	SYP	AA	AA	A
ES0359092055	SERIE D	27/03/2023	FCH	B	B-	BBB
ES0359092055	SERIE D	22/06/2022	MDY	Caa1	Caa1	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

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: 30/09/2023

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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	23.124	1765	26.465	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	24.075	1766	26.829	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	25.156	1767	28.097	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	26.170	1768	29.368	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	26.235	1769	29.960	2769	41.891
Entre 5 y 10 años	0770	215.437	1770	253.446	2770	241.519
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	1.370.127
Total	0772	340.197	1772	394.165	2772	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	6,90	1773	7,65	2773	25,20

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 05/12/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	12.421	1775	8.724	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	3,65	1777	2,21	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	47,08	1792	54,33	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: 30/09/2023

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 30/09/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	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	-3.291	-3.291		
Total							0808 -3.291	0809 -3.291	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 05/12/2006		Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 05/12/2006			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	3.268	7006	1.104	7009	0,99	7012	0,29	7015	1,06		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	3.268	7008	1.104	7011	0,99	7014	0,29	7017	1,06	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	62.232	7024	64.467	7027	15,87	7030	14,37	7033	15,22		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	598	7025	598	7028	0,15	7031	0,13	7034	0,15		
Total Fallidos					7023	62.829	7026	65.065	7029	16,02	7032	14,50	7035	15,37	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		
	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: 30/09/2023

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
SERIE C - ES0359092048	7,50	19,84	18,79	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,94	1,06	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	18,52	17,53	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	25,33	25,89	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	2,00	0,94	1,06	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	7,04	6,98	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	1,25	0,94	1,06	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	7,04	6,98	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	10,00	25,33	25,89	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	8,99	8,52	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	1,75	0,94	1,06	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	5,56	5,26	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	10,00	25,33	25,89	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	10,00	25,33	25,89	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359092006	25,00	7,04	6,98	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE B - ES0359092030	18,30	7,04	6,98	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE D - ES0359092055	9,40	7,04	6,98	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE E - ES0359092063	8,00	7,04	6,98	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE C - ES0359092048	13,20	7,04	6,98	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		3,65	3,23	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

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: 30/09/2023

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: 30/09/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo								Total	
		22/02/2023	22/05/2023	22/08/2023							
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885										
Saldo inicial	0886	8.724	10.354	11.607							
Cobros del periodo	0887	19.825	23.018	23.561							
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-135	-447	-210							
Pagos por derivados	0889	363	68	0							
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-10.354	-11.607	-12.421							
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-18.424	-21.387	-22.537							
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0							
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0							
Saldo disponible	0894	0	0	0							
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	0							0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

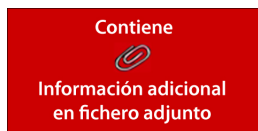
Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

INFORME SOBRE EL CUMPLIMIENTO DE LAS POLÍTICAS DE GESTIÓN DE ACTIVOS Y DE RIESGOS