

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8591
NIF Fondo: V84916956
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2024

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: 31/12/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2024		Periodo anterior 31/12/2023
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	257.623	1001	308.002
I. Activos financieros a largo plazo	0002	257.623	1002	308.002
1. Activos titulizados	0003	257.623	1003	308.002
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	241.807	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	15.855	1025	16.032
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-40	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
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	65.329	1041	79.365
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	12.934	1042	13.573
V. Activos financieros a corto plazo	0043	29.024	1043	29.588
1. Activos titulizados	0044	28.972	1044	29.512
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	23.338	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	422	1065	627
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	50	1066	103
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	5.621	1067	5.230
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	177	1068	153
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-636	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	52	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	52	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	
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	23.371	1085	36.204
1. Tesorería	0086	23.371	1086	36.204
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	322.952	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: 31/12/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2024		Periodo anterior 31/12/2023
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	249.705	1089	308.479
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	249.705	1094	308.479
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	238.120	1095	293.514
1.1 Series no subordinadas	0096	58.120	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	10.846	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	-58.095	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	739	1108	1.585
3.1 Derivados de cobertura	0109	739	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
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

S.01

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) PASIVO CORRIENTE	0117	73.946	1117	80.033
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	67.087	1123	73.561
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	29.941	1124	30.783
1.1 Series no subordinadas	0125	28.959	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	982	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	36.514	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	373	1136	445
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	36.141	1137	32.065
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	632	1139	399
3.1 Derivados de cobertura	0140	632	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
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	6.859	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	6.847	1157	6.459
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-698	1158	-1.144
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-698	1160	-1.144
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	322.952	1162	387.367

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2024

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2024		Acumulado anterior 31/12/2023
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	3.147	1201	4.322	2201	14.552	3201	15.770
1.1 Activos titulizados	0202	2.957	1202	4.051	2202	13.606	3202	14.898
1.2 Otros activos financieros	0203	190	1203	272	2203	946	3203	872
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-3.526	1204	-4.634	2204	-16.266	3204	-16.196
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-2.590	1205	-3.599	2205	-12.261	3205	-12.596
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-936	1206	-1.036	2206	-4.004	3206	-3.599
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-94	1208	-92	2208	-74	3208	-388
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-473	1209	-404	2209	-1.788	3209	-813
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	98	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-35	1217	-185	2217	-576	3217	-944
7.1 Servicios exteriores	0218	-2	1218	-149	2218	-456	3218	-812
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-2	1219	-149	2219	-456	3219	-812
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	-33	1224	-36	2224	-119	3224	-131
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-23	1225	-25	2225	-95	3225	-104
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-4	1227	-5	2227	-18	3227	-21
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	-6	1230	-6	2230	-6	3230	-6
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-250	1231	-162	2231	-482	3231	-538
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-250	1232	-162	2232	-482	3232	-538
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	75	1238	571	2238	312	3238	1.324
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	586	1239	180	2239	2.534	3239	970
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2024

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2024		Acumulado anterior 31/12/2023
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	348	1300	608	2300	1.663	3300	3.573
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	376	1301	638	2301	1.778	3301	3.699
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	3.073	1302	4.017	2302	13.840	3302	14.455
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-2.791	1303	-3.623	2303	-12.790	3303	-12.003
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	409
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-104	1305	-23	2305	-242	3305	0
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	198	1306	267	2306	970	3306	839
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-28	1309	-30	2309	-114	3309	-126
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-23	1310	-25	2310	-96	3310	-105
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-4	1312	-5	2312	-18	3312	-22
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	380	1322	-4.911	2322	-14.496	3322	-11.745
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	499	1325	-422	2325	-3.948	3325	846
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	5.189	1326	5.185	2326	21.143	3326	22.261
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	4.849	1327	9.662	2327	25.095	3327	42.946
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.388	1328	1.021	2328	4.619	3328	4.094
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	3	1329	0	2329	3	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	210	1330	1.123	2330	899	3330	2.926
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-11.140	1331	-17.413	2331	-55.706	3331	-71.380
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-119	1332	-4.489	2332	-10.548	3332	-12.591
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	-119	1336	-4.489	2336	-10.548	3336	-12.591
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	728	1337	-4.303	2337	-12.833	3337	-8.172
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	22.643	1338	40.507	2338	36.204	3338	44.376
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	23.371	1339	36.204	2339	23.371	3339	36.204

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2024

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2024		Acumulado anterior 31/12/2023
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	510	1357	1.284	2357	372	3357	1.716
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	510	1358	1.284	2358	372	3358	1.716
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359	0	3359	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	94	1360	92	2360	74	3360	388
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	-604	1362	-1.376	2362	-446	3362	-2.103
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2024								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	7,49	0401	24,66	0421	0,00	0441	7,92	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: 31/12/2024

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	115	0467	72	0474	34	0481	0	0488	106	0495	9.750	0502	0	0509	9.856
De 1 a 3 meses	0461	21	0468	30	0475	16	0482	0	0489	47	0496	2.158	0503	0	0510	2.205
De 3 a 6 meses	0462	22	0469	62	0476	26	0483	13	0490	100	0497	2.397	0504	0	0511	2.498
De 6 a 9 meses	0463	15	0470	54	0477	18	0484	25	0491	97	0498	1.538	0505	0	0512	1.636
De 9 a 12 meses	0464	17	0471	89	0478	25	0485	57	0492	171	0499	2.071	0506	0	0513	2.242
Más de 12 meses	0465	105	0472	4.017	0479	108	0486	1.630	0493	5.756	0500	11.246	0507	0	0514	17.002
Total	0466	295	0473	4.325	0480	227	0487	1.725	0494	6.277	0501	29.161	0508	0	1515	35.438

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	115	0522	72	0529	34	0536	0	0543	106	0550	9.750	0557	0	0564	9.856	0571	21.889	0578	21.889	0584	45,03
De 1 a 3 meses	0516	21	0523	30	0530	16	0537	0	0544	47	0551	2.158	0558	0	0565	2.205	0572	4.270	0579	4.270	0585	51,63
De 3 a 6 meses	0517	22	0524	62	0531	26	0538	13	0545	100	0552	2.397	0559	0	0566	2.498	0573	4.478	0580	4.478	0586	55,78
De 6 a 9 meses	0518	15	0525	54	0532	18	0539	25	0546	97	0553	1.538	0560	0	0567	1.636	0574	2.737	0581	2.737	0587	59,76
De 9 a 12 meses	0519	17	0526	89	0533	25	0540	57	0547	171	0554	2.071	0561	0	0568	2.242	0575	3.553	0582	3.553	0588	63,10
Más de 12 meses	0520	105	0527	4.017	0534	108	0541	1.630	0548	5.756	0555	11.246	0562	0	0569	17.002	0576	21.904	0583	21.904	0589	77,62
Total	0521	295	0528	4.325	0535	227	0542	1.725	0549	6.277	0556	29.161	0563	0	0570	35.438	0577	58.830			0590	60,24

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2024

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 31/12/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	492	1600	529	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	762	1601	730	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	2.362	1602	1.324	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	6.857	1603	3.655	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	9.666	1604	8.895	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	59.706	1605	49.204	2605	241
Superior a 10 años	0606	206.777	1606	272.987	2606	1.799.759
Total	0607	286.621	1607	337.324	2607	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	11,57	1608	12,29	2608	27,35

Antigüedad	Situación actual 31/12/2024					
	Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006			
Antigüedad media ponderada (años)	0609	19,50	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: 31/12/2024

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 31/12/2024				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	1.446	0630	63.891	1620	1.332	1630	59.281	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.319	0631	142.462	1621	1.269	1631	130.795	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	392	0632	57.885	1622	851	1632	119.659	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	113	0633	22.384	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
Total	0628	3.270	0638	286.621	1628	3.589	1638	337.324	2628	9.884	2638	1.800.000
Media ponderada (%)	0639	52,45	0649		1639	55,02	1649		2639	94,44	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	4,64	1650	4,14	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	5,68	1651	6,16	2651	6,00
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,75	1652	1,90	2652	2,70

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2024				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	128	0683	7.416	1660	146	1683	9.416	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	58	0684	3.697	1661	60	1684	4.155	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	28	0685	1.759	1662	30	1685	2.030	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	26	0686	1.776	1663	27	1686	2.061	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	21	0687	1.147	1664	21	1687	1.258	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	54	0688	2.769	1665	58	1688	3.237	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	83	0689	4.198	1666	92	1689	5.004	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	128	0690	8.932	1667	152	1690	11.017	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	334	0691	33.535	1668	370	1691	39.913	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	13	0692	339	1669	18	1692	421	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	13	0693	601	1670	16	1693	754	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	69	0694	4.261	1671	73	1694	4.998	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	2.082	0695	201.816	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	9	0697	465	1674	9	1697	615	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	12	0698	969	1675	14	1698	1.297	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	11	0699	823	1676	12	1699	996	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	132	0700	6.287	1677	146	1700	7.281	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	69	0701	5.832	1678	74	1701	6.902	2678	162	2701	31.874
Total España	0679	3.270	0702	286.621	1679	3.589	1702	337.324	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	3.270	0705	286.621	1682	3.589	1705	337.324	2682	9.884	2705	1.800.000

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2024
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2024				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	1,16			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

Período de la declaración: 31/12/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2024			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	32.251	87.079	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			
Total		0723	18.000	0724	267.079	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: 31/12/2024

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					
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739					
ES0359092006	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	0	0	NO	0	0	0	0					
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	0	0	NO	0	0	0	0					
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	3,19	301	0	NO	87.079	0	87.380	0					
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	3,25	222	0	NO	63.000	0	63.222	0					
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	3,30	241	0	NO	67.500	0	67.741	0					
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	3,50	116	0	NO	30.600	0	30.716	0					
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	5,00	102	0	NO	18.900	0	19.002	0					
Total						0740	982	0741	0	0743	267.079	0744	0	0745	268.061	0746	0

	Situación actual 31/12/2024		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	4,05	0748	3,58	0749	0,00

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2024								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2023							
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	11.140	182.921	936	53.828	17.413	127.215	1.640	48.926	17.413	127.215	1.640	48.926	17.413	48.926		
ES0359092030	SERIE B	0	0	610	15.085	0	0	655	12.481	0	0	655	12.481	0	12.481		
ES0359092048	SERIE C	0	0	662	16.573	0	0	710	13.749	0	0	710	13.749	0	13.749		
ES0359092055	SERIE D	0	0	316	8.470	0	0	338	7.128	0	0	338	7.128	0	7.128		
ES0359092063	SERIE E	0	0	267	10.377	0	0	281	9.259	0	0	281	9.259	0	9.259		
Total		0754	11.140	0755	1.532.921	0756	2.791	0757	253.177	1754	17.413	1755	1.477.215	1756	3.623	1757	240.387

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2024

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 31/12/2024	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	03/12/2024	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	03/12/2024	SYP	A	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	03/12/2024	SYP	B+	CCC-	BB

S.05.2
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/12/2024
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	21.774	1765	23.162	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	20.879	1766	24.243	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	20.943	1767	25.224	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	21.545	1768	25.263	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	21.635	1769	193.159	2769	41.891
Entre 5 y 10 años	0770	160.303	1770	31.733	2770	241.519
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	1.370.127
Total	0772	267.079	1772	322.785	2772	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	5,64	1773	6,65	2773	25,20

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2024

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2024		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	12.768	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	4,78	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	32,60	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: 31/12/2024

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 31/12/2024	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	-1.370	-1.984		
Total							0808 -1.370	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: 31/12/2024

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 31/12/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006		Situación actual 31/12/2024		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			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2024

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 31/12/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación actual 31/12/2024		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	1.505	7006	3.043	7009	0,58	7012	0,97	7015	0,82		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.505	7008	3.043	7011	0,58	7014	0,97	7017	0,82	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	60.999	7024	61.088	7027	18,95	7030	16,33	7033	18,75		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	426	7025	426	7028	0,13	7031	0,11	7034	0,13		
Total Fallidos					7023	61.425	7026	61.515	7029	19,08	7032	16,44	7035	18,88	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2024		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: 31/12/2024

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
SERIE C - ES0359092048	10,00	21,55	21,95	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	1,75	0,58	0,75	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,58	0,75	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	7,08	6,79	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	23,59	22,64	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	21,55	21,95	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	1,25	0,58	0,75	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359092006	25,00	7,08	7,10	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	7,50	25,27	24,26	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	10,00	21,55	21,95	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	2,00	0,58	0,75	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	10,00	21,55	21,95	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	11,46	11,00	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	7,08	7,10	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	7,08	7,10	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE B - ES0359092030	18,30	7,08	7,10	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE E - ES0359092063	8,00	7,08	7,10	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE C - ES0359092048	13,20	7,08	7,10	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE D - ES0359092055	9,40	7,08	7,10	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		4,78	4,49	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2024

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	

S.05.5
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2024

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	Integrado en el pago de los intereses de los bonistas
Contrapartida	0870	Bonista
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Cláusula 13.4 Intereses de los Bonos Iniciales

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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2024

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo						Total
		22/02/2024	22/05/2024	22/08/2024	22/11/2024			
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885							
Saldo inicial	0886	11.450	11.921	12.235	12.504			
Cobros del periodo	0887	20.640	18.773	16.796	14.470			
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-195	-212	-44	-171			
Pagos por derivados	0889	-117	-53	32	-104			
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-11.921	-12.235	-12.504	-12.768			
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-19.857	-18.194	-16.515	-13.931			
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0	0			
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0	0			
Saldo disponible	0894	0	0	0	0			
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	0	0			0

S.06

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2024

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