

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: 31/03/2024

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)

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: 31/03/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2024		Periodo anterior 31/12/2023
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	293.914	1001	308.002
I. Activos financieros a largo plazo	0002	293.914	1002	308.002
1. Activos titulizados	0003	293.914	1003	308.002
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	276.490	1005	292.021
1.3 Préstamos hipotecarios	0006	0	1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007	0	1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008	0	1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009	0	1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010	0	1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011	0	1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012	0	1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013	0	1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014	0	1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015	0	1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016	0	1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017	0	1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018	0	1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019	0	1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020	0	1020	0
1.18 Bonos de titulización	0021	0	1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022	0	1022	0
1.20 Otros	0023	0	1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024	0	1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	17.475	1025	16.032
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-50	1027	-50
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
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: 31/03/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	78.506	1041	79.365
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	13.265	1042	13.573
V. Activos financieros a corto plazo	0043	29.451	1043	29.588
1. Activos titulizados	0044	29.375	1044	29.512
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	23.598	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	585	1065	627
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	101	1066	103
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	5.550	1067	5.230
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	181	1068	153
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-641	1069	-641
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	76	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	76	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	35.789	1085	36.204
1. Tesorería	0086	35.789	1086	36.204
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	372.420	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: 31/03/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2024		Periodo anterior 31/12/2023
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	291.832	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	291.832	1094	308.479
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	277.344	1095	293.514
1.1 Series no subordinadas	0096	97.344	1096	113.514
1.2 Series subordinadas	0097	180.000	1097	180.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	0	1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	12.902	1101	13.380
2.1 Préstamo subordinado	0102	68.941	1102	68.941
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-56.039	1105	-55.561
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108	1.585	1108	1.585
3.1 Derivados de cobertura	0109	1.585	1109	1.585
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
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: 31/03/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) PASIVO CORRIENTE	0117	81.782	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	74.960	1123	73.561
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	30.544	1124	30.783
1.1 Series no subordinadas	0125	29.149	1125	29.271
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	1.395	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	33.547	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	432	1136	445
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	33.115	1137	32.065
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	399	1139	399
3.1 Derivados de cobertura	0140	399	1140	399
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	10.470	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	10.470	1146	9.870
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	6.822	1148	6.471
1. Comisiones	0149	12	1149	13
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	11	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	6.810	1157	6.459
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-1.194	1158	-1.144
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-1.194	1160	-1.144
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	372.420	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: 31/03/2024

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2024		Acumulado anterior 31/03/2023
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	4.136	1201	3.192	2201	4.136	3201	3.192
1.1 Activos titulizados	0202	3.866	1202	3.054	2202	3.866	3202	3.054
1.2 Otros activos financieros	0203	270	1203	138	2203	270	3203	138
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-4.487	1204	-3.126	2204	-4.487	3204	-3.126
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-3.449	1205	-2.409	2205	-3.449	3205	-2.409
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1.038	1206	-718	2206	-1.038	3206	-718
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	-67	1208	-34	2208	-67	3208	-34
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-417	1209	32	2209	-417	3209	32
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	17	2216	0	3216	17
7. Otros gastos de explotación	0217	-224	1217	-259	2217	-224	3217	-259
7.1 Servicios exteriores	0218	-195	1218	-227	2218	-195	3218	-227
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-195	1219	-227	2219	-195	3219	-227
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-29	1224	-32	2224	-29	3224	-32
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-25	1225	-27	2225	-25	3225	-27
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	-5	3227	-6
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	0	1231	-281	2231	0	3231	-281
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	-281	2232	0	3232	-281
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	164	1238	544	2238	164	3238	544
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	478	1239	-52	2239	478	3239	-52
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: 31/03/2024

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2024		Acumulado anterior 31/03/2023
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	438	1300	1.162	2300	438	3300	1.162
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	468	1301	1.195	2301	468	3301	1.195
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	3.880	1302	2.881	2302	3.880	3302	2.881
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-3.565	1303	-2.166	2303	-3.565	3303	-2.166
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	363	2304	0	3304	363
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-117	1305	0	2305	-117	3305	0
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	270	1306	117	2306	270	3306	117
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	-30	1309	-33	2309	-30	3309	-33
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-25	1310	-27	2310	-25	3310	-27
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	-6	2312	-5	3312	-6
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	-854	1322	-2.780	2322	-854	3322	-2.780
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	-1.256	1325	2.990	2325	-1.256	3325	2.990
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	5.559	1326	5.818	2326	5.559	3326	5.818
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	8.533	1327	11.063	2327	8.533	3327	11.063
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	473	1328	1.302	2328	473	3328	1.302
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	472	1330	1.064	2330	472	3330	1.064
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-16.292	1331	-16.258	2331	-16.292	3331	-16.258
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	402	1332	-5.770	2332	402	3332	-5.770
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	600	1333	0	2333	600	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	-198	1336	-5.770	2336	-198	3336	-5.770
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-415	1337	-1.617	2337	-415	3337	-1.617
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	36.204	1338	44.376	2338	36.204	3338	44.376
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	35.789	1339	42.758	2339	35.789	3339	42.758

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2024

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2024		Acumulado anterior 31/03/2023
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	-117	1357	363	2357	-117	3357	363
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-117	1358	363	2358	-117	3358	363
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	67	1360	34	2360	67	3360	34
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	50	1362	-397	2362	50	3362	-397
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: 31/03/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/03/2024								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	7,13	0401	22,40	0421	0,00	0441	11,01	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	

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: 31/03/2024

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	125	0467	74	0474	51	0481	0	0488	124	0495	11.609	0502	0	0509	11.734
De 1 a 3 meses	0461	47	0468	65	0475	50	0482	0	0489	116	0496	5.859	0503	0	0510	5.974
De 3 a 6 meses	0462	33	0469	92	0476	49	0483	20	0490	161	0497	4.182	0504	0	0511	4.343
De 6 a 9 meses	0463	18	0470	91	0477	23	0484	35	0491	149	0498	1.937	0505	0	0512	2.086
De 9 a 12 meses	0464	19	0471	117	0478	28	0485	84	0492	229	0499	2.553	0506	0	0513	2.782
Más de 12 meses	0465	95	0472	3.818	0479	81	0486	1.378	0493	5.276	0500	10.236	0507	0	0514	15.513
Total	0466	337	0473	4.256	0480	282	0487	1.517	0494	6.055	0501	36.376	0508	0	1515	42.431

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	125	0522	74	0529	51	0536	0	0543	124	0550	11.609	0557	0	0564	11.734	0571	24.106	0578	24.106	0584	48,68
De 1 a 3 meses	0516	47	0523	65	0530	50	0537	0	0544	116	0551	5.859	0558	0	0565	5.974	0572	10.171	0579	10.171	0585	58,74
De 3 a 6 meses	0517	33	0524	92	0531	49	0538	20	0545	161	0552	4.182	0559	0	0566	4.343	0573	7.405	0580	7.405	0586	58,64
De 6 a 9 meses	0518	18	0525	91	0532	23	0539	35	0546	149	0553	1.937	0560	0	0567	2.086	0574	3.937	0581	3.937	0587	52,98
De 9 a 12 meses	0519	19	0526	117	0533	28	0540	84	0547	229	0554	2.553	0561	0	0568	2.782	0575	4.114	0582	4.114	0588	67,64
Más de 12 meses	0520	95	0527	3.818	0534	81	0541	1.378	0548	5.276	0555	10.236	0562	0	0569	15.513	0576	19.509	0583	19.509	0589	79,51
Total	0521	337	0528	4.256	0535	282	0542	1.517	0549	6.055	0556	36.376	0563	0	0570	42.431	0577	69.242			0590	61,28

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: 31/03/2024

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 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	479	1600	529	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	852	1601	730	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.537	1602	1.324	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	4.404	1603	3.655	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	9.775	1604	8.895	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	49.115	1605	49.204	2605	241
Superior a 10 años	0606	256.951	1606	272.987	2606	1.799.759
Total	0607	323.113	1607	337.324	2607	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	12,11	1608	12,29	2608	27,35

Antigüedad	Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	18,77	1609	18,52	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: 31/03/2024

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 31/03/2024				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	1.355	0630	60.026	1620	1.332	1630	59.281	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.307	0631	137.425	1621	1.269	1631	130.795	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	700	0632	99.117	1622	851	1632	119.659	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	132	0633	26.546	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	3.494	0638	323.113	1628	3.589	1638	337.324	2628	9.884	2638	1.800.000
Media ponderada (%)	0639	54,38	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: 31/03/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	4,62	1650	4,14	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,16	1651	6,16	2651	6,00
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,90	1652	1,90	2652	2,70

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/03/2024				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	140	0683	8.684	1660	146	1683	9.416	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	60	0684	4.052	1661	60	1684	4.155	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	30	0685	1.989	1662	30	1685	2.030	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	27	0686	2.022	1663	27	1686	2.061	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	21	0687	1.229	1664	21	1687	1.258	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	54	0688	3.001	1665	58	1688	3.237	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	91	0689	4.843	1666	92	1689	5.004	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	147	0690	10.509	1667	152	1690	11.017	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	361	0691	38.320	1668	370	1691	39.913	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	18	0692	405	1669	18	1692	421	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	16	0693	738	1670	16	1693	754	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	70	0694	4.653	1671	73	1694	4.998	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	2.212	0695	226.296	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	603	1674	9	1697	615	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	14	0698	1.277	1675	14	1698	1.297	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	12	0699	979	1676	12	1699	996	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	138	0700	6.849	1677	146	1700	7.281	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	74	0701	6.665	1678	74	1701	6.902	2678	162	2701	31.874
Total España	0679	3.494	0702	323.113	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	3.494	0705	323.113	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: 31/03/2024
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/03/2024				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	1,06			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: 31/03/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2024			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	46.849	126.493	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	306.493	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: 31/03/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses					Principal pendiente				Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas				
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		0738	0739			
									0730	0731	0732	0733			0734	0735	0742
ES0359092006	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0				
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0				
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	4,13	552	0	NO	126.493	0	0	127.045	0				
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	4,19	279	0	NO	63.000	0	0	63.279	0				
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	4,24	302	0	NO	67.500	0	0	67.802	0				
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	4,44	144	0	NO	30.600	0	0	30.744	0				
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	5,94	119	0	NO	18.900	0	0	19.019	0				
Total						0740	1.395	0741	0	0743	306.493	0744	0	0745	307.888	0746	0

	Situación actual 31/03/2024		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	4,00	0748	3,58	0749	0,00

S.05.2
Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/03/2024
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2024								Situación periodo comparativo anterior 31/03/2023							
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	16.292	143.507	1.515	50.441	16.258	72.093	1.101	44.257	16.258	72.093	1.101	44.257	1.101	44.257		
ES0359092030	SERIE B	0	0	678	13.159	0	0	333	10.789	0	0	333	10.789	333	10.789		
ES0359092048	SERIE C	0	0	735	14.484	0	0	366	11.910	0	0	366	11.910	366	11.910		
ES0359092055	SERIE D	0	0	349	7.476	0	0	182	6.248	0	0	182	6.248	182	6.248		
ES0359092063	SERIE E	0	0	288	9.547	0	0	185	8.501	0	0	185	8.501	185	8.501		
Total		0754	16.292	0755	1.493.507	0756	3.565	0757	243.952	1754	16.258	1755	1.422.093	1756	2.166	1757	230.550

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: 31/03/2024

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 31/03/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 05/12/2006
				0760	0761	0762
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092014	SERIE A2	29/09/2021	FCH	A+	A+	AAA
ES0359092014	SERIE A2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	04/05/2018	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092022	SERIE A3	13/03/2024	FCH	AA+	A+	AAA
ES0359092022	SERIE A3	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	01/06/2022	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092030	SERIE B	13/03/2024	FCH	AA	A+	AA
ES0359092030	SERIE B	22/06/2022	MDY	Aa1	Aa1	Aa1
ES0359092030	SERIE B	01/06/2022	SYP	AA+	AA+	AA
ES0359092048	SERIE C	13/03/2024	FCH	BBB-	BB+	A
ES0359092048	SERIE C	26/10/2023	MDY	A1	A1	A1
ES0359092048	SERIE C	01/06/2022	SYP	AA	AA	A
ES0359092055	SERIE D	13/03/2024	FCH	BB	B	BBB
ES0359092055	SERIE D	26/10/2023	MDY	B3	B3	Baa2
ES0359092055	SERIE D	01/06/2022	SYP	BB+	BB+	BBB
ES0359092063	SERIE E	18/03/2009	FCH	CC	CC	BB+
ES0359092063	SERIE E	11/09/2009	MDY	C	C	Ba1
ES0359092063	SERIE E	01/06/2022	SYP	CCC-	CCC-	BB

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: 31/03/2024
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 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	25.799	1765	23.162	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	22.294	1766	24.243	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	23.346	1767	25.224	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	24.242	1768	25.263	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	24.259	1769	193.159	2769	41.891
Entre 5 y 10 años	0770	186.552	1770	31.733	2770	241.519
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	1.370.127
Total	0772	306.493	1772	322.785	2772	1.800.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	5,40	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: 31/03/2024

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/03/2024		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	11.921	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	3,89	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	41,26	1792	44,23	2792	90,00
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2024

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 31/03/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 05/12/2006	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap de Bases	BANCO SANTANDER	TRIMESTRAL	Media de los Euribor 12M en cada Fecha de Referencia	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	Tipo de Referencia de los Bonos - 0,055%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	-1.984	-1.984		
Total							0808 -1.984	0809 -1.984	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2024

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 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006		Situación actual 31/03/2024		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: 31/03/2024

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 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación actual 31/03/2024		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	3.505	7006	3.043	7009	1,18	7012	0,97	7015	0,76		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	3.505	7008	3.043	7011	1,18	7014	0,97	7017	0,76	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	61.929	7024	61.088	7027	17,25	7030	16,33	7033	16,74		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	426	7025	426	7028	0,12	7031	0,11	7034	0,12		
Total Fallidos					7023	62.355	7026	61.515	7029	17,36	7032	16,44	7035	16,85	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2024

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 A1 - ES0359092006	25,00	7,07	7,05	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	1,18	0,76	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	23,55	24,09	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	7,07	7,05	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	2,00	1,18	0,76	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	1,25	1,18	0,76	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	1,75	1,18	0,76	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	10,00	23,55	24,09	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	10,00	23,55	24,09	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	10,00	23,55	24,09	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	7,50	22,02	20,91	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	6,17	5,86	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	20,56	19,52	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	9,98	9,48	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	7,07	7,05	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE C - ES0359092048	13,20	7,08	7,05	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE D - ES0359092055	9,40	7,08	7,05	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE B - ES0359092030	18,30	7,08	7,05	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE E - ES0359092063	8,00	7,08	7,05	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		3,89	3,55	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: 31/03/2024

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862	11	2862	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,014	4862		5862		6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, S.E.	1864		2864	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3864	0,005	4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2024

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2024

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885	22/02/2024											
Saldo inicial	0886	11.450											
Cobros del periodo	0887	20.640											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-195											
Pagos por derivados	0889	-117											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-11.921											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-19.857											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0											
Resto pagos/retenciones	0893	0											
Saldo disponible	0894	0											
Liquidación de comisión variable	0895	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: 31/03/2024

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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