

**I. DATOS IDENTIFICATIVOS**

Denominación del Fondo: MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS  
Número de registro del Fondo: 8591  
NIF Fondo: V84916956  
Denominación del compartimento:  
Número de registro del compartimento:  
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.  
NIF Gestora: A80352750  
Fondo Abierto: NO  
Fondo Privado: NO  
Estados agregados: NO  
Fecha: 30/09/2024

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

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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2024		Periodo anterior 31/12/2023
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	269.143	1001	308.002
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	269.143	1002	308.002
1. Activos titulizados	0003	269.143	1003	308.002
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	251.923	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	17.271	1025	16.032
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-50	1027	-50
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0039	0	1039	0
<b>III. Otros activos no corrientes</b>	0040	0	1040	0

S.01

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2024		Periodo anterior 31/12/2023
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	64.917	1041	79.365
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042	13.121	1042	13.573
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	29.153	1043	29.588
1. Activos titulizados	0044	29.093	1044	29.512
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	23.208	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	495	1065	627
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	75	1066	103
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	5.763	1067	5.230
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	194	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	60	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	60	1079	76
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
<b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b>	0085	22.643	1085	36.204
1. Tesorería	0086	22.643	1086	36.204
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	334.060	1088	387.367

S.01

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2024		Periodo anterior 31/12/2023
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	262.265	1089	308.479
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0090	0	1090	0
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	0	1092	0
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0094	262.265	1094	308.479
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	249.248	1095	293.514
1.1 Series no subordinadas	0096	69.248	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	11.432	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	-57.509	1105	-55.561
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108	1.585	1108	1.585
3.1 Derivados de cobertura	0109	1.585	1109	1.585
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	0116	0	1116	0

S.01

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2024		Periodo anterior 31/12/2023
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	73.097	1117	80.033
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0118	0	1118	0
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	0119	0	1119	0
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	0
2. Provisión por margen de intermediación	0121	0	1121	0
3. Otras provisiones	0122	0	1122	0
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	0123	66.131	1123	73.561
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	30.153	1124	30.783
1.1 Series no subordinadas	0125	28.970	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	1.183	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	35.579	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	414	1136	445
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	35.165	1137	32.065
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	399	1139	399
3.1 Derivados de cobertura	0140	399	1140	399
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	9.870
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	9.870
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	0148	6.966	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	6.954	1157	6.459
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158	-1.302	1158	-1.144
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159	0	1159	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	-1.302	1160	-1.144
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161	0	1161	0
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	334.060	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: 30/09/2024

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2024		Acumulado anterior 30/09/2023
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	3.502	1201	4.254	2201	11.405	3201	11.448
1.1 Activos titulizados	0202	3.271	1202	3.992	2202	10.649	3202	10.848
1.2 Otros activos financieros	0203	231	1203	262	2203	756	3203	601
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-3.991	1204	-4.488	2204	-12.740	3204	-11.561
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-2.986	1205	-3.507	2205	-9.671	3205	-8.998
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1.005	1206	-981	2206	-3.069	3206	-2.564
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0208	22	1208	-83	2208	21	3208	-296
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	-467	1209	-317	2209	-1.315	3209	-409
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	0210	0	1210	0	2210	0	3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211	0	3211	0
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212	0	3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213	0	3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214	0	3214	0
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0217	-174	1217	-212	2217	-638	3217	-759
7.1 Servicios exteriores	0218	-146	1218	-181	2218	-552	3218	-664
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-146	1219	-181	2219	-552	3219	-664
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	-28	1224	-31	2224	-86	3224	-95
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-24	1225	-26	2225	-73	3225	-79
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	-14	3227	-16
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228	0	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0231	-149	1231	-89	2231	-232	3231	-376
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-149	1232	-89	2232	-232	3232	-376
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	0234	0	1234	0	2234	0	3234	0
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236	0	3236	0
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0238	40	1238	39	2238	237	3238	753
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0239	751	1239	579	2239	1.948	3239	790
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2024		Acumulado anterior 30/09/2023
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	431	1300	727	2300	1.315	3300	2.965
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	459	1301	758	2301	1.402	3301	3.061
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	3.319	1302	3.920	2302	10.767	3302	10.437
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-3.130	1303	-3.421	2303	-9.999	3303	-8.380
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	32	1304	0	2304	0	3304	432
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	-138	3305	0
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	239	1306	258	2306	772	3306	572
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	0309	-28	1309	-31	2309	-87	3309	-96
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-24	1310	-26	2310	-73	3310	-80
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-4	1312	-5	2312	-14	3312	-17
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>	0315	0	1315	0	2315	0	3315	0
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>	0322	-2.499	1322	-4.193	2322	-14.876	3322	-6.834
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b>	0325	-2.354	1325	-3.088	2325	-4.447	3325	1.268
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	5.335	1326	5.276	2326	15.954	3326	17.075
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	4.016	1327	9.610	2327	20.245	3327	33.284
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.545	1328	993	2328	3.231	3328	3.073
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	135	1330	148	2330	689	3330	1.803
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-13.385	1331	-19.115	2331	-44.566	3331	-53.968
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	0332	-146	1332	-1.105	2332	-10.429	3332	-8.102
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	-146	1336	-1.105	2336	-10.429	3336	-8.102
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	0337	-2.068	1337	-3.466	2337	-13.561	3337	-3.869
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	24.711	1338	43.973	2338	36.204	3338	44.376
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	22.643	1339	40.507	2339	22.643	3339	40.507

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2024		Acumulado anterior 30/09/2023
<b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>0356</b>	<b>0</b>	<b>1356</b>	<b>0</b>	<b>2356</b>	<b>0</b>	<b>3356</b>	<b>0</b>
<b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	32	1357	0	2357	-138	3357	432
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	32	1358	0	2358	-138	3358	432
2.1.2 Efecto fiscal	0359	0	1359	0	2359	0	3359	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0360	-22	1360	83	2360	-21	3360	296
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	-10	1362	-84	2362	158	3362	-728
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>0363</b>	<b>0</b>	<b>1363</b>	<b>0</b>	<b>2363</b>	<b>0</b>	<b>3363</b>	<b>0</b>
<b>3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>0369</b>	<b>0</b>	<b>1369</b>	<b>0</b>	<b>2369</b>	<b>0</b>	<b>3369</b>	<b>0</b>
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>0370</b>	<b>0</b>	<b>1370</b>	<b>0</b>	<b>2370</b>	<b>0</b>	<b>3370</b>	<b>0</b>



Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2024								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	7,73	0401	23,89	0421	0,00	0441	8,99	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: 30/09/2024

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	130	0467	78	0474	42	0481	0	0488	119	0495	11.108	0502	0	0509	11.228
De 1 a 3 meses	0461	40	0468	54	0475	33	0482	0	0489	87	0496	4.489	0503	0	0510	4.576
De 3 a 6 meses	0462	26	0469	70	0476	34	0483	14	0490	118	0497	3.161	0504	0	0511	3.279
De 6 a 9 meses	0463	21	0470	84	0477	28	0484	45	0491	157	0498	2.551	0505	0	0512	2.708
De 9 a 12 meses	0464	12	0471	82	0478	14	0485	34	0492	130	0499	1.086	0506	0	0513	1.215
Más de 12 meses	0465	108	0472	4.041	0479	118	0486	1.593	0493	5.751	0500	11.959	0507	0	0514	17.711
<b>Total</b>	0466	337	0473	4.408	0480	269	0487	1.686	0494	6.362	0501	34.354	0508	0	1515	40.716

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	130	0522	78	0529	42	0536	0	0543	119	0550	11.108	0557	0	0564	11.228	0571	24.559	0578	24.559	0584	45,72
De 1 a 3 meses	0516	40	0523	54	0530	33	0537	0	0544	87	0551	4.489	0558	0	0565	4.576	0572	8.535	0579	8.535	0585	53,61
De 3 a 6 meses	0517	26	0524	70	0531	34	0538	14	0545	118	0552	3.161	0559	0	0566	3.279	0573	5.662	0580	5.662	0586	57,91
De 6 a 9 meses	0518	21	0525	84	0532	28	0539	45	0546	157	0553	2.551	0560	0	0567	2.708	0574	4.359	0581	4.359	0587	62,13
De 9 a 12 meses	0519	12	0526	82	0533	14	0540	34	0547	130	0554	1.086	0561	0	0568	1.215	0575	2.289	0582	2.289	0588	53,10
Más de 12 meses	0520	108	0527	4.041	0534	118	0541	1.593	0548	5.751	0555	11.959	0562	0	0569	17.711	0576	22.992	0583	22.992	0589	77,03
<b>Total</b>	0521	337	0528	4.408	0535	269	0542	1.686	0549	6.362	0556	34.354	0563	0	0570	40.716	0577	68.397			0590	59,53

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO C**

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	540	1600	529	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	919	1601	730	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.748	1602	1.324	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	5.627	1603	3.655	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	10.316	1604	8.895	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	52.059	1605	49.204	2605	241
Superior a 10 años	0606	226.955	1606	272.987	2606	1.799.759
<b>Total</b>	0607	<b>298.164</b>	1607	<b>337.324</b>	2607	<b>1.800.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	0608	<b>11,75</b>	1608	<b>12,29</b>	2608	<b>27,35</b>

Antigüedad	Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	19,26	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: 30/09/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO D**

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2024				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	1.430	0630	63.246	1620	1.332	1630	59.281	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.332	0631	143.238	1621	1.269	1631	130.795	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	467	0632	68.500	1622	851	1632	119.659	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	117	0633	23.180	1623	137	1633	27.589	2623	9.439	2633	1.699.335
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	445	2634	100.665
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
<b>Total</b>	0628	<b>3.346</b>	0638	<b>298.164</b>	1628	<b>3.589</b>	1638	<b>337.324</b>	2628	<b>9.884</b>	2638	<b>1.800.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>	0639	<b>53,07</b>	0649		1639	<b>55,02</b>	1649		2639	<b>94,44</b>	2649	

S.05.1

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

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2024**

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

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	4,79	1650	4,14	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	5,75	1651	6,16	2651	6,00
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,75	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: 30/09/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2024				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	131	0683	7.675	1660	146	1683	9.416	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	59	0684	3.781	1661	60	1684	4.155	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	29	0685	1.826	1662	30	1685	2.030	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	27	0686	1.942	1663	27	1686	2.061	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	21	0687	1.177	1664	21	1687	1.258	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	54	0688	2.864	1665	58	1688	3.237	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	87	0689	4.398	1666	92	1689	5.004	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	135	0690	9.525	1667	152	1690	11.017	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	339	0691	34.473	1668	370	1691	39.913	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	14	0692	351	1669	18	1692	421	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	14	0693	614	1670	16	1693	754	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	69	0694	4.356	1671	73	1694	4.998	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	2.129	0695	210.083	1672	2.271	1695	235.971	2672	6.243	2695	1.238.324
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	10	0697	578	1674	9	1697	615	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	12	0698	988	1675	14	1698	1.297	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	12	0699	945	1676	12	1699	996	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	133	0700	6.463	1677	146	1700	7.281	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	71	0701	6.124	1678	74	1701	6.902	2678	162	2701	31.874
<b>Total España</b>	0679	<b>3.346</b>	0702	<b>298.164</b>	1679	<b>3.589</b>	1702	<b>337.324</b>	2679	<b>9.884</b>	2702	<b>1.800.000</b>
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
<b>Total general</b>	0682	<b>3.346</b>	0705	<b>298.164</b>	1682	<b>3.589</b>	1705	<b>337.324</b>	2682	<b>9.884</b>	2705	<b>1.800.000</b>

<b>S.05.1</b>
<b>Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/09/2024</b>
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK</b>

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 30/09/2024				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	1,13			1710	1,03			2710	0,37		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

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

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Periodo de la declaración: 30/09/2024**

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

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

**CUADRO A**

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2024			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	36.377	98.219	2.700	52.883	142.785	2.700	100.000	270.000			
ES0359092030	SERIE B	630	100.000	63.000	630	100.000	63.000	630	100.000	63.000			
ES0359092048	SERIE C	675	100.000	67.500	675	100.000	67.500	675	100.000	67.500			
ES0359092055	SERIE D	306	100.000	30.600	306	100.000	30.600	306	100.000	30.600			
ES0359092063	SERIE E	189	100.000	18.900	189	100.000	18.900	189	100.000	18.900			
<b>Total</b>		0723	18.000	0724	278.219	1723	18.000	1724	322.785	2723	18.000	2724	1.800.000



Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2024

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	Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
						0730	0731			0732	0733				0734	0735	0742
ES0359092006	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	0	0	0	NO	0	0	0	0	0			
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	0	0	0	NO	0	0	0	0	0			
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	3,73	397	0	0	NO	98.219	0	0	98.615	0			
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	3,79	259	0	0	NO	63.000	0	0	63.259	0			
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	3,84	281	0	0	NO	67.500	0	0	67.781	0			
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	4,04	134	0	0	NO	30.600	0	0	30.734	0			
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	5,54	113	0	0	NO	18.900	0	0	19.013	0			
<b>Total</b>						0740	1.183	0741	0	0743	278.219	0744	0	0745	279.402	0746	0

	Situación actual 30/09/2024		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	4,22	0748	3,58	0749	0,00

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

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

**CUADRO C**

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2024								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2023							
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	13.385	171.781	1.144	52.892	19.115	109.803	1.637	47.286	19.115	109.803	1.637	47.286	1.637	47.286		
ES0359092030	SERIE B	0	0	656	14.475	0	0	585	11.826	0	0	585	11.826	585	11.826		
ES0359092048	SERIE C	0	0	711	15.911	0	0	635	13.039	0	0	635	13.039	635	13.039		
ES0359092055	SERIE D	0	0	338	8.154	0	0	304	6.790	0	0	304	6.790	304	6.790		
ES0359092063	SERIE E	0	0	281	10.109	0	0	260	8.978	0	0	260	8.978	260	8.978		
<b>Total</b>		0754	13.385	0755	1.521.781	0756	3.130	0757	250.386	1754	19.115	1755	1.459.803	1756	3.421	1757	236.764

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

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

**CUADRO D**

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/09/2024	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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2024

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 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	22.943	1765	23.162	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	22.123	1766	24.243	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	21.254	1767	25.224	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	132.159	1768	25.263	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769	193.159	2769	41.891
Entre 5 y 10 años	0770	79.740	1770	31.733	2770	241.519
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	1.370.127
<b>Total</b>	<b>0772</b>	<b>278.219</b>	<b>1772</b>	<b>322.785</b>	<b>2772</b>	<b>1.800.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>0773</b>	<b>5,90</b>	<b>1773</b>	<b>6,65</b>	<b>2773</b>	<b>25,20</b>

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2024		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	12.504	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	4,49	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	35,30	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	

S.05.3

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO B**

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/09/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 05/12/2006	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap de Bases	BANCO SANTANDER	TRIMESTRAL	Media de los Euribor 12M en cada Fecha de Referencia	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	Tipo de Referencia de los Bonos - 0,055%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	-1.984	-1.984		
<b>Total</b>							0808 -1.984	0809 -1.984	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO B**

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006		Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 05/12/2006			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
<b>Total</b>	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

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

**CUADRO A**

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	2.209	7006	3.043	7009	0,81	7012	0,97	7015	0,98		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	2.209	7008	3.043	7011	0,81	7014	0,97	7017	0,98	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	62.089	7024	61.088	7027	18,60	7030	16,33	7033	18,12		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	426	7025	426	7028	0,13	7031	0,11	7034	0,13		
Total Fallidos					7023	62.515	7026	61.515	7029	18,73	7032	16,44	7035	18,25	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853



Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

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

**CUADRO B**

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
<b>Amortización secuencial: series</b>	0854	0858	1858	2858
SERIE C - ES0359092048	1,75	0,77	0,93	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	7,50	24,26	23,15	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	2,00	0,77	0,93	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	10,00	22,19	22,56	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	10,00	22,19	22,56	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	7,12	7,09	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	7,12	7,09	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359092006	25,00	7,12	7,09	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	11,00	10,49	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	1,25	0,77	0,93	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	22,19	22,56	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	10,00	22,19	22,56	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	22,64	21,60	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	6,79	6,48	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,77	0,93	Nota de Valores 4.9.4
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series</b>	0855	0859	1859	2859
SERIE B - ES0359092030	18,30	7,12	7,09	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE D - ES0359092055	9,40	7,12	7,09	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE C - ES0359092048	13,20	7,12	7,09	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE E - ES0359092063	8,00	7,12	7,09	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
<b>No Reducción del Fondo de Reserva</b>	0856	0860	1860	2860
		4,49	4,20	3.4.2.2. Modulo Adicional
<b>OTROS TRIGGERS</b>	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

**CUADRO C**

**Informe cumplimiento reglas de funcionamiento**

Contiene



Información adicional  
en fichero adjunto

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

**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
<b>Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/09/2024</b>

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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

**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						
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885									
Saldo inicial	0886	11.450	11.921	12.235						
Cobros del periodo	0887	20.640	18.773	16.796						
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-195	-212	-44						
Pagos por derivados	0889	-117	-53	32						
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-11.921	-12.235	-12.504						
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-19.857	-18.194	-16.515						
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0						
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0						
Saldo disponible	0894	0	0	0						
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	0						0

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

**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**