

**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: 31/03/2022

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

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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2022		Periodo anterior 31/12/2021
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	411.436	1001	423.126
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	411.436	1002	423.126
1. Activos titulizados	0003	411.436	1003	423.126
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	398.238	1005	410.193
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	13.271	1025	13.006
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-73	1027	-73
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

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2022		Periodo anterior 31/12/2021
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	81.252	1041	84.118
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042	15.899	1042	15.899
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	35.220	1043	35.552
1. Activos titulizados	0044	35.219	1044	35.552
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	30.975	1046	31.416
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	72	1065	76
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	10	1066	11
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	4.821	1067	4.705
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	71	1068	74
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-730	1069	-730
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	1	1074	0
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	1	1079	0
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	30.133	1085	32.667
1. Tesorería	0086	30.133	1086	32.667
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	492.689	1088	507.245

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: 31/03/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2022		Periodo anterior 31/12/2021
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	414.065	1089	425.271
<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	414.065	1094	425.271
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	395.966	1095	406.905
1.1 Series no subordinadas	0096	215.966	1096	226.905
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	14.641	1101	14.908
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	-54.299	1105	-54.033
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108	3.458	1108	3.458
3.1 Derivados de cobertura	0109	3.458	1109	3.458
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: 31/03/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2022		Periodo anterior 31/12/2021
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	82.845	1117	86.175
<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	75.496	1123	79.141
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	35.826	1124	36.151
1.1 Series no subordinadas	0125	35.797	1125	36.122
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	29	1128	29
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	27.767	1131	27.517
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	104	1136	107
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	27.662	1137	27.409
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	674	1139	674
3.1 Derivados de cobertura	0140	674	1140	674
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	11.230	1143	14.800
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	11.230	1146	14.800
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	0148	7.349	1148	7.034
1. Comisiones	0149	14	1149	15
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	12	1150	12
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	3	1152	3
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	7.334	1157	7.019
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158	-4.221	1158	-4.201
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159	0	1159	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	-4.221	1160	-4.201
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161	0	1161	0
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	492.689	1162	507.245

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2022		Acumulado anterior 31/03/2021
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	531	1201	633	2201	531	3201	633
1.1 Activos titulizados	0202	531	1202	633	2202	531	3202	633
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-334	1204	-335	2204	-334	3204	-335
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-69	1205	-69	2205	-69	3205	-69
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-250	1206	-253	2206	-250	3206	-253
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-16	1207	-13	2207	-16	3207	-13
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0208	-132	1208	-226	2208	-132	3208	-226
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	65	1209	71	2209	65	3209	71
<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	20	2216	0	3216	20
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0217	-331	1217	-229	2217	-331	3217	-229
7.1 Servicios exteriores	0218	-297	1218	-193	2218	-297	3218	-193
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-297	1219	-193	2219	-297	3219	-193
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	-34	1224	-36	2224	-34	3224	-36
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-28	1225	-29	2225	-28	3225	-29
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-6	1227	-7	2227	-6	3227	-7
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	0	1231	-118	2231	0	3231	-118
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	-118	2232	0	3232	-118
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	0	1238	204	2238	0	3238	204
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0239	266	1239	52	2239	266	3239	52
<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: 31/03/2022

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2022		Acumulado anterior 31/03/2021
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	267	1300	213	2300	267	3300	213
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	301	1301	230	2301	301	3301	230
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	539	1302	669	2302	539	3302	669
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-69	1303	-70	2303	-69	3303	-70
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-152	1305	-357	2305	-152	3305	-357
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-16	1308	-12	2308	-16	3308	-12
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	0309	-35	1309	-36	2309	-35	3309	-36
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-28	1310	-29	2310	-28	3310	-29
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-6	1312	-7	2312	-6	3312	-7
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	20	2315	0	3315	20
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	20	2321	0	3321	20
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>	0322	-2.800	1322	3.378	2322	-2.800	3322	3.378
<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	806	1325	3.574	2325	806	3325	3.574
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	6.585	1326	5.965	2326	6.585	3326	5.965
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	4.796	1327	6.432	2327	4.796	3327	6.432
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	689	1328	862	2328	689	3328	862
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	0	1330	564	2330	0	3330	564
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-11.264	1331	-10.249	2331	-11.264	3331	-10.249
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	0332	-3.606	1332	-196	2332	-3.606	3332	-196
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	-3.606	1336	-196	2336	-3.606	3336	-196
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	0337	-2.533	1337	3.591	2337	-2.533	3337	3.591
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	32.667	1338	14.571	2338	32.667	3338	14.571
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	30.133	1339	18.162	2339	30.133	3339	18.162

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2022		Acumulado anterior 31/03/2021
<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	-152	1357	-357	2357	-152	3357	-357
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-152	1358	-357	2358	-152	3358	-357
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	132	1360	226	2360	132	3360	226
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	20	1362	131	2362	20	3362	131
<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: 31/03/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 31/03/2022								Situación cierre anual anterior 31/12/2021								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	4,04	0401	17,09	0421	0,28	0441	3,75	1381	3,86	1401	16,72	1421	0,28	1441	3,98	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: 31/03/2022

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	143	0467	79	0474	7	0481	0	0488	86	0495	14.257	0502	0	0509	14.343
De 1 a 3 meses	0461	24	0468	30	0475	3	0482	0	0489	34	0496	3.266	0503	0	0510	3.299
De 3 a 6 meses	0462	12	0469	35	0476	2	0483	1	0490	38	0497	1.617	0504	0	0511	1.656
De 6 a 9 meses	0463	11	0470	47	0477	2	0484	3	0491	52	0498	1.180	0505	0	0512	1.231
De 9 a 12 meses	0464	9	0471	62	0478	2	0485	5	0492	69	0499	852	0506	0	0513	921
Más de 12 meses	0465	94	0472	3.528	0479	65	0486	1.041	0493	4.634	0500	10.772	0507	0	0514	15.406
<b>Total</b>	0466	<b>293</b>	0473	<b>3.781</b>	0480	<b>81</b>	0487	<b>1.051</b>	0494	<b>4.913</b>	0501	<b>31.943</b>	0508	<b>0</b>	1515	<b>36.856</b>

Impagados con garantía real (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total		Valor garantía		Valor Garantía con Tasación > 2 años		% Deuda / v. Tasación	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total													
Hasta 1 mes	0515	143	0522	79	0529	7	0536	0	0543	86	0550	14.257	0557	0	0564	14.343	0571	25.928	0578	25.928	0584	55,32
De 1 a 3 meses	0516	24	0523	30	0530	3	0537	0	0544	34	0551	3.266	0558	0	0565	3.299	0572	5.221	0579	5.221	0585	63,19
De 3 a 6 meses	0517	12	0524	35	0531	2	0538	1	0545	38	0552	1.617	0559	0	0566	1.656	0573	2.714	0580	2.714	0586	61,01
De 6 a 9 meses	0518	11	0525	47	0532	2	0539	3	0546	52	0553	1.180	0560	0	0567	1.231	0574	2.004	0581	2.004	0587	61,42
De 9 a 12 meses	0519	9	0526	62	0533	2	0540	5	0547	69	0554	852	0561	0	0568	921	0575	1.663	0582	1.663	0588	55,38
Más de 12 meses	0520	94	0527	3.528	0534	65	0541	1.041	0548	4.634	0555	10.772	0562	0	0569	15.406	0576	19.077	0583	19.077	0589	80,76
<b>Total</b>	0521	<b>293</b>	0528	<b>3.781</b>	0535	<b>81</b>	0542	<b>1.051</b>	0549	<b>4.913</b>	0556	<b>31.943</b>	0563	<b>0</b>	0570	<b>36.856</b>	0577	<b>56.607</b>			0590	<b>65,11</b>

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

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 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0600	195	1600	154	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	673	1601	773	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	875	1602	883	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	1.801	1603	1.498	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	2.302	1604	2.347	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	64.735	1605	66.884	2605	241
Superior a 10 años	0606	376.723	1606	386.781	2606	1.799.759
<b>Total</b>	0607	<b>447.306</b>	1607	<b>459.321</b>	2607	<b>1.800.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	0608	<b>13,67</b>	1608	<b>13,88</b>	2608	<b>27,35</b>

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 05/12/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	16,80	1609	16,56	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: 31/03/2022

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 31/03/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				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	956	0630	40.210	1620	929	1630	38.313	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.591	0631	157.487	1621	1.611	1631	157.667	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	1.458	0632	213.368	1622	1.522	1632	225.348	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	176	0633	36.240	1623	184	1633	37.993	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>4.181</b>	0638	<b>447.306</b>	1628	<b>4.246</b>	1638	<b>459.321</b>	2628	<b>9.884</b>	2638	<b>1.800.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>	0639	<b>59,93</b>	0649		1639	<b>60,56</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: 31/03/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,45	1650	0,47	2650	4,60
Tipo de interés nominal máximo	0651	2,50	1651	2,50	2651	6,00
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,00	2652	2,70

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/03/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				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	185	0683	14.440	1660	190	1683	14.865	2660	413	2683	55.364
Aragón	0661	72	0684	5.449	1661	73	1684	5.595	2661	176	2684	26.730
Asturias	0662	38	0685	2.637	1662	38	1685	2.722	2662	71	2685	8.457
Baleares	0663	32	0686	3.121	1663	33	1686	3.247	2663	73	2686	12.511
Canarias	0664	30	0687	1.948	1664	30	1687	1.986	2664	84	2687	10.967
Cantabria	0665	67	0688	4.518	1665	68	1688	4.630	2665	129	2688	18.240
Castilla-León	0666	101	0689	6.325	1666	102	1689	6.659	2666	212	2689	27.344
Castilla La Mancha	0667	183	0690	15.450	1667	188	1690	15.886	2667	489	2690	75.861
Cataluña	0668	451	0691	54.976	1668	458	1691	56.150	2668	968	2691	187.210
Ceuta	0669	26	0692	605	1669	26	1692	631	2669	59	2692	4.472
Extremadura	0670	22	0693	1.083	1670	23	1693	1.181	2670	39	2693	3.661
Galicia	0671	83	0694	6.545	1671	84	1694	6.773	2671	128	2694	17.541
Madrid	0672	2.593	0695	306.950	1672	2.632	1695	315.099	2672	6.243	2695	1.238.324
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	12	0697	906	1674	13	1697	933	2674	63	2697	8.031
Navarra	0675	16	0698	1.692	1675	16	1698	1.715	2675	45	2698	7.831
La Rioja	0676	14	0699	1.190	1676	14	1699	1.215	2676	48	2699	7.344
Comunidad Valenciana	0677	167	0700	9.779	1677	169	1700	10.119	2677	482	2700	58.238
País Vasco	0678	89	0701	9.692	1678	89	1701	9.914	2678	162	2701	31.874
<b>Total España</b>	0679	<b>4.181</b>	0702	<b>447.306</b>	1679	<b>4.246</b>	1702	<b>459.321</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>4.181</b>	0705	<b>447.306</b>	1682	<b>4.246</b>	1705	<b>459.321</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: 31/03/2022</b>
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK</b>

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 31/03/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				Situación inicial 05/12/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,89			1710	0,88			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: 31/03/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

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

**CUADRO A**

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2022			Situación cierre anual anterior 31/12/2021			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	93.246	251.763	2.700	97.417	263.027	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	431.763	1723	18.000	1724	443.027	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: 31/03/2022

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		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	0736	0737
ES0359092006	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,08	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
ES0359092014	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,15	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
ES0359092022	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,19	0,00	0	0	NO	251.763	0	0	251.763	0	0			
ES0359092030	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	0,00	0	0	NO	63.000	0	0	63.000	0	0			
ES0359092048	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	0,00	0	0	NO	67.500	0	0	67.500	0	0			
ES0359092055	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	0,00	0	0	NO	30.600	0	0	30.600	0	0			
ES0359092063	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,00	1,47	29	0	NO	18.900	0	0	18.929	0	0			
<b>Total</b>						0740	29	0741	0	0743	431.763	0744	0	0745	431.792	0746	0

	Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 05/12/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,06	0748	0,06	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: 31/03/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

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

**CUADRO C**

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2022								Situación periodo comparativo anterior 31/03/2021							
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	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	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	414.000	0	23.408
ES0359092014	SERIE A2	0	936.000	0	125.437	0	936.000	0	125.437	10.249	906.218	0	125.437	0	906.218	0	125.437
ES0359092022	SERIE A3	11.264	18.237	0	42.820	0	18.237	0	42.820	0	0	0	42.820	0	0	0	42.820
ES0359092030	SERIE B	0	0	0	10.352	0	0	0	10.352	0	0	0	0	0	0	0	10.352
ES0359092048	SERIE C	0	0	0	11.425	0	0	0	11.425	0	0	0	0	0	0	0	11.425
ES0359092055	SERIE D	0	0	0	5.985	0	0	0	5.985	0	0	0	0	0	0	0	5.985
ES0359092063	SERIE E	0	0	69	8.052	0	0	69	8.052	0	0	70	0	0	70	0	7.774
<b>Total</b>		0754	11.264	0755	1.368.237	0756	69	0757	227.479	1754	10.249	1755	1.320.218	1756	70	1757	227.201

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: 31/03/2022

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 31/03/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	Situación inicial 05/12/2006
				0760	0761	0762
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359092006	SERIE A1	12/12/2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092014	SERIE A2	29/09/2021	FCH	A+	A+	AAA
ES0359092014	SERIE A2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092014	SERIE A2	04/05/2018	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359092022	SERIE A3	29/09/2021	FCH	A+	A+	AAA
ES0359092022	SERIE A3	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359092022	SERIE A3	15/03/2021	SYP	AA+	AA+	AAA
ES0359092030	SERIE B	29/09/2021	FCH	A	A	AA
ES0359092030	SERIE B	27/11/2020	MDY	Aa2	Aa2	Aa1
ES0359092030	SERIE B	15/03/2021	SYP	AA	AA	AA
ES0359092048	SERIE C	29/09/2021	FCH	BB	BB	A
ES0359092048	SERIE C	27/11/2020	MDY	Ba1	Ba1	A1
ES0359092048	SERIE C	15/03/2021	SYP	A	A	A
ES0359092055	SERIE D	11/07/2019	FCH	B-	B-	BBB
ES0359092055	SERIE D	27/11/2020	MDY	Caa3	Caa3	Baa2
ES0359092055	SERIE D	15/03/2021	SYP	B+	B+	BBB
ES0359092063	SERIE E	18/03/2009	FCH	CC	CC	BB+
ES0359092063	SERIE E	11/09/2009	MDY	C	C	Ba1
ES0359092063	SERIE E	20/03/2013	SYP	D	D	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: 31/03/2022

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 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 05/12/2006	
Inferior a 1 año	0765	23.096	1765	22.529	2765	31.918
Entre 1 y 2 años	0766	27.145	1766	27.286	2766	36.413
Entre 2 y 3 años	0767	28.236	1767	28.346	2767	38.154
Entre 3 y 4 años	0768	29.329	1768	29.466	2768	39.979
Entre 4 y 5 años	0769	30.370	1769	30.515	2769	41.891
Entre 5 y 10 años	0770	293.586	1770	304.885	2770	241.519
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	1.370.127
<b>Total</b>	<b>0772</b>	<b>431.763</b>	<b>1772</b>	<b>443.027</b>	<b>2772</b>	<b>1.800.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>0773</b>	<b>8,76</b>	<b>1773</b>	<b>9,00</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: 31/03/2022**

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 05/12/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	8.259	1775	7.546	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	1,91	1777	1,70	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	58,31	1792	59,37	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: 31/03/2022

**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 31/03/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	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	-4.132	-4.132		
<b>Total</b>							0808 -4.132	0809 -4.132	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

**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 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 05/12/2006		Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		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: 31/03/2022

**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 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	725	7006	1.579	7009	0,17	7012	0,36	7015	0,27		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	725	7008	1.579	7011	0,17	7014	0,36	7017	0,27	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	65.379	7024	65.126	7027	13,37	7030	12,99	7033	13,09		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	598	7025	598	7028	0,12	7031	0,12	7034	0,12		
Total Fallidos					7023	65.976	7026	65.724	7029	13,49	7032	13,11	7035	13,21	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/03/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853



Denominación Fondo: MADRID RMBS II, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2022

**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	0,17	0,24	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	10,00	30,62	31,09	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	7,00	14,59	14,22	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	1,50	0,17	0,24	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	7,50	15,63	15,24	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359092048	10,00	30,62	31,09	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359092014	25,00	7,11	7,10	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A3 - ES0359092022	25,00	7,11	7,10	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	2,00	0,17	0,24	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359092030	10,00	30,62	31,09	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	2,40	4,38	4,27	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359092063	1,25	0,17	0,24	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	3,40	7,09	6,91	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359092006	25,00	7,11	7,10	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359092055	10,00	30,62	31,09	Nota de Valores 4.9.4
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series</b>	0855	0859	1859	2859
SERIE B - ES0359092030	18,30	7,13	7,10	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE C - ES0359092048	13,20	7,13	7,10	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE D - ES0359092055	9,40	7,13	7,10	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
SERIE E - ES0359092063	8,00	7,13	7,10	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
<b>No Reducción del Fondo de Reserva</b>	0856	0860	1860	2860
		1,91	1,70	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: 31/03/2022

**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	10	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: 31/03/2022

**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: 31/03/2022

**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	22/02/2022											
Saldo inicial	0886	7.546											
Cobros del periodo	0887	12.511											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-313											
Pagos por derivados	0889	-152											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-8.259											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-11.333											
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: 31/03/2022

**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**