

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 9724
NIF Fondo: V85981231
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2023

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

S.01

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	236.626	1001	258.406
I. Activos financieros a largo plazo	0002	236.626	1002	258.406
1. Activos titulizados	0003	235.967	1003	257.747
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	230.373	1005	255.632
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	5.604	1025	2.125
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-10	1027	-10
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	658	1029	658
2.1 Derivados de cobertura	0030	658	1030	658
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

S.01

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	48.501	1041	56.247
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	3.778	1042	4.498
V. Activos financieros a corto plazo	0043	13.438	1043	16.384
1. Activos titulizados	0044	12.395	1044	15.050
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	11.433	1046	14.584
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	425	1065	198
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	45	1066	17
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	457	1067	255
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	43	1068	5
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-10	1069	-10
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	814	1071	814
2.1 Derivados de cobertura	0072	814	1072	814
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	229	1074	520
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	229	1077	517
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	3
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	31.285	1085	35.366
1. Tesorería	0086	31.285	1086	35.366
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	285.127	1088	314.653

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	269.898	1089	297.526
I. Provisiones a largo plazo	0090	585	1090	663
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	585	1092	663
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	269.313	1094	296.863
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	116.422	1095	127.633
1.1 Series no subordinadas	0096	116.422	1096	127.633
1.2 Series subordinadas	0097	0	1097	0
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	152.891	1101	169.230
2.1 Préstamo subordinado	0102	31.223	1102	34.135
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	121.668	1104	135.095
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	0	1105	0
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	0	1108	0
3.1 Derivados de cobertura	0109	0	1109	0
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

S.01
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) PASIVO CORRIENTE	0117	13.274	1117	15.751
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118	0	1118	0
V. Provisiones a corto plazo	0119	0	1119	0
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	0
2. Provisión por margen de intermediación	0121	0	1121	0
3. Otras provisiones	0122	0	1122	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	13.200	1123	15.620
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	12.477	1124	15.182
1.1 Series no subordinadas	0125	11.891	1125	14.839
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	586	1128	343
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	723	1131	437
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	723	1136	437
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	0	1139	0
3.1 Derivados de cobertura	0140	0	1140	0
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
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	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	74	1148	131
1. Comisiones	0149	12	1149	11
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	8	1150	6
1.2 Comisión administrador	0151	3	1151	3
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	1	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	62	1157	120
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	1.954	1158	1.376
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	1.954	1160	1.376
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	285.127	1162	314.653

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	2.681	1201	688	2201	7.078	3201	1.121
1.1 Activos titulizados	0202	2.681	1202	688	2202	7.078	3202	1.121
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-2.971	1204	-375	2204	-7.579	3204	-446
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.326	1205	-136	2205	-3.372	3205	-145
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1.638	1206	-232	2206	-4.191	3206	-280
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-7	1207	-7	2207	-16	3207	-21
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	117	1208	111	2208	340	3208	389
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-172	1209	423	2209	-160	3209	1.065
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210	0	3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211	0	3211	0
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212	0	3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213	0	3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214	0	3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	49	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-70	1217	-65	2217	-314	3217	-243
7.1 Servicios exteriores	0218	-40	1218	-35	2218	-224	3218	-154
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-40	1219	-35	2219	-224	3219	-154
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	-30	1224	-30	2224	-90	3224	-90
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-20	1225	-18	2225	-59	3225	-54
7.3.2 Comisión administrador	0226	-7	1226	-8	2226	-21	3226	-23
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-3	1227	-4	2227	-10	3227	-12
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228	0	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	0	1231	0	2231	-12	3231	18
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	0	2232	-12	3232	18
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	14	1234	-358	2234	78	3234	-684
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	14	1236	-358	2236	78	3236	-684
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	179	1238	0	2238	408	3238	86
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	0	1239	0	2239	0	3239	-241
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-70	1300	627	2300	597	3300	117
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-39	1301	670	2301	691	3301	219
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	2.619	1302	633	2302	6.820	3302	1.057
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-1.285	1303	-20	2303	-3.129	3303	-20
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	215	1304	156	2304	918	3304	426
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	3305	0
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	-1.588	1307	-92	2307	-3.905	3307	-1.223
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	-7	2308	-13	3308	-21
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-31	1309	-43	2309	-95	3309	-102
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-21	1310	-31	2310	-63	3310	-67
2.2 Comisión administrador	0311	-7	1311	-8	2311	-21	3311	-24
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-3	1312	-4	2312	-11	3312	-12
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	0	1315	0	2315	0	3315	0
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-2.415	1322	-1.633	2322	-4.678	3322	-263
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	2.802	1325	4.422	2325	11.937	3325	8.740
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	2.484	1326	3.407	2326	8.265	3326	9.956
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	4.295	1327	2.874	2327	16.322	3327	7.593
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	99	1328	1.582	2328	383	3328	2.604
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	18
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	497	1330	0	2330	1.127	3330	275
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-4.572	1331	-3.441	2331	-14.160	3331	-11.707
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-5.218	1332	-6.055	2332	-16.615	3332	-9.002
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	-5.105	1334	-6.020	2334	-16.339	3334	-8.952
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-112	1336	-35	2336	-276	3336	-50
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-2.485	1337	-1.006	2337	-4.081	3337	-146
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	33.770	1338	34.507	2338	35.366	3338	33.647
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	31.285	1339	33.501	2339	31.285	3339	33.501

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	215	1357	156	2357	918	3357	426
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	215	1358	156	2358	918	3358	426
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	-117	1360	-111	2360	-340	3360	-389
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361	0	3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-97	1362	-45	2362	-578	3362	-36
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2023								Situación cierre anual anterior 31/12/2022								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	2,45	0401	6,00	0421	0,00	0441	8,19	1381	0,87	1401	5,48	1421	0,11	1441	4,66	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	6,00
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	51	0467	24	0474	29	0481	0	0488	52	0495	7.478	0502	0	0509	7.530
De 1 a 3 meses	0461	17	0468	18	0475	18	0482	0	0489	36	0496	2.338	0503	0	0510	2.374
De 3 a 6 meses	0462	15	0469	24	0476	21	0483	12	0490	58	0497	2.191	0504	0	0511	2.249
De 6 a 9 meses	0463	9	0470	28	0477	10	0484	16	0491	54	0498	1.389	0505	0	0512	1.443
De 9 a 12 meses	0464	5	0471	25	0478	6	0485	24	0492	55	0499	938	0506	0	0513	993
Más de 12 meses	0465	8	0472	133	0479	4	0486	70	0493	207	0500	1.101	0507	0	0514	1.308
Total	0466	105	0473	252	0480	88	0487	122	0494	462	0501	15.435	0508	0	1515	15.897

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	51	0522	24	0529	29	0536	0	0543	52	0550	7.478	0557	0	0564	7.530	0571	12.595	0578	12.595	0584	59,79
De 1 a 3 meses	0516	17	0523	18	0530	18	0537	0	0544	36	0551	2.338	0558	0	0565	2.374	0572	3.682	0579	3.682	0585	64,47
De 3 a 6 meses	0517	15	0524	24	0531	21	0538	12	0545	58	0552	2.191	0559	0	0566	2.249	0573	3.300	0580	3.300	0586	68,14
De 6 a 9 meses	0518	9	0525	28	0532	10	0539	16	0546	54	0553	1.389	0560	0	0567	1.443	0574	2.303	0581	2.303	0587	62,64
De 9 a 12 meses	0519	5	0526	25	0533	6	0540	24	0547	55	0554	938	0561	0	0568	993	0575	1.348	0582	1.348	0588	73,67
Más de 12 meses	0520	8	0527	133	0534	4	0541	70	0548	207	0555	1.101	0562	0	0569	1.308	0576	1.745	0583	1.745	0589	74,98
Total	0521	105	0528	252	0535	88	0542	122	0549	462	0556	15.435	0563	0	0570	15.897	0577	24.973			0590	63,66

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0600	47	1600	50	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	88	1601	81	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	337	1602	312	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	467	1603	207	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	464	1604	637	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	12.291	1605	11.879	2605	58
Superior a 10 años	0606	234.175	1606	259.431	2606	599.942
Total	0607	247.868	1607	272.597	2607	600.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	17,39	1608	17,99	2608	29,68

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 24/06/2010	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	16,54	1609	15,79	2609	3,22

MADRID RESIDENCIAL II -FTA

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2023
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 24/06/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	304	0630	17.794	1620	252	1630	15.659	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.063	0631	119.991	1621	1.091	1631	125.223	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	645	0632	95.300	1622	751	1632	113.271	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	71	0633	11.400	1623	92	1633	14.149	2623	2.918	2633	567.668
100% - 120%	0624	15	0634	1.328	1624	19	1634	1.796	2624	50	2634	5.203
120% - 140%	0625	9	0635	1.002	1625	7	1635	738	2625	62	2635	7.514
140% - 160%	0626	2	0636	279	1626	6	1636	813	2626	43	2636	5.469
superior al 160%	0627	5	0637	775	1627	6	1637	948	2627	90	2637	14.146
Total	0628	2.114	0638	247.868	1628	2.224	1638	272.597	2628	3.163	2638	600.000
Media ponderada (%)	0639	59,02	0649		1639	60,90	1649		2639	91,03	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 24/06/2010	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,08	1650	0,69	2650	2,03
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,15	1651	5,50	2651	6,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,00	1652	0,01	2652	1,43

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 24/06/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	239	0683	20.425	1660	251	1683	22.637	2660	351	2683	51.156
Aragón	0661	30	0684	2.984	1661	32	1684	3.317	2661	38	2684	5.717
Asturias	0662	37	0685	3.036	1662	38	1685	3.302	2662	50	2685	6.714
Baleares	0663	32	0686	3.943	1663	34	1686	4.386	2663	65	2686	12.923
Canarias	0664	38	0687	3.141	1664	38	1687	3.271	2664	60	2687	7.971
Cantabria	0665	35	0688	3.080	1665	37	1688	3.313	2665	45	2688	6.748
Castilla-León	0666	69	0689	5.603	1666	75	1689	6.212	2666	112	2689	16.110
Castilla La Mancha	0667	175	0690	15.223	1667	186	1690	16.729	2667	285	2690	42.443
Cataluña	0668	204	0691	25.661	1668	215	1691	28.589	2668	330	2691	63.316
Ceuta	0669	5	0692	393	1669	5	1692	405	2669	7	2692	900
Extremadura	0670	21	0693	1.285	1670	21	1693	1.336	2670	36	2693	4.120
Galicia	0671	88	0694	9.071	1671	96	1694	10.139	2671	126	2694	18.967
Madrid	0672	926	0695	131.942	1672	972	1695	144.678	2672	1.339	2695	305.733
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	14	0697	1.211	1674	15	1697	1.284	2674	23	2697	3.585
Navarra	0675	6	0698	511	1675	6	1698	550	2675	10	2698	1.875
La Rioja	0676	8	0699	729	1676	8	1699	754	2676	11	2699	1.834
Comunidad Valenciana	0677	155	0700	15.054	1677	161	1700	16.533	2677	234	2700	40.478
País Vasco	0678	32	0701	4.575	1678	34	1701	5.163	2678	41	2701	9.409
Total España	0679	2.114	0702	247.868	1679	2.224	1702	272.597	2679	3.163	2702	600.000
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	2.114	0705	247.868	1682	2.224	1705	272.597	2682	3.163	2705	600.000

MADRID RESIDENCIAL II -FTA

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2023
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 24/06/2010			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,91			1710	1,84			2710	1,46		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 24/06/2010					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0358969006	Bono A	4.560	28.139	128.313	4.560	31.244	142.473	4.560	100.000	456.000			
Total		0723	4.560	0724	128.313	1723	4.560	1724	142.473	2723	4.560	2724	456.000

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
			0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739						
ES0358969006	Bono A	NS	EURIBOR 3 m	0,40	4,22	586	0		SI	128.313		0		128.899	0			
Total						0740	586	0741	0		0743	128.313	0744	0	0745	128.899	0746	0

	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 24/06/2010	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	2,99	0748	0,56	0749	0,00

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2023								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2022							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0358969006	Bono A	4.572	327.687	1.285	25.221	3.441	310.157	20	21.797								
Total		0754	4.572	0755	327.687	0756	1.285	0757	25.221	1754	3.441	1755	310.157	1756	20	1757	21.797

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/09/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 24/06/2010
				0762	0763	0764
ES0358969006	Bono A	31/03/2021	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0358969006	Bono A	05/11/2012	SYP	A	A	AAA

MADRID RESIDENCIAL II -FTA

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0765	22.449	1765	31.640	2765	10.044
Entre 1 y 2 años	0766	37.815	1766	36.578	2766	12.488
Entre 2 y 3 años	0767	3.112	1767	3.606	2767	12.975
Entre 3 y 4 años	0768	3.249	1768	3.708	2768	13.480
Entre 4 y 5 años	0769	3.385	1769	3.815	2769	14.006
Entre 5 y 10 años	0770	18.677	1770	20.310	2770	78.664
Superior a 10 años	0771	39.627	1771	42.816	2771	314.344
Total	0772	128.313	1772	142.473	2772	456.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	12,41	1773	13,15	2773	29,41

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 24/06/2010	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	24.998	1775	28.413	2775	60.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	24.998	1776	28.413	2776	60.000
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	19,48	1777	19,94	2777	13,16
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	N	1791	N	2791	N
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	100,00	1792	100,00	2792	100,00
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 RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/09/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 24/06/2010	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap de Bases	CAIXABANK	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 + 0,246%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	1.472	1.472		
Total							0808 1.472	0809 1.472	0810	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 24/06/2010		Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 24/06/2010			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	4.235	7006	1.147	7009	1,73	7012	0,42	7015	1,40		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	4.235	7008	1.147	7011	1,73	7014	0,42	7017	1,40	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	12.350	7024	13.659	7027	4,79	7030	4,80	7033	4,74		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	168	7025	350	7028	0,07	7031	0,12	7034	0,06		
Total Fallidos					7023	12.518	7026	14.010	7029	4,85	7032	4,92	7035	4,81	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
Préstamo B	10,00	40,91	41,66	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	48,00	48,67	48,67	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	1,50	1,73	1,40	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	10,00	40,91	41,66	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	48,00	48,67	48,67	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	1,50	1,73	1,40	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Préstamo B	9,95	3,34	3,37	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		19,48	19,48	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



S.05.5

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862		2862	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados de Transmisión de Hipoteca en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,015	4862		5862	19	6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	CAIXABANK	1863		2863	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Préstamos Hipotecarios en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3863	0,010	4863		5863		6863	TRIMESTRAL	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	CAIXABANK	1864		2864	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3864	0,005	4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	CAIXABANK
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo Adicional 3.4.6.4.

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 RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo								Total	
		22/02/2023	22/05/2023	22/08/2023							
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885										
Saldo inicial	0886	27.757	26.723	25.889							
Cobros del periodo	0887	11.881	10.746	11.581							
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-38	-179	-136							
Pagos por derivados	0889	479	225	215							
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-26.723	-25.889	-24.998							
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-6.114	-5.319	-5.857							
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-7.242	-6.308	-6.693							
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0							
Saldo disponible	0894	0	0	0							
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	0							0

S.06

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

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