

**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: 31/03/2024

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

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

S.01

**Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA**

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 31/03/2024**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2024		Periodo anterior 31/12/2023
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	0	1001	0
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	0	1002	0
1. Activos titulizados	0003	0	1003	0
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	0	1005	0
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	0	1025	0
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	0	1027	0
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 RESIDENCIAL II -FTA**

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 31/03/2024**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2024		Periodo anterior 31/12/2023
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	266.789	1041	277.123
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042	3.438	1042	3.543
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	233.134	1043	240.398
1. Activos titulizados	0044	232.635	1044	239.868
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	224.399	1046	232.438
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	411	1065	432
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	38	1066	59
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	7.719	1067	6.891
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	77	1068	57
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	233	1071	233
2.1 Derivados de cobertura	0072	233	1072	233
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	267	1074	297
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	267	1077	297
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	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	30.217	1085	33.183
1. Tesorería	0086	30.217	1086	33.183
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	266.789	1088	277.123

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: 31/03/2024**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2024		Periodo anterior 31/12/2023
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	0	1089	204
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0090	0	1090	204
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	0	1092	204
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0094	0	1094	0
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	0	1095	0
1.1 Series no subordinadas	0096	0	1096	0
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	0	1101	0
2.1 Préstamo subordinado	0102	0	1102	0
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	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
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	0116	0	1116	0

**Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA**

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 31/03/2024**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2024		Periodo anterior 31/12/2023
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	266.616	1117	276.730
<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	266.536	1123	276.647
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	111.903	1124	122.264
1.1 Series no subordinadas	0125	111.392	1125	121.689
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	511	1128	575
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	154.057	1131	153.807
2.1 Préstamo subordinado	0132	31.223	1132	31.223
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133	0	1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134	121.668	1134	121.668
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	-88	1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	725	1136	747
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	529	1137	169
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	576	1139	576
3.1 Derivados de cobertura	0140	576	1140	576
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
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	0148	80	1148	82
1. Comisiones	0149	13	1149	12
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	8	1150	8
1.2 Comisión administrador	0151	3	1151	3
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	1152	1
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	67	1157	70
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158	173	1158	190
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159	0	1159	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	173	1160	190
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161	0	1161	0
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	266.789	1162	277.123

**Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA**

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 31/03/2024**

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2024		Acumulado anterior 31/03/2023
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	2.650	1201	2.012	2201	2.650	3201	2.012
1.1 Activos titulizados	0202	2.650	1202	2.012	2202	2.650	3202	2.012
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-3.033	1204	-2.031	2204	-3.033	3204	-2.031
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.292	1205	-896	2205	-1.292	3205	-896
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1.741	1206	-1.128	2206	-1.741	3206	-1.128
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	-7	2207	0	3207	-7
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0208	128	1208	132	2208	128	3208	132
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	-255	1209	112	2209	-255	3209	112
<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	4	2216	0	3216	4
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0217	-102	1217	-118	2217	-102	3217	-118
7.1 Servicios exteriores	0218	-72	1218	-86	2218	-72	3218	-86
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-72	1219	-86	2219	-72	3219	-86
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	-32	2224	-30	3224	-32
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-20	1225	-21	2225	-20	3225	-21
7.3.2 Comisión administrador	0226	-7	1226	-7	2226	-7	3226	-7
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-3	1227	-4	2227	-3	3227	-4
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	65	1231	-12	2231	65	3231	-12
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	65	1232	-12	2232	65	3232	-12
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	0234	204	1234	-41	2234	204	3234	-41
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	204	1236	-41	2236	204	3236	-41
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	54	2238	0	3238	54
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0239	88	1239	0	2239	88	3239	0
<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 RESIDENCIAL II -FTA**

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 31/03/2024**

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2024		Acumulado anterior 31/03/2023
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	-8	1300	479	2300	-8	3300	479
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	23	1301	511	2301	23	3301	511
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	2.671	1302	1.873	2302	2.671	3302	1.873
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-1.357	1303	-809	2303	-1.357	3303	-809
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	111	1304	479	2304	111	3304	479
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	-1.403	1307	-1.025	2307	-1.403	3307	-1.025
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	-7	2308	0	3308	-7
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	0309	-31	1309	-32	2309	-31	3309	-32
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-22	1310	-21	2310	-22	3310	-21
2.2 Comisión administrador	0311	-6	1311	-7	2311	-6	3311	-7
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-3	1312	-4	2312	-3	3312	-4
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>	0315	0	1315	0	2315	0	3315	0
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>	0322	-2.958	1322	-2.161	2322	-2.958	3322	-2.161
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b>	0325	-2.885	1325	4.145	2325	-2.885	3325	4.145
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	2.440	1326	3.208	2326	2.440	3326	3.208
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	4.608	1327	5.903	2327	4.608	3327	5.903
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	364	1328	169	2328	364	3328	169
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	170	2330	0	3330	170
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-10.297	1331	-5.305	2331	-10.297	3331	-5.305
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	0332	-73	1332	-6.306	2332	-73	3332	-6.306
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	-6.217	2334	0	3334	-6.217
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-73	1336	-89	2336	-73	3336	-89
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	0337	-2.966	1337	-1.682	2337	-2.966	3337	-1.682
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	33.183	1338	35.366	2338	33.183	3338	35.366
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	30.217	1339	33.684	2339	30.217	3339	33.684

**Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA**

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 31/03/2024**

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2024		Acumulado anterior 31/03/2023
<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	111	1357	479	2357	111	3357	479
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	111	1358	479	2358	111	3358	479
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	-128	1360	-132	2360	-128	3360	-132
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	17	1362	-347	2362	17	3362	-347
<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 RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 31/03/2024								Situación cierre anual anterior 31/12/2023								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	3,33	0401	6,39	0421	0,00	0441	8,24	1381	2,88	1401	6,24	1421	0,00	1441	8,46	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	
Prestamos 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 RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO B**

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	40	0467	20	0474	21	0481	0	0488	40	0495	5.382	0502	0	0509	5.422
De 1 a 3 meses	0461	13	0468	15	0475	18	0482	0	0489	33	0496	2.005	0503	0	0510	2.039
De 3 a 6 meses	0462	14	0469	27	0476	28	0483	15	0490	70	0497	2.143	0504	0	0511	2.214
De 6 a 9 meses	0463	10	0470	32	0477	15	0484	23	0491	71	0498	1.436	0505	0	0512	1.507
De 9 a 12 meses	0464	11	0471	56	0478	20	0485	43	0492	119	0499	1.543	0506	0	0513	1.662
Más de 12 meses	0465	15	0472	194	0479	15	0486	147	0493	355	0500	2.287	0507	0	0514	2.642
<b>Total</b>	0466	<b>103</b>	0473	<b>344</b>	0480	<b>116</b>	0487	<b>228</b>	0494	<b>688</b>	0501	<b>14.797</b>	0508	<b>0</b>	1515	<b>15.486</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	40	0522	20	0529	21	0536	0	0543	40	0550	5.382	0557	0	0564	5.422	0571	9.816	0578	9.816	0584	55,24
De 1 a 3 meses	0516	13	0523	15	0530	18	0537	0	0544	33	0551	2.005	0558	0	0565	2.039	0572	2.995	0579	2.995	0585	68,06
De 3 a 6 meses	0517	14	0524	27	0531	28	0538	15	0545	70	0552	2.143	0559	0	0566	2.214	0573	3.159	0580	3.159	0586	70,07
De 6 a 9 meses	0518	10	0525	32	0532	15	0539	23	0546	71	0553	1.436	0560	0	0567	1.507	0574	2.376	0581	2.376	0587	63,40
De 9 a 12 meses	0519	11	0526	56	0533	20	0540	43	0547	119	0554	1.543	0561	0	0568	1.662	0575	2.803	0582	2.803	0588	59,29
Más de 12 meses	0520	15	0527	194	0534	15	0541	147	0548	355	0555	2.287	0562	0	0569	2.642	0576	3.557	0583	3.557	0589	74,28
<b>Total</b>	0521	<b>103</b>	0528	<b>344</b>	0535	<b>116</b>	0542	<b>228</b>	0549	<b>688</b>	0556	<b>14.797</b>	0563	<b>0</b>	0570	<b>15.486</b>	0577	<b>24.707</b>			0590	<b>62,68</b>

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: 31/03/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO C**

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0600	63	1600	41	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	242	1601	181	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	271	1602	200	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	411	1603	436	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	933	1604	681	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	12.033	1605	12.629	2605	58
Superior a 10 años	0606	218.167	1606	225.162	2606	599.942
<b>Total</b>	0607	<b>232.118</b>	1607	<b>239.330</b>	2607	<b>600.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	0608	<b>16,99</b>	1608	<b>17,20</b>	2608	<b>29,68</b>

Antigüedad	Situación actual 31/03/2024					
	Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 24/06/2010			
Antigüedad media ponderada (años)	0609	17,03	1609	16,78	2609	3,22

**MADRID RESIDENCIAL II -FTA**

<b>S.05.1</b>
<b>Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL 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: 31/03/2024</b>
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK</b>

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO D**

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/03/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 24/06/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	324	0630	18.766	1620	322	1630	18.916	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.074	0631	119.456	1621	1.066	1631	118.632	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	551	0632	80.790	1622	600	1632	88.309	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	67	0633	10.264	1623	64	1633	10.290	2623	2.918	2633	567.668
100% - 120%	0624	10	0634	922	1624	13	1634	1.151	2624	50	2634	5.203
120% - 140%	0625	8	0635	884	1625	9	1635	989	2625	62	2635	7.514
140% - 160%	0626	2	0636	271	1626	2	1636	275	2626	43	2636	5.469
superior al 160%	0627	5	0637	764	1627	5	1637	769	2627	90	2637	14.146
<b>Total</b>	0628	<b>2.041</b>	0638	<b>232.118</b>	1628	<b>2.081</b>	1638	<b>239.330</b>	2628	<b>3.163</b>	2638	<b>600.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>	0639	<b>57,81</b>	0649		1639	<b>58,35</b>	1649		2639	<b>91,03</b>	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: 31/03/2024**

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

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 24/06/2010	
Tipo de interés medio ponderado	0650	4,28	1650	3,84	2650	2,03
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,50	1651	6,50	2651	6,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,00	1652	1,00	2652	1,43

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: 31/03/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO F**

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/03/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 24/06/2010			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	227	0683	18.879	1660	234	1683	19.671	2660	351	2683	51.156
Aragón	0661	30	0684	2.902	1661	30	1684	2.948	2661	38	2684	5.717
Asturias	0662	37	0685	2.963	1662	37	1685	3.003	2662	50	2685	6.714
Baleares	0663	32	0686	3.747	1663	32	1686	3.804	2663	65	2686	12.923
Canarias	0664	37	0687	2.994	1664	37	1687	3.035	2664	60	2687	7.971
Cantabria	0665	33	0688	2.882	1665	34	1688	2.918	2665	45	2688	6.748
Castilla-León	0666	66	0689	5.289	1666	69	1689	5.509	2666	112	2689	16.110
Castilla La Mancha	0667	173	0690	14.334	1667	174	1690	14.689	2667	285	2690	42.443
Cataluña	0668	192	0691	23.295	1668	197	1691	24.364	2668	330	2691	63.316
Ceuta	0669	5	0692	386	1669	5	1692	389	2669	7	2692	900
Extremadura	0670	18	0693	999	1670	20	1693	1.212	2670	36	2693	4.120
Galicia	0671	85	0694	8.537	1671	85	1694	8.617	2671	126	2694	18.967
Madrid	0672	901	0695	124.124	1672	914	1695	127.651	2672	1.339	2695	305.733
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	13	0697	1.066	1674	13	1697	1.083	2674	23	2697	3.585
Navarra	0675	5	0698	472	1675	6	1698	493	2675	10	2698	1.875
La Rioja	0676	8	0699	690	1676	8	1699	696	2676	11	2699	1.834
Comunidad Valenciana	0677	149	0700	14.312	1677	154	1700	14.711	2677	234	2700	40.478
País Vasco	0678	30	0701	4.248	1678	32	1701	4.536	2678	41	2701	9.409
<b>Total España</b>	0679	<b>2.041</b>	0702	<b>232.118</b>	1679	<b>2.081</b>	1702	<b>239.330</b>	2679	<b>3.163</b>	2702	<b>600.000</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>2.041</b>	0705	<b>232.118</b>	1682	<b>2.081</b>	1705	<b>239.330</b>	2682	<b>3.163</b>	2705	<b>600.000</b>

<b>S.05.1</b>
<b>Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL 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: 31/03/2024</b>
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK</b>

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 31/03/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 24/06/2010			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,90			1710	1,85			2710	1,46		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

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: 31/03/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

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

**CUADRO A**

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2024			Situación cierre anual anterior 31/12/2023			Situación inicial 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	24.428	111.392	4.560	26.686	121.689	4.560	100.000	456.000			
<b>Total</b>		0723	4.560	0724	111.392	1723	4.560	1724	121.689	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: 31/03/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

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

**CUADRO B**

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas				
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados		Intereses impagados		Serie devenga Intereses en el periodo		Principal no vencido		Principal impagado		0738	0739		
			0731	0732	0733	0734		0735		0742		0736		0737					
ES0358969006	Bono A	NS	EURIBOR 3 m	0,40	4,34	511		0		SI		111.392		0		111.903		0	
<b>Total</b>						0740	511	0741	0		0743	111.392	0744	0	0745	111.903	0746	0	

	Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 24/06/2010	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	4,05	0748	3,65	0749	0,00

**MADRID RESIDENCIAL II -FTA**

<b>S.05.2</b>
<b>Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL 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>Periodo de la declaración: 31/03/2024</b>
<b>Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF</b>

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

**CUADRO C**

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2024								Situación periodo comparativo anterior 31/03/2023							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0358969006	Bono A	10.297	344.608	1.357	27.960	5.305	318.832	809	22.900								
<b>Total</b>		0754	10.297	0755	344.608	0756	1.357	0757	27.960	1754	5.305	1755	318.832	1756	809	1757	22.900

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: 31/03/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

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

**CUADRO D**

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 31/03/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 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

<b>S.05.2</b>
<b>Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL 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>Periodo de la declaración: 31/03/2024</b>
<b>Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF</b>

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

**CUADRO E**

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0765	111.392	1765	54.714	2765	10.044
Entre 1 y 2 años	0766	0	1766	59.932	2766	12.488
Entre 2 y 3 años	0767	0	1767	6.049	2767	12.975
Entre 3 y 4 años	0768	0	1768	994	2768	13.480
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769	0	2769	14.006
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770	0	2770	78.664
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	314.344
<b>Total</b>	<b>0772</b>	<b>111.392</b>	<b>1772</b>	<b>121.689</b>	<b>2772</b>	<b>456.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>0773</b>	<b>0,07</b>	<b>1773</b>	<b>12,15</b>	<b>2773</b>	<b>29,41</b>

**Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA**

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 31/03/2024**

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 24/06/2010	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	24.449	1775	24.998	2775	60.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	24.998	1776	24.998	2776	60.000
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	21,95	1777	20,54	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: 31/03/2024

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO B**

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 31/03/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 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	-343	-343		
<b>Total</b>							0808 -343	0809 -343	0810	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2024

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO B**

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 24/06/2010		Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		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			
<b>Total</b>	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

S.05.4

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2024

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

**CUADRO A**

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	4.579	7006	4.030	7009	2,00	7012	1,71	7015	2,04		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	4.579	7008	4.030	7011	2,00	7014	1,71	7017	2,04	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	13.047	7024	12.925	7027	5,40	7030	5,19	7033	5,20		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	179	7025	168	7028	0,07	7031	0,07	7034	0,07		
Total Fallidos					7023	13.226	7026	13.093	7029	5,47	7032	5,25	7035	5,27	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/03/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		
	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: 31/03/2024

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

**CUADRO B**

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
<b>Amortización secuencial: series</b>	0854	0858	1858	2858
Bono A - ES0358969006	1,50	2,00	2,04	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	48,00	52,20	50,00	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	10,00	38,08	38,84	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	48,00	52,20	50,00	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	10,00	38,08	38,84	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	1,50	2,00	2,04	Nota de Valores 4.9.4
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series</b>	0855	0859	1859	2859
Préstamo B	9,95	3,49	3,43	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
<b>No Reducción del Fondo de Reserva</b>	0856	0860	1860	2860
		21,95	20,54	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

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: 31/03/2024

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO A**

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862		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	20	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	

<b>S.05.5</b>
<b>Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL 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: 31/03/2024</b>

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

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

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

<b>S.05.5</b>
<b>Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL 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: 31/03/2024</b>

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total		
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885	22/02/2024												
Saldo inicial	0886	24.998												
Cobros del periodo	0887	12.480												
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-83												
Pagos por derivados	0889	111												
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-24.449												
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-11.653												
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-1.403												
Resto pagos/retenciones	0893	0												
Saldo disponible	0894	0												
Liquidación de comisión variable	0895	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: 31/03/2024

**NOTAS EXPLICATIVAS**



**INFORME DE AUDITOR**

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