

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: 30/06/2023

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)

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	243.008	1001	258.406
I. Activos financieros a largo plazo	0002	243.008	1002	258.406
1. Activos titulizados	0003	242.350	1003	257.747
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	238.034	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	4.326	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

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	51.743	1041	56.247
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	4.095	1042	4.498
V. Activos financieros a corto plazo	0043	13.878	1043	16.384
1. Activos titulizados	0044	12.885	1044	15.050
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	12.055	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	387	1065	198
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	36	1066	17
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	388	1067	255
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	28	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	179	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	172	1077	517
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	7	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	33.770	1085	35.366
1. Tesorería	0086	33.770	1086	35.366
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	294.751	1088	314.653

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: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	279.037	1089	297.526
I. Provisiones a largo plazo	0090	599	1090	663
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	599	1092	663
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	278.438	1094	296.863
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	120.442	1095	127.633
1.1 Series no subordinadas	0096	120.442	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	157.996	1101	169.230
2.1 Préstamo subordinado	0102	31.993	1102	34.135
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	126.004	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: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) PASIVO CORRIENTE	0117	13.858	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	13.661	1123	15.620
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	12.988	1124	15.182
1.1 Series no subordinadas	0125	12.443	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	545	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	673	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	673	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	196	1148	131
1. Comisiones	0149	11	1149	11
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	7	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	185	1157	120
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	1.857	1158	1.376
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	1.857	1160	1.376
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	294.751	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: 30/06/2023

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2023		Acumulado anterior 30/06/2022
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	2.385	1201	260	2201	4.397	3201	434
1.1 Activos titulizados	0202	2.385	1202	260	2202	4.397	3202	434
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-2.577	1204	-59	2204	-4.608	3204	-70
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.150	1205	-8	2205	-2.046	3205	-8
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1.425	1206	-44	2206	-2.553	3206	-49
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-2	1207	-7	2207	-9	3207	-14
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	91	1208	142	2208	223	3208	278
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-101	1209	342	2209	12	3209	642
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	77	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-256	1217	-74	2217	-292	3217	-178
7.1 Servicios exteriores	0218	-228	1218	-43	2218	-232	3218	-118
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-228	1219	-43	2219	-232	3219	-118
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-28	1224	-30	2224	-60	3224	-60
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-17	1225	-18	2225	-38	3225	-36
7.3.2 Comisión administrador	0226	-7	1226	-8	2226	-14	3226	-16
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-3	1227	-4	2227	-7	3227	-8
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	105	1234	-268	2234	64	3234	-326
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	105	1236	-268	2236	64	3236	-326
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	174	1238	0	2238	228	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: 30/06/2023

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2023		Acumulado anterior 30/06/2022
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	188	1300	53	2300	667	3300	-511
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	219	1301	83	2301	730	3301	-451
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	2.327	1302	252	2302	4.200	3302	423
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-1.036	1303	0	2303	-1.844	3303	0
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	225	1304	141	2304	704	3304	270
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	-1.291	1307	-303	2307	-2.317	3307	-1.131
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-6	1308	-7	2308	-13	3308	-14
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-31	1309	-30	2309	-63	3309	-60
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-21	1310	-18	2310	-42	3310	-36
2.2 Comisión administrador	0311	-7	1311	-8	2311	-14	3311	-16
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-4	1312	-4	2312	-7	3312	-8
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	-101	1322	1.598	2322	-2.263	3322	1.371
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	4.990	1325	4.541	2325	9.134	3325	4.318
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	2.574	1326	3.286	2326	5.781	3326	6.549
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	6.124	1327	2.930	2327	12.027	3327	4.719
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	114	1328	903	2328	283	3328	1.023
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	461	1330	0	2330	631	3330	275
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-4.283	1331	-2.580	2331	-9.588	3331	-8.266
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-5.091	1332	-2.942	2332	-11.397	3332	-2.947
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	-5.016	1334	-2.932	2334	-11.234	3334	-2.932
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-74	1336	-10	2336	-163	3336	-15
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	86	1337	1.651	2337	-1.596	3337	860
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	33.684	1338	32.855	2338	35.366	3338	33.647
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	33.770	1339	34.507	2339	33.770	3339	34.507

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2023		Acumulado anterior 30/06/2022
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	225	1357	141	2357	704	3357	270
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	225	1358	141	2358	704	3358	270
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	-91	1360	-142	2360	-223	3360	-278
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	-134	1362	1	2362	-481	3362	8
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: 30/06/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2023								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	1,85	0401	5,84	0421	0,00	0441	7,47	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	

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: 30/06/2023

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	48	0467	24	0474	23	0481	0	0488	47	0495	7.125	0502	0	0509	7.172
De 1 a 3 meses	0461	18	0468	14	0475	15	0482	0	0489	29	0496	2.379	0503	0	0510	2.408
De 3 a 6 meses	0462	11	0469	20	0476	11	0483	6	0490	36	0497	1.586	0504	0	0511	1.623
De 6 a 9 meses	0463	9	0470	37	0477	11	0484	18	0491	66	0498	1.450	0505	0	0512	1.516
De 9 a 12 meses	0464	2	0471	12	0478	1	0485	8	0492	20	0499	304	0506	0	0513	324
Más de 12 meses	0465	7	0472	115	0479	3	0486	53	0493	172	0500	957	0507	0	0514	1.129
Total	0466	95	0473	221	0480	64	0487	85	0494	370	0501	13.803	0508	0	1515	14.172

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	48	0522	24	0529	23	0536	0	0543	47	0550	7.125	0557	0	0564	7.172	0571	12.016	0578	12.016	0584	59,69
De 1 a 3 meses	0516	18	0523	14	0530	15	0537	0	0544	29	0551	2.379	0558	0	0565	2.408	0572	3.589	0579	3.589	0585	67,09
De 3 a 6 meses	0517	11	0524	20	0531	11	0538	6	0545	36	0552	1.586	0559	0	0566	1.623	0573	2.466	0580	2.466	0586	65,80
De 6 a 9 meses	0518	9	0525	37	0532	11	0539	18	0546	66	0553	1.450	0560	0	0567	1.516	0574	2.371	0581	2.371	0587	63,96
De 9 a 12 meses	0519	2	0526	12	0533	1	0540	8	0547	20	0554	304	0561	0	0568	324	0575	477	0582	477	0588	67,96
Más de 12 meses	0520	7	0527	115	0534	3	0541	53	0548	172	0555	957	0562	0	0569	1.129	0576	1.515	0583	1.515	0589	74,53
Total	0521	95	0528	221	0535	64	0542	85	0549	370	0556	13.803	0563	0	0570	14.172	0577	22.434			0590	63,17

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: 30/06/2023

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 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0600	45	1600	50	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	148	1601	81	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	296	1602	312	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	466	1603	207	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	497	1604	637	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	12.279	1605	11.879	2605	58
Superior a 10 años	0606	241.073	1606	259.431	2606	599.942
Total	0607	254.803	1607	272.597	2607	600.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	17,56	1608	17,99	2608	29,68

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 24/06/2010	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	16,29	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: 30/06/2023
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 30/06/2023				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	290	0630	17.632	1620	252	1630	15.659	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.069	0631	120.604	1621	1.091	1631	125.223	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	676	0632	100.715	1622	751	1632	113.271	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	77	0633	12.165	1623	92	1633	14.149	2623	2.918	2633	567.668
100% - 120%	0624	16	0634	1.481	1624	19	1634	1.796	2624	50	2634	5.203
120% - 140%	0625	9	0635	1.016	1625	7	1635	738	2625	62	2635	7.514
140% - 160%	0626	3	0636	410	1626	6	1636	813	2626	43	2636	5.469
superior al 160%	0627	5	0637	781	1627	6	1637	948	2627	90	2637	14.146
Total	0628	2.145	0638	254.803	1628	2.224	1638	272.597	2628	3.163	2638	600.000
Media ponderada (%)	0639	59,58	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: 30/06/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 24/06/2010	
Tipo de interés medio ponderado	0650	2,19	1650	0,69	2650	2,03
Tipo de interés nominal máximo	0651	5,76	1651	5,50	2651	6,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,00	1652	0,01	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: 30/06/2023
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2023				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	242	0683	21.109	1660	251	1683	22.637	2660	351	2683	51.156
Aragón	0661	30	0684	3.030	1661	32	1684	3.317	2661	38	2684	5.717
Asturias	0662	37	0685	3.073	1662	38	1685	3.302	2662	50	2685	6.714
Baleares	0663	34	0686	4.167	1663	34	1686	4.386	2663	65	2686	12.923
Canarias	0664	38	0687	3.184	1664	38	1687	3.271	2664	60	2687	7.971
Cantabria	0665	35	0688	3.115	1665	37	1688	3.313	2665	45	2688	6.748
Castilla-León	0666	71	0689	5.861	1666	75	1689	6.212	2666	112	2689	16.110
Castilla La Mancha	0667	176	0690	15.451	1667	186	1690	16.729	2667	285	2690	42.443
Cataluña	0668	208	0691	26.428	1668	215	1691	28.589	2668	330	2691	63.316
Ceuta	0669	5	0692	397	1669	5	1692	405	2669	7	2692	900
Extremadura	0670	21	0693	1.302	1670	21	1693	1.336	2670	36	2693	4.120
Galicia	0671	89	0694	9.318	1671	96	1694	10.139	2671	126	2694	18.967
Madrid	0672	940	0695	135.726	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	15	0697	1.231	1674	15	1697	1.284	2674	23	2697	3.585
Navarra	0675	6	0698	532	1675	6	1698	550	2675	10	2698	1.875
La Rioja	0676	8	0699	737	1676	8	1699	754	2676	11	2699	1.834
Comunidad Valenciana	0677	157	0700	15.316	1677	161	1700	16.533	2677	234	2700	40.478
País Vasco	0678	33	0701	4.828	1678	34	1701	5.163	2678	41	2701	9.409
Total España	0679	2.145	0702	254.803	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	2.145	0705	254.803	1682	2.224	1705	272.597	2682	3.163	2705	600.000

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: 30/06/2023
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2023				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	1,95			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: 30/06/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 24/06/2010		
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722
ES0358969006	Bono A	4.560	29.141	132.885	4.560	31.244	142.473	4.560	100.000	456.000
Total		0723 4.560		0724 132.885	1723 4.560		1724 142.473	2723 4.560		2724 456.000

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: 30/06/2023

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		0738	0739			
			0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737								
ES0358969006	Bono A	NS	EURIBOR 3 m	0,40	3,78	545	0		SI	132.885		0		133.430	0			
Total						0740	545	0741	0		0743	132.885	0744	0	0745	133.430	0746	0

	Situación actual 30/06/2023		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	2,11	0748	0,56	0749	0,00

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: 30/06/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2023								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2022							
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	4.283	323.115	1.036	23.936	2.580	306.715	0	21.777								
Total		0754	4.283	0755	323.115	0756	1.036	0757	23.936	1754	2.580	1755	306.715	1756	0	1757	21.777

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: 30/06/2023

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 30/06/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 24/06/2010
				0760	0761	0762
ES0358969006	Bono A	31/03/2021	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0358969006	Bono A	05/11/2012	SYP	A	A	AAA

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: 30/06/2023

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 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0765	36.964	1765	31.640	2765	10.044
Entre 1 y 2 años	0766	28.221	1766	36.578	2766	12.488
Entre 2 y 3 años	0767	3.089	1767	3.606	2767	12.975
Entre 3 y 4 años	0768	3.214	1768	3.708	2768	13.480
Entre 4 y 5 años	0769	3.345	1769	3.815	2769	14.006
Entre 5 y 10 años	0770	19.177	1770	20.310	2770	78.664
Superior a 10 años	0771	38.875	1771	42.816	2771	314.344
Total	0772	132.885	1772	142.473	2772	456.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	12,66	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: 30/06/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2023		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	25.889	1775	28.413	2775	60.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	25.889	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: 30/06/2023

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 30/06/2023	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: 30/06/2023

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 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 24/06/2010		Situación actual 30/06/2023		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: 30/06/2023

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 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación actual 30/06/2023		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	3.041	7006	1.147	7009	1,20	7012	0,42	7015	0,76		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	3.041	7008	1.147	7011	1,20	7014	0,42	7017	0,76	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	13.038	7024	13.659	7027	4,91	7030	4,80	7033	4,85		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	168	7025	350	7028	0,06	7031	0,12	7034	0,06		
Total Fallidos					7023	13.206	7026	14.010	7029	4,97	7032	4,92	7035	4,91	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2023		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: 30/06/2023

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	48,00	48,67	48,67	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	10,00	42,09	43,15	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	48,00	48,67	48,67	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	1,50	1,20	0,76	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	1,50	1,20	0,76	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	10,00	42,09	43,15	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Préstamo B	9,95	3,40	3,41	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



Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

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	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

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	Integrado en el pago de los intereses de los bonistas
Contrapartida	0870	Bonista
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Cláusula 13.4 Intereses de los Bonos Iniciales

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														

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: 30/06/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total		
		22/02/2023	22/05/2023											
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885													
Saldo inicial	0886	27.757	26.723											
Cobros del periodo	0887	11.881	10.746											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-38	-179											
Pagos por derivados	0889	479	225											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-26.723	-25.889											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-6.114	-5.319											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-7.242	-6.308											
Resto pagos/retenciones	0893	0	0											
Saldo disponible	0894	0	0											
Liquidación de comisión variable	0895	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: 30/06/2023

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