

**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: 31/12/2023

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

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

S.01

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

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 31/12/2023**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	0	1001	258.406
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	0	1002	258.406
1. Activos titulizados	0003	0	1003	257.747
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	0	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	0	1025	2.125
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	0	1027	-10
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	658
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	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
<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0039	0	1039	0
<b>III. Otros activos no corrientes</b>	0040	0	1040	0

S.01

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

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 31/12/2023**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	277.123	1041	56.247
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042	3.543	1042	4.498
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	240.398	1043	16.384
1. Activos titulizados	0044	239.868	1044	15.050
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	232.438	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	432	1065	198
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	59	1066	17
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	6.891	1067	255
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	57	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	233	1071	814
2.1 Derivados de cobertura	0072	233	1072	814
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	297	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	297	1077	517
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	3
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
<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	33.183	1085	35.366
1. Tesorería	0086	33.183	1086	35.366
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	277.123	1088	314.653

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

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 31/12/2023**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	204	1089	297.526
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0090	204	1090	663
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	204	1092	663
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0094	0	1094	296.863
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	0	1095	127.633
1.1 Series no subordinadas	0096	0	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	0	1101	169.230
2.1 Préstamo subordinado	0102	0	1102	34.135
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	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
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	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: 31/12/2023**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	276.730	1117	15.751
<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	276.647	1123	15.620
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	122.264	1124	15.182
1.1 Series no subordinadas	0125	121.689	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	575	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	153.807	1131	437
2.1 Préstamo subordinado	0132	31.223	1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133	0	1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134	121.668	1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	0	1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	747	1136	437
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	169	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	576	1139	0
3.1 Derivados de cobertura	0140	576	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
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	0148	82	1148	131
1. Comisiones	0149	12	1149	11
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	8	1150	6
1.2 Comisión administrador	0151	3	1151	3
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	1	1152	2
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	70	1157	120
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158	190	1158	1.376
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159	0	1159	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	190	1160	1.376
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161	0	1161	0
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	277.123	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: 31/12/2023**

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2023		Acumulado anterior 31/12/2022
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	2.744	1201	1.174	2201	9.822	3201	2.296
1.1 Activos titulizados	0202	2.744	1202	1.174	2202	9.822	3202	2.296
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-3.102	1204	-1.196	2204	-10.680	3204	-1.642
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.371	1205	-513	2205	-4.744	3205	-657
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1.730	1206	-677	2206	-5.921	3206	-957
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	-7	2207	-16	3207	-28
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0208	120	1208	244	2208	461	3208	633
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	-237	1209	222	2209	-397	3209	1.287
<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	-86	1217	-112	2217	-400	3217	-356
7.1 Servicios exteriores	0218	-51	1218	-77	2218	-275	3218	-231
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-51	1219	-77	2219	-275	3219	-231
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	-35	1224	-35	2224	-125	3224	-125
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-19	1225	-18	2225	-78	3225	-72
7.3.2 Comisión administrador	0226	-6	1226	-7	2226	-27	3226	-31
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-3	1227	-4	2227	-14	3227	-15
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	-6	1230	-6	2230	-6	3230	-7
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0231	-90	1231	-186	2231	-102	3231	-168
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-90	1232	-186	2232	-102	3232	-168
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	0234	381	1234	21	2234	459	3234	-663
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	381	1236	21	2236	459	3236	-663
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	32	1238	52	2238	440	3238	138
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0239	0	1239	0	2239	0	3239	-241
<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: 31/12/2023**

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2023		Acumulado anterior 31/12/2022
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	-70	1300	563	2300	527	3300	680
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	-39	1301	594	2301	653	3301	813
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	2.710	1302	1.062	2302	9.530	3302	2.119
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-1.382	1303	-295	2303	-4.511	3303	-314
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	171	1304	254	2304	1.089	3304	680
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	-1.537	1307	-420	2307	-5.442	3307	-1.643
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	-7	2308	-13	3308	-28
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	0309	-31	1309	-31	2309	-126	3309	-133
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-21	1310	-20	2310	-84	3310	-87
2.2 Comisión administrador	0311	-7	1311	-8	2311	-28	3311	-31
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-3	1312	-4	2312	-14	3312	-16
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	1.968	1322	1.302	2322	-2.710	3322	1.039
<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	2.014	1325	6.804	2325	13.951	3325	15.544
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	2.406	1326	2.772	2326	10.670	3326	12.728
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	5.862	1327	6.051	2327	22.184	3327	13.644
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	197	1328	1.084	2328	579	3328	3.688
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	174	1330	268	2330	1.301	3330	543
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-6.624	1331	-3.371	2331	-20.784	3331	-15.077
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	0332	-47	1332	-5.502	2332	-16.662	3332	-14.505
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	-5.443	2334	-16.339	3334	-14.395
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-47	1336	-60	2336	-323	3336	-110
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	0337	1.898	1337	1.865	2337	-2.183	3337	1.719
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	31.285	1338	33.501	2338	35.366	3338	33.647
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	33.183	1339	35.366	2339	33.183	3339	35.366

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

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 31/12/2023**

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2023		Acumulado anterior 31/12/2022
<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	-1.644	1357	-4.242	2357	-726	3357	-3.816
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-1.644	1358	-4.242	2358	-726	3358	-3.816
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	-120	1360	-244	2360	-461	3360	-633
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	1.765	1362	4.486	2362	1.187	3362	4.449
<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: 31/12/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2023								Situación cierre anual anterior 31/12/2022								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	2,88	0401	6,24	0421	0,00	0441	8,46	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: 31/12/2023

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	37	0467	21	0474	24	0481	0	0488	45	0495	5.180	0502	0	0509	5.225
De 1 a 3 meses	0461	21	0468	24	0475	34	0482	0	0489	58	0496	3.167	0503	0	0510	3.226
De 3 a 6 meses	0462	16	0469	27	0476	24	0483	13	0490	64	0497	2.397	0504	0	0511	2.461
De 6 a 9 meses	0463	11	0470	42	0477	17	0484	33	0491	91	0498	1.700	0505	0	0512	1.791
De 9 a 12 meses	0464	5	0471	22	0478	6	0485	17	0492	45	0499	619	0506	0	0513	664
Más de 12 meses	0465	12	0472	162	0479	10	0486	111	0493	284	0500	1.922	0507	0	0514	2.206
<b>Total</b>	<b>0466</b>	<b>102</b>	<b>0473</b>	<b>298</b>	<b>0480</b>	<b>115</b>	<b>0487</b>	<b>174</b>	<b>0494</b>	<b>588</b>	<b>0501</b>	<b>14.985</b>	<b>0508</b>	<b>0</b>	<b>1515</b>	<b>15.573</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	37	0522	21	0529	24	0536	0	0543	45	0550	5.180	0557	0	0564	5.225	0571	8.822	0578	8.822	0584	59,23
De 1 a 3 meses	0516	21	0523	24	0530	34	0537	0	0544	58	0551	3.167	0558	0	0565	3.226	0572	4.527	0579	4.527	0585	71,25
De 3 a 6 meses	0517	16	0524	27	0531	24	0538	13	0545	64	0552	2.397	0559	0	0566	2.461	0573	3.880	0580	3.880	0586	63,44
De 6 a 9 meses	0518	11	0525	42	0532	17	0539	33	0546	91	0553	1.700	0560	0	0567	1.791	0574	2.785	0581	2.785	0587	64,30
De 9 a 12 meses	0519	5	0526	22	0533	6	0540	17	0547	45	0554	619	0561	0	0568	664	0575	981	0582	981	0588	67,67
Más de 12 meses	0520	12	0527	162	0534	10	0541	111	0548	284	0555	1.922	0562	0	0569	2.206	0576	2.977	0583	2.977	0589	74,12
<b>Total</b>	<b>0521</b>	<b>102</b>	<b>0528</b>	<b>298</b>	<b>0535</b>	<b>115</b>	<b>0542</b>	<b>174</b>	<b>0549</b>	<b>588</b>	<b>0556</b>	<b>14.985</b>	<b>0563</b>	<b>0</b>	<b>0570</b>	<b>15.573</b>	<b>0577</b>	<b>23.972</b>			<b>0590</b>	<b>64,96</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: 31/12/2023

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 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0600	41	1600	50	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	181	1601	81	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	200	1602	312	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	436	1603	207	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	681	1604	637	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	12.629	1605	11.879	2605	58
Superior a 10 años	0606	225.162	1606	259.431	2606	599.942
<b>Total</b>	0607	<b>239.330</b>	1607	<b>272.597</b>	2607	<b>600.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	0608	<b>17,20</b>	1608	<b>17,99</b>	2608	<b>29,68</b>

Antigüedad	Situación actual 31/12/2023					
	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 24/06/2010	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	16,78	1609	15,79	2609	3,22

<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: 31/12/2023</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 31/12/2023				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	322	0630	18.916	1620	252	1630	15.659	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.066	0631	118.632	1621	1.091	1631	125.223	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	600	0632	88.309	1622	751	1632	113.271	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	64	0633	10.290	1623	92	1633	14.149	2623	2.918	2633	567.668
100% - 120%	0624	13	0634	1.151	1624	19	1634	1.796	2624	50	2634	5.203
120% - 140%	0625	9	0635	989	1625	7	1635	738	2625	62	2635	7.514
140% - 160%	0626	2	0636	275	1626	6	1636	813	2626	43	2636	5.469
superior al 160%	0627	5	0637	769	1627	6	1637	948	2627	90	2637	14.146
<b>Total</b>	0628	<b>2.081</b>	0638	<b>239.330</b>	1628	<b>2.224</b>	1638	<b>272.597</b>	2628	<b>3.163</b>	2638	<b>600.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>	0639	<b>58,35</b>	0649		1639	<b>60,90</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: 31/12/2023**

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

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 24/06/2010	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,84	1650	0,69	2650	2,03
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,50	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: 31/12/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO F**

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2023				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	234	0683	19.671	1660	251	1683	22.637	2660	351	2683	51.156
Aragón	0661	30	0684	2.948	1661	32	1684	3.317	2661	38	2684	5.717
Asturias	0662	37	0685	3.003	1662	38	1685	3.302	2662	50	2685	6.714
Baleares	0663	32	0686	3.804	1663	34	1686	4.386	2663	65	2686	12.923
Canarias	0664	37	0687	3.035	1664	38	1687	3.271	2664	60	2687	7.971
Cantabria	0665	34	0688	2.918	1665	37	1688	3.313	2665	45	2688	6.748
Castilla-León	0666	69	0689	5.509	1666	75	1689	6.212	2666	112	2689	16.110
Castilla La Mancha	0667	174	0690	14.689	1667	186	1690	16.729	2667	285	2690	42.443
Cataluña	0668	197	0691	24.364	1668	215	1691	28.589	2668	330	2691	63.316
Ceuta	0669	5	0692	389	1669	5	1692	405	2669	7	2692	900
Extremadura	0670	20	0693	1.212	1670	21	1693	1.336	2670	36	2693	4.120
Galicia	0671	85	0694	8.617	1671	96	1694	10.139	2671	126	2694	18.967
Madrid	0672	914	0695	127.651	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	13	0697	1.083	1674	15	1697	1.284	2674	23	2697	3.585
Navarra	0675	6	0698	493	1675	6	1698	550	2675	10	2698	1.875
La Rioja	0676	8	0699	696	1676	8	1699	754	2676	11	2699	1.834
Comunidad Valenciana	0677	154	0700	14.711	1677	161	1700	16.533	2677	234	2700	40.478
País Vasco	0678	32	0701	4.536	1678	34	1701	5.163	2678	41	2701	9.409
<b>Total España</b>	0679	<b>2.081</b>	0702	<b>239.330</b>	1679	<b>2.224</b>	1702	<b>272.597</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>2.081</b>	0705	<b>239.330</b>	1682	<b>2.224</b>	1705	<b>272.597</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: 31/12/2023</b>
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK</b>

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 31/12/2023				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	1,85			1710	1,84			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: 31/12/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

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

**CUADRO A**

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 24/06/2010					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0358969006	Bono A	4.560	26.686	121.689	4.560	31.244	142.473	4.560	100.000	456.000			
<b>Total</b>		0723	4.560	0724	121.689	1723	4.560	1724	142.473	2723	4.560	2724	456.000

<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: 31/12/2023</b>
<b>Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF</b>

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

**CUADRO B**

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
			0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739				
ES0358969006	Bono A	NS	EURIBOR 3 m	0,40	4,36	575	0		SI	121.689		0		122.264	0		
<b>Total</b>						0740	575	0741	0	0743	121.689	0744	0	0745	122.264	0746	0

	Situación actual 31/12/2023		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	3,65	0748	0,56	0749	0,00

<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: 31/12/2023</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 31/12/2023								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2022							
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	6.624	334.311	1.382	26.603	3.371	313.527	295	22.092								
<b>Total</b>		0754	6.624	0755	334.311	0756	1.382	0757	26.603	1754	3.371	1755	313.527	1756	295	1757	22.092

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: 31/12/2023

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 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 24/06/2010
				0762	0763	0764
ES0358969006	Bono A	31/03/2021	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0358969006	Bono A	05/11/2012	SYP	A	A	AAA

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: 31/12/2023

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 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0765	54.714	1765	31.640	2765	10.044
Entre 1 y 2 años	0766	59.932	1766	36.578	2766	12.488
Entre 2 y 3 años	0767	6.049	1767	3.606	2767	12.975
Entre 3 y 4 años	0768	994	1768	3.708	2768	13.480
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769	3.815	2769	14.006
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770	20.310	2770	78.664
Superior a 10 años	0771	0	1771	42.816	2771	314.344
<b>Total</b>	<b>0772</b>	<b>121.689</b>	<b>1772</b>	<b>142.473</b>	<b>2772</b>	<b>456.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>0773</b>	<b>12,15</b>	<b>1773</b>	<b>13,15</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: 31/12/2023**

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 24/06/2010	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	24.998	1775	28.413	2775	60.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	24.998	1776	28.413	2776	60.000
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	20,54	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: 31/12/2023

**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 31/12/2023	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	-343	1.472		
<b>Total</b>							0808 -343	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: 31/12/2023

**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 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 24/06/2010	Situación actual 31/12/2023	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		
<b>Total</b>	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: 31/12/2023

**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 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	4.030	7006	1.147	7009	1,71	7012	0,42	7015	1,92		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	4.030	7008	1.147	7011	1,71	7014	0,42	7017	1,92	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	12.925	7024	13.659	7027	5,19	7030	4,80	7033	4,83		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	168	7025	350	7028	0,07	7031	0,12	7034	0,07		
Total Fallidos					7023	13.093	7026	14.010	7029	5,25	7032	4,92	7035	4,89	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2023		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: 31/12/2023

**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	48,00	50,00	48,67	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	1,50	1,76	1,84	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	1,50	1,76	1,84	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	10,00	39,35	40,56	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	48,00	50,00	48,67	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	10,00	39,35	40,56	Nota de Valores 4.9.4
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series</b>	0855	0859	1859	2859
Préstamo B	9,95	3,46	3,34	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
<b>No Reducción del Fondo de Reserva</b>	0856	0860	1860	2860
		20,54	19,48	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: 31/12/2023

**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: 31/12/2023**

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

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

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

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: 31/12/2023**

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo					Total
		22/02/2023	22/05/2023	22/08/2023	22/11/2023		
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885						
Saldo inicial	0886	27.757	26.723	25.889	24.998		
Cobros del periodo	0887	11.881	10.746	11.581	9.463		
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-38	-179	-136	-91		
Pagos por derivados	0889	479	225	215	171		
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-26.723	-25.889	-24.998	-24.998		
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-6.114	-5.319	-5.857	-8.006		
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-7.242	-6.308	-6.693	-1.537		
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0	0		
Saldo disponible	0894	0	0	0	0		
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	0	0		0

S.06

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

**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**