

**MADRID RESIDENCIAL II - Fondo de Titulización de Activos****LIQUIDACION DEL PERIODO 22/05/23 - 22/08/23**

	Euros
<b>I. Situación al 22/05/23:</b>	<b>25.888.862,51</b>
Fondo de Reserva	25.888.862,51
<b>II. Fondos recibidos del emisor</b>	<b>11.580.890,64</b>
<b>Principal:</b>	
Según calendario hasta 31/07/23:	2.736.242,31
Amort. Anticipada hasta 31/07/23:	5.808.872,89
<b>Intereses:</b>	<b>2.452.675,44</b>
Ingresos por inmuebles	583.100,00
<b>III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):</b>	<b>37.469.753,15</b>
<b>IV. Total intereses de la reinversión:</b>	<b>0,00</b>
Intereses de la Cta. de Tesorería	0,00
<b>V. Recursos disponibles ( III + IV ):</b>	<b>37.469.753,15</b>
<b>VI. Gastos:</b>	<b>136.384,82</b>
<b>VII. Liquidación SWAP:</b>	<b>214.618,19</b>
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	2.157.811,09
Cantidad a Pagar por la Parte A (Caixabank):	2.372.429,28
<b>VIII. Pago a los Bonos:</b>	<b>5.856.681,60</b>
<b>Bono:</b>	
Intereses correspondientes al 22/08/23:	1.284.688,80
Retenciones practicadas a los bonos:	244.090,87
Amortización correspondiente al 22/08/23:	4.571.992,80
<b>Reinversión o devolución de las retenciones:</b>	<b>-244.090,87</b>
<b>IX. Saldo disponible ( V - VI + VII - VIII):</b>	<b>31.691.304,92</b>
<b>Distribución del saldo disponible:</b>	
Fondo de Reserva previo (22/05/23):	25.888.862,51
Aportación al Fondo de Reserva	-890.724,50
Intereses préstamo B. pagados	1.266.462,32
Amortización préstamo B.	4.335.252,16
Remuneración Préstamo Constitución FR	318.635,15
Intereses Crédito Subordinado	2.921,58
Amortización Préstamo Constitución FR	769.895,70
Amortización Crédito Subordinado	0,00
<b>Margen de Intermediación Financiera</b>	<b>0,00</b>
<b>Fondo de Reserva (22/08/23):</b>	<b>24.998.138,01</b>

Destinatarios: CNMV, AIAF

**Nº: 3115/23**

Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

<http://www.tda-sgft.com>

MADRID RESIDENCIAL IIIIq.trim\Ago23

## MADRID RESIDENCIAL II

### INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 22 de Agosto de 2023

Importes en euros

I. BONO A ES0358969006	Sobre 4560 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (1/07/2010):	456.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	132.885.012,00 €	29.141,45 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	1.284.688,80 €	281,73 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	4.571.992,80 €	1.002,63 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	128.313.019,20 €	28.138,82 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	28,138820%	28,138820%

### II. EL FONDO

Importes en euros

1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/07/23:	
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:	249.896.851,35 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:	11.751.877,77 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:	249.981.360,90 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:	20.241.990,00 €
2. Amortización del período 30/04/23 a 31/07/23:	8.545.115,20 €
a) Según calendario:	2.736.242,31 €
b) Amortización anticipada hasta 31/07/23:	5.808.872,89 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):	
b) Último año:	7,62%
c) Último semestre:	8,28%
d) Último trimestre:	8,68%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:	1,25%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 12 meses:	0,54%
6. Porcentaje de fallidos (1):	7,49%
7. Nivel de Impago (2):	1,40%

(1) Saldo pendiente de las participaciones hipotecarias fallidas según definición del Folleto de Emisión (retraso de 12 meses y otras causas), sobre el saldo pendiente total.

(2) Importe de principal de las Participaciones Hipotecarias no fallidas con morosidad superior a 90 días el último día del mes anterior a la Fecha de Pago en curso, sobre el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias.

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF



Nº: 3116/23

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

<http://www.tda-sgft.com>

MADRID RESIDENCIAL II\Infoinver.trim\Ago23 (Español)

**MADRID RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
**INFORMACIÓN CORRESPONDIENTE AL PERIODO: 22/05/23-22/08/23**
**I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO**

Fecha de Constitución del Fondo	29 de junio de 2010
Fecha Emisión Bonos	29 de junio de 2010
Fecha Final Amortización Pasivo: (7,62% TAA)	24 de febrero de 2031
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores de Certificados de Transmisión de Hipoteca	Caixabank (Bankia)
Agente de Pagos	Caixabank (Bankia)
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Standard & Poor's / Moody's Investors Service
Calificación	(M) Aa1 sf / (S&P) A sf

**II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO**

Nombre	Bonos de Titulización MADRID RESIDENCIAL II, FTA
Serie A:	
Código ISIN	ES0358969006
Nominal en circulación total (inicial)	456.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	128.313.019,20 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	28.138,82 Euros
Préstamo B:	
Importe Inicial	144.000.000,00 Euros
Importe vencido	4.335.252,16 Euros
Nominal pendiente de vencimiento	121.668.360,94 Euros
Nominal vencido y amortizado (pagado)	4.335.252,16 Euros
Intereses devengados en el periodo	1.266.462,32 Euros
Intereses devengados y no pagados	0,00 Euros

**III. INFORMACION INCLUIDA**

* Liquidación del Período:22/05/23-22/08/23
* Flujos de Caja del Período:22/05/23-22/08/23
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 22 de Agosto de 2023

**MADRID RESIDENCIAL II***Fondo de Titulización de Activos***FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/05/23 - 22/08/23**

<b>I. INVERSIONES/FINANCIACIONES</b>	<b>Euros</b>	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip.		4.571.992,80
Amortización Participaciones Hip.	8.545.115,20	
Amortización Ptmos. Subordinados		5.105.147,86
Ingresos por Inmuebles	583.100,00	
<b>II. INTERESES</b>		
Intereses pagados a los BTH		1.284.688,80
Intereses recibidos de las CTHs	2.452.675,44	
Intereses Ptmos. Subordinados		1.588.019,05
Intereses Inversiones Temporales	0,00	
<b>III. GASTOS</b>		
Comisiones Periódicas:		136.384,82
Neto SWAP	214.618,19	
Margen de Intermediación Financiera		0,00
<b>Total Ingresos/Pagos</b>	<b>11.795.508,83</b>	<b>12.686.233,33</b>
Saldo inicial 22/05/23	25.888.862,51	
A Inversiones Temporales		24.998.138,01
<b>Total</b>	<b>37.684.371,34</b>	<b>37.684.371,34</b>
Retenciones practicadas el 22/08/23	244.090,87	
Inversiones Temporales		244.090,87

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 3121/23**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

<http://www.tda-sgft.com>

MADRID RESIDENCIAL II\fluj.trim\Ago23