

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: 30/06/2022

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

S.01

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	281.437	1001	295.669
I. Activos financieros a largo plazo	0002	281.437	1002	295.669
1. Activos titulizados	0003	275.892	1003	290.124
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	271.894	1005	285.404
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	4.019	1025	4.741
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-21	1027	-21
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	5.545	1029	5.545
2.1 Derivados de cobertura	0030	5.545	1030	5.545
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

S.01

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	54.857	1041	52.235
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	4.909	1042	5.097
V. Activos financieros a corto plazo	0043	15.442	1043	13.491
1. Activos titulizados	0044	14.704	1044	12.932
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	13.761	1046	11.834
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	39	1065	27
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	3	1066	3
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	984	1067	1.150
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	12	1068	15
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-96	1069	-96
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	423	1071	423
2.1 Derivados de cobertura	0072	423	1072	423
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	315	1074	136
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	312	1077	133
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	3	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	34.507	1085	33.647
1. Tesorería	0086	34.507	1086	33.647
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	336.294	1088	347.903

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	315.557	1089	327.949
I. Provisiones a largo plazo	0090	326	1090	0
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	326	1092	0
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	315.231	1094	327.949
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	134.539	1095	144.566
1.1 Series no subordinadas	0096	134.539	1096	144.566
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	180.692	1101	183.383
2.1 Préstamo subordinado	0102	39.138	1102	39.625
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	141.554	1104	144.000
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	0	1105	-241
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: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
B) PASIVO CORRIENTE	0117	14.920	1117	14.128
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	14.795	1123	14.107
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	14.754	1124	12.984
1.1 Series no subordinadas	0125	14.746	1125	12.984
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	8	1128	0
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	41	1131	1.123
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	41	1136	3
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	1.120
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	125	1148	21
1. Comisiones	0149	11	1149	11
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	6	1150	6
1.2 Comisión administrador	0151	3	1151	3
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	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	114	1157	10
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	5.817	1158	5.826
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	5.817	1160	5.826
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	336.294	1162	347.903

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2022		Acumulado anterior 30/06/2021
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	260	1201	182	2201	434	3201	401
1.1 Activos titulizados	0202	260	1202	182	2202	434	3202	401
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-59	1204	-10	2204	-70	3204	-24
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-8	1205	0	2205	-8	3205	0
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-44	1206	-3	2206	-49	3206	-10
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-7	1207	-7	2207	-14	3207	-14
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	142	1208	147	2208	278	3208	247
A) MARGEN DE INTERESES	0209	342	1209	319	2209	642	3209	624
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	0	1216	4	2216	0	3216	10
7. Otros gastos de explotación	0217	-74	1217	-134	2217	-178	3217	-201
7.1 Servicios exteriores	0218	-43	1218	-104	2218	-118	3218	-141
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-43	1219	-104	2219	-118	3219	-141
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-30	1224	-30	2224	-60	3224	-60
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-18	1225	-17	2225	-36	3225	-34
7.3.2 Comisión administrador	0226	-8	1226	-8	2226	-16	3226	-17
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-4	1227	-4	2227	-8	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	18	3231	-49
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	0	2232	18	3232	-49
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	-268	1234	0	2234	-326	3234	0
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	-268	1236	0	2236	-326	3236	0
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	39	2238	86	3238	95
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	0	1239	-228	2239	-241	3239	-478
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: 30/06/2022

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2022		Acumulado anterior 30/06/2021
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	53	1300	219	2300	-511	3300	422
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	83	1301	245	2301	-451	3301	473
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	252	1302	189	2302	423	3302	428
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	0	1303	0	2303	0	3303	0
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	141	1304	118	2304	270	3304	122
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	-303	1307	-55	2307	-1.131	3307	-63
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-7	1308	-7	2308	-14	3308	-14
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-30	1309	-30	2309	-60	3309	-60
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-18	1310	-17	2310	-36	3310	-35
2.2 Comisión administrador	0311	-8	1311	-8	2311	-16	3311	-17
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-4	1312	-4	2312	-8	3312	-9
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	4	2315	0	3315	10
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	4	2321	0	3321	10
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	1.598	1322	-875	2322	1.371	3322	-966
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	4.541	1325	-774	2325	4.318	3325	-829
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	3.286	1326	3.784	2326	6.549	3326	6.567
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	2.930	1327	1.375	2327	4.719	3327	3.947
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	903	1328	132	2328	1.023	3328	280
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	18	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	90	2330	275	3330	289
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-2.580	1331	-6.156	2331	-8.266	3331	-11.911
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-2.942	1332	-100	2332	-2.947	3332	-137
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	-2.932	1334	0	2334	-2.932	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-10	1336	-100	2336	-15	3336	-137
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	1.651	1337	-656	2337	860	3337	-544
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	32.855	1338	34.054	2338	33.647	3338	33.942
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	34.507	1339	33.398	2339	34.507	3339	33.398

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2022		Acumulado anterior 30/06/2021
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	141	1357	118	2357	270	3357	122
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	141	1358	118	2358	270	3358	122
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	-142	1360	-147	2360	-278	3360	-247
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	1362	29	2362	8	3362	125
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: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2022								Situación cierre anual anterior 31/12/2021								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	1,72	0401	5,07	0421	0,11	0441	2,86	1381	1,94	1401	4,88	1421	0,00	1441	2,52	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: 30/06/2022

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	47	0467	28	0474	2	0481	0	0488	30	0495	7.548	0502	0	0509	7.577
De 1 a 3 meses	0461	5	0468	5	0475	1	0482	0	0489	6	0496	749	0503	0	0510	754
De 3 a 6 meses	0462	6	0469	13	0476	2	0483	1	0490	15	0497	657	0504	0	0511	673
De 6 a 9 meses	0463	4	0470	11	0477	0	0484	1	0491	12	0498	270	0505	0	0512	281
De 9 a 12 meses	0464	4	0471	29	0478	0	0485	0	0492	29	0499	515	0506	0	0513	545
Más de 12 meses	0465	25	0472	633	0479	10	0486	154	0493	796	0500	2.876	0507	0	0514	3.672
Total	0466	91	0473	718	0480	15	0487	155	0494	888	0501	12.615	0508	0	1515	13.502

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	47	0522	28	0529	2	0536	0	0543	30	0550	7.548	0557	0	0564	7.577	0571	11.906	0578	11.906	0584	63,64
De 1 a 3 meses	0516	5	0523	5	0530	1	0537	0	0544	6	0551	749	0558	0	0565	754	0572	1.033	0579	1.033	0585	73,06
De 3 a 6 meses	0517	6	0524	13	0531	2	0538	1	0545	15	0552	657	0559	0	0566	673	0573	1.019	0580	1.019	0586	66,01
De 6 a 9 meses	0518	4	0525	11	0532	0	0539	1	0546	12	0553	270	0560	0	0567	281	0574	494	0581	494	0587	56,93
De 9 a 12 meses	0519	4	0526	29	0533	0	0540	0	0547	29	0554	515	0561	0	0568	545	0575	1.009	0582	1.009	0588	54,01
Más de 12 meses	0520	25	0527	633	0534	10	0541	154	0548	796	0555	2.876	0562	0	0569	3.672	0576	4.914	0583	4.914	0589	74,72
Total	0521	91	0528	718	0535	15	0542	155	0549	888	0556	12.615	0563	0	0570	13.502	0577	20.374			0590	66,27

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: 30/06/2022

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 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0600	72	1600	72	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	116	1601	100	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	283	1602	115	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	392	1603	539	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	468	1604	384	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	11.996	1605	11.723	2605	58
Superior a 10 años	0606	277.332	1606	290.196	2606	599.942
Total	0607	290.659	1607	303.129	2607	600.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	18,41	1608	18,87	2608	29,68

Antigüedad	Situación actual 30/06/2022					
	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 24/06/2010	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	15,29	1609	14,80	2609	3,22

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: 30/06/2022

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 30/06/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				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	181	0630	10.768	1620	157	1630	9.406	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.096	0631	125.826	1621	1.008	1631	116.593	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	874	0632	132.232	1622	1.000	1632	151.125	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	106	0633	16.767	1623	126	1633	20.268	2623	2.918	2633	567.668
100% - 120%	0624	20	0634	1.875	1624	24	1634	2.238	2624	50	2634	5.203
120% - 140%	0625	11	0635	1.132	1625	11	1635	1.169	2625	62	2635	7.514
140% - 160%	0626	8	0636	1.092	1626	6	1636	785	2626	43	2636	5.469
superior al 160%	0627	6	0637	967	1627	10	1637	1.545	2627	90	2637	14.146
Total	0628	2.302	0638	290.659	1628	2.342	1638	303.129	2628	3.163	2638	600.000
Media ponderada (%)	0639	62,42	0649		1639	63,68	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: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 24/06/2010	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,25	1650	0,25	2650	2,03
Tipo de interés nominal máximo	0651	5,50	1651	5,50	2651	6,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,00	2652	1,43

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				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	261	0683	24.177	1660	263	1683	25.080	2660	351	2683	51.156
Aragón	0661	32	0684	3.402	1661	33	1684	3.545	2661	38	2684	5.717
Asturias	0662	39	0685	3.594	1662	40	1685	3.714	2662	50	2685	6.714
Baleares	0663	34	0686	4.564	1663	34	1686	4.672	2663	65	2686	12.923
Canarias	0664	40	0687	3.528	1664	40	1687	3.629	2664	60	2687	7.971
Cantabria	0665	37	0688	3.500	1665	37	1688	3.594	2665	45	2688	6.748
Castilla-León	0666	82	0689	7.012	1666	83	1689	7.275	2666	112	2689	16.110
Castilla La Mancha	0667	190	0690	17.673	1667	191	1690	18.266	2667	285	2690	42.443
Cataluña	0668	221	0691	30.414	1668	224	1691	31.371	2668	330	2691	63.316
Ceuta	0669	5	0692	417	1669	5	1692	428	2669	7	2692	900
Extremadura	0670	24	0693	1.675	1670	24	1693	1.720	2670	36	2693	4.120
Galicia	0671	99	0694	10.746	1671	100	1694	11.021	2671	126	2694	18.967
Madrid	0672	1.008	0695	154.148	1672	1.033	1695	161.590	2672	1.339	2695	305.733
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	15	0697	1.330	1674	15	1697	1.374	2674	23	2697	3.585
Navarra	0675	6	0698	590	1675	7	1698	721	2675	10	2698	1.875
La Rioja	0676	9	0699	873	1676	9	1699	893	2676	11	2699	1.834
Comunidad Valenciana	0677	166	0700	17.728	1677	170	1700	18.824	2677	234	2700	40.478
País Vasco	0678	34	0701	5.288	1678	34	1701	5.409	2678	41	2701	9.409
Total España	0679	2.302	0702	290.659	1679	2.342	1702	303.129	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	2.302	0705	290.659	1682	2.342	1705	303.129	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: 30/06/2022
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				Situación inicial 24/06/2010			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,77			1710	1,73			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: 30/06/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2022			Situación cierre anual anterior 31/12/2021			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	32.738	149.285	4.560	34.551	157.550	4.560	100.000	456.000			
Total		0723	4.560	0724	149.285	1723	4.560	1724	157.550	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: 30/06/2022
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas	
			0730	0731	0732	0733	0734		0735	0742	0736		0737		0738		0739
ES0358969006	Bono A	NS	EURIBOR 3 m	0,40	0,05	8	0		SI	149.285		0		149.293		0	
Total						0740	8	0741	0	0743	149.285	0744	0	0745	149.293	0746	0

	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 24/06/2010	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,01	0748	0,00	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: 30/06/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2022								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2021							
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	2.580	306.715	0	21.777	6.156	287.271	0	21.777	1754	6.156	1755	287.271	1756	0	1757	21.777
Total		0754	2.580	0755	306.715	0756	0	0757	21.777	1754	6.156	1755	287.271	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: 30/06/2022

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 30/06/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	Situación inicial 24/06/2010
				0762	0763	0764
ES0358969006	Bono A	31/03/2021	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0358969006	Bono A	05/11/2012	SYP	A	A	AAA

MADRID RESIDENCIAL II -FTA

S.05.2
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2022
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 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0765	37.729	1765	38.159	2765	10.044
Entre 1 y 2 años	0766	34.522	1766	40.124	2766	12.488
Entre 2 y 3 años	0767	4.313	1767	4.608	2767	12.975
Entre 3 y 4 años	0768	4.350	1768	5.158	2768	13.480
Entre 4 y 5 años	0769	4.376	1769	6.451	2769	14.006
Entre 5 y 10 años	0770	35.521	1770	34.718	2770	78.664
Superior a 10 años	0771	28.474	1771	28.332	2771	314.344
Total	0772	149.285	1772	157.550	2772	456.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	13,41	1773	15,46	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: 30/06/2022

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 24/06/2010	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	29.084	1775	30.000	2775	60.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	29.084	1776	30.000	2776	60.000
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	19,48	1777	19,04	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	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

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 30/06/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	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	5.968	5.968		
Total							0808 5.968	0809 5.968	0810	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

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 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 24/06/2010		Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		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: 30/06/2022

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 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	1.127	7006	1.225	7009	0,39	7012	0,41	7015	0,50		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.127	7008	1.225	7011	0,39	7014	0,41	7017	0,50	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	16.702	7024	17.748	7027	5,51	7030	5,62	7033	5,64		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	350	7025	350	7028	0,12	7031	0,11	7034	0,11		
Total Fallidos					7023	17.052	7026	18.098	7029	5,62	7032	5,73	7035	5,75	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		
	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: 30/06/2022

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	48,00	48,67	48,67	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	10,00	47,69	48,47	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	1,50	0,39	0,50	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	1,50	0,39	0,50	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	10,00	47,69	48,47	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Préstamo B	9,95	3,92	4,03	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		19,48	19,48	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



S.05.5

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

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	18	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: 30/06/2022

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

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

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: 30/06/2022

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total		
		22/02/2022	23/05/2022											
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885													
Saldo inicial	0886	30.000	29.586											
Cobros del periodo	0887	6.084	5.208											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-113	-37											
Pagos por derivados	0889	129	141											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-29.586	-29.084											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-5.686	-2.580											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-828	-3.235											
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: 30/06/2022

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