

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: 30/09/2021

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	301.826	1001	314.962
I. Activos financieros a largo plazo	0002	301.826	1002	314.962
1. Activos titulizados	0003	295.782	1003	308.918
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	291.827	1005	304.287
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	3.957	1025	4.633
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-2	1027	-2
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	6.044	1029	6.044
2.1 Derivados de cobertura	0030	6.044	1030	6.044
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	51.986	1041	56.594
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	5.246	1042	5.488
V. Activos financieros a corto plazo	0043	13.211	1043	17.164
1. Activos titulizados	0044	12.430	1044	16.531
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	11.611	1046	15.600
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	28	1065	53
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	4	1066	6
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	929	1067	1.010
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	12	1068	15
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-154	1069	-154
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	394	1071	394
2.1 Derivados de cobertura	0072	394	1072	394
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	387	1074	239
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	384	1077	236
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	33.529	1085	33.942
1. Tesorería	0086	33.529	1086	33.942
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	353.811	1088	371.556

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	333.697	1089	346.101
I. Provisiones a largo plazo	0090	0	1090	0
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	0	1092	0
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	333.697	1094	346.101
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	150.825	1095	164.030
1.1 Series no subordinadas	0096	150.825	1096	164.030
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	182.872	1101	182.071
2.1 Préstamo subordinado	0102	39.625	1102	39.625
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	144.000	1104	144.000
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-752	1105	-1.554
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: 30/09/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) PASIVO CORRIENTE	0117	13.829	1117	19.053
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118	0	1118	0
V. Provisiones a corto plazo	0119	0	1119	0
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	0
2. Provisión por margen de intermediación	0121	0	1121	0
3. Otras provisiones	0122	0	1122	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	13.780	1123	19.021
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	12.541	1124	16.610
1.1 Series no subordinadas	0125	12.541	1125	16.610
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	0	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	1.239	1131	2.411
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	3	1136	7
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	1.236	1137	2.403
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	49	1148	33
1. Comisiones	0149	11	1149	11
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	6	1150	6
1.2 Comisión administrador	0151	3	1151	4
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	39	1157	22
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	6.285	1158	6.402
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	6.285	1160	6.402
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	353.811	1162	371.556

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2021		Acumulado anterior 30/09/2020
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	252	1201	405	2201	653	3201	1.093
1.1 Activos titulizados	0202	252	1202	405	2202	653	3202	1.093
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-8	1204	-129	2204	-33	3204	-324
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	0	1205	-35	2205	0	3205	-60
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1	1206	-87	2206	-12	3206	-244
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-7	1207	-7	2207	-21	3207	-21
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	147	1208	57	2208	393	3208	305
A) MARGEN DE INTERESES	0209	390	1209	334	2209	1.014	3209	1.073
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	4	1216	4	2216	14	3216	12
7. Otros gastos de explotación	0217	-116	1217	-108	2217	-318	3217	-452
7.1 Servicios exteriores	0218	-87	1218	-78	2218	-228	3218	-361
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-87	1219	-78	2219	-228	3219	-361
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	-90	3224	-91
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-17	1225	-17	2225	-52	3225	-51
7.3.2 Comisión administrador	0226	-8	1226	-9	2226	-25	3226	-27
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-4	1227	-4	2227	-13	3227	-13
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	-82	2231	-49	3231	-304
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	-82	2232	-49	3232	-304
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234	0	2234	0	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	0	1236	0	2236	0	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	45	1238	10	2238	141	3238	63
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-323	1239	-159	2239	-802	3239	-391
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: 30/09/2021

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2021		Acumulado anterior 30/09/2020
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-741	1300	386	2300	-319	3300	902
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-715	1301	412	2301	-243	3301	982
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	258	1302	404	2302	685	3302	1.084
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	0	1303	-60	2303	0	3303	-60
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	155	1304	176	2304	277	3304	363
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	-1.121	1307	-102	2307	-1.184	3307	-385
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-7	1308	-7	2308	-21	3308	-21
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-29	1309	-30	2309	-90	3309	-91
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-17	1310	-17	2310	-52	3310	-51
2.2 Comisión administrador	0311	-8	1311	-9	2311	-25	3311	-27
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-4	1312	-4	2312	-13	3312	-13
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	4	1315	4	2315	14	3315	12
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	4	1321	4	2321	14	3321	12
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	872	1322	-393	2322	-94	3322	-2.347
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	946	1325	-313	2325	117	3325	-2.000
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	3.138	1326	3.028	2326	9.704	3326	9.918
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	1.889	1327	1.454	2327	5.835	3327	4.780
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.090	1328	27	2328	1.370	3328	408
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	193	1330	115	2330	482	3330	351
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-5.363	1331	-4.937	2331	-17.274	3331	-17.457
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-74	1332	-80	2332	-211	3332	-347
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	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-74	1336	-80	2336	-211	3336	-347
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	131	1337	-8	2337	-413	3337	-1.445
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	33.398	1338	33.334	2338	33.942	3338	34.772
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	33.529	1339	33.327	2339	33.529	3339	33.327

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2021		Acumulado anterior 30/09/2020
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	155	1357	176	2357	277	3357	363
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	155	1358	176	2358	277	3358	363
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	-147	1360	-57	2360	-393	3360	-305
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	-8	1362	-118	2362	117	3362	-58
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: 30/09/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2021								Situación cierre anual anterior 31/12/2020								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	1,58	0401	4,88	0421	0,00	0441	2,52	1381	1,73	1401	4,61	1421	0,00	1441	2,09	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: 30/09/2021

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	71	0467	36	0474	3	0481	0	0488	38	0495	10.219	0502	0	0509	10.257
De 1 a 3 meses	0461	11	0468	10	0475	1	0482	0	0489	11	0496	1.760	0503	0	0510	1.771
De 3 a 6 meses	0462	4	0469	6	0476	0	0483	0	0490	7	0497	358	0504	0	0511	365
De 6 a 9 meses	0463	1	0470	2	0477	0	0484	0	0491	2	0498	70	0505	0	0512	72
De 9 a 12 meses	0464	5	0471	34	0478	1	0485	3	0492	38	0499	923	0506	0	0513	961
Más de 12 meses	0465	27	0472	656	0479	10	0486	166	0493	832	0500	2.838	0507	0	0514	3.670
Total	0466	119	0473	743	0480	16	0487	169	0494	928	0501	16.169	0508	0	1515	17.097

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	71	0522	36	0529	3	0536	0	0543	38	0550	10.219	0557	0	0564	10.257	0571	15.766	0578	15.766	0584	65,06
De 1 a 3 meses	0516	11	0523	10	0530	1	0537	0	0544	11	0551	1.760	0558	0	0565	1.771	0572	2.534	0579	2.534	0585	69,91
De 3 a 6 meses	0517	4	0524	6	0531	0	0538	0	0545	7	0552	358	0559	0	0566	365	0573	560	0580	560	0586	65,08
De 6 a 9 meses	0518	1	0525	2	0532	0	0539	0	0546	2	0553	70	0560	0	0567	72	0574	121	0581	121	0587	59,73
De 9 a 12 meses	0519	5	0526	34	0533	1	0540	3	0547	38	0554	923	0561	0	0568	961	0575	1.491	0582	1.491	0588	64,44
Más de 12 meses	0520	27	0527	656	0534	10	0541	166	0548	832	0555	2.838	0562	0	0569	3.670	0576	4.835	0583	4.835	0589	75,91
Total	0521	119	0528	743	0535	16	0542	169	0549	928	0556	16.169	0563	0	0570	17.097	0577	25.306			0590	67,56

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: 30/09/2021

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 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0600	3	1600	12	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	90	1601	39	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	167	1602	151	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	418	1603	280	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	477	1604	670	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	11.569	1605	9.222	2605	58
Superior a 10 años	0606	295.601	1606	315.157	2606	599.942
Total	0607	308.325	1607	325.530	2607	600.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	19,10	1608	19,76	2608	29,68

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 24/06/2010	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	14,55	1609	13,80	2609	3,22

MADRID RESIDENCIAL II -FTA

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

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 30/09/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				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	148	0630	9.047	1620	127	1630	7.845	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	939	0631	109.050	1621	799	1631	90.916	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	1.082	0632	162.576	1622	1.268	1632	194.705	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	133	0633	21.674	1623	148	1633	24.768	2623	2.918	2633	567.668
100% - 120%	0624	26	0634	2.307	1624	31	1634	2.757	2624	50	2634	5.203
120% - 140%	0625	11	0635	1.201	1625	15	1635	1.716	2625	62	2635	7.514
140% - 160%	0626	7	0636	907	1626	10	1636	1.212	2626	43	2636	5.469
superior al 160%	0627	10	0637	1.562	1627	10	1637	1.610	2627	90	2637	14.146
Total	0628	2.356	0638	308.325	1628	2.408	1638	325.530	2628	3.163	2638	600.000
Media ponderada (%)	0639	64,27	0649		1639	66,12	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: 30/09/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 24/06/2010	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,31	1650	0,45	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

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: 30/09/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				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	265	0683	25.619	1660	267	1683	26.841	2660	351	2683	51.156
Aragón	0661	33	0684	3.589	1661	35	1684	3.772	2661	38	2684	5.717
Asturias	0662	40	0685	3.784	1662	41	1685	3.977	2662	50	2685	6.714
Baleares	0663	34	0686	4.727	1663	35	1686	5.019	2663	65	2686	12.923
Canarias	0664	40	0687	3.696	1664	43	1687	3.994	2664	60	2687	7.971
Cantabria	0665	38	0688	3.721	1665	40	1688	4.101	2665	45	2688	6.748
Castilla-León	0666	83	0689	7.393	1666	84	1689	7.775	2666	112	2689	16.110
Castilla La Mancha	0667	191	0690	18.533	1667	195	1690	19.624	2667	285	2690	42.443
Cataluña	0668	225	0691	31.848	1668	229	1691	33.730	2668	330	2691	63.316
Ceuta	0669	5	0692	433	1669	6	1692	496	2669	7	2692	900
Extremadura	0670	24	0693	1.746	1670	25	1693	1.880	2670	36	2693	4.120
Galicia	0671	100	0694	11.153	1671	101	1694	11.629	2671	126	2694	18.967
Madrid	0672	1.038	0695	164.071	1672	1.063	1695	173.121	2672	1.339	2695	305.733
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	15	0697	1.396	1674	15	1697	1.457	2674	23	2697	3.585
Navarra	0675	7	0698	751	1675	7	1698	782	2675	10	2698	1.875
La Rioja	0676	9	0699	902	1676	9	1699	920	2676	11	2699	1.834
Comunidad Valenciana	0677	174	0700	19.428	1677	178	1700	20.716	2677	234	2700	40.478
País Vasco	0678	35	0701	5.535	1678	35	1701	5.695	2678	41	2701	9.409
Total España	0679	2.356	0702	308.325	1679	2.408	1702	325.530	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	2.356	0705	308.325	1682	2.408	1705	325.530	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: 30/09/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 24/06/2010			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,71			1710	1,66			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: 30/09/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2021			Situación cierre anual anterior 31/12/2020			Situación inicial 24/06/2010		
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722
ES0358969006	Bono A	4.560	35.826	163.366	4.560	39.614	180.640	4.560	100.000	456.000
Total		0723 4.560		0724 163.366	1723 4.560		1724 180.640	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: 30/09/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados		Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		0738	0739		
						0730	0731			0732	0733	0734	0735			0736	0737
ES0358969006	Bono A	NS	EURIBOR 3 m	0,40	0,00	0	0	0	SI	163.366	0	0	0	163.366	0		
Total						0740	0	0741	0	0743	163.366	0744	0	0745	163.366	0746	0

	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 24/06/2010	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,00	0748	0,03	0749	0,00

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: 30/09/2021
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2021								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2020							
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	1750	1751	1752	1753								
ES0358969006	Bono A	5.363	292.634	0	21.777	4.937	270.352	60	21.777								
Total		0754	5.363	0755	292.634	0756	0	0757	21.777	1754	4.937	1755	270.352	1756	60	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: 30/09/2021

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 30/09/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 24/06/2010
				0760	0761	0762
ES0358969006	Bono A	31/03/2021	MDY	Aa1	Aa2	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: 30/09/2021

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 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 24/06/2010	
Inferior a 1 año	0765	32.657	1765	53.360	2765	10.044
Entre 1 y 2 años	0766	48.653	1766	41.789	2766	12.488
Entre 2 y 3 años	0767	4.715	1767	4.713	2767	12.975
Entre 3 y 4 años	0768	4.715	1768	4.707	2768	13.480
Entre 4 y 5 años	0769	6.628	1769	4.708	2769	14.006
Entre 5 y 10 años	0770	34.094	1770	34.207	2770	78.664
Superior a 10 años	0771	31.904	1771	37.156	2771	314.344
Total	0772	163.366	1772	180.640	2772	456.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	15,71	1773	16,73	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: 30/09/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 24/06/2010	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	30.000	1775	30.000	2775	60.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	30.000	1776	30.000	2776	60.000
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	18,36	1777	16,61	2777	13,16
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	CaixaBank	1778	Bankia	2778	Caja Madrid
1.4 Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781		1781		2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782		1782		2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784		1784		2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786		1786		2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787		1787		2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788		1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	N	1791	N	2791	N
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	100,00	1792	100,00	2792	100,00
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

S.05.3

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

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 30/09/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	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	6.438	6.438		
Total							0808 6.438	0809 6.438	0810	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

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 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 24/06/2010		Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		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: 30/09/2021

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 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	1.179	7006	1.276	7009	0,39	7012	0,40	7015	0,37		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.179	7008	1.276	7011	0,39	7014	0,40	7017	0,37	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	17.360	7024	18.918	7027	5,40	7030	5,57	7033	5,45		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	350	7025	266	7028	0,11	7031	0,08	7034	0,11		
Total Fallidos					7023	17.710	7026	19.185	7029	5,51	7032	5,65	7035	5,56	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL II -FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

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	1,50	0,39	0,37	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	48,00	46,85	46,05	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	10,00	50,65	51,23	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	48,00	46,85	46,05	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	10,00	50,65	51,23	Nota de Valores 4.9.4
Bono A - ES0358969006	1,50	0,39	0,37	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Préstamo B	9,95	4,02	4,05	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		18,36	17,78	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: 30/09/2021

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	17	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	

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: 30/09/2021

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: 30/09/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo								Total	
		22/02/2021	24/05/2021	23/08/2021							
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885										
Saldo inicial	0886	30.000	29.883	30.000							
Cobros del periodo	0887	5.713	6.346	6.445							
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-71	-136	-116							
Pagos por derivados	0889	4	118	155							
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-29.883	-30.000	-30.000							
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-5.755	-6.156	-5.363							
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-8	-55	-1.121							
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0							
Saldo disponible	0894	0	0	0							
Liquidación de comisión variable	0895	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: 30/09/2021

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