

MADRID RESIDENCIAL II - Fondo de Titulización de Activos**LIQUIDACION DEL PERIODO 24/05/21 - 23/08/21**

| | Euros |
|--|----------------------|
| I. Situación al 24/05/21: | 30.000.000,00 |
| Fondo de Reserva | 30.000.000,00 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 6.451.869,64 |
| Principal: | |
| Según calendario hasta 31/07/21: | 4.409.615,14 |
| Amort. Anticipada hasta 31/07/21: | 1.690.511,62 |
| Intereses: | 258.391,61 |
| Ingresos por inmuebles | 93.351,27 |
| III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II): | 36.451.869,64 |
| IV. Total intereses de la reinversión: | -6.990,56 |
| Intereses de la Cta. de Tesorería | -6.990,56 |
| V. Recursos disponibles (III + IV): | 36.444.879,08 |
| VI. Gastos: | 115.701,53 |
| VII. Liquidación SWAP: | 154.599,89 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo): | -391.219,19 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (Caixabank): | -236.619,30 |
| VIII. Pago a los Bonos: | 5.363.244,00 |
| Bono: | |
| Intereses correspondientes al 23/08/21: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 23/08/21: | 5.363.244,00 |
| Reinversión o devolución de las retenciones: | 0,00 |
| IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII): | 31.120.533,44 |
| Distribución del saldo disponible: | |
| Fondo de Reserva previo (24/05/21): | 30.000.000,00 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 0,00 |
| Intereses préstamo B. pagados | 1.820,00 |
| Amortización préstamo B. | 0,00 |
| Remuneración Préstamo Constitución FR | 1.118.713,44 |
| Intereses Crédito Subordinado | 0,00 |
| Amortización Préstamo Constitución FR | 0,00 |
| Amortización Crédito Subordinado | 0,00 |
| Margen de Intermediación Financiera | 0,00 |

Fondo de Reserva (23/08/21):**30.000.000,00****Destinatarios: CNMV, AIAF****Nº: 3057/21**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

MADRID RESIDENCIAL II\liq.trim\Ago21

MADRID RESIDENCIAL II

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 23 de Agosto de 2021

Importes en euros

| I. BONO A ES0358969006 | Sobre 4560 bonos | Por Bono |
|---|------------------|--------------|
| 1. Saldo inicial (1/07/2010): | 456.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 168.728.846,40 € | 37.001,94 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 5.363.244,00 € | 1.176,15 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 163.365.602,40 € | 35.825,79 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 35,825790% | 35,825790% |

II. EL FONDO

Importes en euros

| | | |
|--|--|------------------|
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/07/21: | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas: | | 307.291.519,81 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas: | | 16.478.744,82 € |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas: | | 307.365.589,04 € |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidas: | | 24.308.872,50 € |
| 2. Amortización del período 30/04/21 a 31/07/21: | | 6.100.126,76 € |
| a) Según calendario: | | 4.409.615,14 € |
| b) Amortización anticipada hasta 31/07/21: | | 1.690.511,62 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | |
| b) Ultimo año: | | 2,43% |
| c) Ultimo semestre: | | 2,66% |
| d) Ultimo trimestre: | | 2,15% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | | 0,30% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 12 meses: | | 0,30% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | | 7,33% |
| 7. Nivel de Impago (2): | | 0,37% |

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

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

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF



Nº: 3058/21

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

MADRID RESIDENCIAL II\Infoinver.trim\Ago21 (Español)

MADRID RESIDENCIAL II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACIÓN CORRESPONDIENTE AL PERIODO: 24/05/21-23/08/21
I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|---|---|
| Fecha de Constitución del Fondo | 29 de junio de 2010 |
| Fecha Emisión Bonos | 29 de junio de 2010 |
| Fecha Final Amortización Pasivo: (2,43% TAA) | 22 de noviembre de 2033 |
| Sociedad Gestora | Titulización de Activos, SGFT,S.A. |
| Emisores de Certificados de Transmisión de Hipoteca | Bankia (Caja Madrid) |
| Agente de Pagos | Bankia (Caja Madrid) |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencia de Calificación | Standard & Poor's / Moody's Investors Service |
| Calificación | (M) Aa2 sf / (S&P) A sf |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Nombre | Bonos de Titulización MADRID RESIDENCIAL II, FTA |
|---|---|
| Serie A: | |
| Código ISIN | ES0358969006 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 456.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 163.365.602,40 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 35.825,79 Euros |
| Préstamo B: | |
| Importe Inicial | 144.000.000,00 Euros |
| Importe vencido | 0,00 Euros |
| Nominal pendiente de vencimiento | 144.000.000,00 Euros |
| Nominal vencido y amortizado (pagado) | 0,00 Euros |
| Intereses devengados en el periodo | 1.820,00 Euros |
| Intereses devengados y no pagados | 0,00 Euros |

III. INFORMACION INCLUIDA

| |
|---|
| * Liquidación del Período:24/05/21-23/08/21 |
| * Flujos de Caja del Período:24/05/21-23/08/21 |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 23 de Agosto de 2021 |

MADRID RESIDENCIAL II**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 24/05/21 - 23/08/21**

| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | Euros | |
|--------------------------------------|----------------------|----------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| Amortización Bonos Titulización Hip. | | 5.363.244,00 |
| Amortización Participaciones Hip. | 6.100.126,76 | |
| Amortización Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| Ingresos por Inmuebles | 93.351,27 | |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados a los BTH | | 0,00 |
| Intereses recibidos de las CTHs | 258.391,61 | |
| Intereses Ptmos. Subordinados | | 1.120.533,44 |
| Intereses Inversiones Temporales | -6.990,56 | |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones Periódicas: | | 115.701,53 |
| Neto SWAP | 154.599,89 | |
| Margen de Intermediación Financiera | | 0,00 |
| Total Ingresos/Pagos | 6.599.478,97 | 6.599.478,97 |
| Saldo inicial 24/05/21 | 30.000.000,00 | |
| A Inversiones Temporales | | 30.000.000,00 |
| Total | 36.599.478,97 | 36.599.478,97 |
| Retenciones practicadas el 23/08/21 | 0,00 | |
| Inversiones Temporales | | 0,00 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 3063/21**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

MADRID RESIDENCIAL II/fluj.trim\Ago21