

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8558
NIF Fondo: V84889229
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: 30/06/2023

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	387.470	1001	426.136
I. Activos financieros a largo plazo	0002	387.470	1002	426.136
1. Activos titulizados	0003	387.470	1003	426.136
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	372.916	1005	413.451
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	15.674	1025	13.805
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-1.119	1027	-1.119
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
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 RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	101.655	1041	109.012
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	17.112	1042	18.096
V. Activos financieros a corto plazo	0043	34.648	1043	39.221
1. Activos titulizados	0044	33.646	1044	38.243
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	30.169	1046	35.295
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	635	1065	363
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	119	1066	46
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	5.037	1067	4.880
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	97	1068	71
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-2.411	1069	-2.411
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	927	1071	927
2.1 Derivados de cobertura	0072	927	1072	927
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	74	1074	50
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	0	1077	9
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	74	1079	41
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	49.896	1085	51.695
1. Tesorería	0086	49.896	1086	51.695
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	489.126	1088	535.148

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	410.465	1089	447.109
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	410.465	1094	447.109
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	378.745	1095	415.763
1.1 Series no subordinadas	0096	178.745	1096	215.763
1.2 Series subordinadas	0097	200.000	1097	200.000
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	25.994	1101	25.622
2.1 Préstamo subordinado	0102	71.000	1102	71.000
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-45.006	1105	-45.378
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	5.725	1108	5.725
3.1 Derivados de cobertura	0109	5.725	1109	5.725
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 RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) PASIVO CORRIENTE	0117	82.876	1117	93.184
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	80.970	1123	91.378
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	36.864	1124	41.221
1.1 Series no subordinadas	0125	35.207	1125	40.174
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	1.657	1128	1.046
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	26.846	1131	25.287
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	399	1136	279
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	26.447	1137	25.008
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	17.260	1143	24.870
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	17.260	1146	24.870
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	1.907	1148	1.806
1. Comisiones	0149	18	1149	19
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	10	1150	11
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	8	1152	8
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	1.888	1157	1.786
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-4.215	1158	-5.145
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-4.215	1160	-5.145
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	489.126	1162	535.148

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2023		Acumulado anterior 30/06/2022
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	4.621	1201	688	2201	8.282	3201	1.275
1.1 Activos titulizados	0202	4.394	1202	688	2202	7.894	3202	1.275
1.2 Otros activos financieros	0203	227	1203	0	2203	388	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-4.371	1204	-333	2204	-7.820	3204	-636
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-3.516	1205	-77	2205	-6.261	3205	-143
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-855	1206	-242	2206	-1.559	3206	-464
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	-14	2207	0	3207	-30
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	77	1208	-92	2208	415	3208	-264
A) MARGEN DE INTERESES	0209	326	1209	263	2209	877	3209	375
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	258	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-591	1217	-44	2217	-628	3217	-375
7.1 Servicios exteriores	0218	-556	1218	-6	2218	-558	3218	-299
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-556	1219	-6	2219	-558	3219	-299
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-35	1224	-38	2224	-71	3224	-76
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-29	1225	-31	2225	-58	3225	-61
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-6	1227	-7	2227	-13	3227	-14
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	-105	1231	-69	2231	-399	3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-105	1232	-69	2232	-399	3232	0
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	210	1238	50	2238	523	3238	50
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-99	1239	-200	2239	-373	3239	-49
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 RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2023		Acumulado anterior 30/06/2022
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	1.629	1300	402	2300	3.500	3300	677
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	1.664	1301	439	2301	3.572	3301	753
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	4.207	1302	665	2302	7.523	3302	1.258
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-3.182	1303	-67	2303	-5.651	3303	-133
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	421	1304	0	2304	1.345	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	-144	2305	0	3305	-340
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	218	1306	0	2306	355	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	-15	2308	0	3308	-32
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-35	1309	-38	2309	-72	3309	-76
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-29	1310	-31	2310	-59	3310	-61
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-6	1312	-7	2312	-13	3312	-14
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	0	2315	0	3315	0
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	757	1322	9.731	2322	-5.299	3322	9.409
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	1.959	1325	52	2325	2.866	3325	467
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	6.770	1326	7.538	2326	13.658	3326	15.296
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	14.770	1327	5.032	2327	27.426	3327	8.918
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	974	1328	485	2328	2.259	3328	1.030
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	618	1330	91	2330	1.507	3330	91
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-21.172	1331	-13.093	2331	-41.985	3331	-24.868
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-1.203	1332	9.679	2332	-8.165	3332	8.943
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	9.720	2333	0	3333	9.010
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	-1.203	1336	-41	2336	-8.165	3336	-67
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	2.385	1337	10.132	2337	-1.799	3337	10.086
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	47.511	1338	34.514	2338	51.695	3338	34.560
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	49.896	1339	44.646	2339	49.896	3339	44.646

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2023		Acumulado anterior 30/06/2022
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	421	1357	-144	2357	1.345	3357	-340
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	421	1358	-144	2358	1.345	3358	-340
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	-77	1360	92	2360	-415	3360	264
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	-344	1362	52	2362	-930	3362	77
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 RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2023								Situación cierre anual anterior 31/12/2022								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	4,89	0401	18,85	0421	0,00	0441	9,35	1381	4,00	1401	17,34	1421	0,14	1441	5,22	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	17,00
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	

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	171	0467	94	0474	64	0481	0	0488	157	0495	18.177	0502	0	0509	18.335
De 1 a 3 meses	0461	56	0468	76	0475	55	0482	0	0489	131	0496	7.145	0503	0	0510	7.276
De 3 a 6 meses	0462	24	0469	52	0476	25	0483	14	0490	91	0497	3.323	0504	0	0511	3.415
De 6 a 9 meses	0463	17	0470	66	0477	14	0484	31	0491	110	0498	2.194	0505	0	0512	2.304
De 9 a 12 meses	0464	7	0471	48	0478	3	0485	15	0492	65	0499	734	0506	0	0513	799
Más de 12 meses	0465	98	0472	3.732	0479	55	0486	1.041	0493	4.828	0500	10.562	0507	0	0514	15.390
Total	0466	373	0473	4.068	0480	215	0487	1.100	0494	5.384	0501	42.135	0508	0	1515	47.519

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	171	0522	94	0529	64	0536	0	0543	157	0550	18.177	0557	0	0564	18.335	0571	32.764	0578	32.764	0584	55,96
De 1 a 3 meses	0516	56	0523	76	0530	55	0537	0	0544	131	0551	7.145	0558	0	0565	7.276	0572	11.649	0579	11.649	0585	62,46
De 3 a 6 meses	0517	24	0524	52	0531	25	0538	14	0545	91	0552	3.323	0559	0	0566	3.415	0573	5.024	0580	5.024	0586	67,96
De 6 a 9 meses	0518	17	0525	66	0532	14	0539	31	0546	110	0553	2.194	0560	0	0567	2.304	0574	3.281	0581	3.281	0587	70,23
De 9 a 12 meses	0519	7	0526	48	0533	3	0540	15	0547	65	0554	734	0561	0	0568	799	0575	1.361	0582	1.361	0588	58,69
Más de 12 meses	0520	98	0527	3.732	0534	55	0541	1.041	0548	4.828	0555	10.562	0562	0	0569	15.390	0576	19.427	0583	19.427	0589	79,22
Total	0521	373	0528	4.068	0535	215	0542	1.100	0549	5.384	0556	42.135	0563	0	0570	47.519	0577	73.507			0590	64,65

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 14/11/2006	
Inferior a 1 año	0600	606	1600	507	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	1.080	1601	1.225	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.346	1602	1.093	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	2.643	1603	2.159	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	8.406	1604	5.760	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	57.935	1605	63.849	2605	194
Superior a 10 años	0606	351.780	1606	392.838	2606	1.999.806
Total	0607	423.796	1607	467.429	2607	2.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	12,66	1608	13,07	2608	27,56

Antigüedad	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 14/11/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	18,03	1609	17,54	2609	1,64

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

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 30/06/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 14/11/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.404	0630	59.157	1620	1.284	1630	53.483	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.581	0631	149.000	1621	1.669	1631	154.558	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	1.331	0632	182.788	1622	1.599	1632	222.540	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	162	0633	32.850	1623	181	1633	36.849	2623	10.556	2633	1.878.659
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	534	2634	121.341
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	4.478	0638	423.796	1628	4.733	1638	467.429	2628	11.090	2638	2.000.000
Media ponderada (%)	0639	56,69	0649		1639	58,17	1649		2639	95,42	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 14/11/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	2,48	1650	0,95	2650	4,51
Tipo de interés nominal máximo	0651	8,36	1651	4,63	2651	5,88
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,50	1652	0,50	2652	2,75

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 14/11/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	210	0683	13.852	1660	226	1683	15.624	2660	484	2683	62.633
Aragón	0661	75	0684	4.708	1661	78	1684	5.229	2661	206	2684	30.916
Asturias	0662	39	0685	2.230	1662	39	1685	2.342	2662	71	2685	7.768
Baleares	0663	35	0686	3.059	1663	37	1686	3.224	2663	73	2686	11.943
Canarias	0664	25	0687	1.377	1664	26	1687	1.536	2664	82	2687	10.692
Cantabria	0665	73	0688	5.279	1665	77	1688	5.749	2665	142	2688	20.344
Castilla-León	0666	115	0689	6.649	1666	117	1689	7.011	2666	235	2689	30.276
Castilla La Mancha	0667	193	0690	15.375	1667	204	1690	16.724	2667	560	2690	89.081
Cataluña	0668	482	0691	48.110	1668	514	1691	53.555	2668	1.050	2691	188.843
Ceuta	0669	14	0692	313	1669	15	1692	361	2669	43	2692	3.879
Extremadura	0670	23	0693	1.004	1670	25	1693	1.049	2670	41	2693	4.142
Galicia	0671	73	0694	5.218	1671	78	1694	5.981	2671	127	2694	17.283
Madrid	0672	2.818	0695	294.892	1672	2.975	1695	325.174	2672	7.105	2695	1.401.798
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	16	0697	970	1674	17	1697	1.156	2674	72	2697	8.796
Navarra	0675	12	0698	1.029	1675	14	1698	1.241	2675	38	2698	6.331
La Rioja	0676	21	0699	1.651	1676	22	1699	1.805	2676	61	2699	9.523
Comunidad Valenciana	0677	158	0700	8.292	1677	167	1700	8.938	2677	502	2700	58.875
País Vasco	0678	96	0701	9.788	1678	102	1701	10.731	2678	198	2701	36.877
Total España	0679	4.478	0702	423.796	1679	4.733	1702	467.429	2679	11.090	2702	2.000.000
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	4.478	0705	423.796	1682	4.733	1705	467.429	2682	11.090	2705	2.000.000

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 14/11/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,83			1710	0,78			2710	0,33		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 14/11/2006					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal	Nº de pasivos emitidos		Nominal	Nº de pasivos emitidos		Nominal			
		0720	0721	unitario (€)	1720	1721	unitario (€)	2720	2721	unitario (€)			
		Principal pendiente			Principal pendiente			Principal pendiente					
		0722			1722			2722					
ES0359091008	SERIE A1	4.600	0	0	4.600	0	0	4.600	100.000	460.000			
ES0359091016	SERIE A2	13.400	15.967	213.952	13.400	19.100	255.937	13.400	100.000	1.340.000			
ES0359091024	SERIE B	700	100.000	70.000	700	100.000	70.000	700	100.000	70.000			
ES0359091032	SERIE C	750	100.000	75.000	750	100.000	75.000	750	100.000	75.000			
ES0359091040	SERIE D	340	100.000	34.000	340	100.000	34.000	340	100.000	34.000			
ES0359091057	SERIE E	210	100.000	21.000	210	100.000	21.000	210	100.000	21.000			
Total		0723	20.000	0724	413.952	1723	20.000	1724	455.937	2723	20.000	2724	2.000.000

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2023

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		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
ES0359091008	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,06	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0				
ES0359091016	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,16	3,54	821	0	NO	213.952	0	0	214.774	0				
ES0359091024	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	3,63	276	0	NO	70.000	0	0	70.276	0				
ES0359091032	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	3,68	299	0	NO	75.000	0	0	75.299	0				
ES0359091040	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	3,88	143	0	NO	34.000	0	0	34.143	0				
ES0359091057	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	1,80	5,18	118	0	NO	21.000	0	0	21.118	0				
Total						0740	1.657	0741	0	0743	413.952	0744	0	0745	415.609	0746	0

	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 14/11/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	2,00	0748	0,54	0749	3,77

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2023								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2022							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0359091008	SERIE A1	0	460.000	0	26.345	0	460.000	0	26.345	0	460.000	0	26.345	0	26.345		
ES0359091016	SERIE A2	21.172	1.126.048	1.636	194.348	13.093	1.055.872	0	191.035	0	1.055.872	0	191.035	0	191.035		
ES0359091024	SERIE B	0	0	503	12.678	0	0	0	11.690	0	0	0	11.690	0	11.690		
ES0359091032	SERIE C	0	0	548	13.985	0	0	0	12.898	0	0	0	12.898	0	12.898		
ES0359091040	SERIE D	0	0	265	7.304	0	0	0	6.747	0	0	0	6.747	0	6.747		
ES0359091057	SERIE E	0	0	231	9.067	0	0	67	8.447	67	0	67	8.447	67	8.447		
Total		0754	21.172	0755	1.586.048	0756	3.182	0757	263.727	1754	13.093	1755	1.515.872	1756	67	1757	257.162

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/06/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 14/11/2006
				0760	0761	0762
ES0359091008	SERIE A1	15/11/2006	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0359091008	SERIE A1	15/11/2006	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359091008	SERIE A1	15/11/2006	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359091016	SERIE A2	29/09/2021	FCH	A+	A+	AAA
ES0359091016	SERIE A2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359091016	SERIE A2	01/06/2022	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359091024	SERIE B	27/03/2023	FCH	A+	A-	AA
ES0359091024	SERIE B	22/06/2022	MDY	Aa1	Aa1	Aa2
ES0359091024	SERIE B	01/06/2022	SYP	AA+	AA+	AA
ES0359091032	SERIE C	27/03/2023	FCH	BB	BB-	A
ES0359091032	SERIE C	16/05/2023	MDY	A3	Baa1	A2
ES0359091032	SERIE C	01/06/2022	SYP	AA	AA	A
ES0359091040	SERIE D	27/03/2023	FCH	B-	CCC	BBB
ES0359091040	SERIE D	22/06/2022	MDY	Caa1	Caa1	Baa2
ES0359091040	SERIE D	01/06/2022	SYP	BB+	BB+	BBB
ES0359091057	SERIE E	18/03/2009	FCH	CC	CC	BB+
ES0359091057	SERIE E	11/09/2009	MDY	C	C	Ba2
ES0359091057	SERIE E	20/03/2013	SYP	CCC-	CCC-	BB

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 14/11/2006	
Inferior a 1 año	0765	33.096	1765	26.107	2765	26.458
Entre 1 y 2 años	0766	27.953	1766	29.503	2766	28.925
Entre 2 y 3 años	0767	29.304	1767	30.836	2767	30.618
Entre 3 y 4 años	0768	30.616	1768	32.278	2768	32.409
Entre 4 y 5 años	0769	31.511	1769	33.039	2769	34.306
Entre 5 y 10 años	0770	164.776	1770	163.455	2770	204.080
Superior a 10 años	0771	96.695	1771	140.719	2771	1.643.203
Total	0772	413.952	1772	455.937	2772	2.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	8,87	1773	9,42	2773	27,32

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 14/11/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	12.311	1775	8.862	2775	71.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	71.000	1776	71.000	2776	71.000
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	2,97	1777	1,94	2777	3,55
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	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	51,68	1792	56,13	2792	90,00
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 RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/06/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 14/11/2006	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap de Bases	BANCO SANTANDER	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 - 0,07%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	-4.798	-4.798		
Total							0808 -4.798	0809 -4.798	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 14/11/2006		Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 14/11/2006			
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 RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	3.132	7006	861	7009	0,79	7012	0,20	7015	0,41		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	3.132	7008	861	7011	0,79	7014	0,20	7017	0,41	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	72.890	7024	75.461	7027	15,47	7030	14,59	7033	15,00		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	72.890	7026	75.461	7029	15,47	7032	14,59	7035	15,00	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

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
SERIE A2 - ES0359091016	25,00	6,80	6,79	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	1,75	0,70	0,47	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	10,00	26,72	27,50	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	10,00	26,72	27,50	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	1,25	0,70	0,47	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	10,00	26,72	27,50	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	7,00	16,91	16,09	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	2,10	5,07	4,83	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	1,50	0,70	0,47	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	10,00	26,72	27,50	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	7,50	18,12	17,24	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359091008	25,00	6,80	6,79	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	2,00	0,70	0,47	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	3,40	8,21	7,81	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE D - ES0359091040	9,40	6,79	6,84	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE C - ES0359091032	13,20	6,79	6,84	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE E - ES0359091057	8,00	6,79	6,84	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE B - ES0359091024	18,30	6,79	6,84	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		2,97	2,49	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862	11	2862	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,014	4862		5862		6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, S.E.	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 RMBS I, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	CAIXABANK
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo Adicional 3.4.3.2

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													

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
		22/02/2023	22/05/2023										
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885												
Saldo inicial	0886	8.862	10.829										
Cobros del periodo	0887	24.470	25.908										
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-146	-492										
Pagos por derivados	0889	924	421										
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-10.829	-12.311										
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-23.281	-24.355										
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0										
Resto pagos/retenciones	0893	0	0										
Saldo disponible	0894	0	0										
Liquidación de comisión variable	0895	0	0										0

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

INFORME SOBRE EL CUMPLIMIENTO DE LAS POLÍTICAS DE GESTIÓN DE ACTIVOS Y DE RIESGOS