

MADRID RMBS I - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 22/02/19 - 22/05/19

| | Euros |
|---|----------------------|
| I. Situación al 22/02/19: | 125,06 |
| Fondo de Reserva | 0,00 |
| Otros Recursos | 125,06 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 14.960.766,02 |
| Principal: | |
| Según calendario hasta 30/04/19: | 8.323.934,84 |
| Amort. Anticipada hasta 30/04/19: | 3.394.582,63 |
| Intereses: | 1.285.350,38 |
| Ingresos por inmuebles | 1.956.898,17 |
| III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II): | 14.960.891,08 |
| IV. Total intereses de la reinversión: | -15.447,20 |
| Intereses de la Cta. De Tesorería | -15.447,20 |
| V. Recursos disponibles (III + IV): | 14.945.443,88 |
| VI. Gastos: | 621.741,56 |
| VII. Liquidación SWAP: | -353.020,80 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo): | -249.928,89 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (Santander): | -602.949,69 |
| VIII. Pago a los Bonos: | 13.338.428,40 |
| Bonos A2 : | |
| Intereses correspondientes al 22/05/19: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 22/05/19: | 13.244.828,00 |
| Bonos B: | |
| Intereses correspondientes al 22/05/19: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 22/05/19: | 0,00 |
| Bonos C: | |
| Intereses correspondientes al 22/05/19: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 22/05/19: | 0,00 |
| Bonos D: | |
| Intereses correspondientes al 22/05/19: | 16.139,80 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 3.066,56 |
| Amortización correspondiente al 22/05/19: | 0,00 |
| Bonos E: | |
| Intereses correspondientes al 22/05/19: | 77.460,60 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 14.717,51 |
| Amortización correspondiente al 22/05/19: | 0,00 |
| Reinversión o devolución de las retenciones: | -17.784,07 |
| IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII): | 632.253,12 |
| Distribución del saldo disponible: | |
| Fondo de Reserva previo 22/02/19: | 0,00 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 632.253,12 |
| Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada | 0,00 |
| Amortización Préstamo Participativo | 0,00 |
| Remuneración Variable Prést. Participativo | 0,00 |
| Fondo de Reserva 22/05/19: | 632.253,12 |

Destinatarios: CNMV, AIAF



Nº: 1910/19

Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.: 917020808
<http://www.tda-sgft.com>
MADRID RMBS I liq.trimlMay19

MADRID RMBS I

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 22 de Mayo de 2019

Importes en euros

| I. BONOS A2 ES0359091016 | | |
|--|--------------------|------------------|
| | Sobre 13400 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/11/06): | 1.340.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 442.137.288,00 € | 32.995,32 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 13.244.828,00 € | 988,42 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 428.892.460,00 € | 32.006,90 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 32,006900% | 32,006900% |
| II. BONOS B ES0359091024 | | |
| | Sobre 700 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/11/06): | 70.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 70.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 70.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |
| III. BONOS C ES0359091032 | | |
| | Sobre 750 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/11/06): | 75.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 75.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 75.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |
| IV. BONOS D ES0359091040 | | |
| | Sobre 340 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/11/06): | 34.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 34.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 16.139,80 € | 47,47 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 34.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |
| V. BONOS E ES0359091057 | | |
| | Sobre 210 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/11/06): | 21.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 21.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 77.460,60 € | 368,86 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 21.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |
| VI. EL FONDO | | |
| Importes en euros | | |
| 1. Saldo de certificados de transmisión hipotecaria a 30/04/19: | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidos: | | 628.892.399,23 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidos: | | 84.051.020,77 € |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidos: | | 629.104.333,58 € |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidos: | | 141.270.513,33 € |
| 2. Amortización del período 31/01/19 a 30/04/19: | | |
| a) Según calendario: | | 8.323.934,84 € |
| b) Amortización anticipada hasta 30/04/19: | | 3.394.582,63 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | |
| a) Ultimo año: | | 1,69% |
| b) Ultimo semestre: | | 1,99% |
| c) Ultimo trimestre: | | 2,10% |
| 4. Porcentaje de fallidos (1): | | |
| | | 18,34% |
| 5. Nivel de Impago(2): | | |
| | | 0,36% |

(1) Saldo pendiente de las participaciones hipotecarias fallidas según definición del Folleto de Emisión (retraso de 6 meses y otras causas), sobre el saldo pendiente total.

(2) Importe de principal de las Certificados de Transmisión Hipotecaria con morosidad superior a 90 días en la Fecha de Cobro inmediata anterior a la Fecha de Pago en curso, sobre el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias.

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF.



Nº: 1911/19

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

http://www.tda-sgft.com

MADRID RMBS I Infoinver.trimMay19

MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 22/02/19-22/05/19
I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|---|--|
| Fecha de Constitución del Fondo | 15 de noviembre de 2006 |
| Fecha Emisión BTH | 15 de noviembre de 2006 |
| Fecha Final Amortización Bonos: (1,69% TAA) | 23 de febrero de 2032 |
| Sociedad Gestora | Titulización de Activos, SGFT,S.A. |
| Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca | Bankia (Caja Madrid) |
| Agente de Pagos | BNP Paribas, Sucursal en España |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencia de Calificación | Fitch Ibcra / Standard & Poor's / Moody's Investors Service |
| Calificación | Bonos A2: (F) A- sf / (S&P) A- sf / (M) Aa1 sf Bonos B: (F) BBB- sf / (S&P) A- sf / (M) A1 sf Bonos C: (F) B sf / (S&P) BB- sf / (M) Ba3 sf Bonos D: (F) CCC sf / (S&P) B- sf / (M) C sf Bonos E: (F) CC sf / (S&P) CCC- sf / (M) C sf |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Nombre | Bonos de Titulización MADRID RMBS I |
|---|-------------------------------------|
| Serie A2: | |
| Código ISIN | ES0359091016 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 1.340.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 428.892.460,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 32.006,90 Euros |
| Serie B: | |
| Código ISIN | ES0359091024 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 70.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 70.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)

| Nombre | Bonos de Titulización MADRID RMBS I |
|---|--|
| Serie C: | |
| Código ISIN | ES035091032 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 75.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 75.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |
| Serie D: | |
| Código ISIN | ES0359091040 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 34.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 34.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |
| Serie E: | |
| Código ISIN | ES0359091057 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 21.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 21.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |

III. INFORMACION INCLUIDA

| |
|---|
| * Liquidación del Período:22/02/19-22/05/19 |
| * Flujos de Caja del Período:22/02/19-22/05/19 |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 22 de Mayo de 2019 |

MADRID RMBS I\INFO.trim\May19

MADRID RMBS I**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/02/19 - 22/05/19**

| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | Euros | |
|--|----------------------|----------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| Amortización Bonos Titulización Hip. | | 13.244.828,00 |
| Amortización Participaciones Hip. | 11.718.517,47 | |
| Ingresos inmuebles | 1.956.898,17 | |
| Amortización Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados a los BTH | | 93.600,40 |
| Intereses recibidos de las CTHs | 1.285.350,38 | |
| Intereses Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| Intereses Inversiones Temporales | -15.447,20 | |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones y Gastos | | 621.741,56 |
| Neto SWAP | | 353.020,80 |
| Remuneración Variable Préstamo Participativo | | 0,00 |
| Total Ingresos/Pagos | 14.945.318,82 | 14.313.190,76 |
| Saldo inicial 22/02/19 | 125,06 | |
| A Inversiones Temporales | | 632.253,12 |
| Otros Recursos | | 0,00 |
| Total | 14.945.443,88 | 14.945.443,88 |
| Retenciones practicadas el 22/05/19 | 17.784,07 | |
| A Inversiones Temporales | | 17.784,07 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 1916/19**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Ornese, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

MADRID RMBS Ifluj.trim\May19