

**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: 30/09/2023

**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: 30/09/2023**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	369.917	1001	426.136
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	369.917	1002	426.136
1. Activos titulizados	0003	369.917	1003	426.136
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	352.358	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	18.678	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
<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0039	0	1039	0
<b>III. Otros activos no corrientes</b>	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: 30/09/2023**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	96.249	1041	109.012
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042	16.841	1042	18.096
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	33.618	1043	39.221
1. Activos titulizados	0044	32.610	1044	38.243
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	28.779	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	673	1065	363
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	101	1066	46
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	5.323	1067	4.880
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	146	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	81	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	81	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	
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
<b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b>	0085	45.790	1085	51.695
1. Tesorería	0086	45.790	1086	51.695
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	466.167	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: 30/09/2023**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	389.336	1089	447.109
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	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
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0094	389.336	1094	447.109
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	357.928	1095	415.763
1.1 Series no subordinadas	0096	157.928	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	25.683	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	-45.317	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
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	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: 30/09/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	80.889	1117	93.184
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0118	0	1118	0
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	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
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	0123	79.348	1123	91.378
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	35.859	1124	41.221
1.1 Series no subordinadas	0125	34.102	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	1.757	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	27.820	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	432	1136	279
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	27.388	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	15.670	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	15.670	1146	24.870
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	0148	1.540	1148	1.806
1. Comisiones	0149	14	1149	19
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	12	1150	11
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	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	1.526	1157	1.786
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158	-4.058	1158	-5.145
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159	0	1159	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	-4.058	1160	-5.145
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161	0	1161	0
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	466.167	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: 30/09/2023

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	4.876	1201	1.201	2201	13.158	3201	2.476
1.1 Activos titulizados	0202	4.582	1202	1.201	2202	12.476	3202	2.476
1.2 Otros activos financieros	0203	295	1203	0	2203	682	3203	0
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-4.982	1204	-731	2204	-12.802	3204	-1.367
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-4.008	1205	-402	2205	-10.270	3205	-544
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-974	1206	-320	2206	-2.532	3206	-784
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	-9	2207	0	3207	-39
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0208	48	1208	75	2208	464	3208	-188
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	-57	1209	545	2209	820	3209	920
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	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
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0217	-212	1217	-43	2217	-840	3217	-418
7.1 Servicios exteriores	0218	-182	1218	-6	2218	-739	3218	-305
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-182	1219	-6	2219	-739	3219	-305
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	-37	2224	-101	3224	-113
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-30	1225	-30	2225	-87	3225	-91
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	0	1227	-7	2227	-13	3227	-21
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
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0231	-249	1231	-24	2231	-648	3231	-24
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-249	1232	-24	2232	-648	3232	-24
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	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
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0238	207	1238	0	2238	729	3238	50
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0239	311	1239	-478	2239	-61	3239	-527
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	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: 30/09/2023

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	1.063	1300	943	2300	4.564	3300	1.621
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	1.098	1301	981	2301	4.670	3301	1.734
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	4.513	1302	1.105	2302	12.036	3302	2.362
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-3.909	1303	-90	2303	-9.560	3303	-223
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	205	1304	0	2304	1.550	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	-16	2305	0	3305	-356
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	288	1306	0	2306	643	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	-18	2308	0	3308	-50
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	0309	-34	1309	-37	2309	-106	3309	-113
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-28	1310	-30	2310	-87	3310	-92
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-6	1312	-7	2312	-19	3312	-21
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>	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>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>	0322	-5.170	1322	572	2322	-10.469	3322	9.982
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b>	0325	-3.329	1325	278	2325	-463	3325	745
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	6.118	1326	7.347	2326	19.776	3326	22.642
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	10.918	1327	5.205	2327	38.344	3327	14.123
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.080	1328	798	2328	3.340	3328	1.828
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	477	1330	0	2330	1.984	3330	91
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-21.922	1331	-13.072	2331	-63.907	3331	-37.940
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	0332	-1.841	1332	294	2332	-10.007	3332	9.237
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	300	2333	0	3333	9.310
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	-1.841	1336	-6	2336	-10.007	3336	-73
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	0337	-4.107	1337	1.516	2337	-5.906	3337	11.602
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	49.896	1338	44.646	2338	51.695	3338	34.560
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	45.790	1339	46.162	2339	45.790	3339	46.162

**Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA**

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2023**

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
<b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>								
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
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>0356</b>	<b>0</b>	<b>1356</b>	<b>0</b>	<b>2356</b>	<b>0</b>	<b>3356</b>	<b>0</b>
<b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	205	1357	-16	2357	1.550	3357	-356
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	205	1358	-16	2358	1.550	3358	-356
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	-48	1360	-75	2360	-464	3360	188
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	-157	1362	91	2362	-1.087	3362	167
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>0363</b>	<b>0</b>	<b>1363</b>	<b>0</b>	<b>2363</b>	<b>0</b>	<b>3363</b>	<b>0</b>
<b>3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>								
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
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>0369</b>	<b>0</b>	<b>1369</b>	<b>0</b>	<b>2369</b>	<b>0</b>	<b>3369</b>	<b>0</b>
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>0370</b>	<b>0</b>	<b>1370</b>	<b>0</b>	<b>2370</b>	<b>0</b>	<b>3370</b>	<b>0</b>



Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2023								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	5,92	0401	19,59	0421	0,00	0441	10,85	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: 30/09/2023

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	168	0467	93	0474	68	0481	0	0488	160	0495	17.682	0502	0	0509	17.842
De 1 a 3 meses	0461	36	0468	46	0475	33	0482	0	0489	79	0496	4.199	0503	0	0510	4.279
De 3 a 6 meses	0462	42	0469	112	0476	64	0483	33	0490	208	0497	5.970	0504	0	0511	6.178
De 6 a 9 meses	0463	17	0470	64	0477	18	0484	37	0491	119	0498	2.201	0505	0	0512	2.320
De 9 a 12 meses	0464	11	0471	60	0478	8	0485	37	0492	106	0499	1.533	0506	0	0513	1.639
Más de 12 meses	0465	98	0472	3.773	0479	55	0486	1.117	0493	4.946	0500	10.288	0507	0	0514	15.233
<b>Total</b>	0466	<b>372</b>	0473	<b>4.147</b>	0480	<b>246</b>	0487	<b>1.224</b>	0494	<b>5.618</b>	0501	<b>41.874</b>	0508	<b>0</b>	1515	<b>47.492</b>

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	168	0522	93	0529	68	0536	0	0543	160	0550	17.682	0557	0	0564	17.842	0571	32.154	0578	32.154	0584	55,49
De 1 a 3 meses	0516	36	0523	46	0530	33	0537	0	0544	79	0551	4.199	0558	0	0565	4.279	0572	7.230	0579	7.230	0585	59,17
De 3 a 6 meses	0517	42	0524	112	0531	64	0538	33	0545	208	0552	5.970	0559	0	0566	6.178	0573	9.262	0580	9.262	0586	66,71
De 6 a 9 meses	0518	17	0525	64	0532	18	0539	37	0546	119	0553	2.201	0560	0	0567	2.320	0574	3.442	0581	3.442	0587	67,41
De 9 a 12 meses	0519	11	0526	60	0533	8	0540	37	0547	106	0554	1.533	0561	0	0568	1.639	0575	2.241	0582	2.241	0588	73,16
Más de 12 meses	0520	98	0527	3.773	0534	55	0541	1.117	0548	4.946	0555	10.288	0562	0	0569	15.233	0576	19.410	0583	19.410	0589	78,48
<b>Total</b>	0521	<b>372</b>	0528	<b>4.147</b>	0535	<b>246</b>	0542	<b>1.224</b>	0549	<b>5.618</b>	0556	<b>41.874</b>	0563	<b>0</b>	0570	<b>47.492</b>	0577	<b>73.739</b>			0590	<b>64,41</b>

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: 30/09/2023

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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 14/11/2006	
Inferior a 1 año	0600	795	1600	507	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	805	1601	1.225	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.457	1602	1.093	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	3.312	1603	2.159	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	9.483	1604	5.760	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	56.131	1605	63.849	2605	194
Superior a 10 años	0606	333.156	1606	392.838	2606	1.999.806
<b>Total</b>	0607	<b>405.138</b>	1607	<b>467.429</b>	2607	<b>2.000.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	0608	<b>12,45</b>	1608	<b>13,07</b>	2608	<b>27,56</b>

Antigüedad	Situación actual 30/09/2023						Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 14/11/2006	
	Antigüedad media ponderada (años)	0609	18,28	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: 30/09/2023

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 30/09/2023				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	1.469	0630	63.330	1620	1.284	1630	53.483	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.551	0631	148.321	1621	1.669	1631	154.558	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	1.186	0632	162.509	1622	1.599	1632	222.540	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	154	0633	30.979	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
<b>Total</b>	0628	<b>4.360</b>	0638	<b>405.138</b>	1628	<b>4.733</b>	1638	<b>467.429</b>	2628	<b>11.090</b>	2638	<b>2.000.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>	0639	<b>55,89</b>	0649		1639	<b>58,17</b>	1649		2639	<b>95,42</b>	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: 30/09/2023**

**Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK**

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 14/11/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,40	1650	0,95	2650	4,51
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,26	1651	4,63	2651	5,88
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,50	1652	0,50	2652	2,75

<b>S.05.1</b>
<b>Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/09/2023</b>
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK</b>

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO F**

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2023				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	203	0683	13.509	1660	226	1683	15.624	2660	484	2683	62.633
Aragón	0661	73	0684	4.608	1661	78	1684	5.229	2661	206	2684	30.916
Asturias	0662	38	0685	2.181	1662	39	1685	2.342	2662	71	2685	7.768
Baleares	0663	35	0686	3.003	1663	37	1686	3.224	2663	73	2686	11.943
Canarias	0664	24	0687	1.343	1664	26	1687	1.536	2664	82	2687	10.692
Cantabria	0665	72	0688	5.155	1665	77	1688	5.749	2665	142	2688	20.344
Castilla-León	0666	111	0689	6.385	1666	117	1689	7.011	2666	235	2689	30.276
Castilla La Mancha	0667	185	0690	14.561	1667	204	1690	16.724	2667	560	2690	89.081
Cataluña	0668	463	0691	45.568	1668	514	1691	53.555	2668	1.050	2691	188.843
Ceuta	0669	13	0692	295	1669	15	1692	361	2669	43	2692	3.879
Extremadura	0670	22	0693	925	1670	25	1693	1.049	2670	41	2693	4.142
Galicia	0671	73	0694	5.101	1671	78	1694	5.981	2671	127	2694	17.283
Madrid	0672	2.751	0695	281.502	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	951	1674	17	1697	1.156	2674	72	2697	8.796
Navarra	0675	11	0698	918	1675	14	1698	1.241	2675	38	2698	6.331
La Rioja	0676	21	0699	1.627	1676	22	1699	1.805	2676	61	2699	9.523
Comunidad Valenciana	0677	156	0700	8.096	1677	167	1700	8.938	2677	502	2700	58.875
País Vasco	0678	93	0701	9.411	1678	102	1701	10.731	2678	198	2701	36.877
<b>Total España</b>	0679	<b>4.360</b>	0702	<b>405.138</b>	1679	<b>4.733</b>	1702	<b>467.429</b>	2679	<b>11.090</b>	2702	<b>2.000.000</b>
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
<b>Total general</b>	0682	<b>4.360</b>	0705	<b>405.138</b>	1682	<b>4.733</b>	1705	<b>467.429</b>	2682	<b>11.090</b>	2705	<b>2.000.000</b>

<b>S.05.1</b>
<b>Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/09/2023</b>
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK</b>

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 30/09/2023				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	0,85			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: 30/09/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 14/11/2006					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0359091008	SERIE A1	4.600	0	0	4.600	0	0	4.600	100.000	460.000			
ES0359091016	SERIE A2	13.400	14.331	192.030	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			
<b>Total</b>		0723	20.000	0724	392.030	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: 30/09/2023

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	3,98	827	0	NO	192.030	0	0	192.857	0				
ES0359091024	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	4,07	308	0	NO	70.000	0	0	70.308	0				
ES0359091032	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	4,12	334	0	NO	75.000	0	0	75.334	0				
ES0359091040	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	4,32	159	0	NO	34.000	0	0	34.159	0				
ES0359091057	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	1,80	5,62	128	0	NO	21.000	0	0	21.128	0				
<b>Total</b>						0740	1.757	0741	0	0743	392.030	0744	0	0745	393.787	0746	0

	Situación actual 30/09/2023		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	2,88	0748	0,54	0749	3,77

**MADRID RMBS I, FTA**

S.05.2

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: 30/09/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO C**

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2023								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2022							
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	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0359091008	SERIE A1	0	460.000	0	26.345	0	26.345	0	460.000	0	26.345	0	26.345	0	460.000	0	26.345
ES0359091016	SERIE A2	21.922	1.147.970	1.937	196.285	13.072	1.068.944	0	191.035	0	191.035	0	191.035	0	1.068.944	0	191.035
ES0359091024	SERIE B	0	0	650	13.328	0	0	0	11.690	0	11.690	0	11.690	0	0	0	11.690
ES0359091032	SERIE C	0	0	706	14.691	0	0	0	12.898	0	12.898	0	12.898	0	0	0	12.898
ES0359091040	SERIE D	0	0	337	7.642	0	0	13	6.760	0	6.760	0	6.760	13	0	0	6.760
ES0359091057	SERIE E	0	0	278	9.345	0	0	77	8.524	0	8.524	0	8.524	77	0	0	8.524
<b>Total</b>		0754	21.922	0755	1.607.970	0756	3.909	0757	267.636	1754	13.072	1755	1.528.944	1756	90	1757	257.252

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: 30/09/2023

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 30/09/2023	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

<b>S.05.2</b>
<b>Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Periodo de la declaración: 30/09/2023</b>
<b>Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF</b>

**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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 14/11/2006	
Inferior a 1 año	0765	30.871	1765	26.107	2765	26.458
Entre 1 y 2 años	0766	27.246	1766	29.503	2766	28.925
Entre 2 y 3 años	0767	28.605	1767	30.836	2767	30.618
Entre 3 y 4 años	0768	29.844	1768	32.278	2768	32.409
Entre 4 y 5 años	0769	30.422	1769	33.039	2769	34.306
Entre 5 y 10 años	0770	245.042	1770	163.455	2770	204.080
Superior a 10 años	0771	0	1771	140.719	2771	1.643.203
<b>Total</b>	<b>0772</b>	<b>392.030</b>	<b>1772</b>	<b>455.937</b>	<b>2772</b>	<b>2.000.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>0773</b>	<b>7,88</b>	<b>1773</b>	<b>9,42</b>	<b>2773</b>	<b>27,32</b>

**Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA**

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2023**

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2023		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	12.793	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	3,26	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	48,98	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: 30/09/2023

**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 30/09/2023	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		
<b>Total</b>							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: 30/09/2023

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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 14/11/2006		Situación actual 30/09/2023		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			
<b>Total</b>	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: 30/09/2023

**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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación actual 30/09/2023		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	4.819	7006	861	7009	1,27	7012	0,20	7015	1,00		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	4.819	7008	861	7011	1,27	7014	0,20	7017	1,00	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	72.794	7024	75.461	7027	16,11	7030	14,59	7033	15,64		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	72.794	7026	75.461	7029	16,11	7032	14,59	7035	15,64	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853



Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

**INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO**

**CUADRO B**

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
<b>Amortización secuencial: series</b>	0854	0858	1858	2858
SERIE C - ES0359091032	1,75	1,26	1,01	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	3,40	8,67	8,21	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	10,00	25,77	26,41	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	1,50	1,26	1,01	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	10,00	25,77	26,41	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359091008	25,00	6,82	6,80	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	2,00	1,26	1,01	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	2,10	5,36	5,07	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	7,50	19,13	18,12	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	7,00	17,86	16,91	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	10,00	25,77	26,41	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	10,00	25,77	26,41	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359091016	25,00	6,82	6,80	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	1,25	1,26	1,01	Nota de Valores 4.9.4
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series</b>	0855	0859	1859	2859
SERIE E - ES0359091057	8,00	6,80	6,80	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE D - ES0359091040	9,40	6,80	6,80	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE C - ES0359091032	13,20	6,80	6,80	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE B - ES0359091024	18,30	6,80	6,80	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
<b>No Reducción del Fondo de Reserva</b>	0856	0860	1860	2860
		3,26	2,97	3.4.2.2. Modulo Adicional
<b>OTROS TRIGGERS</b>	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: 30/09/2023

**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
<b>Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/09/2023</b>

**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												
<b>Ingresos y gastos del periodo de cálculo</b>	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: 30/09/2023

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo								Total	
		22/02/2023	22/05/2023	22/08/2023							
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885										
Saldo inicial	0886	8.862	10.829	12.311							
Cobros del periodo	0887	24.470	25.908	26.386							
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-146	-492	-279							
Pagos por derivados	0889	924	421	205							
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-10.829	-12.311	-12.793							
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-23.281	-24.355	-25.831							
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0							
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0							
Saldo disponible	0894	0	0	0							
Liquidación de comisión variable	0895	0	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: 30/09/2023

**NOTAS EXPLICATIVAS**



**INFORME DE AUDITOR**

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