

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: 30/09/2024

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: 30/09/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2024		Periodo anterior 31/12/2023
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	303.870	1001	352.187
I. Activos financieros a largo plazo	0002	303.870	1002	352.187
1. Activos titulizados	0003	303.870	1003	352.187
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	289.269	1005	333.963
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	15.689	1025	19.313
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-1.089	1027	-1.089
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: 30/09/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	73.534	1041	88.711
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	15.061	1042	15.817
V. Activos financieros a corto plazo	0043	30.358	1043	31.710
1. Activos titulizados	0044	30.286	1044	31.620
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	26.935	1046	27.687
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	545	1065	673
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	85	1066	95
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	5.003	1067	5.426
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	147	1068	168
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-2.429	1069	-2.429
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	72	1074	90
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	0
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	72	1079	90
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	28.116	1085	41.184
1. Tesorería	0086	28.116	1086	41.184
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	377.404	1088	440.899

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2024		Periodo anterior 31/12/2023
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	314.816	1089	369.204
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	314.816	1094	369.204
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	286.971	1095	339.161
1.1 Series no subordinadas	0096	86.971	1096	139.161
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	22.920	1101	25.118
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	-48.080	1105	-45.882
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	4.925	1108	4.925
3.1 Derivados de cobertura	0109	4.925	1109	4.925
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: 30/09/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) PASIVO CORRIENTE	0117	67.856	1117	76.838
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	66.264	1123	75.182
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	33.283	1124	34.844
1.1 Series no subordinadas	0125	31.938	1125	33.113
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	1.346	1128	1.730
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	31.902	1131	28.850
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	411	1136	443
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	31.492	1137	28.407
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	1.078	1139	1.078
3.1 Derivados de cobertura	0140	1.078	1140	1.078
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	10.410
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	10.410
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	1.592	1148	1.656
1. Comisiones	0149	13	1149	14
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	11	1150	11
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	1152	2
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	1.579	1157	1.642
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-5.268	1158	-5.143
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-5.268	1160	-5.143
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	377.404	1162	440.899

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2024		Acumulado anterior 30/09/2023
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	4.039	1201	4.876	2201	13.071	3201	13.158
1.1 Activos titulizados	0202	3.770	1202	4.582	2202	12.210	3202	12.476
1.2 Otros activos financieros	0203	269	1203	295	2203	861	3203	682
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-4.397	1204	-4.982	2204	-14.076	3204	-12.802
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-3.399	1205	-4.008	2205	-11.023	3205	-10.270
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-998	1206	-974	2206	-3.052	3206	-2.532
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-7	1208	48	2208	-133	3208	464
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-365	1209	-57	2209	-1.137	3209	820
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	0	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-155	1217	-212	2217	-547	3217	-840
7.1 Servicios exteriores	0218	-125	1218	-182	2218	-453	3218	-739
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-125	1219	-182	2219	-453	3219	-739
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-30	1224	-30	2224	-94	3224	-101
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-25	1225	-30	2225	-78	3225	-87
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-5	1227	0	2227	-16	3227	-13
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228	0	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-506	1231	-249	2231	-1.103	3231	-648
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-506	1232	-249	2232	-1.103	3232	-648
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	174	1238	207	2238	589	3238	729
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	852	1239	311	2239	2.199	3239	-61
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: 30/09/2024

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2024		Acumulado anterior 30/09/2023
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	457	1300	1.063	2300	1.488	3300	4.564
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	488	1301	1.098	2301	1.582	3301	4.670
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	3.820	1302	4.513	2302	12.369	3302	12.036
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-3.565	1303	-3.909	2303	-11.408	3303	-9.560
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	205	2304	0	3304	1.550
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-42	1305	0	2305	-258	3305	0
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	275	1306	288	2306	879	3306	643
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	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-31	1309	-34	2309	-95	3309	-106
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-26	1310	-28	2310	-79	3310	-87
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	-6	2312	-16	3312	-19
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	-552	1322	-5.170	2322	-14.556	3322	-10.469
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	-385	1325	-3.329	2325	-3.597	3325	-463
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	6.453	1326	6.118	2326	18.099	3326	19.776
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	5.624	1327	10.918	2327	24.557	3327	38.344
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	2.761	1328	1.080	2328	5.737	3328	3.340
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	31	1329	0	2329	31	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	366	1330	477	2330	1.345	3330	1.984
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-15.619	1331	-21.922	2331	-53.365	3331	-63.907
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-166	1332	-1.841	2332	-10.960	3332	-10.007
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-166	1336	-1.841	2336	-10.960	3336	-10.007
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-95	1337	-4.107	2337	-13.068	3337	-5.906
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	28.210	1338	49.896	2338	41.184	3338	51.695
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	28.116	1339	45.790	2339	28.116	3339	45.790

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2024		Acumulado anterior 30/09/2023
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	-42	1357	205	2357	-258	3357	1.550
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-42	1358	205	2358	-258	3358	1.550
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	7	1360	-48	2360	133	3360	-464
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	35	1362	-157	2362	125	3362	-1.087
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: 30/09/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2024								Situación cierre anual anterior 31/12/2023								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	6,14	0401	22,94	0421	0,08	0441	9,36	1381	6,40	1401	20,42	1421	0,00	1441	11,16	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	
Prestamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

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	157	0467	87	0474	56	0481	0	0488	143	0495	15.784	0502	0	0509	15.927
De 1 a 3 meses	0461	34	0468	47	0475	29	0482	0	0489	77	0496	3.791	0503	0	0510	3.868
De 3 a 6 meses	0462	22	0469	66	0476	27	0483	20	0490	113	0497	2.423	0504	0	0511	2.536
De 6 a 9 meses	0463	11	0470	51	0477	14	0484	23	0491	88	0498	1.212	0505	0	0512	1.300
De 9 a 12 meses	0464	13	0471	88	0478	19	0485	52	0492	159	0499	1.595	0506	0	0513	1.755
Más de 12 meses	0465	107	0472	3.598	0479	86	0486	1.375	0493	5.059	0500	11.659	0507	0	0514	16.718
Total	0466	344	0473	3.937	0480	232	0487	1.470	0494	5.638	0501	36.465	0508	0	1515	42.103

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	157	0522	87	0529	56	0536	0	0543	143	0550	15.784	0557	0	0564	15.927	0571	30.267	0578	30.267	0584	52,62
De 1 a 3 meses	0516	34	0523	47	0530	29	0537	0	0544	77	0551	3.791	0558	0	0565	3.868	0572	6.952	0579	6.952	0585	55,64
De 3 a 6 meses	0517	22	0524	66	0531	27	0538	20	0545	113	0552	2.423	0559	0	0566	2.536	0573	4.357	0580	4.357	0586	58,20
De 6 a 9 meses	0518	11	0525	51	0532	14	0539	23	0546	88	0553	1.212	0560	0	0567	1.300	0574	2.133	0581	2.133	0587	60,97
De 9 a 12 meses	0519	13	0526	88	0533	19	0540	52	0547	159	0554	1.595	0561	0	0568	1.755	0575	2.803	0582	2.803	0588	62,59
Más de 12 meses	0520	107	0527	3.598	0534	86	0541	1.375	0548	5.059	0555	11.659	0562	0	0569	16.718	0576	21.675	0583	21.675	0589	77,13
Total	0521	344	0528	3.937	0535	232	0542	1.470	0549	5.638	0556	36.465	0563	0	0570	42.103	0577	68.187			0590	61,75

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: 30/09/2024

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 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 14/11/2006	
Inferior a 1 año	0600	556	1600	958	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	926	1601	620	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	2.458	1602	1.691	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	7.121	1603	4.440	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	11.420	1604	9.677	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	62.116	1605	54.378	2605	194
Superior a 10 años	0606	252.299	1606	314.625	2606	1.999.806
Total	0607	336.896	1607	386.389	2607	2.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	11,65	1608	12,26	2608	27,56

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 14/11/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	19,27	1609	18,52	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: 30/09/2024

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 30/09/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				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	1.648	0630	72.108	1620	1.512	1630	65.401	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.619	0631	165.282	1621	1.550	1631	150.452	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	534	0632	76.274	1622	1.024	1632	140.770	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	116	0633	23.232	1623	147	1633	29.767	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	3.917	0638	336.896	1628	4.233	1638	386.389	2628	11.090	2638	2.000.000
Media ponderada (%)	0639	52,81	0649		1639	55,16	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: 30/09/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 14/11/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	4,81	1650	4,16	2650	4,51
Tipo de interés nominal máximo	0651	7,17	1651	6,26	2651	5,88
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,50	1652	1,50	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: 30/09/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				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	181	0683	11.332	1660	190	1683	12.449	2660	484	2683	62.633
Aragón	0661	66	0684	3.962	1661	72	1684	4.490	2661	206	2684	30.916
Asturias	0662	34	0685	1.879	1662	37	1685	2.130	2662	71	2685	7.768
Baleares	0663	30	0686	2.236	1663	34	1686	2.815	2663	73	2686	11.943
Canarias	0664	23	0687	1.209	1664	23	1687	1.301	2664	82	2687	10.692
Cantabria	0665	66	0688	4.312	1665	72	1688	5.049	2665	142	2688	20.344
Castilla-León	0666	100	0689	5.220	1666	106	1689	5.879	2666	235	2689	30.276
Castilla La Mancha	0667	163	0690	12.090	1667	179	1690	13.724	2667	560	2690	89.081
Cataluña	0668	407	0691	36.743	1668	442	1691	42.656	2668	1.050	2691	188.843
Ceuta	0669	7	0692	186	1669	10	1692	271	2669	43	2692	3.879
Extremadura	0670	19	0693	774	1670	20	1693	827	2670	41	2693	4.142
Galicia	0671	66	0694	4.165	1671	71	1694	4.834	2671	127	2694	17.283
Madrid	0672	2.498	0695	235.666	1672	2.692	1695	270.323	2672	7.105	2695	1.401.798
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	13	0697	686	1674	16	1697	904	2674	72	2697	8.796
Navarra	0675	11	0698	859	1675	11	1698	902	2675	38	2698	6.331
La Rioja	0676	18	0699	1.363	1676	19	1699	1.434	2676	61	2699	9.523
Comunidad Valenciana	0677	133	0700	6.800	1677	150	1700	7.800	2677	502	2700	58.875
País Vasco	0678	82	0701	7.415	1678	89	1701	8.602	2678	198	2701	36.877
Total España	0679	3.917	0702	336.896	1679	4.233	1702	386.389	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	3.917	0705	336.896	1682	4.233	1705	386.389	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: 30/09/2024
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 14/11/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,98			1710	0,89			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: 30/09/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2024			Situación cierre anual anterior 31/12/2023			Situación inicial 14/11/2006					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente			
		0720	Nominal unitario (€) 0721	0722	1720	Nominal unitario (€) 1721	1722	2720	Nominal unitario (€) 2721	2722			
ES0359091008	SERIE A1	4.600	0	0	4.600	0	0	4.600	100.000	460.000			
ES0359091016	SERIE A2	13.400	8.874	118.909	13.400	12.856	172.274	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	318.909	1723	20.000	1724	372.274	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: 30/09/2024

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		0738	0739			
						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	3,70	476	0	NO	118.909	0	0	119.385	0				
ES0359091024	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	3,79	287	0	NO	70.000	0	0	70.287	0				
ES0359091032	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	3,84	312	0	NO	75.000	0	0	75.312	0				
ES0359091040	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	4,04	149	0	NO	34.000	0	0	34.149	0				
ES0359091057	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	1,80	5,34	121	0	NO	21.000	0	0	21.121	0				
Total						0740	1.346	0741	0	0743	318.909	0744	0	0745	320.255	0746	0

	Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 14/11/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	4,19	0748	3,55	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: 30/09/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2024								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2023							
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	460.000	0	26.345	0	460.000	0	26.345	0	460.000	0	26.345
ES0359091016	SERIE A2	15.619	1.221.091	1.369	202.973	21.922	1.147.970	1.937	196.285	15.619	1.221.091	1.369	202.973	21.922	1.147.970	1.937	196.285
ES0359091024	SERIE B	0	0	728	16.271	0	0	650	13.328	0	0	0	0	0	0	650	13.328
ES0359091032	SERIE C	0	0	790	17.882	0	0	706	14.691	0	0	0	0	0	0	706	14.691
ES0359091040	SERIE D	0	0	376	9.158	0	0	337	7.642	0	0	0	0	0	0	337	7.642
ES0359091057	SERIE E	0	0	302	10.559	0	0	278	9.345	0	0	0	0	0	0	278	9.345
Total		0754	15.619	0755	1.681.091	0756	3.565	0757	283.188	1754	21.922	1755	1.607.970	1756	3.909	1757	267.636

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: 30/09/2024

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 30/09/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	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	13/03/2024	FCH	AA+	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	13/03/2024	FCH	AA-	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	13/03/2024	FCH	BB+	BB	A
ES0359091032	SERIE C	26/10/2023	MDY	A1	A1	A2
ES0359091032	SERIE C	01/06/2022	SYP	AA	AA	A
ES0359091040	SERIE D	13/03/2024	FCH	BB-	B-	BBB
ES0359091040	SERIE D	26/10/2023	MDY	B3	B3	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: 30/09/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 14/11/2006	
Inferior a 1 año	0765	25.806	1765	33.665	2765	26.458
Entre 1 y 2 años	0766	25.517	1766	26.399	2766	28.925
Entre 2 y 3 años	0767	26.571	1767	27.684	2767	30.618
Entre 3 y 4 años	0768	26.977	1768	28.795	2768	32.409
Entre 4 y 5 años	0769	27.078	1769	29.041	2769	34.306
Entre 5 y 10 años	0770	186.960	1770	226.689	2770	204.080
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	1.643.203
Total	0772	318.909	1772	372.274	2772	2.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	6,37	1773	7,33	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: 30/09/2024

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 14/11/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	13.139	1775	13.019	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	4,12	1777	3,50	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	37,28	1792	46,27	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	

MADRID RMBS I, FTA

S.05.3

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

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 30/09/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	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		-6.004		
Total							0808	0809	-6.004	0810

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

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 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 14/11/2006		Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		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: 30/09/2024

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 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	2.249	7006	2.906	7009	0,72	7012	0,81	7015	0,57		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	2.249	7008	2.906	7011	0,72	7014	0,81	7017	0,57	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	67.587	7024	73.246	7027	17,82	7030	16,99	7033	18,09		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	67.587	7026	73.246	7029	17,82	7032	16,99	7035	18,09	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		
	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: 30/09/2024

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 E - ES0359091057	1,25	0,64	0,57	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	7,00	21,95	20,93	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	10,00	22,31	22,78	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	7,50	23,52	22,42	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	10,00	22,31	22,78	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	1,50	0,64	0,57	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	2,00	0,64	0,57	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	3,40	10,66	10,16	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359091016	25,00	6,72	6,83	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359091008	25,00	6,72	6,83	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	10,00	22,31	22,78	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	2,10	6,59	6,28	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	1,75	0,64	0,57	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	10,00	22,31	22,78	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE C - ES0359091032	13,20	6,83	6,83	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE E - ES0359091057	8,00	6,83	6,83	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE D - ES0359091040	9,40	6,83	6,83	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE B - ES0359091024	18,30	6,83	6,83	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		4,12	3,93	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: 30/09/2024

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: 30/09/2024

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: 30/09/2024

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo								Total
		22/02/2024	22/05/2024	22/08/2024						
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885									
Saldo inicial	0886	13.019	12.372	13.139						
Cobros del periodo	0887	24.607	21.733	20.671						
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-192	-222	-53						
Pagos por derivados	0889	-80	-135	-42						
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-12.372	-13.139	-14.532						
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-24.980	-20.608	-19.184						
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

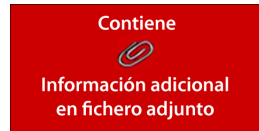
Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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