

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 9275
NIF Fondo: V85594927
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2023

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	250.792	1001	269.164
I. Activos financieros a largo plazo	0002	250.792	1002	269.164
1. Activos titulizados	0003	250.792	1003	269.164
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	244.414	1005	265.260
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	6.378	1025	3.904
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	0	1027	0
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

S.01

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	57.684	1041	63.896
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	7.081	1042	7.334
V. Activos financieros a corto plazo	0043	16.000	1043	18.202
1. Activos titulizados	0044	15.050	1044	17.393
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	13.654	1046	16.390
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	388	1065	215
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	49	1066	18
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	988	1067	796
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	35	1068	39
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-64	1069	-64
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	628	1071	628
2.1 Derivados de cobertura	0072	628	1072	628
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	322	1074	180
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	321	1077	180
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	1	1079	0
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	34.602	1085	38.360
1. Tesorería	0086	34.602	1086	38.360
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	308.476	1088	333.060

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	292.345	1089	315.325
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	292.345	1094	315.325
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	113.923	1095	122.515
1.1 Series no subordinadas	0096	113.923	1096	122.515
1.2 Series subordinadas	0097	0	1097	0
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	177.357	1101	191.746
2.1 Préstamo subordinado	0102	49.387	1102	51.225
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	139.015	1104	151.055
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-11.045	1105	-10.535
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	1.064	1108	1.064
3.1 Derivados de cobertura	0109	1.064	1109	1.064
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 RESIDENCIAL I, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) PASIVO CORRIENTE	0117	16.112	1117	18.187
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	15.972	1123	18.046
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	15.170	1124	17.522
1.1 Series no subordinadas	0125	14.643	1125	17.186
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	527	1128	336
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	803	1131	521
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	803	1136	521
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
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	0	1143	3
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	3
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	139	1148	142
1. Comisiones	0149	13	1149	13
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	8	1150	8
1.2 Comisión administrador	0151	3	1151	3
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	127	1157	129
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	19	1158	-452
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	19	1160	-452
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	308.476	1162	333.060

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2023		Acumulado anterior 30/06/2022
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	2.536	1201	295	2201	4.590	3201	508
1.1 Activos titulizados	0202	2.536	1202	295	2202	4.590	3202	508
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-2.823	1204	-69	2204	-5.055	3204	-81
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.117	1205	-8	2205	-1.994	3205	-8
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1.703	1206	-53	2206	-3.051	3206	-58
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-3	1207	-7	2207	-10	3207	-15
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	8	1208	185	2208	145	3208	262
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-279	1209	411	2209	-320	3209	689
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	49	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-201	1217	-39	2217	-285	3217	-173
7.1 Servicios exteriores	0218	-168	1218	-7	2218	-219	3218	-111
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-168	1219	-7	2219	-219	3219	-111
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	-32	1224	-31	2224	-65	3224	-62
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-21	1225	-18	2225	-43	3225	-36
7.3.2 Comisión administrador	0226	-7	1226	-9	2226	-15	3226	-17
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-4	1227	-4	2227	-8	3227	-9
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	0	1231	-62	2231	0	3231	-62
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	-62	2232	0	3232	-62
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	29	1238	0	2238	95	3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	402	1239	-311	2239	510	3239	-453
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 RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2023		Acumulado anterior 30/06/2022
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	75	1300	313	2300	355	3300	554
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	107	1301	344	2301	420	3301	616
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	2.453	1302	283	2302	4.390	3302	495
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-1.010	1303	0	2303	-1.803	3303	0
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	214	1304	81	2304	617	3304	148
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	3305	0
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	-1.543	1307	-12	2307	-2.769	3307	-12
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-6	1308	-7	2308	-14	3308	-15
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-32	1309	-31	2309	-65	3309	-62
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-21	1310	-18	2310	-42	3310	-36
2.2 Comisión administrador	0311	-8	1311	-9	2311	-15	3311	-17
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-4	1312	-4	2312	-8	3312	-9
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	-2.372	1322	-394	2322	-4.113	3322	-803
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	4.188	1325	4.346	2325	9.987	3325	8.077
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	2.787	1326	3.909	2326	6.210	3326	7.936
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	6.347	1327	3.470	2327	14.305	3327	6.539
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	107	1328	603	2328	259	3328	728
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	147	1330	0	2330	348	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-5.199	1331	-3.636	2331	-11.135	3331	-7.126
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-6.560	1332	-4.740	2332	-14.100	3332	-8.880
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	-6.446	1334	-4.724	2334	-13.878	3334	-8.851
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-114	1336	-16	2336	-222	3336	-29
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-2.297	1337	-81	2337	-3.758	3337	-249
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	36.899	1338	36.633	2338	38.360	3338	36.801
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	34.602	1339	36.552	2339	34.602	3339	36.552

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2023		Acumulado anterior 30/06/2022
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	214	1357	81	2357	617	3357	148
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	214	1358	81	2358	617	3358	148
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	-8	1360	-185	2360	-145	3360	-262
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	-206	1362	104	2362	-472	3362	114
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 RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2023								Situación cierre anual anterior 31/12/2022								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	2,78	0401	8,35	0421	0,05	0441	8,48	1381	1,64	1401	7,79	1421	0,00	1441	5,59	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	8,00
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 RESIDENCIAL I, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2023
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	66	0467	30	0474	28	0481	0	0488	59	0495	8.463	0502	0	0509	8.521
De 1 a 3 meses	0461	15	0468	22	0475	20	0482	0	0489	42	0496	2.614	0503	0	0510	2.656
De 3 a 6 meses	0462	17	0469	35	0476	21	0483	12	0490	68	0497	2.692	0504	0	0511	2.760
De 6 a 9 meses	0463	5	0470	16	0477	4	0484	11	0491	32	0498	692	0505	0	0512	723
De 9 a 12 meses	0464	4	0471	20	0478	2	0485	11	0492	32	0499	584	0506	0	0513	616
Más de 12 meses	0465	21	0472	576	0479	8	0486	184	0493	769	0500	2.751	0507	0	0514	3.520
Total	0466	128	0473	699	0480	83	0487	218	0494	1.001	0501	17.795	0508	0	1515	18.796

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	66	0522	30	0529	28	0536	0	0543	59	0550	8.463	0557	0	0564	8.521	0571	14.641	0578	14.641	0584	58,20
De 1 a 3 meses	0516	15	0523	22	0530	20	0537	0	0544	42	0551	2.614	0558	0	0565	2.656	0572	4.148	0579	4.148	0585	64,02
De 3 a 6 meses	0517	17	0524	35	0531	21	0538	12	0545	68	0552	2.692	0559	0	0566	2.760	0573	4.052	0580	4.052	0586	68,11
De 6 a 9 meses	0518	5	0525	16	0532	4	0539	11	0546	32	0553	692	0560	0	0567	723	0574	1.002	0581	1.002	0587	72,17
De 9 a 12 meses	0519	4	0526	20	0533	2	0540	11	0547	32	0554	584	0561	0	0568	616	0575	947	0582	947	0588	65,00
Más de 12 meses	0520	21	0527	576	0534	8	0541	184	0548	769	0555	2.751	0562	0	0569	3.520	0576	5.364	0583	5.364	0589	65,61
Total	0521	128	0528	699	0535	83	0542	218	0549	1.001	0556	17.795	0563	0	0570	18.796	0577	30.156			0590	62,33

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 23/12/2008	
Inferior a 1 año	0600	73	1600	40	2600	679
Entre 1 y 2 años	0601	228	1601	261	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	524	1602	407	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	1.116	1603	925	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	2.161	1604	1.989	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	16.581	1605	17.112	2605	70
Superior a 10 años	0606	244.751	1606	265.616	2606	804.250
Total	0607	265.435	1607	286.350	2607	805.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	16,79	1608	17,21	2608	30,05

Antigüedad	Situación actual 30/06/2023						Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 23/12/2008	
	Antigüedad media ponderada (años)	0609	16,34	1609	15,85	2609	1,92			

MADRID RESIDENCIAL I, FTA

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2023
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 23/12/2008			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	525	0630	29.508	1620	492	1630	28.176	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.104	0631	128.046	1621	1.144	1631	132.633	2621	19	2631	3.712
60% - 80%	0622	679	0632	102.530	1622	776	1632	119.148	2622	252	2632	48.479
80% - 100%	0623	27	0633	5.350	1623	32	1633	6.393	2623	3.757	2633	744.799
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	31	2634	8.010
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	2.335	0638	265.435	1628	2.444	1638	286.350	2628	4.059	2638	805.000
Media ponderada (%)	0639	55,54	0649		1639	56,78	1649		2639	88,45	2649	

MADRID RESIDENCIAL I, FTA

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 23/12/2008	
Tipo de interés medio ponderado	0650	2,24	1650	0,74	2650	5,83
Tipo de interés nominal máximo	0651	5,96	1651	5,95	2651	7,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,74	1652	0,10	2652	3,50

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 23/12/2008			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	213	0683	19.667	1660	231	1683	22.345	2660	351	2683	61.043
Aragón	0661	20	0684	2.002	1661	23	1684	2.216	2661	41	2684	6.944
Asturias	0662	40	0685	3.472	1662	40	1685	3.616	2662	56	2685	8.847
Baleares	0663	35	0686	3.898	1663	37	1686	4.380	2663	69	2686	13.031
Canarias	0664	36	0687	3.738	1664	38	1687	3.972	2664	62	2687	10.989
Cantabria	0665	25	0688	2.144	1665	25	1688	2.217	2665	36	2688	5.849
Castilla-León	0666	84	0689	7.069	1666	87	1689	7.489	2666	138	2689	20.939
Castilla La Mancha	0667	230	0690	20.333	1667	237	1690	21.676	2667	400	2690	64.008
Cataluña	0668	253	0691	32.184	1668	267	1691	34.812	2668	485	2691	95.641
Ceuta	0669	11	0692	643	1669	12	1692	694	2669	27	2692	3.535
Extremadura	0670	24	0693	1.507	1670	26	1693	1.792	2670	37	2693	4.862
Galicia	0671	119	0694	11.155	1671	120	1694	11.690	2671	157	2694	26.119
Madrid	0672	1.052	0695	138.677	1672	1.098	1695	148.245	2672	1.794	2695	412.125
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	30	0697	2.489	1674	30	1697	2.667	2674	58	2697	9.146
Navarra	0675	9	0698	865	1675	9	1698	902	2675	15	2698	3.096
La Rioja	0676	3	0699	340	1676	3	1699	350	2676	4	2699	788
Comunidad Valenciana	0677	135	0700	12.876	1677	141	1700	13.744	2677	300	2700	51.171
País Vasco	0678	16	0701	2.377	1678	20	1701	3.544	2678	29	2701	6.868
Total España	0679	2.335	0702	265.435	1679	2.444	1702	286.350	2679	4.059	2702	805.000
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	2.335	0705	265.435	1682	2.444	1705	286.350	2682	4.059	2705	805.000

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2023
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 23/12/2008			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,66			1710	1,61			2710	1,09		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 23/12/2008		
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722
ES0358968008	SERIE A	6.077	21.156	128.566	6.077	22.989	139.701	6.077	100.000	607.700
Total		0723 6.077		0724 128.566	1723 6.077		1724 139.701	2723 6.077		2724 607.700

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados		Intereses impagados	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			0736	0737
ES0358968008	SERIE A	NS	EURIBOR 3 m	0,40	3,78	527	0	SI	128.566	0	129.093	0					
Total						0740	527	0741	0	0743	128.566	0744	0	0745	129.093	0746	0

	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 23/12/2008	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	2,10	0748	0,56	0749	3,25

MADRID RESIDENCIAL I, FTA

S.05.2
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/06/2023
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2023								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2022							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0358968008	SERIE A	5.199	479.134	1.010	38.705	3.636	460.303	0	36.592								
Total		0754	5.199	0755	479.134	0756	1.010	0757	38.705	1754	3.636	1755	460.303	1756	0	1757	36.592

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/06/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 23/12/2008
				0760	0761	0762
ES0358968008	SERIE A	31/03/2021	MDY	Aa1	Aa1	
ES0358968008	SERIE A	05/11/2012	SYP	A	A	AAA

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 23/12/2008	
Inferior a 1 año	0765	6.794	1765	8.161	2765	10.047
Entre 1 y 2 años	0766	6.023	1766	7.199	2766	11.500
Entre 2 y 3 años	0767	6.336	1767	7.409	2767	12.212
Entre 3 y 4 años	0768	6.633	1768	7.629	2768	13.036
Entre 4 y 5 años	0769	6.877	1769	7.827	2769	13.904
Entre 5 y 10 años	0770	36.779	1770	66.136	2770	84.167
Superior a 10 años	0771	59.123	1771	35.340	2771	462.834
Total	0772	128.566	1772	139.701	2772	607.700
Vida residual media ponderada (años)	0773	11,66	1773	12,15	2773	30,62

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 23/12/2008	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	26.758	1775	29.076	2775	80.500
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	26.758	1776	29.076	2776	80.500
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	20,81	1777	20,81	2777	13,25
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	N	1791	N	2791	N
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	100,00	1792	100,00	2792	100,00
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	

S.05.3

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/06/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 23/12/2008	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap de Bases	CAIXABANK	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 + 0,16%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	-436	-436		
Total							0808 -436	0809 -436	0810	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 23/12/2008		Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 23/12/2008			
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 RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	3.828	7006	1.044	7009	1,47	7012	0,37	7015	1,03		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	3.828	7008	1.044	7011	1,47	7014	0,37	7017	1,03	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	20.774	7024	21.456	7027	7,32	7030	7,02	7033	7,18		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	1.892	7025	1.892	7028	0,67	7031	0,62	7034	0,65		
Total Fallidos					7023	22.666	7026	23.347	7029	7,99	7032	7,64	7035	7,83	7036	Glosario de Términos

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

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

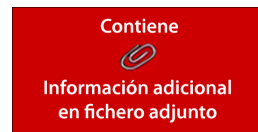
CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
SERIE A - ES0358968008	2,50	1,47	0,95	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A - ES0358968008	49,02	51,95	51,95	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A - ES0358968008	10,00	32,44	33,24	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	49,02	51,95	51,95	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	2,50	1,47	0,95	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	10,00	32,44	33,24	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Préstamo B	12,00	6,78	6,77	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		20,81	20,81	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



S.05.5

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862		2862	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados de Transmisión de Hipoteca en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,020	4862		5862	19	6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	CAIXABANK	1863		2863	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Préstamos Hipotecarios en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3863	0,010	4863		5863		6863	TRIMESTRAL	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	CAIXABANK	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 RESIDENCIAL I, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	Integrado en el pago de los intereses de los bonistas
Contrapartida	0870	Bonista
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Cláusula 13.4 Intereses de los Bonos Iniciales

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															

S.05.5

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)	Fecha cálculo										Total	
	0885	22/02/2023	22/05/2023									
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885	22/02/2023	22/05/2023									
Saldo inicial	0886	29.076	27.840									
Cobros del periodo	0887	13.813	13.126									
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-64	-224									
Pagos por derivados	0889	403	214									
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-27.840	-26.758									
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-6.730	-6.208									
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-8.658	-7.989									
Resto pagos/retenciones	0893	0	0									
Saldo disponible	0894	0	0									
Liquidación de comisión variable	0895	0	0									0

S.06

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

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