

MADRID RMBS I - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 22/11/17 - 22/02/18

| | Euros |
|---|----------------------|
| I. Situación al 22/11/17: | 15,05 |
| Fondo de Reserva | 0,00 |
| Otros Recursos | 15,05 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 13.914.828,87 |
| Principal: | |
| Según calendario hasta 31/01/18: | 7.712.882,55 |
| Amort. Anticipada hasta 31/01/18: | 3.704.236,76 |
| Intereses: | 1.387.271,76 |
| Ingresos por venta: | 1.100.850,40 |
| Ingresos de alquiler de Inmuebles: | 9.587,40 |
| III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II): | 13.914.843,92 |
| IV. Total intereses de la reinversión: | -14.711,19 |
| Intereses de la Cta. De Tesorería | -14.711,19 |
| V. Recursos disponibles (III + IV): | 13.900.132,73 |
| VI. Gastos: | 455.058,46 |
| VII. Liquidación SWAP: | -453.310,96 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo): | -262.466,45 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (Santander): | -715.777,41 |
| VIII. Pago a los Bonos: | 12.991.703,20 |
| Bonos A2 : | |
| Intereses correspondientes al 22/02/18: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 22/02/18: | 12.897.902,00 |
| Bonos B: | |
| Intereses correspondientes al 22/02/18: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 22/02/18: | 0,00 |
| Bonos C: | |
| Intereses correspondientes al 22/02/18: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 22/02/18: | 0,00 |
| Bonos D: | |
| Intereses correspondientes al 22/02/18: | 14.858,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 2.823,02 |
| Amortización correspondiente al 22/02/18: | 0,00 |
| Bonos E: | |
| Intereses correspondientes al 22/02/18: | 78.943,20 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 14.999,21 |
| Amortización correspondiente al 22/02/18: | 0,00 |
| Reinversión o devolución de las retenciones: | -17.822,23 |
| IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII): | 60,11 |
| Distribución del saldo disponible: | |
| Fondo de Reserva previo 22/11/17: | 0,00 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 0,00 |
| Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada | 0,00 |
| Amortización Préstamo Participativo | 0,00 |
| Otros Recursos para el siguiente pago | 60,11 |
| Remuneración Variable Prést. Participativo | 0,00 |
| Fondo de Reserva 22/02/18: | 0,00 |

Destinatarios: CNMV, AIAF



Nº: 668/18

Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.: 917020808
<http://www.tda-sgft.com>
MADRID RMBS I liq.trim\Feb18

MADRID RMBS I

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 22 de Febrero de 2018

Importes en euros

| I. BONOS A2 ES0359091016 | | |
|--|--------------------|------------------|
| | Sobre 13400 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/11/06): | 1.340.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 504.622.694,00 € | 37.658,41 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 12.897.902,00 € | 962,53 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 491.724.792,00 € | 36.695,88 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 36,695880% | 36,695880% |
| II. BONOS B ES0359091024 | | |
| | Sobre 700 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/11/06): | 70.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 70.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 70.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |
| III. BONOS C ES0359091032 | | |
| | Sobre 750 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/11/06): | 75.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 75.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 75.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |
| IV. BONOS D ES0359091040 | | |
| | Sobre 340 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/11/06): | 34.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 34.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 14.858,00 € | 43,70 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 34.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |
| V. BONOS E ES0359091057 | | |
| | Sobre 210 bonos | Por Bono |
| 1. Saldo inicial (22/11/06): | 21.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago: | 21.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 78.943,20 € | 375,92 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 21.000.000,00 € | 100.000,00 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 100,000000% | 100,000000% |
| VI. EL FONDO | | |
| Importes en euros | | |
| 1. Saldo de certificados de transmisión hipotecaria a 31/01/18: | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidos: | | 684.131.118,29 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidos: | | 101.040.006,88 € |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidos: | | 684.283.977,94 € |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidos: | | 147.895.523,88 € |
| 2. Amortización del periodo 31/10/17 a 31/01/18: | | |
| a) Según calendario: | | 7.712.882,55 € |
| b) Amortización anticipada hasta 31/01/18: | | 3.704.236,76 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | |
| a) Ultimo año: | | 1,20% |
| b) Ultimo semestre: | | 1,54% |
| c) Ultimo trimestre: | | 2,11% |
| 4. Porcentaje de fallidos (1): | | 17,77% |
| 5. Nivel de Impago(2): | | 0,19% |

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

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

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF.



Nº: 669/18

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

MADRID RMBS I Inforver.trimFeb18

MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 22/11/17-22/02/18

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

| | |
|---|--|
| Fecha de Constitución del Fondo | 15 de noviembre de 2006 |
| Fecha Emisión BTH | 15 de noviembre de 2006 |
| Fecha Final Amortización Bonos: (1,2% TAA) | 23 de mayo de 2033 |
| Sociedad Gestora | Titulización de Activos, SGFT,S.A. |
| Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca | Bankia (Caja Madrid) |
| Agente de Pagos | BNP Paribas, Sucursal en España |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencia de Calificación | Fitch Ibcra / Standard & Poor's / Moody's Investors Service |
| Calificación | Bonos A2: (F) BBB- sf / (S&P) BBB sf / (M) Aa2 sf Bonos B: (F) BB- sf / (S&P) BB+ sf / (M) A3 sf Bonos C: (F) B- sf / (S&P) B- sf / (M) B1 sf Bonos D: (F) CCC sf / (S&P) CCC+ sf / (M) C sf Bonos E: (F) CC sf / (S&P) CCC- sf / (M) C sf |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

| Nombre | Bonos de Titulización MADRID RMBS I |
|---|-------------------------------------|
| Serie A2: | |
| Código ISIN | ES0359091016 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 1.340.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 491.724.792,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 36.695,88 Euros |
| Serie B: | |
| Código ISIN | ES0359091024 |
| Nominal en circulación total (inicial) | 70.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación total (actual) | 70.000.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 100.000,00 Euros |

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)

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

III. INFORMACION INCLUIDA

| |
|--|
| * Liquidación del Período:22/11/17-22/02/18 |
| * Flujos de Caja del Período:22/11/17-22/02/18 |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 22 de Febrero de 2018 |

MADRID RMBS I\INFO.trim\Feb18

MADRID RMBS I*Fondo de Titulización de Activos***FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/11/17 - 22/02/18**

| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | Euros | |
|--|----------------------|----------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| Amortización Bonos Titulización Hip. | | 12.897.902,00 |
| Amortización Participaciones Hip. | 11.417.119,31 | |
| Ingresos inmuebles | 1.110.437,80 | |
| Amortización Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados a los BTH | | 93.801,20 |
| Intereses recibidos de las CTHs | 1.387.271,76 | |
| Intereses Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| Intereses Inversiones Temporales | -14.711,19 | |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones y Gastos | | 455.058,46 |
| Neto SWAP | | 453.310,96 |
| Remuneración Variable Préstamo Participativo | | 0,00 |
| Total Ingresos/Pagos | 13.900.117,68 | 13.900.072,62 |
| Saldo inicial 22/11/17 | 15,05 | |
| A Inversiones Temporales | | 0,00 |
| Otros Recursos | | 60,11 |
| Total | 13.900.132,73 | 13.900.132,73 |
| Retenciones practicadas el 22/02/18 | 17.822,23 | |
| A Inversiones Temporales | | 17.822,23 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 674/18**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

MADRID RMBS I fluj.trim\Feb18