

MADRID RMBS I - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 22/02/16 - 23/05/16

	Euros
I. Situación al 22/02/16:	26,76
Fondo de Reserva	0,00
Otros Recursos	26,76
II. Fondos recibidos del emisor	14.909.625,04
Principal:	
Según calendario hasta 30/04/16:	8.499.611,25
Amort. Anticipada hasta 30/04/16:	3.285.226,68
Intereses:	2.056.109,11
Ingresos por venta:	1.068.678,00
III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):	14.909.651,80
IV. Total intereses de la reinversión:	0,00
Intereses de la Cta. De Tesorería	0,00
V. Recursos disponibles (III + IV):	14.909.651,80
VI. Gastos:	504.298,32
VII. Liquidación SWAP:	-764.901,94
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	243.752,06
Cantidad a Pagar por la Parte A (Santander):	-521.149,88
VIII. Pago a los Bonos:	13.640.342,10
Bonos A2 :	
Intereses correspondientes al 23/05/16:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 23/05/16:	13.499.294,00
Bonos B:	
Intereses correspondientes al 23/05/16:	9.730,00
Retenciones practicadas a los bonos:	1.848,00
Amortización correspondiente al 23/05/16:	0,00
Bonos C:	
Intereses correspondientes al 23/05/16:	19.905,00
Retenciones practicadas a los bonos:	3.780,00
Amortización correspondiente al 23/05/16:	0,00
Bonos D:	
Intereses correspondientes al 23/05/16:	26.214,00
Retenciones practicadas a los bonos:	4.981,00
Amortización correspondiente al 23/05/16:	0,00
Bonos E:	
Intereses correspondientes al 23/05/16:	85.199,10
Retenciones practicadas a los bonos:	16.186,80
Amortización correspondiente al 23/05/16:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones:	-26.795,80
IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII):	109,44
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva previo 22/02/16:	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	109,44
Remuneración Variable Prést. Participativo	0,00
Fondo de Reserva 23/05/16:	0,00

Destinatarios: CNMV, AIAF



Nº: 2282/16

Titulización de Activos, SGFT, S.A.
 Orense, 69
 28020 Madrid
 Tel.: 917020808
<http://www.tda-sgft.com>
 MADRID RMBS I liq.trimMay16

MADRID RMBS I

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 23 de Mayo de 2016

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:	587.664.772,00 €	43.855,58 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	13.499.294,00 €	1.007,41 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	574.165.478,00 €	42.848,17 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	42,848170%	42,848170%
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:	9.730,00 €	13,90 €
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:	19.905,00 €	26,54 €
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:	26.214,00 €	77,10 €
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:	85.199,10 €	405,71 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	21.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
VI. EL FONDO		
Importes en euros		
1. Saldo de certificados de transmisión hipotecaria a 30/04/16:		
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidos:		761.421.475,62 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidos:		114.045.447,84 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidos:		761.589.842,66 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidos:		149.826.814,58 €
2. Amortización del período 31/01/16 a 30/04/16:		
a) Según calendario:		8.499.611,25 €
b) Amortización anticipada hasta 30/04/16:		3.285.226,68 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):		
a) Ultimo año:		1,92%
b) Ultimo semestre:		1,89%
c) Ultimo trimestre:		1,69%
4. Porcentaje de fallidos (1):		16,44%
5. Nivel de Impago(2):		0,36%

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

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

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF.



Nº: 2283/16

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 69

28020 Madrid

Tel.: 917020808

http://www.tda-sgft.com

MADRID RMBS I\Infoinver.trim\May16

MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 22/02/16-23/05/16
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: (1,92% TAA)	22 de mayo de 2029
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) Aa3 sf Bonos B: (F) BB- sf / (S&P) BB+ sf / (M) Baa1 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)	574.165.478,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	42.848,17 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

MADRID RMBS I\INFO.trim\May16

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)

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

III. INFORMACION INCLUIDA

* Liquidación del Período:22/02/16-23/05/16
* Flujos de Caja del Período:22/02/16-23/05/16
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 23 de Mayo de 2016

MADRID RMBS I\INFO.trim\May16

MADRID RMBS I**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/02/16 - 23/05/16**

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip.		13.499.294,00
Amortización Participaciones Hip.	11.784.837,93	
Ingresos por venta	1.068.678,00	
Amortización Ptmos. Subordinados		0,00
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH		141.048,10
Intereses recibidos de las CTHs	2.056.109,11	
Intereses Ptmos. Subordinados		0,00
Intereses Inversiones Temporales	0,00	
III. GASTOS		
Comisiones y Gastos		504.298,32
Neto SWAP		764.901,94
Remuneración Variable Préstamo Participativo		0,00
Total Ingresos/Pagos	14.909.625,04	14.909.542,36
Saldo inicial 22/02/16	26,76	
A Inversiones Temporales		0,00
Otros Recursos		109,44
Total	14.909.651,80	14.909.651,80
Retenciones practicadas el 23/05/16	26.795,80	
A Inversiones Temporales		26.795,80

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 2288/16**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Ornese, 69

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

MADRID RMBS Ifluj.trim\May16