

MADRID RMBS I

INFORMACIÓN CORRESPONDIENTE AL MES DE DICIEMBRE DE 2011:
INFORMATION CORRESPONDING TO THE MONTH OF DECEMBER 2011:

La Sociedad Gestora informa de los siguientes conceptos/ The Sociedad Gestora provides the following information:

* Saldo Vivo de Certificados de Transmisión Hipotecarias a 01/12/11: <i>Outstanding Balance of the Mortgage Transfer Certificates on 01/12/11:</i>	1.072.782.017,95 Euros
* Saldo Vivo de Certificados de Transmisión Hipotecarias a 31/12/11: <i>Outstanding Balance of the Mortgage Transfer Certificates on 31/12/11:</i>	1.062.119.063,32 Euros
* Tasa(1)de Amortización Anticipada (TAA) correspondiente al mes de DICIEMBRE: <i>Prepayment Rate(1)corresponding to the month of DECEMBER:</i>	6,54%
* TAA (12 meses)/ CPR (12 months):	2,46%
* Tipo de interés medio ponderado / <i>Weighted average interest rate:</i>	3,11%
* Vencimiento residual medio / <i>Weighted average maturity:</i>	22,75
* Vida Media bonos (TAA 10%) / <i>Average Life of bonds (CPR 10%):</i>	
- Bonos A2 / <i>Bonds A2:</i>	5,58
- Bonos B / <i>Bonds B:</i>	6,22
- Bonos C / <i>Bonds C:</i>	6,22
- Bonos D / <i>Bonds D:</i>	6,22
- Bonos E / <i>Bonds E:</i>	6,22
* Calificación Actual de los Bonos / <i>Current Rating :</i>	
- Bonos A2 / <i>Bonds A2:</i>	(F) A sf / (S&P) AA sf / (M) A1 sf
- Bonos B / <i>Bonds B:</i>	(F) BBB sf / (S&P) BBB- sf / (M) Ba1 sf
- Bonos C / <i>Bonds C:</i>	(F) BB+ sf / (S&P) B sf / (M) Caa2 sf
- Bonos D / <i>Bonds D:</i>	(F) CCC sf / (S&P) CCC sf / (M) C sf
- Bonos E / <i>Bonds E:</i>	(F) CC sf / (S&P) CCC sf / (M) C sf

La Sociedad Gestora, para facilitar a los inversores la valoración de los Bonos, suministra a demanda los flujos de pago previstos durante la vida del Bono, bajo diversas hipótesis alternativas de TAA.
In order to facilitate the evaluation of the Bonds for the investors, the Sociedad Gestora will supply upon request the projected cashflows for the life of the Bond, under different prepayment scenarios.

(1) Tasa Anualizada
(1) *Annualized Rate*

Nº: 368/12
MADRID RMBS I\Info.mensual\Dic11