

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: 30/06/2022

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: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	456.796	1001	484.125
I. Activos financieros a largo plazo	0002	456.796	1002	484.125
1. Activos titulizados	0003	456.796	1003	484.125
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	443.918	1005	471.814
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	14.346	1025	13.778
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-1.467	1027	-1.467
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: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	103.796	1041	91.659
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	18.359	1042	18.400
V. Activos financieros a corto plazo	0043	40.791	1043	38.699
1. Activos titulizados	0044	40.783	1044	38.691
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	37.950	1046	36.284
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	100	1065	85
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	13	1066	12
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	4.843	1067	4.434
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	70	1068	69
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-2.193	1069	-2.193
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	9	1074	9
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	9	1077	9
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	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	44.646	1085	34.560
1. Tesorería	0086	44.646	1086	34.560
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	560.592	1088	575.784

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	470.341	1089	497.235
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	470.341	1094	497.235
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	441.335	1095	468.279
1.1 Series no subordinadas	0096	241.335	1096	268.279
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	24.587	1101	24.538
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	-46.413	1105	-46.462
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	4.418	1108	4.418
3.1 Derivados de cobertura	0109	4.418	1109	4.418
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

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2022		Periodo anterior 31/12/2021
B) PASIVO CORRIENTE	0117	95.605	1117	83.826
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	93.730	1123	82.173
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	42.830	1124	40.745
1.1 Series no subordinadas	0125	42.792	1125	40.717
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	38	1128	28
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	24.459	1131	23.996
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	109	1136	95
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	24.350	1137	23.900
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	736	1139	736
3.1 Derivados de cobertura	0140	736	1140	736
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	25.704	1143	16.696
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	25.704	1146	16.696
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	1.875	1148	1.653
1. Comisiones	0149	13	1149	14
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	11	1150	12
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	1.862	1157	1.639
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-5.354	1158	-5.277
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-5.354	1160	-5.277
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	560.592	1162	575.784

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2022		Acumulado anterior 30/06/2021
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	688	1201	605	2201	1.275	3201	1.363
1.1 Activos titulizados	0202	688	1202	605	2202	1.275	3202	1.363
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-333	1204	-308	2204	-636	3204	-614
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-77	1205	-67	2205	-143	3205	-133
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-242	1206	-225	2206	-464	3206	-450
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-14	1207	-16	2207	-30	3207	-31
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-92	1208	-199	2208	-264	3208	-555
A) MARGEN DE INTERESES	0209	263	1209	97	2209	375	3209	194
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	22	2216	0	3216	46
7. Otros gastos de explotación	0217	-44	1217	-324	2217	-375	3217	-633
7.1 Servicios exteriores	0218	-6	1218	-284	2218	-299	3218	-553
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-6	1219	-284	2219	-299	3219	-553
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	-38	1224	-40	2224	-76	3224	-79
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-31	1225	-32	2225	-61	3225	-63
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-7	1227	-8	2227	-14	3227	-16
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	-69	1231	-52	2231	0	3231	-308
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-69	1232	-52	2232	0	3232	-308
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	50	1238	92	2238	50	3238	454
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-200	1239	165	2239	-49	3239	247
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: 30/06/2022

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2022		Acumulado anterior 30/06/2021
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	402	1300	217	2300	677	3300	404
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	439	1301	234	2301	753	3301	438
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	665	1302	615	2302	1.258	3302	1.408
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-67	1303	-67	2303	-133	3303	-134
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-144	1305	-297	2305	-340	3305	-804
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	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-15	1308	-17	2308	-32	3308	-31
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-38	1309	-40	2309	-76	3309	-80
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-31	1310	-32	2310	-61	3310	-64
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-7	1312	-8	2312	-14	3312	-16
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	22	2315	0	3315	46
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	22	2321	0	3321	46
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	9.731	1322	-3.490	2322	9.409	3322	-163
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	52	1325	-3.186	2325	467	3325	304
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	7.538	1326	6.353	2326	15.296	3326	13.427
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	5.032	1327	4.591	2327	8.918	3327	10.398
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	485	1328	394	2328	1.030	3328	1.759
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	91	1330	458	2330	91	3330	1.605
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-13.093	1331	-14.981	2331	-24.868	3331	-26.885
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	9.679	1332	-304	2332	8.943	3332	-467
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	9.720	1333	0	2333	9.010	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	-41	1336	-304	2336	-67	3336	-467
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	10.132	1337	-3.273	2337	10.086	3337	241
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	34.514	1338	20.464	2338	34.560	3338	16.950
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	44.646	1339	17.191	2339	44.646	3339	17.191

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2022		Acumulado anterior 30/06/2021
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	-144	1357	-297	2357	-340	3357	-804
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-144	1358	-297	2358	-340	3358	-804
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	92	1360	199	2360	264	3360	555
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	52	1362	98	2362	77	3362	249
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: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2022								Situación cierre anual anterior 31/12/2021								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	3,83	0401	16,33	0421	0,14	0441	3,09	1381	3,46	1401	15,67	1421	0,00	1441	3,20	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	
Préstamos 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	

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

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	169	0467	95	0474	12	0481	0	0488	106	0495	19.070	0502	0	0509	19.176
De 1 a 3 meses	0461	16	0468	21	0475	2	0482	0	0489	22	0496	1.627	0503	0	0510	1.649
De 3 a 6 meses	0462	16	0469	35	0476	3	0483	2	0490	39	0497	1.719	0504	0	0511	1.758
De 6 a 9 meses	0463	10	0470	40	0477	2	0484	2	0491	43	0498	1.038	0505	0	0512	1.081
De 9 a 12 meses	0464	8	0471	54	0478	1	0485	4	0492	59	0499	1.135	0506	0	0513	1.194
Más de 12 meses	0465	102	0472	3.483	0479	64	0486	870	0493	4.417	0500	11.685	0507	0	0514	16.102
Total	0466	321	0473	3.727	0480	83	0487	877	0494	4.688	0501	36.274	0508	0	1515	40.962

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	169	0522	95	0529	12	0536	0	0543	106	0550	19.070	0557	0	0564	19.176	0571	32.263	0578	32.263	0584	59,44
De 1 a 3 meses	0516	16	0523	21	0530	2	0537	0	0544	22	0551	1.627	0558	0	0565	1.649	0572	2.941	0579	2.941	0585	56,08
De 3 a 6 meses	0517	16	0524	35	0531	3	0538	2	0545	39	0552	1.719	0559	0	0566	1.758	0573	2.694	0580	2.694	0586	65,26
De 6 a 9 meses	0518	10	0525	40	0532	2	0539	2	0546	43	0553	1.038	0560	0	0567	1.081	0574	1.757	0581	1.757	0587	61,53
De 9 a 12 meses	0519	8	0526	54	0533	1	0540	4	0547	59	0554	1.135	0561	0	0568	1.194	0575	1.780	0582	1.780	0588	67,09
Más de 12 meses	0520	102	0527	3.483	0534	64	0541	870	0548	4.417	0555	11.685	0562	0	0569	16.102	0576	20.328	0583	20.328	0589	79,21
Total	0521	321	0528	3.727	0535	83	0542	877	0549	4.688	0556	36.274	0563	0	0570	40.962	0577	61.764			0590	66,32

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: 30/06/2022

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 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 14/11/2006	
Inferior a 1 año	0600	378	1600	287	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	950	1601	887	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.600	1602	1.725	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	1.849	1603	1.445	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	3.606	1604	2.832	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	69.787	1605	75.208	2605	194
Superior a 10 años	0606	422.885	1606	443.925	2606	1.999.806
Total	0607	501.056	1607	526.310	2607	2.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	13,49	1608	13,90	2608	27,56

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 14/11/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	17,05	1609	16,56	2609	1,64

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: 30/06/2022
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 30/06/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				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	1.172	0630	48.386	1620	1.057	1630	43.576	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.770	0631	162.650	1621	1.842	1631	167.560	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	1.767	0632	249.618	1622	1.898	1632	272.685	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	198	0633	40.401	1623	209	1633	42.488	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	4.907	0638	501.056	1628	5.006	1638	526.310	2628	11.090	2638	2.000.000
Media ponderada (%)	0639	59,55	0649		1639	60,84	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: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 14/11/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,48	1650	0,48	2650	4,51
Tipo de interés nominal máximo	0651	2,01	1651	2,00	2651	5,88
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,00	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: 30/06/2022

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				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	234	0683	16.607	1660	243	1683	17.771	2660	484	2683	62.633
Aragón	0661	81	0684	5.625	1661	83	1684	5.928	2661	206	2684	30.916
Asturias	0662	42	0685	2.695	1662	43	1685	3.035	2662	71	2685	7.768
Baleares	0663	38	0686	3.433	1663	39	1686	3.631	2663	73	2686	11.943
Canarias	0664	26	0687	1.607	1664	26	1687	1.697	2664	82	2687	10.692
Cantabria	0665	80	0688	6.096	1665	85	1688	6.480	2665	142	2688	20.344
Castilla-León	0666	120	0689	7.450	1666	123	1689	7.889	2666	235	2689	30.276
Castilla La Mancha	0667	217	0690	18.085	1667	221	1690	19.143	2667	560	2690	89.081
Cataluña	0668	537	0691	57.747	1668	546	1691	60.534	2668	1.050	2691	188.843
Ceuta	0669	18	0692	416	1669	19	1692	501	2669	43	2692	3.879
Extremadura	0670	25	0693	1.097	1670	25	1693	1.142	2670	41	2693	4.142
Galicia	0671	81	0694	6.363	1671	81	1694	6.574	2671	127	2694	17.283
Madrid	0672	3.077	0695	348.157	1672	3.129	1695	364.711	2672	7.105	2695	1.401.798
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	18	0697	1.218	1674	18	1697	1.264	2674	72	2697	8.796
Navarra	0675	15	0698	1.361	1675	16	1698	1.525	2675	38	2698	6.331
La Rioja	0676	22	0699	1.858	1676	22	1699	1.916	2676	61	2699	9.523
Comunidad Valenciana	0677	171	0700	9.638	1677	178	1700	10.174	2677	502	2700	58.875
País Vasco	0678	105	0701	11.602	1678	109	1701	12.395	2678	198	2701	36.877
Total España	0679	4.907	0702	501.056	1679	5.006	1702	526.310	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	4.907	0705	501.056	1682	5.006	1705	526.310	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: 30/06/2022
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2022				Situación cierre anual anterior 31/12/2021				Situación inicial 14/11/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,76			1710	0,74			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: 30/06/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2022			Situación cierre anual anterior 31/12/2021			Situación inicial 14/11/2006					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0359091008	SERIE A1	4.600	0	0	4.600	0	0	4.600	100.000	460.000			
ES0359091016	SERIE A2	13.400	21.204	284.128	13.400	23.059	308.996	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	484.128	1723	20.000	1724	508.996	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: 30/06/2022

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					
ES0359091016	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,16	0,00	0	0	NO	284.128	0	0	284.128					
ES0359091024	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	0,00	0	0	NO	70.000	0	0	70.000					
ES0359091032	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	0,00	0	0	NO	75.000	0	0	75.000					
ES0359091040	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	0,15	5	0	NO	34.000	0	0	34.005					
ES0359091057	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	1,80	1,45	32	0	NO	21.000	0	0	21.032					
Total						0740	38	0741	0	0743	484.128	0744	0	0745	484.165	0746	

	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 14/11/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,05	0748	0,05	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: 30/06/2022

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2022								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2021							
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	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	26.345		
ES0359091016	SERIE A2	13.093	1.055.872	0	191.035	14.981	1.005.337	0	191.035	0	1.005.337	0	191.035	0	191.035		
ES0359091024	SERIE B	0	0	0	11.690	0	0	0	11.690	0	0	0	11.690	0	11.690		
ES0359091032	SERIE C	0	0	0	12.898	0	0	0	12.898	0	0	0	12.898	0	12.898		
ES0359091040	SERIE D	0	0	0	6.747	0	0	0	6.747	0	0	0	6.747	0	6.747		
ES0359091057	SERIE E	0	0	67	8.447	0	0	67	8.447	0	0	67	8.447	0	8.447		
Total		0754	13.093	0755	1.515.872	0756	67	0757	257.162	1754	14.981	1755	1.465.337	1756	67	1757	256.896

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: 30/06/2022

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 30/06/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	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	29/09/2021	FCH	A+	A+	AAA
ES0359091016	SERIE A2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359091016	SERIE A2	01/06/2022	SYP	AAA	AA+	AAA
ES0359091024	SERIE B	29/09/2021	FCH	A-	A-	AA
ES0359091024	SERIE B	22/06/2022	MDY	Aa1	Aa2	Aa2
ES0359091024	SERIE B	01/06/2022	SYP	AA+	AA	AA
ES0359091032	SERIE C	29/09/2021	FCH	BB-	BB-	A
ES0359091032	SERIE C	22/06/2022	MDY	Baa1	Ba1	A2
ES0359091032	SERIE C	01/06/2022	SYP	AA	A	A
ES0359091040	SERIE D	18/03/2009	FCH	CCC	CCC	BBB
ES0359091040	SERIE D	22/06/2022	MDY	Caa1	Caa3	Baa2
ES0359091040	SERIE D	01/06/2022	SYP	BB+	B+	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

S.05.2
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: 30/06/2022
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 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 14/11/2006	
Inferior a 1 año	0765	26.217	1765	21.327	2765	26.458
Entre 1 y 2 años	0766	30.437	1766	32.253	2766	28.925
Entre 2 y 3 años	0767	31.478	1767	33.307	2767	30.618
Entre 3 y 4 años	0768	32.695	1768	34.497	2768	32.409
Entre 4 y 5 años	0769	33.738	1769	35.782	2769	34.306
Entre 5 y 10 años	0770	163.727	1770	176.775	2770	204.080
Superior a 10 años	0771	165.836	1771	175.055	2771	1.643.203
Total	0772	484.128	1772	508.996	2772	2.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	10,30	1773	10,50	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: 30/06/2022

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 14/11/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	7.923	1775	7.203	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	1,64	1777	1,42	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	58,68	1792	60,70	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	

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

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 30/06/2022	Situación cierre anual anterior 31/12/2021	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	-5.155	-5.155		
Total							0808 -5.155	0809 -5.155	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2022

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 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación inicial 14/11/2006		Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		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: 30/06/2022

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 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	1.204	7006	417	7009	0,25	7012	0,08	7015	0,17		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.204	7008	417	7011	0,25	7014	0,08	7017	0,17	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	75.858	7024	75.756	7027	13,76	7030	13,14	7033	13,54		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	75.858	7026	75.756	7029	13,76	7032	13,14	7035	13,54	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2022		Situación cierre anual anterior 31/12/2021		
	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: 30/06/2022

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 C - ES0359091032	7,50	15,49	15,08	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359091016	25,00	6,87	6,87	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	10,00	30,64	31,08	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	2,00	0,25	0,17	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	3,40	7,02	6,84	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	2,10	4,34	4,22	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	10,00	30,64	31,08	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359091008	25,00	6,87	6,87	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	7,00	14,46	14,08	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	1,50	0,25	0,17	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	10,00	30,64	31,08	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	10,00	30,64	31,08	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	1,25	0,25	0,17	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	1,75	0,25	0,17	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE B - ES0359091024	18,30	6,87	6,87	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE C - ES0359091032	13,20	6,87	6,87	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE D - ES0359091040	9,40	6,87	6,87	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE E - ES0359091057	8,00	6,87	6,87	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		1,64	1,57	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: 30/06/2022

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	10	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: 30/06/2022

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: 30/06/2022

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
		22/02/2022	23/05/2022										
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885												
Saldo inicial	0886	7.203	7.789										
Cobros del periodo	0887	12.953	13.487										
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-330	-49										
Pagos por derivados	0889	-196	-144										
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-7.789	-7.923										
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-11.841	-13.160										
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0										
Resto pagos/retenciones	0893	0	0										
Saldo disponible	0894	0	0										
Liquidación de comisión variable	0895	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: 30/06/2022

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