

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: 30/06/2021

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: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	507.001	1001	530.973
I. Activos financieros a largo plazo	0002	507.001	1002	530.973
1. Activos titulizados	0003	507.001	1003	530.973
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	494.567	1005	518.816
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	13.798	1025	13.519
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-1.363	1027	-1.363
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: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	75.640	1041	79.595
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	19.823	1042	20.734
V. Activos financieros a corto plazo	0043	38.626	1043	41.912
1. Activos titulizados	0044	38.617	1044	41.903
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	36.228	1046	39.733
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	87	1065	130
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	16	1066	23
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	4.062	1067	3.798
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	64	1068	59
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-1.840	1069	-1.840
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	17.191	1085	16.950
1. Tesorería	0086	17.191	1086	16.950
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	582.641	1088	610.568

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	525.607	1089	549.498
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	525.607	1094	549.498
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	494.374	1095	518.017
1.1 Series no subordinadas	0096	294.374	1096	318.017
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	23.758	1101	24.005
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	-47.242	1105	-46.995
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	7.475	1108	7.475
3.1 Derivados de cobertura	0109	7.475	1109	7.475
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: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) PASIVO CORRIENTE	0117	65.818	1117	69.606
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	65.020	1123	67.812
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	40.316	1124	43.559
1.1 Series no subordinadas	0125	40.289	1125	43.531
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	27	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	23.543	1131	23.092
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	92	1136	96
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	23.451	1137	22.997
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	1.156	1139	1.156
3.1 Derivados de cobertura	0140	1.156	1140	1.156
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	5	1143	5
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	5	1146	5
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	799	1148	1.794
1. Comisiones	0149	14	1149	15
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	3
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	785	1157	1.779
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-8.785	1158	-8.535
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-8.785	1160	-8.535
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	582.641	1162	610.568

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2021		Acumulado anterior 30/06/2020
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	605	1201	994	2201	1.363	3201	1.955
1.1 Activos titulizados	0202	605	1202	994	2202	1.363	3202	1.955
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-308	1204	-356	2204	-614	3204	-695
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-67	1205	-91	2205	-133	3205	-173
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-225	1206	-259	2206	-450	3206	-509
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-16	1207	-5	2207	-31	3207	-13
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-199	1208	-212	2208	-555	3208	-515
A) MARGEN DE INTERESES	0209	97	1209	426	2209	194	3209	746
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	22	1216	17	2216	46	3216	36
7. Otros gastos de explotación	0217	-324	1217	-409	2217	-633	3217	-899
7.1 Servicios exteriores	0218	-284	1218	-367	2218	-553	3218	-814
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-284	1219	-367	2219	-553	3219	-814
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	-40	1224	-43	2224	-79	3224	-85
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-32	1225	-34	2225	-63	3225	-67
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-8	1227	-8	2227	-16	3227	-17
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	-52	1231	-262	2231	-308	3231	-262
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-52	1232	-262	2232	-308	3232	-262
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	92	1238	64	2238	454	3238	358
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	165	1239	164	2239	247	3239	22
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: 30/06/2021

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2021		Acumulado anterior 30/06/2020
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	217	1300	577	2300	404	3300	1.014
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	234	1301	604	2301	438	3301	1.063
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	615	1302	955	2302	1.408	3302	1.918
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-67	1303	-79	2303	-134	3303	-164
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	-297	1305	-266	2305	-804	3305	-674
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	-17	1308	-7	2308	-31	3308	-18
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-40	1309	-42	2309	-80	3309	-85
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-32	1310	-34	2310	-64	3310	-68
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-8	1312	-8	2312	-16	3312	-17
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	22	1315	16	2315	46	3315	36
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	22	1321	16	2321	46	3321	36
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-3.490	1322	-1.928	2322	-163	3322	-2.423
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	-3.186	1325	-1.555	2325	304	3325	-1.598
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	6.353	1326	7.139	2326	13.427	3326	14.648
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	4.591	1327	1.323	2327	10.398	3327	4.647
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	394	1328	785	2328	1.759	3328	1.323
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	458	1330	618	2330	1.605	3330	1.618
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-14.981	1331	-11.419	2331	-26.885	3331	-23.833
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-304	1332	-373	2332	-467	3332	-825
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	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	-304	1336	-373	2336	-467	3336	-825
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-3.273	1337	-1.351	2337	241	3337	-1.409
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	20.464	1338	13.916	2338	16.950	3338	13.974
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	17.191	1339	12.565	2339	17.191	3339	12.565

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2021		Acumulado anterior 30/06/2020
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	-297	1357	-266	2357	-804	3357	-674
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-297	1358	-266	2358	-804	3358	-674
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	199	1360	212	2360	555	3360	515
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	98	1362	54	2362	249	3362	160
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: 30/06/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2021								Situación cierre anual anterior 31/12/2020								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	3,26	0401	15,28	0421	0,00	0441	3,29	1381	3,01	1401	14,62	1421	0,00	1441	2,20	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	

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: 30/06/2021

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	258	0467	122	0474	14	0481	0	0488	136	0495	28.129	0502	0	0509	28.264
De 1 a 3 meses	0461	24	0468	30	0475	3	0482	0	0489	32	0496	2.865	0503	0	0510	2.897
De 3 a 6 meses	0462	13	0469	34	0476	3	0483	2	0490	40	0497	1.686	0504	0	0511	1.726
De 6 a 9 meses	0463	12	0470	45	0477	3	0484	4	0491	52	0498	1.590	0505	0	0512	1.642
De 9 a 12 meses	0464	9	0471	47	0478	4	0485	3	0492	55	0499	1.232	0506	0	0513	1.287
Más de 12 meses	0465	91	0472	2.859	0479	54	0486	727	0493	3.639	0500	10.366	0507	0	0514	14.006
Total	0466	407	0473	3.137	0480	80	0487	737	0494	3.954	0501	45.867	0508	0	1515	49.821

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	258	0522	122	0529	14	0536	0	0543	136	0550	28.129	0557	0	0564	28.264	0571	46.425	0578	46.425	0584	60,88
De 1 a 3 meses	0516	24	0523	30	0530	3	0537	0	0544	32	0551	2.865	0558	0	0565	2.897	0572	4.529	0579	4.529	0585	63,97
De 3 a 6 meses	0517	13	0524	34	0531	3	0538	2	0545	40	0552	1.686	0559	0	0566	1.726	0573	2.580	0580	2.580	0586	66,88
De 6 a 9 meses	0518	12	0525	45	0532	3	0539	4	0546	52	0553	1.590	0560	0	0567	1.642	0574	2.361	0581	2.361	0587	69,55
De 9 a 12 meses	0519	9	0526	47	0533	4	0540	3	0547	55	0554	1.232	0561	0	0568	1.287	0575	2.008	0582	2.008	0588	64,08
Más de 12 meses	0520	91	0527	2.859	0534	54	0541	727	0548	3.639	0555	10.366	0562	0	0569	14.006	0576	17.803	0583	17.803	0589	78,67
Total	0521	407	0528	3.137	0535	80	0542	737	0549	3.954	0556	45.867	0563	0	0570	49.821	0577	75.706			0590	65,81

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: 30/06/2021

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 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 14/11/2006	
Inferior a 1 año	0600	214	1600	193	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	547	1601	357	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.485	1602	1.442	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	1.994	1603	2.117	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	2.100	1604	1.984	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	81.089	1605	82.371	2605	194
Superior a 10 años	0606	461.225	1606	487.402	2606	1.999.806
Total	0607	548.653	1607	575.867	2607	2.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	14,32	1608	14,80	2608	27,56

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 14/11/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	16,08	1609	15,59	2609	1,64

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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 30/06/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				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	965	0630	40.697	1620	882	1630	37.087	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.907	0631	174.615	1621	1.991	1631	184.412	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	1.973	0632	286.687	1622	2.057	1632	302.914	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	228	0633	46.654	1623	249	1633	51.455	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	5.073	0638	548.653	1628	5.179	1638	575.867	2628	11.090	2638	2.000.000
Media ponderada (%)	0639	62,06	0649		1639	63,40	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: 30/06/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 14/11/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,61	1650	0,68	2650	4,51
Tipo de interés nominal máximo	0651	2,00	1651	2,10	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: 30/06/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				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	248	0683	18.989	1660	258	1683	20.323	2660	484	2683	62.633
Aragón	0661	84	0684	6.270	1661	87	1684	6.739	2661	206	2684	30.916
Asturias	0662	43	0685	3.133	1662	43	1685	3.244	2662	71	2685	7.768
Baleares	0663	39	0686	3.774	1663	39	1686	3.896	2663	73	2686	11.943
Canarias	0664	26	0687	1.774	1664	27	1687	1.953	2664	82	2687	10.692
Cantabria	0665	86	0688	6.822	1665	88	1688	7.143	2665	142	2688	20.344
Castilla-León	0666	125	0689	8.367	1666	128	1689	8.997	2666	235	2689	30.276
Castilla La Mancha	0667	224	0690	20.153	1667	227	1690	20.974	2667	560	2690	89.081
Cataluña	0668	554	0691	63.512	1668	567	1691	66.584	2668	1.050	2691	188.843
Ceuta	0669	20	0692	565	1669	20	1692	617	2669	43	2692	3.879
Extremadura	0670	25	0693	1.204	1670	25	1693	1.247	2670	41	2693	4.142
Galicia	0671	83	0694	6.855	1671	84	1694	7.126	2671	127	2694	17.283
Madrid	0672	3.164	0695	378.292	1672	3.230	1695	396.805	2672	7.105	2695	1.401.798
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	19	0697	1.403	1674	19	1697	1.449	2674	72	2697	8.796
Navarra	0675	16	0698	1.573	1675	16	1698	1.620	2675	38	2698	6.331
La Rioja	0676	22	0699	1.972	1676	22	1699	2.026	2676	61	2699	9.523
Comunidad Valenciana	0677	182	0700	10.713	1677	184	1700	11.300	2677	502	2700	58.875
País Vasco	0678	113	0701	13.283	1678	115	1701	13.823	2678	198	2701	36.877
Total España	0679	5.073	0702	548.653	1679	5.179	1702	575.867	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	5.073	0705	548.653	1682	5.179	1705	575.867	2682	11.090	2705	2.000.000

MADRID RMBS I, FTA

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: 30/06/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 14/11/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,72			1710	0,71			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: 30/06/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2021			Situación cierre anual anterior 31/12/2020			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	24.975	334.663	13.400	26.981	361.548	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	534.663	1723	20.000	1724	561.548	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: 30/06/2021

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		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
						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	0	0			
ES0359091016	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,16	0,00	0	0	NO	334.663	0	0	334.663	0	0			
ES0359091024	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	0,00	0	0	NO	70.000	0	0	70.000	0	0			
ES0359091032	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	0,00	0	0	NO	75.000	0	0	75.000	0	0			
ES0359091040	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	0,00	0	0	NO	34.000	0	0	34.000	0	0			
ES0359091057	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	1,80	1,26	27	0	NO	21.000	0	0	21.027	0	0			
Total						0740	27	0741	0	0743	534.663	0744	0	0745	534.690	0746	0

	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 14/11/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,05	0748	0,06	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: 30/06/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2021								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2020							
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
ES0359091008	SERIE A1	0	460.000	0	26.345	0	26.345	0	460.000	0	460.000	0	26.345	0	26.345	0	26.345
ES0359091016	SERIE A2	14.981	1.005.337	0	191.035	0	191.035	11.419	956.794	0	191.035	0	191.035	0	191.035	0	191.035
ES0359091024	SERIE B	0	0	0	11.690	0	11.690	0	0	0	11.690	0	11.690	0	11.690	0	11.690
ES0359091032	SERIE C	0	0	0	12.898	0	12.898	0	0	0	12.898	0	12.898	0	12.898	0	12.898
ES0359091040	SERIE D	0	0	0	6.747	0	6.747	0	0	7	6.727	0	6.727	7	6.727	0	6.727
ES0359091057	SERIE E	0	0	67	8.180	67	8.180	0	0	71	7.893	71	7.893	71	7.893	71	7.893
Total		0754	14.981	0755	1.465.337	0756	67	0757	256.896	1754	11.419	1755	1.416.794	1756	79	1757	256.585

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: 30/06/2021

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 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	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	22/12/2017	FCH	A-	A-	AAA
ES0359091016	SERIE A2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359091016	SERIE A2	15/03/2021	SYP	AA+	AA-	AAA
ES0359091024	SERIE B	11/07/2019	FCH	BBB	BBB	AA
ES0359091024	SERIE B	27/11/2020	MDY	Aa2	Aa2	Aa2
ES0359091024	SERIE B	15/03/2021	SYP	AA	A	AA
ES0359091032	SERIE C	11/07/2019	FCH	B+	B+	A
ES0359091032	SERIE C	27/11/2020	MDY	Ba1	Ba1	A2
ES0359091032	SERIE C	15/03/2021	SYP	A	BBB	A
ES0359091040	SERIE D	18/03/2009	FCH	CCC	CCC	BBB
ES0359091040	SERIE D	27/11/2020	MDY	Caa3	Caa3	Baa2
ES0359091040	SERIE D	15/03/2021	SYP	B+	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

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: 30/06/2021

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 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 14/11/2006	
Inferior a 1 año	0765	26.609	1765	20.965	2765	26.458
Entre 1 y 2 años	0766	32.035	1766	32.061	2766	28.925
Entre 2 y 3 años	0767	33.189	1767	33.431	2767	30.618
Entre 3 y 4 años	0768	34.297	1768	34.555	2768	32.409
Entre 4 y 5 años	0769	35.553	1769	35.830	2769	34.306
Entre 5 y 10 años	0770	181.369	1770	186.445	2770	204.080
Superior a 10 años	0771	191.611	1771	218.262	2771	1.643.203
Total	0772	534.663	1772	561.548	2772	2.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	10,83	1773	14,40	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: 30/06/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 14/11/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	6.717	1775	5.349	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	1,26	1777	0,95	2777	3,55
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	CaixaBank	1778	Bankia	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	62,59	1792	64,38	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: 30/06/2021

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 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	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	-8.631	-8.631		
Total							0808 -8.631	0809 -8.631	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 14/11/2006		Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		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: 30/06/2021

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 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	1.177	7006	1.069	7009	0,22	7012	0,19	7015	0,45		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.177	7008	1.069	7011	0,22	7014	0,19	7017	0,45	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	77.369	7024	79.251	7027	12,84	7030	12,53	7033	12,59		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	104	7028	0,00	7031	0,02	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	77.369	7026	79.355	7029	12,84	7032	12,55	7035	12,59	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		
	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: 30/06/2021

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 D - ES0359091040	3,40	6,36	6,19	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	7,00	13,09	12,74	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359091008	25,00	6,91	6,89	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	2,10	3,93	3,82	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	10,00	33,17	33,63	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	10,00	33,17	33,63	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	1,25	0,22	0,45	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	1,75	0,22	0,45	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	2,00	0,22	0,45	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359091016	25,00	6,91	6,89	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	7,50	14,03	13,65	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	1,50	0,22	0,45	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	10,00	33,17	33,63	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	10,00	33,17	33,63	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE E - ES0359091057	8,00	6,91	6,89	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE B - ES0359091024	18,30	6,91	6,89	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE C - ES0359091032	13,20	6,91	6,89	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE D - ES0359091040	9,40	6,91	6,89	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		1,26	1,08	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: 30/06/2021

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	

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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: 30/06/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
		22/02/2021	24/05/2021										
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885												
Saldo inicial	0886	5.349	5.920										
Cobros del periodo	0887	13.289	16.543										
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-239	-400										
Pagos por derivados	0889	-507	-297										
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-5.920	-6.717										
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-11.971	-15.048										
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: 30/06/2021

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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