

**MADRID RMBS I - Fondo de Titulización de Activos**

**LIQUIDACION DEL PERIODO 23/08/21 - 22/11/21**

	Euros
<b>I. Situación al 23/08/21:</b>	<b>6.991.370,01</b>
Fondo de Reserva	6.991.370,01
<b>II. Fondos recibidos del emisor</b>	<b>12.259.786,58</b>
<b>Principal:</b>	
Según calendario hasta 31/10/21:	8.268.516,04
Amort. Anticipada hasta 31/10/21:	2.956.042,49
<b>Intereses:</b>	<b>614.203,03</b>
Ingresos por inmuebles	421.025,02
<b>III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):</b>	<b>19.251.156,59</b>
<b>IV. Total intereses de la reinversión:</b>	<b>-14.939,60</b>
Intereses de la Cta. De Tesorería	-14.939,60
<b>V. Recursos disponibles (III + IV):</b>	<b>19.236.216,99</b>
<b>VI. Gastos:</b>	<b>242.863,46</b>
<b>VII. Liquidación SWAP:</b>	<b>-167.560,49</b>
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	-659.198,42
Cantidad a Pagar por la Parte A (Caixabank):	-826.758,91
<b>VIII. Pago a los Bonos:</b>	<b>11.622.379,70</b>
<b>Bonos A2 :</b>	
Intereses correspondientes al 22/11/21:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 22/11/21:	11.556.026,00
<b>Bonos B:</b>	
Intereses correspondientes al 22/11/21:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 22/11/21:	0,00
<b>Bonos C:</b>	
Intereses correspondientes al 22/11/21:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 22/11/21:	0,00
<b>Bonos D:</b>	
Intereses correspondientes al 22/11/21:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 22/11/21:	0,00
<b>Bonos E:</b>	
Intereses correspondientes al 22/11/21:	66.353,70
Retenciones practicadas a los bonos:	12.607,20
Amortización correspondiente al 22/11/21:	0,00
<b>Reinversión o devolución de las retenciones:</b>	<b>-12.607,20</b>
<b>IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII):</b>	<b>7.203.413,34</b>
<b>Distribución del saldo disponible:</b>	
Fondo de Reserva previo 23/08/21:	6.991.370,01
Aportación al Fondo de Reserva	212.043,33
Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada	0,00
Amortización Préstamo Participativo	0,00
<b>Remuneración Variable Prést. Participativo</b>	<b>0,00</b>

**Fondo de Reserva 22/11/21:**

**7.203.413,34**

**Destinatarios: CNMV, AIAF**



**Nº: 4166/21**

Titulización de Activos, SGFT, S.A.  
Orense, 58  
28020 Madrid  
Tel.: 917020808  
<http://www.tda-sgft.com>  
MADRID RMBS I liq.trim/Nov21

**MADRID RMBS I****INFORMACION A LOS INVERSORES****FECHA DE PAGO: 22 de Noviembre de 2021**

Importes en euros

<b>I. BONOS A2 ES0359091016</b>		
	<b>Sobre 13400 bonos</b>	<b>Por Bono</b>
1. Saldo inicial (22/11/06):	1.340.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	320.551.986,00 €	23.921,79 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	11.556.026,00 €	862,39 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	308.995.960,00 €	23.059,40 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	23,059400%	23,059400%

<b>II. BONOS B ES0359091024</b>		
	<b>Sobre 700 bonos</b>	<b>Por Bono</b>
1. Saldo inicial (22/11/06):	70.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	70.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	70.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

<b>III. BONOS C ES0359091032</b>		
	<b>Sobre 750 bonos</b>	<b>Por Bono</b>
1. Saldo inicial (22/11/06):	75.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	75.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	75.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

<b>IV. BONOS D ES0359091040</b>		
	<b>Sobre 340 bonos</b>	<b>Por Bono</b>
1. Saldo inicial (22/11/06):	34.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	34.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	34.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

<b>V. BONOS E ES0359091057</b>		
	<b>Sobre 210 bonos</b>	<b>Por Bono</b>
1. Saldo inicial (22/11/06):	21.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	21.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	66.353,70 €	315,97 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	21.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

<b>VI. EL FONDO</b>		
<b>Importes en euros</b>		
<b>1. Saldo de certificados de transmisión hipotecaria a 31/10/21:</b>		
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidos:		508.995.949,32 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidos:		69.142.480,10 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidos:		509.136.168,19 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidos:		137.687.218,70 €
<b>2. Amortización del periodo 31/07/21 a 31/10/21:</b>		<b>11.224.558,53 €</b>
a) Según calendario:		8.268.516,04 €
b) Amortización anticipada hasta 31/10/21:		2.956.042,49 €
<b>3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):</b>		
a) Ultimo año:		3,25%
b) Ultimo semestre:		3,01%
c) Ultimo trimestre:		2,25%
<b>4. Porcentaje de fallidos (1):</b>		<b>21,29%</b>
<b>5. Nivel de Impago(2):</b>		<b>0,10%</b>

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

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

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF.



Nº: 4167/21

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

MADRID RMBS I\infoinver.trim\Nov21

**MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

**INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 23/08/21-22/11/21**

**I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO**

Fecha de Constitución del Fondo	15 de noviembre de 2006
Fecha Emisión BTH	15 de noviembre de 2006
Fecha Final Amortización Bonos: (3,25% TAA)	24 de noviembre de 2031
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca	Bankia (Caja Madrid)
Agente de Pagos	BNP Paribas, Sucursal en España
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Fitch Ibcá / Standard & Poor's / Moody's Investors Service
Calificación	Bonos A2: (F) A+ sf / (S&P) AA+ sf / (M) Aa1 sf Bonos B: (F) A- sf / (S&P) AA sf / (M) Aa2 sf Bonos C: (F) BB- sf / (S&P) A sf / (M) Ba1 sf Bonos D: (F) CCC sf / (S&P) B+ sf / (M) Caa3 sf Bonos E: (F) CC sf / (S&P) CCC- sf / (M) C sf

**II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO**

Nombre	Bonos de Titulización MADRID RMBS I
Serie A2:	
Código ISIN	ES0359091016
Nominal en circulación total (inicial)	1.340.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	308.995.960,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	23.059,40 Euros
Serie B:	
Código ISIN	ES0359091024
Nominal en circulación total (inicial)	70.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	70.000.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros

MADRID RMBS I\INFO.trim\Nov21

**II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)**

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

**III. INFORMACION INCLUIDA**

* Liquidación del Período:23/08/21-22/11/21
* Flujos de Caja del Período:23/08/21-22/11/21
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 22 de Noviembre de 2021

MADRID RMBS I\INFO.trim\Nov21

**MADRID RMBS I****Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 23/08/21 - 22/11/21**

<b>I. INVERSIONES/FINANCIACIONES</b>	<b>Euros</b>	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip.		11.556.026,00
Amortización Participaciones Hip.	11.224.558,53	
Ingresos inmuebles	421.025,02	
Amortización Ptmos. Subordinados		0,00
<b>II. INTERESES</b>		
Intereses pagados a los BTH		66.353,70
Intereses recibidos de las CTHs	614.203,03	
Intereses Ptmos. Subordinados		0,00
Intereses Inversiones Temporales	-14.939,60	
<b>III. GASTOS</b>		
Comisiones y Gastos		242.863,46
Neto SWAP		167.560,49
Remuneración Variable Préstamo Participativo		0,00
<b>Total Ingresos/Pagos</b>	<b>12.244.846,98</b>	<b>12.032.803,65</b>
Saldo inicial 23/08/21	6.991.370,01	
A Inversiones Temporales		7.203.413,34
Otros Recursos		0,00
<b>Total</b>	<b>19.236.216,99</b>	<b>19.236.216,99</b>
Retenciones practicadas el 22/11/21	12.607,20	
A Inversiones Temporales		12.607,20

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 4172/21**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

MADRID RMBS I\fluj.trim\Nov21