

MADRID RMBS I - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 22/11/23 - 22/02/24

	Euros
I. Situación al 22/11/23:	13.018.586,57
Fondo de Reserva	13.018.586,57
II. Fondos recibidos del emisor	24.289.812,33
Principál:	
Según calendario hasta 31/01/24:	7.366.014,08
Amort. Anticipada hasta 31/01/24:	11.503.423,44
Intereses:	4.623.874,81
Ingresos por inmuebles	796.500,00
III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):	37.308.398,90
IV. Total intereses de la reinversión:	317.152,39
Intereses de la Cta. De Tesorería	317.152,39
V. Recursos disponibles (III + IV):	37.625.551,29
VI. Gastos:	192.461,96
VII. Liquidación SWAP:	-80.378,57
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	3.798.035,09
Cantidad a Pagar por la Parte A (Caixabank):	3.717.656,52
VIII. Pago a los Bonos:	24.980.424,70
Bonos A2 :	
Intereses correspondientes al 22/02/24:	1.814.762,00
Retenciones practicadas a los bonos:	344.804,78
Amortización correspondiente al 22/02/24:	20.898.372,00
Bonos B:	
Intereses correspondientes al 22/02/24:	753.480,00
Retenciones practicadas a los bonos:	143.161,20
Amortización correspondiente al 22/02/24:	0,00
Bonos C:	
Intereses correspondientes al 22/02/24:	816.885,00
Retenciones practicadas a los bonos:	155.208,15
Amortización correspondiente al 22/02/24:	0,00
Bonos D:	
Intereses correspondientes al 22/02/24:	387.698,60
Retenciones practicadas a los bonos:	73.662,73
Amortización correspondiente al 22/02/24:	0,00
Bonos E:	
Intereses correspondientes al 22/02/24:	309.227,10
Retenciones practicadas a los bonos:	58.753,15
Amortización correspondiente al 22/02/24:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones:	-775.590,01
IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII):	12.372.286,06
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva previo 22/11/23:	13.018.586,57
Aportación al Fondo de Reserva	-646.300,51
Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada	0,00
Amortización Préstamo Participativo	0,00
Otros Recursos para el siguiente pago	0,00
Remuneración Variable Prést. Participativo	0,00
Fondo de Reserva 22/02/24:	12.372.286,06

Destinatario: CNMV, AIAF



Nº: 617/24

Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

MADRID RMBS I liq.trim1Feb24

MADRID RMBS I**INFORMACION A LOS INVERSORES****FECHA DE PAGO: 22 de Febrero de 2024**

Importes en euros

I. BONOS A2 ES0359091016		
	Sobre 13400 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (22/11/06):	1.340.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	172.273.750,00 €	12.856,25 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	1.814.762,00 €	135,43 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	20.898.372,00 €	1.559,58 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	151.375.378,00 €	11.296,67 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	11,296670%	11,296670%
II. BONOS B ES0359091024		
	Sobre 700 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (22/11/06):	70.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	70.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	753.480,00 €	1.076,40 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	70.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
III. BONOS C ES0359091032		
	Sobre 750 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (22/11/06):	75.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	75.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	816.885,00 €	1.089,18 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	75.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
IV. BONOS D ES0359091040		
	Sobre 340 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (22/11/06):	34.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	34.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	387.698,60 €	1.140,29 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	34.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
V. BONOS E ES0359091057		
	Sobre 210 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (22/11/06):	21.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	21.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	309.227,10 €	1.472,51 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	21.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
VI. EL FONDO		
Importes en euros		
1. Saldo de certificados de transmisión hipotecaria a 31/01/24:		
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidos:		351.375.413,02 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidos:		65.278.758,93 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidos:		351.543.819,32 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidos:		137.642.760,27 €
2. Amortización del período 31/10/23 a 31/01/24:		18.869.437,52 €
a) Según calendario:		7.366.014,08 €
b) Amortización anticipada hasta 31/01/24:		11.503.423,44 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):		
a) Ultimo año:		11,35%
b) Ultimo semestre:		11,13%
c) Ultimo trimestre:		11,80%
4. Porcentaje de fallidos (1):		28,14%
5. Nivel de Impago(2):		0,80%

(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: 618/24

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

http://www.tda-sgft.com

MADRID RMBS I|Inforver.trimFeb24

MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 22/11/23-22/02/24

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: (11,35% TAA)	22 de mayo de 2028
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca	Caixabank (Bankia)
Agente de Pagos	Société Générale, Sucursal en España
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Fitch Ibca / Standard & Poor's / Moody's Investors Service
Calificación	Bonos A2: (F) A+ sf / (S&P) AAA sf / (M) Aa1 sf Bonos B: (F) A+ sf / (S&P) AA+ sf / (M) Aa1 sf Bonos C: (F) BB sf / (S&P) AA sf / (M) A1 sf Bonos D: (F) B- sf / (S&P) BB+ sf / (M) B3 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)	151.375.378,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	11.296,67 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\Feb24

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)

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

III. INFORMACION INCLUIDA

* Liquidación del Período:22/11/23-22/02/24
* Flujos de Caja del Período:22/11/23-22/02/24
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 22 de Febrero de 2024

MADRID RMBS I\INFO.trim\Feb24

MADRID RMBS I**Fondo de Titulización de Activos
FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/11/23 - 22/02/24**

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip.		20.898.372,00
Amortización Participaciones Hip.	18.869.437,52	
Ingresos inmuebles	796.500,00	
Amortización Ptmos. Subordinados		0,00
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH		4.082.052,70
Intereses recibidos de las CTHs	4.623.874,81	
Intereses Ptmos. Subordinados		0,00
Intereses Inversiones Temporales	317.152,39	
III. GASTOS		
Comisiones y Gastos		192.461,96
Neto SWAP		80.378,57
Remuneración Variable Préstamo Participativo		0,00
Total Ingresos/Pagos	24.606.964,72	25.253.265,23
Saldo inicial 22/11/23	13.018.586,57	
A Inversiones Temporales		12.372.286,06
Otros Recursos		0,00
Total	37.625.551,29	37.625.551,29
Retenciones practicadas el 22/02/24	775.590,01	
A Inversiones Temporales		775.590,01

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 623/24**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

MADRID RMBS I\flujo.trim\Feb24