

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: 30/06/2024

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: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	318.337	1001	352.187
I. Activos financieros a largo plazo	0002	318.337	1002	352.187
1. Activos titulizados	0003	318.337	1003	352.187
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	301.463	1005	333.963
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	17.963	1025	19.313
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-1.089	1027	-1.089
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: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	74.305	1041	88.711
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	15.253	1042	15.817
V. Activos financieros a corto plazo	0043	30.842	1043	31.710
1. Activos titulizados	0044	30.765	1044	31.620
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	27.045	1046	27.687
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	578	1065	673
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	85	1066	95
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	5.322	1067	5.426
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	164	1068	168
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-2.429	1069	-2.429
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	78	1074	90
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	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	78	1079	90
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	28.210	1085	41.184
1. Tesorería	0086	28.210	1086	41.184
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	392.642	1088	440.899

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	330.858	1089	369.204
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	330.858	1094	369.204
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	302.161	1095	339.161
1.1 Series no subordinadas	0096	102.161	1096	139.161
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	23.772	1101	25.118
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	-47.228	1105	-45.882
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	4.925	1108	4.925
3.1 Derivados de cobertura	0109	4.925	1109	4.925
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: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) PASIVO CORRIENTE	0117	67.017	1117	76.838
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	65.861	1123	75.182
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	33.878	1124	34.844
1.1 Series no subordinadas	0125	32.367	1125	33.113
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	1.511	1128	1.730
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	30.904	1131	28.850
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	432	1136	443
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	30.471	1137	28.407
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	1.078	1139	1.078
3.1 Derivados de cobertura	0140	1.078	1140	1.078
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	0	1143	10.410
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	10.410
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	1.157	1148	1.656
1. Comisiones	0149	13	1149	14
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	11	1150	11
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	1.143	1157	1.642
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-5.233	1158	-5.143
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-5.233	1160	-5.143
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	392.642	1162	440.899

S.02

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2024		Acumulado anterior 30/06/2023
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	4.312	1201	4.621	2201	9.032	3201	8.282
1.1 Activos titulizados	0202	4.026	1202	4.394	2202	8.440	3202	7.894
1.2 Otros activos financieros	0203	286	1203	227	2203	592	3203	388
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-4.706	1204	-4.371	2204	-9.678	3204	-7.820
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-3.684	1205	-3.516	2205	-7.624	3205	-6.261
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1.021	1206	-855	2206	-2.054	3206	-1.559
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-10	1208	77	2208	-126	3208	415
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-403	1209	326	2209	-772	3209	877
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	258	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-207	1217	-591	2217	-392	3217	-628
7.1 Servicios exteriores	0218	-176	1218	-556	2218	-328	3218	-558
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-176	1219	-556	2219	-328	3219	-558
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	-31	1224	-35	2224	-63	3224	-71
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-26	1225	-29	2225	-53	3225	-58
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-5	1227	-6	2227	-11	3227	-13
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	-525	1231	-105	2231	-598	3231	-399
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-525	1232	-105	2232	-598	3232	-399
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	255	1238	210	2238	415	3238	523
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	880	1239	-99	2239	1.346	3239	-373
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: 30/06/2024

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2024		Acumulado anterior 30/06/2023
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	467	1300	1.629	2300	1.031	3300	3.500
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	498	1301	1.664	2301	1.095	3301	3.572
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	4.105	1302	4.207	2302	8.550	3302	7.523
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-3.761	1303	-3.182	2303	-7.843	3303	-5.651
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	421	2304	0	3304	1.345
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-135	1305	0	2305	-215	3305	0
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	290	1306	218	2306	604	3306	355
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	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-32	1309	-35	2309	-64	3309	-72
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-26	1310	-29	2310	-53	3310	-59
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	-6	2312	-11	3312	-13
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	0	2315	0	3315	0
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	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-11.220	1322	757	2322	-14.005	3322	-5.299
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	241	1325	1.959	2325	-3.211	3325	2.866
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	5.787	1326	6.770	2326	11.646	3326	13.658
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	8.975	1327	14.770	2327	18.932	3327	27.426
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.761	1328	974	2328	2.976	3328	2.259
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	566	1330	618	2330	979	3330	1.507
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-16.847	1331	-21.172	2331	-37.746	3331	-41.985
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-11.461	1332	-1.203	2332	-10.793	3332	-8.165
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	-11.461	1336	-1.203	2336	-10.793	3336	-8.165
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-10.753	1337	2.385	2337	-12.974	3337	-1.799
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	38.963	1338	47.511	2338	41.184	3338	51.695
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	28.210	1339	49.896	2339	28.210	3339	49.896

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2024		Acumulado anterior 30/06/2023
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	-135	1357	421	2357	-215	3357	1.345
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-135	1358	421	2358	-215	3358	1.345
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	10	1360	-77	2360	126	3360	-415
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	125	1362	-344	2362	90	3362	-930
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: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2024								Situación cierre anual anterior 31/12/2023								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	6,62	0401	22,09	0421	0,00	0441	10,26	1381	6,40	1401	20,42	1421	0,00	1441	11,16	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: 30/06/2024

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	155	0467	85	0474	59	0481	0	0488	143	0495	15.326	0502	0	0509	15.470
De 1 a 3 meses	0461	25	0468	36	0475	26	0482	0	0489	62	0496	3.016	0503	0	0510	3.078
De 3 a 6 meses	0462	20	0469	51	0476	26	0483	14	0490	91	0497	2.328	0504	0	0511	2.418
De 6 a 9 meses	0463	16	0470	71	0477	23	0484	36	0491	130	0498	2.026	0505	0	0512	2.156
De 9 a 12 meses	0464	15	0471	90	0478	22	0485	61	0492	174	0499	1.932	0506	0	0513	2.106
Más de 12 meses	0465	113	0472	3.788	0479	92	0486	1.446	0493	5.326	0500	12.999	0507	0	0514	18.325
Total	0466	344	0473	4.120	0480	249	0487	1.557	0494	5.926	0501	37.628	0508	0	1515	43.554

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	155	0522	85	0529	59	0536	0	0543	143	0550	15.326	0557	0	0564	15.470	0571	29.524	0578	29.524	0584	52,40
De 1 a 3 meses	0516	25	0523	36	0530	26	0537	0	0544	62	0551	3.016	0558	0	0565	3.078	0572	5.028	0579	5.028	0585	61,22
De 3 a 6 meses	0517	20	0524	51	0531	26	0538	14	0545	91	0552	2.328	0559	0	0566	2.418	0573	4.045	0580	4.045	0586	59,79
De 6 a 9 meses	0518	16	0525	71	0532	23	0539	36	0546	130	0553	2.026	0560	0	0567	2.156	0574	3.565	0581	3.565	0587	60,49
De 9 a 12 meses	0519	15	0526	90	0533	22	0540	61	0547	174	0554	1.932	0561	0	0568	2.106	0575	3.045	0582	3.045	0588	69,15
Más de 12 meses	0520	113	0527	3.788	0534	92	0541	1.446	0548	5.326	0555	12.999	0562	0	0569	18.325	0576	23.248	0583	23.248	0589	78,83
Total	0521	344	0528	4.120	0535	249	0542	1.557	0549	5.926	0556	37.628	0563	0	0570	43.554	0577	68.455			0590	63,62

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: 30/06/2024

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 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 14/11/2006	
Inferior a 1 año	0600	721	1600	958	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	836	1601	620	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.920	1602	1.691	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	6.231	1603	4.440	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	11.769	1604	9.677	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	58.192	1605	54.378	2605	194
Superior a 10 años	0606	272.123	1606	314.625	2606	1.999.806
Total	0607	351.793	1607	386.389	2607	2.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	11,89	1608	12,26	2608	27,56

Antigüedad	Situación actual 30/06/2024					
	Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 14/11/2006			
Antigüedad media ponderada (años)	0609	19,02	1609	18,52	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: 30/06/2024

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 30/06/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				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	1.601	0630	70.210	1620	1.512	1630	65.401	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.589	0631	158.962	1621	1.550	1631	150.452	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	680	0632	95.539	1622	1.024	1632	140.770	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	135	0633	27.082	1623	147	1633	29.767	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	4.005	0638	351.793	1628	4.233	1638	386.389	2628	11.090	2638	2.000.000
Media ponderada (%)	0639	53,70	0649		1639	55,16	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: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 14/11/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	4,81	1650	4,16	2650	4,51
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,16	1651	6,26	2651	5,88
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,50	1652	1,50	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: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				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	183	0683	11.706	1660	190	1683	12.449	2660	484	2683	62.633
Aragón	0661	67	0684	4.049	1661	72	1684	4.490	2661	206	2684	30.916
Asturias	0662	34	0685	1.926	1662	37	1685	2.130	2662	71	2685	7.768
Baleares	0663	32	0686	2.383	1663	34	1686	2.815	2663	73	2686	11.943
Canarias	0664	23	0687	1.240	1664	23	1687	1.301	2664	82	2687	10.692
Cantabria	0665	66	0688	4.389	1665	72	1688	5.049	2665	142	2688	20.344
Castilla-León	0666	102	0689	5.349	1666	106	1689	5.879	2666	235	2689	30.276
Castilla La Mancha	0667	168	0690	12.529	1667	179	1690	13.724	2667	560	2690	89.081
Cataluña	0668	421	0691	38.729	1668	442	1691	42.656	2668	1.050	2691	188.843
Ceuta	0669	7	0692	216	1669	10	1692	271	2669	43	2692	3.879
Extremadura	0670	19	0693	791	1670	20	1693	827	2670	41	2693	4.142
Galicia	0671	67	0694	4.383	1671	71	1694	4.834	2671	127	2694	17.283
Madrid	0672	2.553	0695	246.331	1672	2.692	1695	270.323	2672	7.105	2695	1.401.798
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	13	0697	700	1674	16	1697	904	2674	72	2697	8.796
Navarra	0675	11	0698	873	1675	11	1698	902	2675	38	2698	6.331
La Rioja	0676	18	0699	1.387	1676	19	1699	1.434	2676	61	2699	9.523
Comunidad Valenciana	0677	138	0700	7.108	1677	150	1700	7.800	2677	502	2700	58.875
País Vasco	0678	83	0701	7.705	1678	89	1701	8.602	2678	198	2701	36.877
Total España	0679	4.005	0702	351.793	1679	4.233	1702	386.389	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	4.005	0705	351.793	1682	4.233	1705	386.389	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: 30/06/2024
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 14/11/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,95			1710	0,89			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: 30/06/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2024			Situación cierre anual anterior 31/12/2023			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	10.039	134.528	13.400	12.856	172.274	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	334.528	1723	20.000	1724	372.274	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: 30/06/2024

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				
ES0359091016	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,16	3,98	580	0	NO	134.528	0	0	135.109	0				
ES0359091024	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	4,07	309	0	NO	70.000	0	0	70.309	0				
ES0359091032	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	4,12	335	0	NO	75.000	0	0	75.335	0				
ES0359091040	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	4,32	159	0	NO	34.000	0	0	34.159	0				
ES0359091057	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	1,80	5,62	128	0	NO	21.000	0	0	21.128	0				
Total						0740	1.511	0741	0	0743	334.528	0744	0	0745	336.039	0746	0

	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 14/11/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	4,17	0748	3,55	0749	3,77

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: 30/06/2024
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2024								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2023							
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	460.000	0	26.345
ES0359091016	SERIE A2	16.847	1.205.472	1.553	201.604	21.172	1.126.048	1.636	194.348	16.847	1.205.472	1.553	201.604	21.172	1.126.048	1.636	194.348
ES0359091024	SERIE B	0	0	734	15.542	0	0	503	12.678	0	0	503	12.678	0	0	503	12.678
ES0359091032	SERIE C	0	0	796	17.092	0	0	548	13.985	0	0	548	13.985	0	0	548	13.985
ES0359091040	SERIE D	0	0	378	8.782	0	0	265	7.304	0	0	265	7.304	0	0	265	7.304
ES0359091057	SERIE E	0	0	302	10.257	0	0	231	9.067	0	0	231	9.067	0	0	231	9.067
Total		0754	16.847	0755	1.665.472	0756	3.761	0757	279.623	1754	21.172	1755	1.586.048	1756	3.182	1757	263.727

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: 30/06/2024

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 30/06/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	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	13/03/2024	FCH	AA+	A+	AAA
ES0359091016	SERIE A2	25/04/2018	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359091016	SERIE A2	01/06/2022	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359091024	SERIE B	13/03/2024	FCH	AA-	A+	AA
ES0359091024	SERIE B	22/06/2022	MDY	Aa1	Aa1	Aa2
ES0359091024	SERIE B	01/06/2022	SYP	AA+	AA+	AA
ES0359091032	SERIE C	13/03/2024	FCH	BB+	BB	A
ES0359091032	SERIE C	26/10/2023	MDY	A1	A1	A2
ES0359091032	SERIE C	01/06/2022	SYP	AA	AA	A
ES0359091040	SERIE D	13/03/2024	FCH	BB-	B-	BBB
ES0359091040	SERIE D	26/10/2023	MDY	B3	B3	Baa2
ES0359091040	SERIE D	01/06/2022	SYP	BB+	BB+	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: 30/06/2024

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 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 14/11/2006	
Inferior a 1 año	0765	29.326	1765	33.665	2765	26.458
Entre 1 y 2 años	0766	25.580	1766	26.399	2766	28.925
Entre 2 y 3 años	0767	26.711	1767	27.684	2767	30.618
Entre 3 y 4 años	0768	27.435	1768	28.795	2768	32.409
Entre 4 y 5 años	0769	32.167	1769	29.041	2769	34.306
Entre 5 y 10 años	0770	193.309	1770	226.689	2770	204.080
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	1.643.203
Total	0772	334.528	1772	372.274	2772	2.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	6,59	1773	7,33	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: 30/06/2024

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 14/11/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	13.139	1775	13.019	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	3,93	1777	3,50	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	40,21	1792	46,27	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: 30/06/2024

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 30/06/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	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	-6.004	-6.004		
Total							0808 -6.004	0809 -6.004	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 14/11/2006		Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		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: 30/06/2024

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 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	1.932	7006	2.906	7009	0,60	7012	0,81	7015	0,90		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.932	7008	2.906	7011	0,60	7014	0,81	7017	0,90	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	70.790	7024	73.246	7027	17,93	7030	16,99	7033	17,68		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	70.790	7026	73.246	7029	17,93	7032	16,99	7035	17,68	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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	22,42	21,34	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	10,00	23,04	23,60	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	2,10	6,28	5,98	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	3,40	10,16	9,68	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359091008	25,00	6,84	6,87	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	1,25	0,60	0,92	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	2,00	0,60	0,92	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	10,00	23,04	23,60	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	1,50	0,60	0,92	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	1,75	0,60	0,92	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	10,00	23,04	23,60	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	7,00	20,93	19,92	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359091016	25,00	6,84	6,87	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	10,00	23,04	23,60	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE E - ES0359091057	8,00	6,87	6,87	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
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
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		3,93	3,52	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: 30/06/2024

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	11	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: 30/06/2024

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: 30/06/2024

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total		
		22/02/2024	22/05/2024											
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885													
Saldo inicial	0886	13.019	12.372											
Cobros del periodo	0887	24.607	21.733											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-192	-222											
Pagos por derivados	0889	-80	-135											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-12.372	-13.139											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-24.980	-20.608											
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: 30/06/2024

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