

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: 31/12/2019

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: 31/12/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2019		Periodo anterior 31/12/2018
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	575.702	1001	623.068
I. Activos financieros a largo plazo	0002	575.702	1002	623.068
1. Activos titulizados	0003	575.702	1003	623.068
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	562.663	1005	608.516
1.3 Préstamos hipotecarios	0006	0	1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007	0	1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008	0	1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009	0	1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010	0	1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011	0	1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012	0	1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013	0	1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014	0	1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015	0	1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016	0	1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017	0	1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018	0	1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019	0	1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020	0	1020	0
1.18 Bonos de titulización	0021	0	1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022	0	1022	0
1.20 Otros	0023	0	1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024	0	1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	14.601	1025	16.755
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-1.563	1027	-2.203
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: 31/12/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	79.603	1041	80.082
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	22.397	1042	25.089
V. Activos financieros a corto plazo	0043	43.231	1043	43.213
1. Activos titulizados	0044	43.223	1044	43.204
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	41.332	1046	41.248
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	143	1065	179
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	24	1066	30
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	3.432	1067	3.676
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	62	1068	76
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-1.769	1069	-2.005
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	13.974	1085	11.780
1. Tesorería	0086	13.974	1086	11.780
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	655.305	1088	703.150

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2019		Periodo anterior 31/12/2018
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	598.479	1089	650.243
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	598.479	1094	650.243
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	562.276	1095	611.067
1.1 Series no subordinadas	0096	362.276	1096	411.067
1.2 Series subordinadas	0097	200.000	1097	200.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	0	1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	24.547	1101	24.425
2.1 Préstamo subordinado	0102	71.000	1102	71.000
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-46.453	1105	-46.575
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	11.657	1108	14.751
3.1 Derivados de cobertura	0109	11.657	1109	14.751
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: 31/12/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) PASIVO CORRIENTE	0117	69.520	1117	69.164
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	67.980	1123	67.539
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	44.799	1124	44.965
1.1 Series no subordinadas	0125	44.763	1125	44.924
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	35	1128	41
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	22.088	1131	21.044
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	108	1136	115
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	21.980	1137	20.929
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	1.088	1139	1.526
3.1 Derivados de cobertura	0140	1.088	1140	1.526
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	6	1143	4
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	6	1146	4
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	1.541	1148	1.626
1. Comisiones	0149	16	1149	19
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	13	1150	15
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	3	1152	4
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	1.525	1157	1.607
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-12.695	1158	-16.258
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-12.695	1160	-16.258
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	655.305	1162	703.150

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2019		Acumulado anterior 31/12/2018
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	1.078	1201	1.262	2201	4.911	3201	5.087
1.1 Activos titulizados	0202	1.078	1202	1.262	2202	4.911	3202	5.087
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-354	1204	-379	2204	-1.475	3204	-1.495
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-82	1205	-95	2205	-361	3205	-375
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-251	1206	-269	2206	-1.044	3206	-1.062
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-20	1207	-15	2207	-70	3207	-58
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-472	1208	-348	2208	-1.718	3208	-1.476
A) MARGEN DE INTERESES	0209	253	1209	535	2209	1.719	3209	2.115
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	33	1216	20	2216	85	3216	48
7. Otros gastos de explotación	0217	-246	1217	-459	2217	-1.784	3217	-1.857
7.1 Servicios exteriores	0218	-200	1218	-408	2218	-1.604	3218	-1.665
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-200	1219	-408	2219	-1.604	3219	-1.665
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	-46	1224	-51	2224	-180	3224	-193
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-33	1225	-36	2225	-139	3225	-148
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-8	1227	-10	2227	-35	3227	-39
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	-5	1230	-5	2230	-6	3230	-6
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	50	1231	-877	2231	-1.794	3231	-2.533
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	50	1232	-877	2232	-1.794	3232	-2.533
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	205	1238	754	2238	1.897	3238	1.683
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	-295	1239	26	2239	-122	3239	545
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: 31/12/2019

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2019		Acumulado anterior 31/12/2018
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	440	1300	787	2300	2.752	3300	3.022
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	450	1301	821	2301	2.845	3301	3.162
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	1.125	1302	1.273	2302	4.968	3302	5.133
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-81	1303	-95	2303	-366	3303	-374
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	-573	1305	-342	2305	-1.688	3305	-1.539
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	-21	1308	-14	2308	-69	3308	-58
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-43	1309	-46	2309	-178	3309	-188
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-34	1310	-37	2310	-141	3310	-149
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-9	1312	-10	2312	-36	3312	-39
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	33	1315	12	2315	85	3315	48
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	33	1321	12	2321	85	3321	48
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	1.125	1322	1.692	2322	-558	3322	-2.125
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	1.401	1325	1.942	2325	1.187	3325	-614
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	7.448	1326	7.833	2326	29.800	3326	30.137
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	3.056	1327	3.275	2327	11.031	3327	9.836
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.029	1328	565	2328	3.333	3328	2.990
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	4	2329	3	3329	4
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	654	1330	2.295	2330	5.972	3330	5.051
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-10.785	1331	-12.029	2331	-48.951	3331	-48.632
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-276	1332	-250	2332	-1.745	3332	-1.511
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	-276	1336	-250	2336	-1.745	3336	-1.511
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	1.565	1337	2.480	2337	2.194	3337	897
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	12.409	1338	9.300	2338	11.780	3338	10.883
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	13.974	1339	11.780	2339	13.974	3339	11.780

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2019		Acumulado anterior 31/12/2018
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	2.960	1357	361	2357	1.845	3357	-836
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	2.960	1358	361	2358	1.845	3358	-836
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	472	1360	348	2360	1.718	3360	1.476
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	-3.432	1362	-709	2362	-3.563	3362	-640
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: 31/12/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2019								Situación cierre anual anterior 31/12/2018								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	2,90	0401	13,55	0421	0,00	0441	1,72	1381	3,05	1401	12,38	1421	0,00	1441	1,43	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: 31/12/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

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	270	0467	111	0474	18	0481	0	0488	129	0495	32.353	0502	0	0509	32.482
De 1 a 3 meses	0461	40	0468	42	0475	6	0482	0	0489	48	0496	4.618	0503	0	0510	4.666
De 3 a 6 meses	0462	19	0469	51	0476	6	0483	3	0490	60	0497	2.696	0504	0	0511	2.756
De 6 a 9 meses	0463	16	0470	56	0477	3	0484	6	0491	65	0498	2.082	0505	0	0512	2.148
De 9 a 12 meses	0464	7	0471	38	0478	2	0485	6	0492	46	0499	919	0506	0	0513	966
Más de 12 meses	0465	81	0472	2.234	0479	51	0486	691	0493	2.975	0500	9.956	0507	0	0514	12.931
Total	0466	433	0473	2.532	0480	86	0487	706	0494	3.324	0501	52.625	0508	0	1515	55.949

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	270	0522	111	0529	18	0536	0	0543	129	0550	32.353	0557	0	0564	32.482	0571	49.427	0578	49.427	0584	65,72
De 1 a 3 meses	0516	40	0523	42	0530	6	0537	0	0544	48	0551	4.618	0558	0	0565	4.666	0572	7.412	0579	7.412	0585	62,95
De 3 a 6 meses	0517	19	0524	51	0531	6	0538	3	0545	60	0552	2.696	0559	0	0566	2.756	0573	4.190	0580	4.190	0586	65,79
De 6 a 9 meses	0518	16	0525	56	0532	3	0539	6	0546	65	0553	2.082	0560	0	0567	2.148	0574	3.089	0581	3.089	0587	69,53
De 9 a 12 meses	0519	7	0526	38	0533	2	0540	6	0547	46	0554	919	0561	0	0568	966	0575	1.346	0582	1.346	0588	71,72
Más de 12 meses	0520	81	0527	2.234	0534	51	0541	691	0548	2.975	0555	9.956	0562	0	0569	12.931	0576	15.569	0583	15.569	0589	83,05
Total	0521	433	0528	2.532	0535	86	0542	706	0549	3.324	0556	52.625	0563	0	0570	55.949	0577	81.033			0590	69,04

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: 31/12/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 14/11/2006	
Inferior a 1 año	0600	259	1600	54	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	170	1601	449	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	664	1602	467	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	1.974	1603	893	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	2.547	1604	2.604	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	70.841	1605	49.378	2605	194
Superior a 10 años	0606	545.573	1606	616.350	2606	1.999.806
Total	0607	622.028	1607	670.195	2607	2.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	15,60	1608	16,46	2608	27,56

Antigüedad	Situación actual 31/12/2019					
	Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 14/11/2006			
Antigüedad media ponderada (años)	0609	14,61	1609	13,63	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: 31/12/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				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	691	0630	28.100	1620	499	1630	20.473	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.992	0631	184.566	1621	1.665	1631	145.756	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	2.357	0632	348.623	1622	2.814	1632	403.929	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	296	0633	60.739	1623	508	1633	100.038	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	5.336	0638	622.028	1628	5.486	1638	670.195	2628	11.090	2638	2.000.000
Media ponderada (%)	0639	65,94	0649		1639	68,57	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: 31/12/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 14/11/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,78	1650	0,75	2650	4,51
Tipo de interés nominal máximo	0651	2,06	1651	2,07	2651	5,88
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,01	1652	0,07	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: 31/12/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				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	269	0683	22.281	1660	282	1683	24.629	2660	484	2683	62.633
Aragón	0661	90	0684	7.377	1661	90	1684	7.933	2661	206	2684	30.916
Asturias	0662	44	0685	3.434	1662	46	1685	3.664	2662	71	2685	7.768
Baleares	0663	39	0686	4.126	1663	42	1686	4.672	2663	73	2686	11.943
Canarias	0664	28	0687	2.160	1664	29	1687	2.372	2664	82	2687	10.692
Cantabria	0665	91	0688	7.941	1665	95	1688	8.658	2665	142	2688	20.344
Castilla-León	0666	134	0689	9.917	1666	139	1689	10.996	2666	235	2689	30.276
Castilla La Mancha	0667	228	0690	22.403	1667	232	1690	24.014	2667	560	2690	89.081
Cataluña	0668	586	0691	71.722	1668	599	1691	76.788	2668	1.050	2691	188.843
Ceuta	0669	21	0692	739	1669	21	1692	851	2669	43	2692	3.879
Extremadura	0670	26	0693	1.380	1670	27	1693	1.586	2670	41	2693	4.142
Galicia	0671	86	0694	7.584	1671	90	1694	8.368	2671	127	2694	17.283
Madrid	0672	3.319	0695	427.853	1672	3.404	1695	459.604	2672	7.105	2695	1.401.798
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	19	0697	1.539	1674	21	1697	1.755	2674	72	2697	8.796
Navarra	0675	17	0698	1.715	1675	18	1698	1.847	2675	38	2698	6.331
La Rioja	0676	23	0699	2.143	1676	24	1699	2.337	2676	61	2699	9.523
Comunidad Valenciana	0677	192	0700	12.389	1677	200	1700	13.663	2677	502	2700	58.875
País Vasco	0678	124	0701	15.326	1678	127	1701	16.457	2678	198	2701	36.877
Total España	0679	5.336	0702	622.028	1679	5.486	1702	670.195	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	5.336	0705	622.028	1682	5.486	1705	670.195	2682	11.090	2705	2.000.000

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2019
Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 14/11/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,68			1710	0,65			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: 31/12/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2019			Situación cierre anual anterior 31/12/2018			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	30.376	407.039	13.400	34.029	455.991	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	607.039	1723	20.000	1724	655.991	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: 31/12/2019

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	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado							
			0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739					
ES0359091008	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,06	0,00	0	0	NO	0	0	0	0					
ES0359091016	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,16	0,00	0	0	NO	407.039	0	407.039	0					
ES0359091024	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	0,00	0	0	NO	70.000	0	70.000	0					
ES0359091032	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	0,00	0	0	NO	75.000	0	75.000	0					
ES0359091040	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	0,09	3	0	NO	34.000	0	34.003	0					
ES0359091057	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	1,80	1,39	32	0	NO	21.000	0	21.032	0					
Total						0740	35	0741	0	0743	607.039	0744	0	0745	607.075	0746	0

	Situación actual 31/12/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 14/11/2006			
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,06	0748	0,05	0749	3,77

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2019								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2018							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0359091008	SERIE A1	0	460.000	0	26.345	0	460.000	0	26.345	0	460.000	0	26.345	0	26.345		
ES0359091016	SERIE A2	10.785	932.961	0	191.035	12.029	884.009	0	191.035	0	884.009	0	191.035	0	191.035		
ES0359091024	SERIE B	0	0	0	11.690	0	0	0	11.690	0	0	0	11.690	0	11.690		
ES0359091032	SERIE C	0	0	0	12.895	0	0	0	12.895	0	0	0	12.895	0	12.895		
ES0359091040	SERIE D	0	0	7	6.711	0	0	16	6.711	0	0	16	6.711	0	6.711		
ES0359091057	SERIE E	0	0	74	7.746	0	0	79	7.746	0	0	79	7.746	0	7.746		
Total		0754	10.785	0755	1.392.961	0756	81	0757	256.421	1754	12.029	1755	1.344.009	1756	95	1757	256.055

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: 31/12/2019

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 31/12/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	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	28/05/2019	SYP	AA-	A-	AAA
ES0359091024	SERIE B	11/07/2019	FCH	BBB	BBB-	AA
ES0359091024	SERIE B	29/06/2018	MDY	A1	A1	Aa2
ES0359091024	SERIE B	28/05/2019	SYP	A	A-	AA
ES0359091032	SERIE C	11/07/2019	FCH	B+	B	A
ES0359091032	SERIE C	29/06/2018	MDY	Ba3	Ba3	A2
ES0359091032	SERIE C	28/05/2019	SYP	BBB	BB-	A
ES0359091040	SERIE D	18/03/2009	FCH	CCC	CCC	BBB
ES0359091040	SERIE D	11/09/2009	MDY	C	C	Baa2
ES0359091040	SERIE D	28/05/2019	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: 31/12/2019

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 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 14/11/2006	
Inferior a 1 año	0765	20.015	1765	23.157	2765	26.458
Entre 1 y 2 años	0766	31.830	1766	34.671	2766	28.925
Entre 2 y 3 años	0767	33.301	1767	35.855	2767	30.618
Entre 3 y 4 años	0768	34.664	1768	36.800	2768	32.409
Entre 4 y 5 años	0769	35.860	1769	35.617	2769	34.306
Entre 5 y 10 años	0770	193.437	1770	196.221	2770	204.080
Superior a 10 años	0771	257.932	1771	293.668	2771	1.643.203
Total	0772	607.039	1772	655.991	2772	2.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	15,40	1773	16,65	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: 31/12/2019

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 14/11/2006	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	3.480	1775	0	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	0,57	1777	0,00	2777	3,55
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Bankia	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	67,05	1792	69,51	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: 31/12/2019

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 31/12/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	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	-12.744	-16.278		
Total							0808 -12.744	0809 -16.278	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2019

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 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 14/11/2006		Situación actual 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		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: 31/12/2019

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 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación actual 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	1.947	7006	1.579	7009	0,33	7012	0,24	7015	0,29		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	1.947	7008	1.579	7011	0,33	7014	0,24	7017	0,29	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	83.953	7024	96.963	7027	12,29	7030	13,07	7033	12,22		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	369	7025	265	7028	0,05	7031	0,04	7034	0,05		
Total Fallidos					7023	84.322	7026	97.228	7029	12,34	7032	13,11	7035	12,28	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		
	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: 31/12/2019

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	12,36	12,14	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	2,10	3,46	3,40	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A2 - ES0359091016	25,00	6,94	6,96	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	1,50	0,33	0,29	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	1,25	0,33	0,29	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	10,00	36,89	37,32	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	10,00	36,89	37,32	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	7,00	11,53	11,33	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	2,00	0,33	0,29	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	3,40	5,60	5,50	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359091008	25,00	6,94	6,96	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	10,00	36,89	37,32	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	10,00	36,89	37,32	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	1,75	0,33	0,29	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE B - ES0359091024	18,30	6,94	6,96	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE C - ES0359091032	13,20	6,94	6,96	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE D - ES0359091040	9,40	6,94	6,96	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE E - ES0359091057	8,00	6,94	6,96	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		0,57	0,41	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: 31/12/2019

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862	10	2862	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,014	4862		5862		6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, S.E.	1864		2864	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3864	0,005	4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2019

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	Bankia
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: 31/12/2019

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo				Total
		22/02/2019	22/05/2019	22/08/2019	22/11/2019	
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885					
Saldo inicial	0886	0	0	632	2.519	
Cobros del periodo	0887	14.732	14.945	13.951	12.643	
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-435	-622	-487	-243	
Pagos por derivados	0889	-348	-353	-413	-573	
Retención importe Fondo de Reserva	0890	0	-632	-2.519	-3.480	
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-13.949	-13.338	-11.164	-10.866	
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0	0	
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0	0	
Saldo disponible	0894	0	0	0	0	
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	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: 31/12/2019

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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