

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 9275
NIF Fondo: V85594927
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: 31/12/2023

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)

Cambio en los ingresos por ventas de activos adjudicados. Como consecuencia de este cambio, se producen variaciones en los estados S.01 y S.02.

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	233.681	1001	269.164
I. Activos financieros a largo plazo	0002	233.681	1002	269.164
1. Activos titulizados	0003	233.681	1003	269.164
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	226.257	1005	265.260
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	7.431	1025	3.904
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-8	1027	0
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 RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	53.784	1041	63.896
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	6.503	1042	7.334
V. Activos financieros a corto plazo	0043	14.348	1043	18.202
1. Activos titulizados	0044	14.017	1044	17.393
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	12.554	1046	16.390
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	429	1065	215
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	51	1066	18
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	986	1067	796
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	64	1068	39
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-67	1069	-64
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	49	1071	628
2.1 Derivados de cobertura	0072	49	1072	628
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	282	1074	180
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	282	1077	180
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	32.933	1085	38.360
1. Tesorería	0086	32.933	1086	38.360
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	287.465	1088	333.060

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	272.917	1089	315.325
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	272.917	1094	315.325
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	106.220	1095	122.515
1.1 Series no subordinadas	0096	106.220	1096	122.515
1.2 Series subordinadas	0097	0	1097	0
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	165.534	1101	191.746
2.1 Préstamo subordinado	0102	48.288	1102	51.225
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	129.494	1104	151.055
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-12.247	1105	-10.535
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	1.163	1108	1.064
3.1 Derivados de cobertura	0109	1.163	1109	1.064
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

S.01
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) PASIVO CORRIENTE	0117	15.081	1117	18.187
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	14.975	1123	18.046
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	14.106	1124	17.522
1.1 Series no subordinadas	0125	13.540	1125	17.186
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	566	1128	336
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	869	1131	521
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	869	1136	521
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	0	1139	0
3.1 Derivados de cobertura	0140	0	1140	0
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	3
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	3
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	106	1148	142
1. Comisiones	0149	12	1149	13
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	8	1150	8
1.2 Comisión administrador	0151	3	1151	3
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	1	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	93	1157	129
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-533	1158	-452
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-533	1160	-452
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	287.465	1162	333.060

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2023		Acumulado anterior 31/12/2022
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	2.865	1201	1.326	2201	10.219	3201	2.640
1.1 Activos titulizados	0202	2.865	1202	1.326	2202	10.219	3202	2.640
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-3.375	1204	-1.322	2204	-11.666	3204	-1.825
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.333	1205	-503	2205	-4.608	3205	-646
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-2.042	1206	-811	2206	-7.047	3206	-1.148
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	-8	2207	-11	3207	-30
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	60	1208	136	2208	280	3208	373
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-451	1209	140	2209	-1.168	3209	1.189
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	4	2216	0	3216	4
7. Otros gastos de explotación	0217	-97	1217	-78	2217	-470	3217	-308
7.1 Servicios exteriores	0218	-60	1218	-40	2218	-334	3218	-164
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-60	1219	-40	2219	-334	3219	-164
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	-38	1224	-38	2224	-135	3224	-144
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-21	1225	-20	2225	-85	3225	-88
7.3.2 Comisión administrador	0226	-7	1226	-8	2226	-29	3226	-33
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-3	1227	-4	2227	-15	3227	-17
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228	0	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-6	1230	-6	2230	-6	3230	-6
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-224	1231	-35	2231	-327	3231	-97
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-224	1232	-35	2232	-327	3232	-97
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	120	1238	91	2238	252	3238	91
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	652	1239	-121	2239	1.712	3239	-878
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 RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2023		Acumulado anterior 31/12/2022
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-429	1300	603	2300	-397	3300	1.834
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-397	1301	635	2301	-268	3301	1.972
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	2.844	1302	1.212	2302	9.947	3302	2.468
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-1.332	1303	-290	2303	-4.378	3303	-310
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	127	1304	228	2304	876	3304	473
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	3305	0
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	-2.036	1307	-506	2307	-6.699	3307	-629
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	-8	2308	-14	3308	-30
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-32	1309	-32	2309	-129	3309	-138
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-21	1310	-20	2310	-85	3310	-87
2.2 Comisión administrador	0311	-7	1311	-8	2311	-30	3311	-34
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-3	1312	-4	2312	-15	3312	-17
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	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	532	1322	-107	2322	-5.030	3322	-275
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	5.285	1325	7.988	2325	19.846	3325	23.003
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	2.999	1326	3.672	2326	11.991	3326	15.311
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	4.801	1327	6.955	2327	25.333	3327	17.259
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	855	1328	1.117	2328	1.478	3328	5.034
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	12	2329	0	3329	12
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	512	1330	208	2330	985	3330	208
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-3.882	1331	-3.976	2331	-19.941	3331	-14.821
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-4.753	1332	-8.095	2332	-24.876	3332	-23.278
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	-4.697	1334	-8.041	2334	-24.499	3334	-23.181
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-56	1336	-55	2336	-377	3336	-97
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	103	1337	496	2337	-5.427	3337	1.560
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	32.830	1338	37.864	2338	38.360	3338	36.801
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	32.933	1339	38.360	2339	32.933	3339	38.360

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2023		Acumulado anterior 31/12/2022
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	-551	1357	-2.817	2357	199	3357	-2.571
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-551	1358	-2.817	2358	199	3358	-2.571
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	-60	1360	-136	2360	-280	3360	-373
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	611	1362	2.953	2362	81	3362	2.945
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 RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2023								Situación cierre anual anterior 31/12/2022								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	3,40	0401	9,02	0421	0,00	0441	9,24	1381	1,64	1401	7,79	1421	0,00	1441	5,59	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	8,00
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 RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

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	54	0467	23	0474	26	0481	0	0488	49	0495	6.554	0502	0	0509	6.603
De 1 a 3 meses	0461	17	0468	24	0475	25	0482	0	0489	50	0496	2.818	0503	0	0510	2.867
De 3 a 6 meses	0462	13	0469	28	0476	19	0483	9	0490	56	0497	1.928	0504	0	0511	1.984
De 6 a 9 meses	0463	8	0470	29	0477	15	0484	20	0491	64	0498	960	0505	0	0512	1.024
De 9 a 12 meses	0464	16	0471	75	0478	21	0485	63	0492	160	0499	2.561	0506	0	0513	2.720
Más de 12 meses	0465	17	0472	470	0479	9	0486	206	0493	684	0500	2.366	0507	0	0514	3.050
Total	0466	125	0473	650	0480	115	0487	298	0494	1.063	0501	17.186	0508	0	1515	18.249

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	54	0522	23	0529	26	0536	0	0543	49	0550	6.554	0557	0	0564	6.603	0571	11.792	0578	11.792	0584	56,00
De 1 a 3 meses	0516	17	0523	24	0530	25	0537	0	0544	50	0551	2.818	0558	0	0565	2.867	0572	4.754	0579	4.754	0585	60,31
De 3 a 6 meses	0517	13	0524	28	0531	19	0538	9	0545	56	0552	1.928	0559	0	0566	1.984	0573	3.509	0580	3.509	0586	56,55
De 6 a 9 meses	0518	8	0525	29	0532	15	0539	20	0546	64	0553	960	0560	0	0567	1.024	0574	1.734	0581	1.734	0587	59,06
De 9 a 12 meses	0519	16	0526	75	0533	21	0540	63	0547	160	0554	2.561	0561	0	0568	2.720	0575	4.037	0582	4.037	0588	67,38
Más de 12 meses	0520	17	0527	470	0534	9	0541	206	0548	684	0555	2.366	0562	0	0569	3.050	0576	4.489	0583	4.489	0589	67,95
Total	0521	125	0528	650	0535	115	0542	298	0549	1.063	0556	17.186	0563	0	0570	18.249	0577	30.315			0590	60,20

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

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 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 23/12/2008	
Inferior a 1 año	0600	107	1600	40	2600	679
Entre 1 y 2 años	0601	230	1601	261	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	636	1602	407	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	1.406	1603	925	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	1.655	1604	1.989	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	17.127	1605	17.112	2605	70
Superior a 10 años	0606	226.067	1606	265.616	2606	804.250
Total	0607	247.229	1607	286.350	2607	805.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	16,43	1608	17,21	2608	30,05

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 23/12/2008	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	16,83	1609	15,85	2609	1,92

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2023
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 31/12/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 23/12/2008			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	567	0630	31.626	1620	492	1630	28.176	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.077	0631	123.361	1621	1.144	1631	132.633	2621	19	2631	3.712
60% - 80%	0622	582	0632	87.654	1622	776	1632	119.148	2622	252	2632	48.479
80% - 100%	0623	23	0633	4.588	1623	32	1633	6.393	2623	3.757	2633	744.799
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	31	2634	8.010
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	2.249	0638	247.229	1628	2.444	1638	286.350	2628	4.059	2638	805.000
Media ponderada (%)	0639	54,35	0649		1639	56,78	1649		2639	88,45	2649	

MADRID RESIDENCIAL I, FTA

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 23/12/2008	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,87	1650	0,74	2650	5,83
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,36	1651	5,95	2651	7,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,00	1652	0,10	2652	3,50

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 23/12/2008			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	199	0683	17.239	1660	231	1683	22.345	2660	351	2683	61.043
Aragón	0661	20	0684	1.938	1661	23	1684	2.216	2661	41	2684	6.944
Asturias	0662	40	0685	3.387	1662	40	1685	3.616	2662	56	2685	8.847
Baleares	0663	33	0686	3.653	1663	37	1686	4.380	2663	69	2686	13.031
Canarias	0664	35	0687	3.580	1664	38	1687	3.972	2664	62	2687	10.989
Cantabria	0665	25	0688	2.037	1665	25	1688	2.217	2665	36	2688	5.849
Castilla-León	0666	84	0689	6.699	1666	87	1689	7.489	2666	138	2689	20.939
Castilla La Mancha	0667	222	0690	19.177	1667	237	1690	21.676	2667	400	2690	64.008
Cataluña	0668	239	0691	29.130	1668	267	1691	34.812	2668	485	2691	95.641
Ceuta	0669	10	0692	613	1669	12	1692	694	2669	27	2692	3.535
Extremadura	0670	23	0693	1.420	1670	26	1693	1.792	2670	37	2693	4.862
Galicia	0671	114	0694	10.291	1671	120	1694	11.690	2671	157	2694	26.119
Madrid	0672	1.022	0695	130.780	1672	1.098	1695	148.245	2672	1.794	2695	412.125
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	30	0697	2.379	1674	30	1697	2.667	2674	58	2697	9.146
Navarra	0675	8	0698	744	1675	9	1698	902	2675	15	2698	3.096
La Rioja	0676	3	0699	330	1676	3	1699	350	2676	4	2699	788
Comunidad Valenciana	0677	127	0700	11.668	1677	141	1700	13.744	2677	300	2700	51.171
País Vasco	0678	15	0701	2.164	1678	20	1701	3.544	2678	29	2701	6.868
Total España	0679	2.249	0702	247.229	1679	2.444	1702	286.350	2679	4.059	2702	805.000
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	2.249	0705	247.229	1682	2.444	1705	286.350	2682	4.059	2705	805.000

MADRID RESIDENCIAL I, FTA

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2023
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 23/12/2008			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,73			1710	1,61			2710	1,09		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 23/12/2008					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0358968008	SERIE A	6.077	19.707	119.760	6.077	22.989	139.701	6.077	100.000	607.700			
Total		0723	6.077	0724	119.760	1723	6.077	1724	139.701	2723	6.077	2724	607.700

S.05.2
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/12/2023
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		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
			0730	0731	0732	0733	0734		0735	0742	0736		0737			0738	0739	
ES0358968008	SERIE A	NS	EURIBOR 3 m	0,40	4,36	566	0		SI	119.760		0		120.326	0			
Total						0740	566	0741	0		0743	119.760	0744	0	0745	120.326	0746	0

	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 23/12/2008	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	3,65	0748	0,56	0749	3,25

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2023								Situación periodo comparativo anterior 31/12/2022							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0358968008	SERIE A	3.882	487.940	1.332	41.280	3.976	467.999	290	36.902								
Total		0754	3.882	0755	487.940	0756	1.332	0757	41.280	1754	3.976	1755	467.999	1756	290	1757	36.902

S.05.2
Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/12/2023
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 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 23/12/2008
				0762	0763	0764
ES0358968008	SERIE A	31/03/2021	MDY	Aa1	Aa1	
ES0358968008	SERIE A	05/11/2012	SYP	A	A	AAA

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/12/2023

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 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 23/12/2008	
Inferior a 1 año	0765	6.984	1765	8.161	2765	10.047
Entre 1 y 2 años	0766	5.793	1766	7.199	2766	11.500
Entre 2 y 3 años	0767	6.090	1767	7.409	2767	12.212
Entre 3 y 4 años	0768	6.373	1768	7.629	2768	13.036
Entre 4 y 5 años	0769	6.524	1769	7.827	2769	13.904
Entre 5 y 10 años	0770	35.139	1770	66.136	2770	84.167
Superior a 10 años	0771	52.857	1771	35.340	2771	462.834
Total	0772	119.760	1772	139.701	2772	607.700
Vida residual media ponderada (años)	0773	11,15	1773	12,15	2773	30,62

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 23/12/2008	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	24.925	1775	29.076	2775	80.500
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	24.925	1776	29.076	2776	80.500
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	20,81	1777	20,81	2777	13,25
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	N	1791	N	2791	N
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	100,00	1792	100,00	2792	100,00
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	

S.05.3

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

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 31/12/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 23/12/2008	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap de Bases	CAIXABANK	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 + 0,16%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	-1.113	-436		
Total							0808 -1.113	0809 -436	0810	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

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 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 23/12/2008		Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 23/12/2008			
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 RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

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 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	5.376	7006	1.044	7009	2,21	7012	0,37	7015	2,13		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	5.376	7008	1.044	7011	2,21	7014	0,37	7017	2,13	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	19.003	7024	21.456	7027	7,19	7030	7,02	7033	7,35		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	1.892	7025	1.892	7028	0,72	7031	0,62	7034	0,70		
Total Fallidos					7023	20.895	7026	23.347	7029	7,90	7032	7,64	7035	8,05	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

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
Préstamo B	2,50	2,21	2,07	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A - ES0358968008	2,50	2,21	2,07	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A - ES0358968008	49,02	51,95	51,95	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A - ES0358968008	10,00	30,24	30,96	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	10,00	30,24	30,96	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	49,02	51,95	51,95	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Préstamo B	12,00	6,87	6,84	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		20,81	20,81	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

S.05.5

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

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		2862	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados de Transmisión de Hipoteca en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,020	4862		5862	19	6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	CAIXABANK	1863		2863	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Préstamos Hipotecarios en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3863	0,010	4863		5863		6863	TRIMESTRAL	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	CAIXABANK	1864		2864	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3864	0,005	4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

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 3.4.6.4.

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														

S.05.5

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo					Total
		22/02/2023	22/05/2023	22/08/2023	22/11/2023		
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885						
Saldo inicial	0886	29.076	27.840	26.758	25.733		
Cobros del periodo	0887	13.813	13.126	12.958	11.098		
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-64	-224	-131	-86		
Pagos por derivados	0889	403	214	133	127		
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-27.840	-26.758	-25.733	-24.925		
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-6.730	-6.208	-6.167	-5.214		
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-8.658	-7.989	-7.818	-6.733		
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

S.06

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2023

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