Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8558
NIF Fondo: V84889229
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2026

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)

S.01

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2026		Periodo anterior 31/12/2025
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	203.972	1001	238.052
I. Activos financieros a largo plazo	0002	203.972	1002	238.052
1. Activos titulizados	0003	203.972	1003	238.052
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	195.059	1005	225.857
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	9.419	1025	12.702
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-506	1027	-506
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

S.01

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2026		Periodo anterior 31/12/2025
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	79.957	1041	77.738
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	13.609	1042	14.602
V. Activos financieros a corto plazo	0043	28.270	1043	30.510
1. Activos titulizados	0044	28.204	1044	30.463
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	24.993	1046	26.657
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	278	1065	274
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	39	1066	34
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	4.642	1067	5.218
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	95	1068	122
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-1.842	1069	-1.842
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	67	1074	47
3.1 Valores representativos de deuda	0075	0	1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076	0	1076	0
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	0	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	67	1079	47
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	38.077	1085	32.627
1. Tesorería	0086	38.077	1086	32.627
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	283.929	1088	315.791

S.01
Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2026

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2026		Periodo anterior 31/12/2025
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	214.484	1089	245.881
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	214.484	1094	245.881
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	191.781	1095	223.615
1.1 Series no subordinadas	0096	0	1096	23.615
1.2 Series subordinadas	0097	191.781	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	21.950	1101	21.512
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	-49.050	1105	-49.488
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	753	1108	753
3.1 Derivados de cobertura	0109	753	1109	753
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 RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2026		Periodo anterior 31/12/2025
B) PASIVO CORRIENTE	0117	70.448	1117	70.905
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	68.823	1123	68.912
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	30.306	1124	32.521
1.1 Series no subordinadas	0125	21.416	1125	31.875
1.2 Series subordinadas	0126	8.219	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	671	1128	646
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	37.912	1131	35.786
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	314	1136	281
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	37.598	1137	35.505
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	605	1139	605
3.1 Derivados de cobertura	0140	605	1140	605
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	0
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	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	1.625	1148	1.993
1. Comisiones	0149	11	1149	11
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	9	1150	9
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
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	1.614	1157	1.982
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-1.004	1158	-995
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-1.004	1160	-995
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	283.929	1162	315.791

S.02

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2026		Acumulado anterior 30/09/2025
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	2.334	1201	2.394	2201	6.701	3201	8.076
1.1 Activos titulizados	0202	2.127	1202	2.245	2202	6.173	3202	7.550
1.2 Otros activos financieros	0203	207	1203	149	2203	528	3203	526
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-2.345	1204	-2.406	2204	-6.781	3204	-8.339
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.599	1205	-1.708	2205	-4.654	3205	-6.080
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-746	1206	-698	2206	-2.126	3206	-2.260
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-127	1208	-251	2208	-359	3208	-708
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-139	1209	-264	2209	-439	3209	-971
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	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-157	1217	-106	2217	-451	3217	-370
7.1 Servicios exteriores	0218	-132	1218	-78	2218	-371	3218	-284
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-132	1219	-78	2219	-371	3219	-284
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	-26	1224	-28	2224	-80	3224	-86
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-22	1225	-23	2225	-68	3225	-73
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-4	1227	-4	2227	-11	3227	-13
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228	0	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	0	1231	-112	2231	1.176	3231	-104
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	-112	2232	1.176	3232	-104
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	116	1238	64	2238	151	3238	64
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	180	1239	418	2239	-438	3239	1.382
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

S.03

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2026		Acumulado anterior 30/09/2025
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	619	1300	290	2300	1.627	3300	652
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	645	1301	318	2301	1.707	3301	738
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	2.128	1302	2.289	2302	6.196	3302	7.751
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-1.586	1303	-1.744	2303	-4.629	3303	-6.496
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	-92	1305	-377	2305	-368	3305	-1.070
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	194	1306	151	2306	508	3306	553
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-26	1309	-28	2309	-80	3309	-87
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-22	1310	-24	2310	-69	3310	-73
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-4	1312	-4	2312	-12	3312	-14
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	1.948	1322	-794	2322	3.824	3322	-1.269
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	2.080	1325	-716	2325	4.176	3325	-979
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	5.357	1326	5.850	2326	16.386	3326	17.593
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	4.663	1327	4.077	2327	14.438	3327	17.571
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	3.054	1328	1.387	2328	7.098	3328	3.590
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	20	3329	1
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	204	1330	110	2330	309	3330	110
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-11.198	1331	-12.139	2331	-34.074	3331	-39.843
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-132	1332	-78	2332	-353	3332	-290
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	-132	1336	-78	2336	-353	3336	-290
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	2.567	1337	-504	2337	5.451	3337	-617
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	35.510	1338	30.881	2338	32.627	3338	30.994
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	38.077	1339	30.377	2339	38.077	3339	30.377

S.04

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2026		Acumulado anterior 30/09/2025
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 periodo	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	-92	1357	-377	2357	-368	3357	-1.070
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-92	1358	-377	2358	-368	3358	-1.070
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	127	1360	251	2360	359	3360	708
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	-35	1362	126	2362	9	3362	362
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 directemente en el balance en el periodo	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

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

	Situación actual 30/09/2026								Situación cierre anual anterior 31/12/2025								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
Ratios (%)	**Tasa de activos dudosos**		**Tasa de fallido**		**Tasa de recuperación fallidos**		**Tasa de amortización anticipada**		**Tasa de activos dudosos**		**Tasa de fallido**		**Tasa de recuperación fallidos**		**Tasa de amortización anticipada**		**Tasa de activos dudosos**		**Tasa de fallido**		**Tasa de recuperación fallidos**		**Tasa de amortización anticipada**	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	6,01	0401	29,87	0421	0,00	0441	8,06	1381	6,63	1401	27,17	1421	0,00	1441	8,08	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	
Prestamos 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	

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

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	132	0467	85	0474	32	0481	0	0488	117	0495	10.597	0502	0	0509	10.713
De 1 a 3 meses	0461	13	0468	18	0475	7	0482	0	0489	25	0496	1.209	0503	0	0510	1.235
De 3 a 6 meses	0462	10	0469	29	0476	7	0483	2	0490	39	0497	848	0504	0	0511	886
De 6 a 9 meses	0463	10	0470	52	0477	6	0484	11	0491	69	0498	713	0505	0	0512	782
De 9 a 12 meses	0464	4	0471	27	0478	3	0485	10	0492	40	0499	428	0506	0	0513	468
Más de 12 meses	0465	82	0472	3.564	0479	78	0486	1.399	0493	5.041	0500	8.400	0507	0	0514	13.441
Total	0466	**251**	0473	**3.775**	0480	**134**	0487	**1.422**	0494	**5.330**	0501	**22.195**	0508	**0**	1515	**27.525**

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	132	0522	85	0529	32	0536	0	0543	117	0550	10.597	0557	0	0564	10.713	0571	25.112	0578	25.112	0584	42,66
De 1 a 3 meses	0516	13	0523	18	0530	7	0537	0	0544	25	0551	1.209	0558	0	0565	1.235	0572	2.573	0579	2.573	0585	47,99
De 3 a 6 meses	0517	10	0524	29	0531	7	0538	2	0545	39	0552	848	0559	0	0566	886	0573	1.960	0580	1.960	0586	45,22
De 6 a 9 meses	0518	10	0525	52	0532	6	0539	11	0546	69	0553	713	0560	0	0567	782	0574	1.790	0581	1.790	0587	43,68
De 9 a 12 meses	0519	4	0526	27	0533	3	0540	10	0547	40	0554	428	0561	0	0568	468	0575	903	0582	903	0588	51,87
Más de 12 meses	0520	82	0527	3.564	0534	78	0541	1.399	0548	5.041	0555	8.400	0562	0	0569	13.441	0576	17.329	0583	17.329	0589	77,56
Total	0521	251	0528	3.775	0535	134	0542	1.422	0549	5.330	0556	22.195	0563	0	0570	27.525	0577	49.666			0590	55,42

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 14/11/2006	
Inferior a 1 año	0600	1.031	1600	836	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	2.803	1601	1.989	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	5.607	1602	5.083	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	7.633	1603	8.286	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	4.683	1604	8.846	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	160.753	1605	149.294	2605	194
Superior a 10 años	0606	51.602	1606	96.100	2606	1.999.806
Total	0607	**234.113**	1607	**270.434**	2607	**2.000.000**
Vida residual media ponderada (años)	0608	**10,06**	1608	**10,64**	2608	**27,56**

Antigüedad	Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 14/11/2006	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	21,21	1609	20,49	2609	1,64

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2026				Situación cierre anual anterior 31/12/2025				Situación inicial 14/11/2006			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.838	0630	76.114	1620	1.843	1630	80.041	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.188	0631	122.107	1621	1.377	1631	145.012	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	184	0632	30.694	1622	190	1632	29.907	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	26	0633	5.198	1623	80	1633	15.474	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	**3.236**	0638	**234.113**	1628	**3.490**	1638	**270.434**	2628	**11.090**	2638	**2.000.000**
Media ponderada (%)	0639	**46,95**	0649		1639	**49,16**	1649		2639	**95,42**	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 14/11/2006	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,21	1650	3,39	2650	4,51
Tipo de interés nominal máximo	0651	5,05	1651	4,48	2651	5,88
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,50	1652	1,50	2652	2,75

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2026				Situación cierre anual anterior 31/12/2025				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	144	0683	7.562	1660	151	1683	8.459	2660	484	2683	62.633
Aragón	0661	54	0684	2.726	1661	59	1684	3.196	2661	206	2684	30.916
Asturias	0662	31	0685	1.452	1662	33	1685	1.653	2662	71	2685	7.768
Baleares	0663	29	0686	1.753	1663	29	1686	1.920	2663	73	2686	11.943
Canarias	0664	22	0687	897	1664	23	1687	1.027	2664	82	2687	10.692
Cantabria	0665	54	0688	3.000	1665	56	1688	3.247	2665	142	2688	20.344
Castilla-León	0666	86	0689	3.357	1666	90	1689	3.943	2666	235	2689	30.276
Castilla La Mancha	0667	125	0690	7.767	1667	140	1690	9.359	2667	560	2690	89.081
Cataluña	0668	313	0691	23.260	1668	347	1691	27.890	2668	1.050	2691	188.843
Ceuta	0669	4	0692	108	1669	4	1692	126	2669	43	2692	3.879
Extremadura	0670	13	0693	501	1670	16	1693	673	2670	41	2693	4.142
Galicia	0671	60	0694	2.917	1671	60	1694	3.154	2671	127	2694	17.283
Madrid	0672	2.084	0695	166.786	1672	2.249	1695	192.033	2672	7.105	2695	1.401.798
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	10	0697	367	1674	10	1697	407	2674	72	2697	8.796
Navarra	0675	10	0698	641	1675	10	1698	750	2675	38	2698	6.331
La Rioja	0676	14	0699	953	1676	16	1699	1.077	2676	61	2699	9.523
Comunidad Valenciana	0677	111	0700	4.778	1677	123	1700	5.721	2677	502	2700	58.875
País Vasco	0678	72	0701	5.287	1678	74	1701	5.799	2678	198	2701	36.877
Total España	0679	**3.236**	0702	**234.113**	1679	**3.490**	1702	**270.434**	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	**3.236**	0705	**234.113**	1682	**3.490**	1705	**270.434**	2682	**11.090**	2705	**2.000.000**

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2026				Situación cierre anual anterior 31/12/2025				Situación inicial 14/11/2006			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,21			1710	1,08			2710	0,33		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2026

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2026					Situación cierre anual anterior 31/12/2025					Situación inicial 14/11/2006				
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	
ES0359091008	SERIE A1	4.600		0	0		4.600		0	0		4.600		100.000	460.000	
ES0359091016	SERIE A2	13.400		1.598	21.416		13.400		4.141	55.491		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	221.416	1723	20.000		1724	255.491	2723	20.000		2724	2.000.000

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2026

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		
		0730	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	2,67	59	0	NO	21.416	0	21.475	0
ES0359091024	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,25	2,76	198	0	NO	70.000	0	70.198	0
ES0359091032	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,30	2,81	216	0	NO	75.000	0	75.216	0
ES0359091040	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,50	3,01	105	0	NO	34.000	0	34.105	0
ES0359091057	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	1,80	4,31	93	0	NO	21.000	0	21.093	0
Total						0740 671	0741 0		0743 221.416	0744 0	0745 222.088	0746 0

	Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 14/11/2006	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	2,56	0748	2,65	0749	3,77

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2026

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2026								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2025							
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	
ES0359091016	SERIE A2	11.198		1.318.584		199		207.156		12.139		1.272.951		449		206.029	
ES0359091024	SERIE B	0		0		444		20.085		0		0		413		18.426	
ES0359091032	SERIE C	0		0		486		22.046		0		0		452		20.230	
ES0359091040	SERIE D	0		0		238		11.183		0		0		222		10.291	
ES0359091057	SERIE E	0		0		218		12.365		0		0		207		11.536	
Total		0754	11.198	0755	1.778.584	0756	1.586	0757	299.180	1754	12.139	1755	1.732.951	1756	1.744	1757	292.858

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2026

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

				Calificación		
Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Situación actual 30/09/2026	Situación cierre anual anterior 31/12/2025	Situación inicial 14/11/2006
		0760	0761	0762	0763	0764
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	25/05/2026	FCH	AAA	AA+	AAA
ES0359091016	SERIE A2	12/12/2025	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359091016	SERIE A2	01/06/2022	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0359091024	SERIE B	25/05/2026	FCH	AAA	AA+	AA
ES0359091024	SERIE B	12/12/2025	MDY	Aaa	Aaa	Aa2
ES0359091024	SERIE B	26/02/2026	SYP	AAA	AA+	AA
ES0359091032	SERIE C	25/05/2026	FCH	AAA	AA+	A
ES0359091032	SERIE C	12/12/2025	MDY	Aaa	Aaa	A2
ES0359091032	SERIE C	03/12/2024	SYP	AA+	AA+	A
ES0359091040	SERIE D	25/05/2026	FCH	A+	A	BBB
ES0359091040	SERIE D	12/12/2025	MDY	Aa1	Aa1	Baa2
ES0359091040	SERIE D	26/02/2026	SYP	AA	A	BBB
ES0359091057	SERIE E	25/05/2026	FCH	A	BBB+	BB+
ES0359091057	SERIE E	12/12/2025	MDY	Baa3	Baa3	Ba2
ES0359091057	SERIE E	26/02/2026	SYP	BB+	B+	BB

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

S.05.2

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2026

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 14/11/2006	
Inferior a 1 año	0765	27.554	1765	24.147	2765	26.458
Entre 1 y 2 años	0766	24.178	1766	24.347	2766	28.925
Entre 2 y 3 años	0767	23.141	1767	25.105	2767	30.618
Entre 3 y 4 años	0768	146.543	1768	23.421	2768	32.409
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769	22.290	2769	34.306
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770	136.180	2770	204.080
Superior a 10 años	0771	0	1771	0	2771	1.643.203
Total	0772	**221.416**	1772	**255.491**	2772	**2.000.000**
Vida residual media ponderada (años)	0773	**3,16**	1773	**4,55**	2773	**27,32**

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

S.05.3

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 14/11/2006	
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	25.738	1775	20.779	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	11,62	1777	8,13	2777	3,55
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	CaixaBank	1778	CaixaBank	2778	Caja Madrid
1.4 Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781		1781		2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782		1782		2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784		1784		2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786		1786		2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787		1787		2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788		1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	9,67	1792	21,71	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	

S.05.3

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS			Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)						Otras características
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		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		-1.358		-1.358			
Total							0808	-1.358	0809	-1.358	0810		

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

S.05.3

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
Naturaleza riesgo cubierto	Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 14/11/2006		Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		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	

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

S.05.4

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio						Ref. Folleto	
					Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Última Fecha Pago			
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	556	7006	805	7009	0,26	7012	0,33	7015	0,16		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	556	7008	805	7011	0,26	7014	0,33	7017	0,16	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	58.330	7024	64.853	7027	21,36	7030	20,78	7033	21,58		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	58.330	7026	64.853	7029	21,36	7032	20,78	7035	21,58	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio						Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Última Fecha Pago			
	0850		1850		2850		3850	
	0851		1851		2851		3851	
	0852		1852		2852		3852	
	0853		1853		2853		3853	

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

S.05.4

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

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 A2 - ES0359091016	25,00	6,31	6,43	Nota de Valores 4.9.4
SERIE A1 - ES0359091008	25,00	6,31	6,43	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	3,40	15,36	14,62	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	1,25	0,26	0,16	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	1,50	0,26	0,16	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	7,00	31,61	30,09	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	10,00	17,05	17,51	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	2,10	9,48	9,03	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	2,00	0,26	0,16	Nota de Valores 4.9.4
SERIE D - ES0359091040	10,00	17,05	17,51	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	1,75	0,26	0,16	Nota de Valores 4.9.4
SERIE B - ES0359091024	10,00	17,05	17,51	Nota de Valores 4.9.4
SERIE E - ES0359091057	10,00	17,05	17,51	Nota de Valores 4.9.4
SERIE C - ES0359091032	7,50	33,87	32,24	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE C - ES0359091032	13,20	6,43	6,43	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE E - ES0359091057	8,00	6,43	6,43	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE B - ES0359091024	18,30	6,43	6,43	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
SERIE D - ES0359091040	9,40	6,43	6,43	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		11,62	10,18	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

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

S.05.5

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Minimo (miles de euros)		Periodidad 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	12	2862	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,014	4862		5862		6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, S.E.	1864		2864	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3864	0,005	4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

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	Multicedente
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													

Dirección General de Mercados
Edison, 4, 28006 Madrid, España
(+34) 915 851 500, www.cnmv.es

S.05.5

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo												Total
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885	23/02/2026	22/05/2026	24/08/2026										
Saldo inicial	0886	20.779	21.645	23.690										
Cobros del periodo	0887	14.634	14.797	15.096										
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-202	-122	-172										
Pagos por derivados	0889	-122	-154	-92										
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-21.645	-23.690	-25.738										
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-13.443	-12.476	-12.784										
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0										
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0										
Saldo disponible	0894	0	0	0										
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	0										0

S.06

Denominación Fondo: MADRID RMBS I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2026

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