

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: 30/06/2024

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:
(sólo se cumplimentará en el supuesto de que se produzca el reenvío con alguna modificación de la información periódica)

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	214.079	1001	233.681
I. Activos financieros a largo plazo	0002	214.079	1002	233.681
1. Activos titulizados	0003	214.079	1003	233.681
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	208.118	1005	226.257
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	5.969	1025	7.431
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-8	1027	-8
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 RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	52.000	1041	53.784
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	5.896	1042	6.503
V. Activos financieros a corto plazo	0043	14.094	1043	14.348
1. Activos titulizados	0044	13.471	1044	14.017
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	12.354	1046	12.554
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	358	1065	429
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	42	1066	51
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	716	1067	986
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	68	1068	64
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-67	1069	-67
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	49	1071	49
2.1 Derivados de cobertura	0072	49	1072	49
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	573	1074	282
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	573	1077	282
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	32.010	1085	32.933
1. Tesorería	0086	32.010	1086	32.933
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	266.078	1088	287.465

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	251.734	1089	272.917
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	251.734	1094	272.917
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	97.052	1095	106.220
1.1 Series no subordinadas	0096	97.052	1096	106.220
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	153.519	1101	165.534
2.1 Préstamo subordinado	0102	47.675	1102	48.288
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	119.072	1104	129.494
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	-13.228	1105	-12.247
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	1.163
3.1 Derivados de cobertura	0109	1.163	1109	1.163
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) PASIVO CORRIENTE	0117	14.984	1117	15.081
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	14.899	1123	14.975
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	13.574	1124	14.106
1.1 Series no subordinadas	0125	13.070	1125	13.540
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	504	1128	566
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	1.325	1131	869
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	790	1136	869
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	536	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	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	85	1148	106
1. Comisiones	0149	12	1149	12
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	8	1150	8
1.2 Comisión administrador	0151	2	1151	3
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	1	1152	1
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	73	1157	93
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-640	1158	-533
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-640	1160	-533
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	266.078	1162	287.465

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2024		Acumulado anterior 30/06/2023
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	2.579	1201	2.536	2201	5.402	3201	4.590
1.1 Activos titulizados	0202	2.579	1202	2.536	2202	5.402	3202	4.590
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-3.131	1204	-2.823	2204	-6.424	3204	-5.055
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-1.225	1205	-1.117	2205	-2.521	3205	-1.994
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1.906	1206	-1.703	2206	-3.903	3206	-3.051
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	-3	2207	0	3207	-10
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	158	1208	8	2208	230	3208	145
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-394	1209	-279	2209	-791	3209	-320
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	49	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-121	1217	-201	2217	-226	3217	-285
7.1 Servicios exteriores	0218	-89	1218	-168	2218	-163	3218	-219
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-89	1219	-168	2219	-163	3219	-219
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-31	1224	-32	2224	-63	3224	-65
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-22	1225	-21	2225	-44	3225	-43
7.3.2 Comisión administrador	0226	-6	1226	-7	2226	-13	3226	-15
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-3	1227	-4	2227	-7	3227	-8
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	-272	1231	0	2231	-96	3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-272	1232	0	2232	-96	3232	0
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	108	1238	29	2238	132	3238	95
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	679	1239	402	2239	981	3239	510
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: 30/06/2024

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2024		Acumulado anterior 30/06/2023
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	105	1300	75	2300	-418	3300	355
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	137	1301	107	2301	-354	3301	420
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	2.703	1302	2.453	2302	5.552	3302	4.390
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-1.248	1303	-1.010	2303	-2.583	3303	-1.803
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	78	1304	214	2304	124	3304	617
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	-1.396	1307	-1.543	2307	-3.446	3307	-2.769
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	-6	2308	0	3308	-14
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-32	1309	-32	2309	-64	3309	-65
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-22	1310	-21	2310	-44	3310	-42
2.2 Comisión administrador	0311	-7	1311	-8	2311	-13	3311	-15
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-3	1312	-4	2312	-7	3312	-8
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	-114	1322	-2.372	2322	-506	3322	-4.113
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	5.233	1325	4.188	2325	10.707	3325	9.987
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	2.501	1326	2.787	2326	5.192	3326	6.210
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	5.680	1327	6.347	2327	12.411	3327	14.305
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.468	1328	107	2328	2.228	3328	259
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	439	1330	147	2330	514	3330	348
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-4.854	1331	-5.199	2331	-9.638	3331	-11.135
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-5.348	1332	-6.560	2332	-11.213	3332	-14.100
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	-5.248	1334	-6.446	2334	-11.034	3334	-13.878
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-100	1336	-114	2336	-179	3336	-222
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-9	1337	-2.297	2337	-923	3337	-3.758
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	32.018	1338	36.899	2338	32.933	3338	38.360
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	32.010	1339	34.602	2339	32.010	3339	34.602

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2024		Acumulado anterior 30/06/2023
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	78	1357	214	2357	124	3357	617
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	78	1358	214	2358	124	3358	617
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	-158	1360	-8	2360	-230	3360	-145
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	80	1362	-206	2362	107	3362	-472
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: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2024								Situación cierre anual anterior 31/12/2023								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	2,94	0401	9,77	0421	0,00	0441	9,22	1381	3,40	1401	9,02	1421	0,00	1441	9,24	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: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	70	0467	31	0474	32	0481	0	0488	64	0495	8.235	0502	0	0509	8.299
De 1 a 3 meses	0461	11	0468	13	0475	10	0482	0	0489	23	0496	1.344	0503	0	0510	1.367
De 3 a 6 meses	0462	6	0469	13	0476	12	0483	5	0490	30	0497	994	0504	0	0511	1.024
De 6 a 9 meses	0463	8	0470	31	0477	17	0484	25	0491	74	0498	1.314	0505	0	0512	1.388
De 9 a 12 meses	0464	6	0471	27	0478	8	0485	22	0492	58	0499	698	0506	0	0513	756
Más de 12 meses	0465	23	0472	341	0479	30	0486	227	0493	598	0500	3.265	0507	0	0514	3.864
Total	0466	124	0473	457	0480	110	0487	280	0494	847	0501	15.852	0508	0	1515	16.699

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	70	0522	31	0529	32	0536	0	0543	64	0550	8.235	0557	0	0564	8.299	0571	15.613	0578	15.613	0584	53,16
De 1 a 3 meses	0516	11	0523	13	0530	10	0537	0	0544	23	0551	1.344	0558	0	0565	1.367	0572	2.480	0579	2.480	0585	55,13
De 3 a 6 meses	0517	6	0524	13	0531	12	0538	5	0545	30	0552	994	0559	0	0566	1.024	0573	1.596	0580	1.596	0586	64,17
De 6 a 9 meses	0518	8	0525	31	0532	17	0539	25	0546	74	0553	1.314	0560	0	0567	1.388	0574	1.966	0581	1.966	0587	70,62
De 9 a 12 meses	0519	6	0526	27	0533	8	0540	22	0547	58	0554	698	0561	0	0568	756	0575	1.030	0582	1.030	0588	73,44
Más de 12 meses	0520	23	0527	341	0534	30	0541	227	0548	598	0555	3.265	0562	0	0569	3.864	0576	5.571	0583	5.571	0589	69,35
Total	0521	124	0528	457	0535	110	0542	280	0549	847	0556	15.852	0563	0	0570	16.699	0577	28.255			0590	59,10

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: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 23/12/2008	
Inferior a 1 año	0600	93	1600	107	2600	679
Entre 1 y 2 años	0601	295	1601	230	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	660	1602	636	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	1.549	1603	1.406	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	2.002	1604	1.655	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	16.518	1605	17.127	2605	70
Superior a 10 años	0606	206.039	1606	226.067	2606	804.250
Total	0607	227.157	1607	247.229	2607	805.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	16,04	1608	16,43	2608	30,05

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 23/12/2008	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	17,31	1609	16,83	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: 30/06/2024
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 23/12/2008			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	562	0630	31.171	1620	567	1630	31.626	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.054	0631	118.933	1621	1.077	1631	123.361	2621	19	2631	3.712
60% - 80%	0622	490	0632	73.321	1622	582	1632	87.654	2622	252	2632	48.479
80% - 100%	0623	19	0633	3.732	1623	23	1633	4.588	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	2.125	0638	227.157	1628	2.249	1638	247.229	2628	4.059	2638	805.000
Media ponderada (%)	0639	53,22	0649		1639	54,35	1649		2639	88,45	2649	

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: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 23/12/2008	
Tipo de interés medio ponderado	0650	4,50	1650	3,87	2650	5,83
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,12	1651	6,36	2651	7,50
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,00	1652	1,00	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: 30/06/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 23/12/2008			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	185	0683	15.771	1660	199	1683	17.239	2660	351	2683	61.043
Aragón	0661	19	0684	1.813	1661	20	1684	1.938	2661	41	2684	6.944
Asturias	0662	39	0685	3.253	1662	40	1685	3.387	2662	56	2685	8.847
Baleares	0663	32	0686	3.494	1663	33	1686	3.653	2663	69	2686	13.031
Canarias	0664	35	0687	3.483	1664	35	1687	3.580	2664	62	2687	10.989
Cantabria	0665	24	0688	1.972	1665	25	1688	2.037	2665	36	2688	5.849
Castilla-León	0666	79	0689	6.205	1666	84	1689	6.699	2666	138	2689	20.939
Castilla La Mancha	0667	217	0690	17.949	1667	222	1690	19.177	2667	400	2690	64.008
Cataluña	0668	220	0691	25.805	1668	239	1691	29.130	2668	485	2691	95.641
Ceuta	0669	10	0692	592	1669	10	1692	613	2669	27	2692	3.535
Extremadura	0670	22	0693	1.320	1670	23	1693	1.420	2670	37	2693	4.862
Galicia	0671	105	0694	9.291	1671	114	1694	10.291	2671	157	2694	26.119
Madrid	0672	962	0695	119.899	1672	1.022	1695	130.780	2672	1.794	2695	412.125
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	29	0697	2.246	1674	30	1697	2.379	2674	58	2697	9.146
Navarra	0675	8	0698	712	1675	8	1698	744	2675	15	2698	3.096
La Rioja	0676	3	0699	320	1676	3	1699	330	2676	4	2699	788
Comunidad Valenciana	0677	121	0700	10.917	1677	127	1700	11.668	2677	300	2700	51.171
País Vasco	0678	15	0701	2.114	1678	15	1701	2.164	2678	29	2701	6.868
Total España	0679	2.125	0702	227.157	1679	2.249	1702	247.229	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	2.125	0705	227.157	1682	2.249	1705	247.229	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: 30/06/2024
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 23/12/2008			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	1,85			1710	1,73			2710	1,09		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

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: 30/06/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2024			Situación cierre anual anterior 31/12/2023			Situación inicial 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	18.121	110.122	6.077	19.707	119.760	6.077	100.000	607.700			
Total		0723	6.077	0724	110.122	1723	6.077	1724	119.760	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: 30/06/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado						
			0730	0731	0732	0733	0734		0735	0742	0736		0737		0738		0739	
ES0358968008	SERIE A	NS	EURIBOR 3 m	0,40	4,22	504	0		SI	110.122		0		110.626		0		
Total						0740	504	0741	0		0743	110.122	0744	0	0745	110.626	0746	0

	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 23/12/2008	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	4,25	0748	3,65	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: 30/06/2024
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2024								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2023							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0358968008	SERIE A	4.854	497.578	1.248	43.863	5.199	479.134	1.010	38.705								
Total		0754	4.854	0755	497.578	0756	1.248	0757	43.863	1754	5.199	1755	479.134	1756	1.010	1757	38.705

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

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/06/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 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

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

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 23/12/2008	
Inferior a 1 año	0765	110.122	1765	6.984	2765	10.047
Entre 1 y 2 años	0766	0	1766	5.793	2766	11.500
Entre 2 y 3 años	0767	0	1767	6.090	2767	12.212
Entre 3 y 4 años	0768	0	1768	6.373	2768	13.036
Entre 4 y 5 años	0769	0	1769	6.524	2769	13.904
Entre 5 y 10 años	0770	0	1770	35.139	2770	84.167
Superior a 10 años	0771	0	1771	52.857	2771	462.834
Total	0772	110.122	1772	119.760	2772	607.700
Vida residual media ponderada (años)	0773	0,05	1773	11,15	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: 30/06/2024

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 23/12/2008	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	22.835	1775	24.925	2775	80.500
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	22.919	1776	24.925	2776	80.500
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	20,74	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: 30/06/2024

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/06/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 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	-1.113		
Total							0808 -1.113	0809 -1.113	0810	

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 23/12/2008		Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		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: 30/06/2024

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	2.998	7006	5.376	7009	1,35	7012	2,21	7015	1,52		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	2.998	7008	5.376	7011	1,35	7014	2,21	7017	1,52	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	12	7020		7021	18.869	7024	19.003	7027	7,77	7030	7,19	7033	8,15		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	1.498	7025	1.892	7028	0,62	7031	0,72	7034	0,66		
Total Fallidos					7023	20.367	7026	20.895	7029	8,39	7032	7,90	7035	8,81	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		
	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: 30/06/2024

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
SERIE A - ES0358968008	2,50	1,35	1,39	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	49,02	51,95	51,95	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	2,50	1,35	1,39	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	27,63	28,47	Nota de Valores 4.9.4
Préstamo B	10,00	27,63	28,47	Nota de Valores 4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
Préstamo B	12,00	7,21	7,15	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.6.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		20,74	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: 30/06/2024

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862		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	20	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	

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: 30/06/2024

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	Integrado en el pago de los intereses de los bonistas
Contrapartida	0870	Bonista
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Cláusula 13.4 Intereses de los Bonos Iniciales

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: 30/06/2024

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
		22/02/2024	22/05/2024										
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885												
Saldo inicial	0886	24.925	23.930										
Cobros del periodo	0887	13.020	11.677										
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-106	-104										
Pagos por derivados	0889	45	78										
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-23.930	-22.835										
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-6.119	-6.102										
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-7.836	-6.645										
Resto pagos/retenciones	0893	0	0										
Saldo disponible	0894	0	0										
Liquidación de comisión variable	0895	0	0										0

Denominación Fondo: MADRID RESIDENCIAL I, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

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