

MADRID RMBS I - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 24/08/20 - 23/11/20

	Euros
I. Situación al 24/08/20:	4.784.127,05
Fondo de Reserva	4.784.127,05
II. Fondos recibidos del emisor	13.160.794,99
Principal:	
Según calendario hasta 31/10/20:	7.731.245,54
Amort. Anticipada hasta 31/10/20:	3.695.352,01
Intereses:	1.074.573,72
Ingresos por inmuebles	659.623,72
III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):	17.944.922,04
IV. Total intereses de la reinversión:	-8.610,60
Intereses de la Cta. De Tesorería	-8.610,60
V. Recursos disponibles (III + IV):	17.936.311,44
VI. Gastos:	312.161,43
VII. Liquidación SWAP:	-524.732,14
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	-296.302,98
Cantidad a Pagar por la Parte A (Santander):	-821.035,12
VIII. Pago a los Bonos:	11.750.908,10
Bonos A2 :	
Intereses correspondientes al 23/11/20:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 23/11/20:	11.680.646,00
Bonos B:	
Intereses correspondientes al 23/11/20:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 23/11/20:	0,00
Bonos C:	
Intereses correspondientes al 23/11/20:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 23/11/20:	0,00
Bonos D:	
Intereses correspondientes al 23/11/20:	775,20
Retenciones practicadas a los bonos:	147,29
Amortización correspondiente al 23/11/20:	0,00
Bonos E:	
Intereses correspondientes al 23/11/20:	69.486,90
Retenciones practicadas a los bonos:	13.202,51
Amortización correspondiente al 23/11/20:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones:	-13.349,80
IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII):	5.348.509,77
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva previo 24/08/20:	4.784.127,05
Aportación al Fondo de Reserva	564.382,72
Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada	0,00
Amortización Préstamo Participativo	0,00
Remuneración Variable Prést. Participativo	0,00
Fondo de Reserva 23/11/20:	5.348.509,77

Destinatarios: CNMV, AIAF



Nº: 4292/20

Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.: 917020808
<http://www.tda-sgft.com>
MADRID RMBS I liq.trim1Nov20

MADRID RMBS I

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 23 de Noviembre de 2020

Importes en euros

I. BONOS A2 ES0359091016	Sobre 13400 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (22/11/06):	1.340.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	373.228.860,00 €	27.852,90 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	11.680.646,00 €	871,69 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	361.548.214,00 €	26.981,21 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	26,981210%	26,981210%

II. BONOS B ES0359091024	Sobre 700 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (22/11/06):	70.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	70.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	70.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

III. BONOS C ES0359091032	Sobre 750 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (22/11/06):	75.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	75.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	75.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

IV. BONOS D ES0359091040	Sobre 340 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (22/11/06):	34.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	34.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	775,20 €	2,28 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	34.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

V. BONOS E ES0359091057	Sobre 210 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (22/11/06):	21.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	21.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	69.486,90 €	330,89 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	21.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

VI. EL FONDO	Importes en euros
1. Saldo de certificados de transmisión hipotecaria a 31/10/20:	
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidos:	561.548.221,91 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidos:	73.327.594,88 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidos:	561.700.872,50 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidos:	137.881.411,96 €
2. Amortización del período 31/07/20 a 31/10/20:	11.426.597,55 €
a) Según calendario:	7.731.245,54 €
b) Amortización anticipada hasta 31/10/20:	3.695.352,01 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):	
a) Ultimo año:	1,96%
b) Ultimo semestre:	1,99%
c) Ultimo trimestre:	2,55%
4. Porcentaje de fallidos (1):	19,71%
5. Nivel de Impago(2):	0,09%

(1) Saldo pendiente de las participaciones hipotecarias fallidas según definición del Folleto de Emisión (retraso de 6 meses y otras causas), sobre el saldo pendiente total.

(2) Importe de principal de las Certificados de Transmisión Hipotecaria con morosidad superior a 90 días en la Fecha de Cobro inmediata anterior a la Fecha de Pago en curso, sobre el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias.

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF.



Nº: 4293/20

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

<http://www.tda-sgft.com>

MADRID RMBS Nnfoinver.trim\Nov20

MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 24/08/20-23/11/20

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO

Fecha de Constitución del Fondo	15 de noviembre de 2006
Fecha Emisión BTH	15 de noviembre de 2006
Fecha Final Amortización Bonos: (1,96% TAA)	22 de noviembre de 2032
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca	Bankia (Caja Madrid)
Agente de Pagos	BNP Paribas, Sucursal en España
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Fitch Ibcra / Standard & Poor's / Moody's Investors Service
Calificación	Bonos A2: (F) A- sf / (S&P) AA- sf / (M) Aa1 sf Bonos B: (F) BBB- sf / (S&P) A sf / (M) A1 sf Bonos C: (F) B sf / (S&P) BBB sf / (M) Ba3 sf Bonos D: (F) CCC sf / (S&P) B sf / (M) C sf Bonos E: (F) CC sf / (S&P) CCC- sf / (M) C sf

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO

Nombre	Bonos de Titulización MADRID RMBS I
Serie A2:	
Código ISIN	ES0359091016
Nominal en circulación total (inicial)	1.340.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	361.548.214,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	26.981,21 Euros
Serie B:	
Código ISIN	ES0359091024
Nominal en circulación total (inicial)	70.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	70.000.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)

Nombre	Bonos de Titulización MADRID RMBS I
Serie C:	
Código ISIN	ES035091032
Nominal en circulación total (inicial)	75.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	75.000.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie D:	
Código ISIN	ES0359091040
Nominal en circulación total (inicial)	34.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	34.000.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie E:	
Código ISIN	ES0359091057
Nominal en circulación total (inicial)	21.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	21.000.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA

* Liquidación del Período:24/08/20-23/11/20
* Flujos de Caja del Período:24/08/20-23/11/20
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 23 de Noviembre de 2020

MADRID RMBS I\INFO.trim\Nov20

MADRID RMBS I*Fondo de Titulización de Activos***FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 24/08/20 - 23/11/20**

I. INVERSIONES/FINANCIACIONES	Euros	
	<u>Ingresos</u>	<u>Pagos</u>
Amortización Bonos Titulización Hip.		11.680.646,00
Amortización Participaciones Hip.	11.426.597,55	
Ingresos inmuebles	659.623,72	
Amortización Ptmos. Subordinados		0,00
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH		70.262,10
Intereses recibidos de las CTHs	1.074.573,72	
Intereses Ptmos. Subordinados		0,00
Intereses Inversiones Temporales	-8.610,60	
III. GASTOS		
Comisiones y Gastos		312.161,43
Neto SWAP		524.732,14
Remuneración Variable Préstamo Participativo		0,00
Total Ingresos/Pagos	13.152.184,39	12.587.801,67
Saldo inicial 24/08/20	4.784.127,05	
A Inversiones Temporales		5.348.509,77
Otros Recursos		0,00
Total	17.936.311,44	17.936.311,44
Retenciones practicadas el 23/11/20	13.349,80	
A Inversiones Temporales		13.349,80

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 4298/20**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

<http://www.tda-sgft.com>

MADRID RMBS I fluj.trim\Nov20