# MADRID RMBS I - Fondo de Titulización de Activos

*LIQUIDACION DEL PERIODO 22/02/21 - 24/05/21*

| | Euros |
|---|---|
| **I. Situación al 22/02/21:** | **5.919.830,57** |
| Fondo de Reserva | 5.919.830,57 |
| **II. Fondos recibidos del emisor** | **16.558.772,17** |
| **Principal:** | |
| Según calendario hasta 30/04/21: | 8.149.372,27 |
| Amort. Anticipada hasta 30/04/21: | 6.269.099,99 |
| **Intereses:** | 713.519,89 |
| Ingresos por inmuebles | 1.426.780,02 |
| **III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II):** | **22.478.602,74** |
| **IV. Total intereses de la reinversión:** | **-15.889,29** |
| Intereses de la Cta. De Tesorería | -15.889,29 |
| **V. Recursos disponibles (III + IV):** | **22.462.713,45** |
| **VI. Gastos:** | **400.092,89** |
| **VII. Liquidación SWAP:** | **-297.308,42** |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo): | -560.484,32 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (Santander): | -857.792,74 |
| **VIII. Pago a los Bonos:** | **15.047.925,40** |
| **Bonos A2 :** | |
| Intereses correspondientes al 24/05/21: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 24/05/21: | 14.981.200,00 |
| **Bonos B:** | |
| Intereses correspondientes al 24/05/21: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 24/05/21: | 0,00 |
| **Bonos C:** | |
| Intereses correspondientes al 24/05/21: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 24/05/21: | 0,00 |
| **Bonos D:** | |
| Intereses correspondientes al 24/05/21: | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 0,00 |
| Amortización correspondiente al 24/05/21: | 0,00 |
| **Bonos E:** | |
| Intereses correspondientes al 24/05/21: | 66.725,40 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 12.677,83 |
| Amortización correspondiente al 24/05/21: | 0,00 |
| **Reinversión o devolución de las retenciones:** | -12.677,83 |
| **IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII):** | **6.717.386,74** |
| **Distribución del saldo disponible:** | |
| Fondo de Reserva previo 22/02/21: | 5.919.830,57 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 797.556,17 |
| Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada | 0,00 |
| Amortización Préstamo Participativo | 0,00 |
| **Remuneración Variable Prést.Participativo** | **0,00** |
| **Fondo de Reserva 24/05/21:** | **6.717.386,74** |

**Destinatarios: CNMV, AIAF**

TdA Titulización de Activos

**Nº: 1817/21**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Orense, 58
28020 Madrid
Tel.:917020808
http:\\www.tda-sgft.com

# MADRID RMBS I

## *INFORMACION A LOS INVERSORES*

## *FECHA DE PAGO: 24 de Mayo de 2021*

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: | 349.644.458,00 € | 26.092,87 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 14.981.200,00 € | 1.118,00 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 334.663.258,00 € | 24.974,87 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 24,974870% | 24,974870% |

| 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: | 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: | 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: | 66.725,40 € | 317,74 € |
| 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 trasmisión hipotecaria a 30/04/21: | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidos: | 534.663.286,94 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidos: | 70.166.532,05 € |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidos: | 534.848.079,66 € |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidos: | 137.745.029,36 € |
| 2. Amortización del período 31/01/21 a 30/04/21: | 14.418.472,26 € |
| a) Según calendario: | 8.149.372,27 € |
| b) Amortización anticipada hasta 30/04/21: | 6.269.099,99 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | |
| a) Ultimo año: | 2,74% |
| b) Ultimo semestre: | 3,58% |
| c) Ultimo trimestre: | 4,48% |
| 4. Porcentaje de fallidos (1): | 20,48% |
| 5. Nivel de Impago(2): | 0,45% |

(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.**

TdA Titulización de Activos

**Nº: 1818/21**

**Titulización de Activos, (SGFT),S.A.**
**Orense, 58**
**28020 Madrid**
**Tel.:917020808**
**http:\\www.tda-sgft.com**

**MADRID RMBS I\Infoinver.trim\May21**

TdA Titulización de Activos

# MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

## INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 22/02/21-24/05/21

| 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: (2,74% TAA) | 23 de febrero 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 Ibca / Standard & Poor's / Moody's Investors Service |
| Calificación | Bonos A2: (F) A- sf / (S&P) AA- sf / (M) Aa1 sf<br>Bonos B: (F) BBB- sf / (S&P) A sf / (M) A1 sf<br>Bonos C: (F) B sf / (S&P) BBB sf / (M) Ba3 sf<br>Bonos D: (F) CCC sf / (S&P) B sf / (M) C sf<br>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) | 334.663.258,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 24.974,87 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 |

TdA Titulización de Activos

| 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:22/02/21-24/05/21 |
| * Flujos de Caja del Período:22/02/21-24/05/21 |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 24 de Mayo de 2021 |

MADRID RMBS I\INFO.trim\May21

# MADRID RMBS I

## *Fondo de Titulización de Activos*

## *FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/02/21 - 24/05/21*

| | Euros | |
|---|---|---|
| **I. INVERSIONES/FINANCIACIONES** | Ingresos | Pagos |
| Amortización Bonos Titulización Hip. | | 14.981.200,00 |
| Amortización Participaciones Hip. | 14.418.472,26 | |
| Ingresos inmuebles | 1.426.780,02 | |
| Amortización Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| **II. INTERESES** | | |
| Intereses pagados a los BTH | | 66.725,40 |
| Intereses recibidos de las CTHs | 713.519,89 | |
| Intereses Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| Intereses Inversiones Temporales | -15.889,29 | |
| **III. GASTOS** | | |
| Comisiones y Gastos | | 400.092,89 |
| Neto SWAP | | 297.308,42 |
| Remuneración Variable Préstamo Participativo | | 0,00 |
| **Total Ingresos/Pagos** | 16.542.882,88 | 15.745.326,71 |
| Saldo inicial 22/02/21 | 5.919.830,57 | |
| A Inversiones Temporales | | 6.717.386,74 |
| Otros Recursos | | 0,00 |
| **Total** | 22.462.713,45 | 22.462.713,45 |
| Retenciones practicadas el 24/05/21 | 12.677,83 | |
| A Inversiones Temporales | | 12.677,83 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.

TdA Titulización de Activos

**Nº: 1823/21**

**Titulización de Activos, SGFT,S.A.**

**Orense, 58**

**28020 Madrid**

**Tel.:917020808**

**http:\\www.tda-sgft.com**

**MADRID RMBS I\fluj.trim\May21**