

MADRID RMBS I - Fondo de Titulización de Activos
LIQUIDACION DEL PERIODO 22/05/24 - 22/08/24

| | Euros |
|---|----------------------|
| I. Situación al 22/05/24: | 13.139.455,59 |
| Fondo de Reserva | 13.139.455,59 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 20.387.219,51 |
| Principal: | |
| Según calendario hasta 31/07/24: | 7.838.342,17 |
| Amort. Anticipada hasta 31/07/24: | 8.296.731,22 |
| Intereses: | 3.984.046,12 |
| Ingresos por inmuebles | 268.100,00 |
| III. Subtotal Recursos Disponibles (I + II): | 33.526.675,10 |
| IV. Total intereses de la reinversión: | 283.613,41 |
| Intereses de la Cta. De Tesorería | 283.613,41 |
| V. Recursos disponibles (III + IV): | 33.810.288,51 |
| VI. Gastos: | 52.559,99 |
| VII. Liquidación SWAP: | -42.205,34 |
| Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo): | 3.292.692,80 |
| Cantidad a Pagar por la Parte A (Caixabank): | 3.250.487,46 |
| VIII. Pago a los Bonos: | 19.183.982,70 |
| Bonos A2 : | |
| Intereses correspondientes al 22/08/24: | 1.368.944,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 260.099,36 |
| Amortización correspondiente al 22/08/24: | 15.619.308,00 |
| Bonos B: | |
| Intereses correspondientes al 22/08/24: | 728.434,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 138.402,46 |
| Amortización correspondiente al 22/08/24: | 0,00 |
| Bonos C: | |
| Intereses correspondientes al 22/08/24: | 790.050,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 150.109,50 |
| Amortización correspondiente al 22/08/24: | 0,00 |
| Bonos D: | |
| Intereses correspondientes al 22/08/24: | 375.533,40 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 71.351,35 |
| Amortización correspondiente al 22/08/24: | 0,00 |
| Bonos E: | |
| Intereses correspondientes al 22/08/24: | 301.713,30 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 57.325,53 |
| Amortización correspondiente al 22/08/24: | 0,00 |
| Reinversión o devolución de las retenciones: | -677.288,20 |
| IX. Saldo disponible (V - VI + VII - VIII): | 14.531.540,48 |
| Distribución del saldo disponible: | |
| Fondo de Reserva previo 22/05/24: | 13.139.455,59 |
| Aportación al Fondo de Reserva | 1.392.084,89 |
| Remuneración Fija Préstamo Participativo pagada | 0,00 |
| Amortización Préstamo Participativo | 0,00 |
| Otros Recursos para el siguiente pago | 0,00 |
| Remuneración Variable Prést. Participativo | 0,00 |
| Fondo de Reserva 22/08/24: | 14.531.540,48 |

Destinatario: CNMV, AIAF



Nº: 3054/24

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58
28020 Madrid
Tel.:917020808

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

MADRID RMBS I/liqu.trim/Ago24

MADRID RMBS I**INFORMACION A LOS INVERSORES****FECHA DE PAGO: 22 de Agosto de 2024**

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: | 134.528.228,00 € | 10.039,42 € |
| 3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago: | 1.368.944,00 € | 102,16 € |
| 4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago: | 15.619.308,00 € | 1.165,62 € |
| 5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago: | 118.908.920,00 € | 8.873,80 € |
| 6. Porcentaje pendiente de vencimiento: | 8,873800% | 8,873800% |
| 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: | 728.434,00 € | 1.040,62 € |
| 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: | 790.050,00 € | 1.053,40 € |
| 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: | 375.533,40 € | 1.104,51 € |
| 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: | 301.713,30 € | 1.436,73 € |
| 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 31/07/24: | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidos: | | 318.908.911,26 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidos: | | 63.287.437,84 € |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidos: | | 319.056.817,26 € |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidos: | | 136.619.077,68 € |
| 2. Amortización del período 30/04/24 a 31/07/24: | | 16.135.073,39 € |
| a) Según calendario: | | 7.838.342,17 € |
| b) Amortización anticipada hasta 31/07/24: | | 8.296.731,22 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | |
| a) Último año: | | 10,26% |
| b) Último semestre: | | 9,85% |
| c) Último trimestre: | | 9,56% |
| 4. Porcentaje de fallidos (1): | | 29,98% |
| 5. Nivel de Impago(2): | | 0,57% |

(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: 3055/24

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

http://www.tda-sgft.com

MADRID RMBS I\Infoinver.trim\Ago24

MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL TRIMESTRE: 22/05/24-22/08/24
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: (10,26% TAA) | 22 de mayo de 2028 |
| Sociedad Gestora | Titulización de Activos, SGFT,S.A. |
| Emisores Participaciones Hipotecarias y Certificados de Transmisión de Hipoteca | Caixabank (Bankia) |
| Agente de Pagos | Société Générale, Sucursal en España |
| Negociación Mercado | Mercado AIAF |
| Agencia de Calificación | Fitch Ibcra / Standard & Poor's / Moody's Investors Service |
| Calificación | Bonos A2: (F) AA+ sf / (S&P) AAA sf / (M) Aa1 sf Bonos B: (F) AA- sf / (S&P) AA+ sf / (M) Aa1 sf Bonos C: (F) BB+ sf / (S&P) AA sf / (M) A1 sf Bonos D: (F) BB- sf / (S&P) BB+ sf / (M) B3 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) | 118.908.920,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (inicial) | 100.000,00 Euros |
| Nominal en circulación unitario (actual) | 8.873,80 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 |

MADRID RMBS I\INFO.trim\Ago24

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:22/05/24-22/08/24 |
| * Flujos de Caja del Período:22/05/24-22/08/24 |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 22 de Agosto de 2024 |

MADRID RMBS I\INFO.trim\Ago24

MADRID RMBS I

Fondo de Titulización de Activos

FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/05/24 - 22/08/24

| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | Euros | |
|--|----------------------|----------------------|
| | Ingresos | Pagos |
| Amortización Bonos Titulización Hip. | | 15.619.308,00 |
| Amortización Participaciones Hip. | 16.135.073,39 | |
| Ingresos inmuebles | 268.100,00 | |
| Amortización Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados a los BTH | | 3.564.674,70 |
| Intereses recibidos de las CTHs | 3.984.046,12 | |
| Intereses Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| Intereses Inversiones Temporales | 283.613,41 | |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones y Gastos | | 52.559,99 |
| Neto SWAP | | 42.205,34 |
| Remuneración Variable Préstamo Participativo | | 0,00 |
| Total Ingresos/Pagos | 20.670.832,92 | 19.278.748,03 |
| IV. RECURSOS | | |
| Saldo inicial 22/05/24 | 13.139.455,59 | |
| A Inversiones Temporales | | 14.531.540,48 |
| Otros Recursos | | 0,00 |
| Total | 33.810.288,51 | 33.810.288,51 |
| V. RETENCIONES | | |
| Retenciones practicadas el 22/08/24 | 677.288,20 | |
| A Inversiones Temporales | | 677.288,20 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.



Nº: 3060/24

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

MADRID RMBS Ifluj.trimAgo24