

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8801
NIF Fondo: V85160935
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: 30/06/2023

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 RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	742.380	1001	798.958
I. Activos financieros a largo plazo	0002	742.380	1002	798.958
1. Activos titulizados	0003	742.380	1003	798.958
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	704.734	1005	767.728
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	37.930	1025	31.513
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-283	1027	-283
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

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	150.188	1041	160.444
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	37.847	1042	39.173
V. Activos financieros a corto plazo	0043	54.520	1043	61.566
1. Activos titulizados	0044	53.198	1044	60.277
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	42.994	1046	50.968
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	1.107	1065	609
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	164	1066	64
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	10.211	1067	9.990
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	247	1068	171
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-1.525	1069	-1.525
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	1.258	1071	1.258
2.1 Derivados de cobertura	0072	1.258	1072	1.258
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	63	1074	31
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	63	1079	31
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	57.822	1085	59.705
1. Tesorería	0086	57.822	1086	59.705
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	892.568	1088	959.402

S.01

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	726.792	1089	789.533
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	726.792	1094	789.533
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	721.390	1095	784.131
1.1 Series no subordinadas	0096	451.390	1096	514.131
1.2 Series subordinadas	0097	270.000	1097	270.000
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	0	1101	0
2.1 Préstamo subordinado	0102	129.041	1102	129.041
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	-129.041	1105	-129.041
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	5.402	1108	5.402
3.1 Derivados de cobertura	0109	5.402	1109	5.402
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 III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) PASIVO CORRIENTE	0117	168.614	1117	173.962
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	166.282	1123	172.636
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	88.257	1124	90.812
1.1 Series no subordinadas	0125	53.205	1125	60.957
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	3.183	1128	2.026
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	31.870	1129	27.828
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	51.205	1131	50.814
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	-3.010	1135	-373
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	766	1136	548
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	53.448	1137	50.639
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	26.820	1143	31.010
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	26.820	1146	31.010
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	2.332	1148	1.327
1. Comisiones	0149	20	1149	20
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	14	1150	14
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	5	1152	6
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	2.312	1157	1.307
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-2.837	1158	-4.093
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-2.837	1160	-4.093
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	892.568	1162	959.402

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2023		Acumulado anterior 30/06/2022
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	7.581	1201	1.061	2201	13.903	3201	1.965
1.1 Activos titulizados	0202	7.361	1202	1.061	2202	13.517	3202	1.965
1.2 Otros activos financieros	0203	221	1203	0	2203	385	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-8.402	1204	-795	2204	-15.069	3204	-1.522
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-6.749	1205	-246	2205	-12.041	3205	-458
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1.653	1206	-537	2206	-3.028	3206	-1.038
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	-12	2207	0	3207	-27
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-45	1208	-16	2208	99	3208	-18
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-866	1209	250	2209	-1.067	3209	425
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	652	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-1.457	1217	-72	2217	-1.478	3217	-701
7.1 Servicios exteriores	0218	-1.412	1218	-26	2218	-1.387	3218	-610
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1.412	1219	-26	2219	-1.387	3219	-610
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	-46	1224	-46	2224	-92	3224	-91
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-34	1225	-32	2225	-67	3225	-64
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-12	1227	-13	2227	-24	3227	-26
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	-220	1231	-213	2231	-763	3231	-220
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-220	1232	-213	2232	-763	3232	-220
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	365	1238	112	2238	670	3238	134
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	1.526	1239	-77	2239	2.637	3239	362
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 RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2023		Acumulado anterior 30/06/2022
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	3.838	1300	985	2300	7.590	3300	1.807
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	3.884	1301	1.030	2301	7.682	3301	1.897
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	7.055	1302	1.029	2302	12.817	3302	1.946
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-3.834	1303	0	2303	-6.843	3303	0
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	459	1304	14	2304	1.355	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	3305	-21
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	204	1306	0	2306	353	3306	0
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	-13	2308	0	3308	-27
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-46	1309	-45	2309	-92	3309	-90
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-34	1310	-32	2310	-67	3310	-64
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-12	1312	-13	2312	-25	3312	-27
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	-2.484	1322	-3.592	2322	-9.473	3322	-5.881
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	-426	1325	-1.750	2325	-4.037	3325	-1.622
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	9.039	1326	9.790	2326	19.146	3326	19.966
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	21.396	1327	6.766	2327	40.750	3327	13.859
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.735	1328	1.099	2328	4.314	3328	2.101
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	250	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	1.037	1330	514	2330	1.997	3330	725
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-33.634	1331	-19.918	2331	-70.494	3331	-38.273
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-2.058	1332	-1.842	2332	-5.437	3332	-4.259
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	-2.058	1336	-1.842	2336	-5.437	3336	-4.259
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	1.355	1337	-2.607	2337	-1.883	3337	-4.075
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	56.467	1338	49.587	2338	59.705	3338	51.054
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	57.822	1339	46.980	2339	57.822	3339	46.980

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2023		Acumulado anterior 30/06/2022
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	459	1357	14	2357	1.355	3357	-21
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	459	1358	14	2358	1.355	3358	-21
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	45	1360	16	2360	-99	3360	18
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	-505	1362	-30	2362	-1.256	3362	3
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 RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2023								Situación cierre anual anterior 31/12/2022								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	6,05	0401	19,00	0421	0,00	0441	8,07	1381	4,82	1401	17,77	1421	0,00	1441	4,82	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	
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 RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

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	228	0467	114	0474	87	0481	0	0488	201	0495	26.920	0502	0	0509	27.122
De 1 a 3 meses	0461	73	0468	93	0475	77	0482	0	0489	170	0496	11.157	0503	0	0510	11.327
De 3 a 6 meses	0462	72	0469	162	0476	76	0483	41	0490	279	0497	10.001	0504	0	0511	10.280
De 6 a 9 meses	0463	26	0470	116	0477	26	0484	53	0491	195	0498	4.026	0505	0	0512	4.220
De 9 a 12 meses	0464	8	0471	45	0478	4	0485	21	0492	70	0499	952	0506	0	0513	1.022
Más de 12 meses	0465	218	0472	7.394	0479	141	0486	2.825	0493	10.359	0500	25.446	0507	0	0514	35.806
Total	0466	625	0473	7.924	0480	411	0487	2.940	0494	11.274	0501	78.502	0508	0	1515	89.776

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	228	0522	114	0529	87	0536	0	0543	201	0550	26.920	0557	0	0564	27.122	0571	46.160	0578	46.160	0584	58,76
De 1 a 3 meses	0516	73	0523	93	0530	77	0537	0	0544	170	0551	11.157	0558	0	0565	11.327	0572	16.739	0579	16.739	0585	67,67
De 3 a 6 meses	0517	72	0524	162	0531	76	0538	41	0545	279	0552	10.001	0559	0	0566	10.280	0573	15.952	0580	15.952	0586	64,44
De 6 a 9 meses	0518	26	0525	116	0532	26	0539	53	0546	195	0553	4.026	0560	0	0567	4.220	0574	6.366	0581	6.366	0587	66,29
De 9 a 12 meses	0519	8	0526	45	0533	4	0540	21	0547	70	0554	952	0561	0	0568	1.022	0575	1.573	0582	1.573	0588	64,95
Más de 12 meses	0520	218	0527	7.394	0534	141	0541	2.825	0548	10.359	0555	25.446	0562	0	0569	35.806	0576	43.757	0583	43.757	0589	81,83
Total	0521	625	0528	7.924	0535	411	0542	2.940	0549	11.274	0556	78.502	0563	0	0570	89.776	0577	130.548			0590	68,77

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

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 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 10/07/2007	
Inferior a 1 año	0600	286	1600	254	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	835	1601	901	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	2.251	1602	1.659	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	4.140	1603	2.730	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	7.447	1604	7.412	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	62.293	1605	66.412	2605	0
Superior a 10 años	0606	718.615	1606	780.830	2606	3.000.000
Total	0607	795.868	1607	860.199	2607	3.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	15,93	1608	16,34	2608	29,39

Antigüedad	Situación actual 30/06/2023						Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 10/07/2007	
	Antigüedad media ponderada (años)	0609	17,43	1609	16,94	2609	1,68			

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

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 30/06/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 10/07/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.465	0630	66.423	1620	1.340	1630	58.969	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	2.549	0631	272.454	1621	2.708	1631	290.396	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	2.231	0632	342.581	1622	2.462	1632	382.675	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	555	0633	114.411	1623	616	1633	128.160	2623	16.086	2633	3.000.000
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	0	2634	0
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	6.800	0638	795.868	1628	7.126	1638	860.199	2628	16.086	2638	3.000.000
Media ponderada (%)	0639	61,81	0649		1639	62,97	1649		2639	92,35	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 10/07/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	2,25	1650	0,82	2650	5,03
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,03	1651	5,03	2651	6,63
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,29	1652	0,40	2652	4,11

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 10/07/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	291	0683	23.581	1660	313	1683	26.547	2660	660	2683	94.850
Aragón	0661	67	0684	5.358	1661	72	1684	6.390	2661	183	2684	30.662
Asturias	0662	135	0685	10.202	1662	138	1685	10.648	2662	232	2685	28.884
Baleares	0663	143	0686	15.520	1663	151	1686	16.740	2663	383	2686	66.465
Canarias	0664	59	0687	5.582	1664	62	1687	6.181	2664	131	2687	20.463
Cantabria	0665	103	0688	9.117	1665	104	1688	9.539	2665	210	2688	32.047
Castilla-León	0666	142	0689	10.711	1666	148	1689	11.632	2666	299	2689	40.527
Castilla La Mancha	0667	266	0690	24.656	1667	275	1690	26.105	2667	724	2690	118.810
Cataluña	0668	1.124	0691	119.553	1668	1.186	1691	130.070	2668	3.674	2691	632.820
Ceuta	0669	22	0692	968	1669	23	1692	1.050	2669	56	2692	6.010
Extremadura	0670	30	0693	1.891	1670	30	1693	1.975	2670	63	2693	7.524
Galicia	0671	128	0694	10.608	1671	132	1694	11.365	2671	211	2694	29.795
Madrid	0672	3.914	0695	521.486	1672	4.102	1695	562.676	2672	8.144	2695	1.719.219
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	25	0697	2.199	1674	27	1697	2.470	2674	132	2697	18.809
Navarra	0675	37	0698	4.186	1675	39	1698	4.652	2675	93	2698	17.319
La Rioja	0676	10	0699	704	1676	10	1699	756	2676	38	2699	5.539
Comunidad Valenciana	0677	192	0700	15.013	1677	197	1700	15.767	2677	652	2700	90.277
País Vasco	0678	112	0701	14.533	1678	117	1701	15.639	2678	201	2701	39.979
Total España	0679	6.800	0702	795.868	1679	7.126	1702	860.199	2679	16.086	2702	3.000.000
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	6.800	0705	795.868	1682	7.126	1705	860.199	2682	16.086	2705	3.000.000

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2023
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 10/07/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,52			1710	0,50			2710	0,25		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 10/07/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal	Nº de pasivos emitidos		Nominal	Nº de pasivos emitidos		Nominal			
		0720	0721	unitario (€)	0722	1720	1721	unitario (€)	1722	2720	2721	2722	
				Principal pendiente				Principal pendiente			Principal pendiente		
ES0359093004	SERIE A1	6.580	0	0	6.580	0	0	6.580	100.000	658.000			
ES0359093012	SERIE A2	15.750	482	7.595	15.750	4.958	78.088	15.750	100.000	1.575.000			
ES0359093020	SERIE A3	4.970	100.000	497.000	4.970	100.000	497.000	4.970	100.000	497.000			
ES0359093038	SERIE B	555	100.000	55.500	555	100.000	55.500	555	100.000	55.500			
ES0359093046	SERIE C	900	100.000	90.000	900	100.000	90.000	900	100.000	90.000			
ES0359093053	SERIE D	720	100.000	72.000	720	100.000	72.000	720	100.000	72.000			
ES0359093061	SERIE E	525	100.000	52.500	525	100.000	52.500	525	100.000	52.500			
Total		0723	30.000	0724	774.595	1723	30.000	1724	845.088	2723	30.000	2724	3.000.000

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2023

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		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
						0730	0731		0732	0733	0734	0735			0742	0736	0737
ES0359093004	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,10	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0				
ES0359093012	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,20	3,58	29	0	NO	7.595	0	0	7.624	0				
ES0359093020	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,23	3,61	1.945	0	NO	497.000	0	0	498.945	0				
ES0359093038	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,30	3,68	221	1.274	NO	55.500	0	0	56.996	0				
ES0359093046	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,35	3,73	364	4.912	NO	90.000	0	0	95.276	0				
ES0359093053	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,60	3,98	311	8.125	NO	72.000	0	0	80.436	0				
ES0359093061	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,10	5,48	312	17.559	NO	52.500	0	0	70.371	0				
Total						0740	3.183	0741	31.870	0743	774.595	0744	0	0745	809.647	0746	0

	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 10/07/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	2,10	0748	0,61	0749	4,51

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2023								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2022							
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
ES0359093004	SERIE A1	0	658.000	0	41.199	0	658.000	0	41.199	0	658.000	0	41.199	0	658.000	0	41.199
ES0359093012	SERIE A2	33.634	1.567.405	291	185.997	19.918	1.452.219	0	185.149	0	1.452.219	0	185.149	0	1.452.219	0	185.149
ES0359093020	SERIE A3	0	0	3.544	75.336	0	0	0	68.399	0	0	0	68.399	0	0	0	68.399
ES0359093038	SERIE B	0	0	0	7.526	0	0	0	7.526	0	0	0	7.526	0	0	0	7.526
ES0359093046	SERIE C	0	0	0	9.902	0	0	0	9.902	0	0	0	9.902	0	0	0	9.902
ES0359093053	SERIE D	0	0	0	6.349	0	0	0	6.349	0	0	0	6.349	0	0	0	6.349
ES0359093061	SERIE E	0	0	0	5.654	0	0	0	5.654	0	0	0	5.654	0	0	0	5.654
Total		0754	33.634	0755	2.225.405	0756	3.834	0757	331.962	1754	19.918	1755	2.110.219	1756	0	1757	324.177

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2023

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 30/06/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 10/07/2007
				0760	0761	0762
ES0359093004	SERIE A1	18/03/2009	FCH	AA-	AA-	AAA
ES0359093004	SERIE A1	11/07/2007	MDY	Aaa	Aaa	Aaa
ES0359093004	SERIE A1	29/04/2009	SYP	AA	AA	AAA
ES0359093012	SERIE A2	29/09/2021	FCH	A+	A+	AAA
ES0359093012	SERIE A2	22/06/2022	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359093012	SERIE A2	15/03/2021	SYP	AA+	AA+	AAA
ES0359093020	SERIE A3	29/09/2021	FCH	A+	A+	AAA
ES0359093020	SERIE A3	22/06/2022	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0359093020	SERIE A3	15/03/2021	SYP	AA	AA	AAA
ES0359093038	SERIE B	29/11/2018	FCH	BB+	BB+	AA
ES0359093038	SERIE B	24/10/2014	MDY	B2	B2	Aa2
ES0359093038	SERIE B	12/06/2014	SYP	D	D	AA
ES0359093046	SERIE C	27/03/2023	FCH	BB+	BB-	A
ES0359093046	SERIE C	27/11/2020	MDY	Caa1	Caa1	A2
ES0359093046	SERIE C	24/02/2010	SYP	D	D	A
ES0359093053	SERIE D	27/03/2023	FCH	CCC	CC	BBB
ES0359093053	SERIE D	11/09/2009	MDY	C	C	Baa2
ES0359093053	SERIE D	22/05/2009	SYP	D	D	BBB
ES0359093061	SERIE E	10/03/2014	FCH	C	C	BB
ES0359093061	SERIE E	11/09/2009	MDY	C	C	Ba3
ES0359093061	SERIE E	22/05/2009	SYP	D	D	BB

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2023

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 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 10/07/2007	
Inferior a 1 año	0765	52.018	1765	34.138	2765	50.809
Entre 1 y 2 años	0766	39.080	1766	33.535	2766	27.541
Entre 2 y 3 años	0767	39.255	1767	35.939	2767	27.162
Entre 3 y 4 años	0768	41.261	1768	38.427	2768	30.904
Entre 4 y 5 años	0769	42.781	1769	40.770	2769	34.888
Entre 5 y 10 años	0770	225.951	1770	224.458	2770	243.706
Superior a 10 años	0771	334.248	1771	437.821	2771	2.584.989
Total	0772	774.595	1772	845.088	2772	3.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	12,48	1773	13,50	2773	25,06

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 10/07/2007	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	0	1775	0	2775	108.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	108.000	1776	108.000	2776	108.000
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	0,00	1777	0,00	2777	3,60
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	62,57	1792	65,87	2792	91,00
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	

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

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 30/06/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 10/07/2007	
	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 +0,0625%	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de las CTH al inicio del periodo que al final del periodo tengan como máximo 90 días de impago	-4.144	-4.144		
Total							0808 -4.144	0809 -4.144	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

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 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 10/07/2007		Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 10/07/2007			
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 RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

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 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	8.651	7006	2.296	7009	1,17	7012	0,29	7015	0,66		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	8.651	7008	2.296	7011	1,17	7014	0,29	7017	0,66	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	163.363	7024	167.408	7027	18,04	7030	17,20	7033	17,55		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	2.115	7025	2.269	7028	0,23	7031	0,23	7034	0,24		
Total Fallidos					7023	165.478	7026	169.678	7029	18,27	7032	17,43	7035	17,79	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

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 C - ES0359093046	1,75	1,16	0,73	4.9.4
SERIE E - ES0359093061	10,00	33,80	34,60	4.9.4
SERIE B - ES0359093038	3,70	7,17	6,87	4.9.4
SERIE A1 - ES0359093004	25,00	9,13	9,11	4.9.4
SERIE E - ES0359093061	1,25	1,16	0,73	4.9.4
SERIE D - ES0359093053	10,00	33,80	34,60	4.9.4
SERIE D - ES0359093053	1,50	1,16	0,73	4.9.4
SERIE B - ES0359093038	2,00	1,16	0,73	4.9.4
SERIE C - ES0359093046	6,00	11,62	11,14	4.9.4
SERIE C - ES0359093046	10,00	33,80	34,60	4.9.4
SERIE E - ES0359093061	3,50	6,78	6,50	4.9.4
SERIE B - ES0359093038	10,00	33,80	34,60	4.9.4
SERIE D - ES0359093053	4,80	9,30	8,91	4.9.4
SERIE A2 - ES0359093012	25,00	9,13	9,11	4.9.4
SERIE A3 - ES0359093020	25,00	9,13	9,11	4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE C - ES0359093046	14,65	23,51	23,44	3.4.6.2.
SERIE B - ES0359093038	20,30	23,51	23,44	3.4.6.2.
SERIE D - ES0359093053	10,47	23,51	23,44	3.4.6.2.
SERIE E - ES0359093061	8,94	23,51	23,44	3.4.6.2.
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		0,00	0,00	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

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

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 en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,011	4862		5862	34	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	

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

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	CAIXABANK
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														

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total		
		22/02/2023	22/05/2023											
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885													
Saldo inicial	0886	0	0											
Cobros del periodo	0887	39.283	38.077											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-310	-1.068											
Pagos por derivados	0889	895	459											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	0	0											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-39.868	-37.468											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0											
Resto pagos/retenciones	0893	0	0											
Saldo disponible	0894	0	0											
Liquidación de comisión variable	0895	0	0											0

S.06

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

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