

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: 30/06/2024

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 RMBS III, 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	631.657	1001	687.058
I. Activos financieros a largo plazo	0002	631.657	1002	687.058
1. Activos titulizados	0003	631.657	1003	687.058
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	590.930	1005	642.328
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	41.104	1025	45.107
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-378	1027	-378
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: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	110.175	1041	134.260
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	34.275	1042	35.482
V. Activos financieros a corto plazo	0043	49.536	1043	50.650
1. Activos titulizados	0044	49.473	1044	50.578
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	38.763	1046	39.369
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	1.077	1065	1.250
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	153	1066	171
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	10.472	1067	10.785
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	385	1068	381
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-1.377	1069	-1.377
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	63	1074	72
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	72
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	26.365	1085	48.128
1. Tesorería	0086	26.365	1086	48.128
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	741.832	1088	821.317

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	596.210	1089	658.808
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	596.210	1094	658.808
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	592.579	1095	655.177
1.1 Series no subordinadas	0096	322.579	1096	385.177
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	3.631	1108	3.631
3.1 Derivados de cobertura	0109	3.631	1109	3.631
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: 30/06/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) PASIVO CORRIENTE	0117	148.130	1117	164.727
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	146.629	1123	162.788
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	96.486	1124	91.376
1.1 Series no subordinadas	0125	49.235	1125	50.154
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	2.968	1128	3.354
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	44.282	1129	37.868
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	49.980	1131	51.559
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	-12.004	1135	-6.496
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	828	1136	847
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	61.156	1137	57.207
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	163	1139	163
3.1 Derivados de cobertura	0140	163	1140	163
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	19.690
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	19.690
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	1.501	1148	1.939
1. Comisiones	0149	18	1149	18
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	15	1150	14
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	4	1152	4
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	1.482	1157	1.921
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-2.508	1158	-2.218
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-2.508	1160	-2.218
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	741.832	1162	821.317

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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	7.536	1201	7.581	2201	15.774	3201	13.903
1.1 Activos titulizados	0202	7.275	1202	7.361	2202	15.236	3202	13.517
1.2 Otros activos financieros	0203	262	1203	221	2203	537	3203	385
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-9.180	1204	-8.402	2204	-18.823	3204	-15.069
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-7.225	1205	-6.749	2205	-14.894	3205	-12.041
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1.954	1206	-1.653	2206	-3.929	3206	-3.028
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	365	1208	-45	2208	461	3208	99
A) MARGEN DE INTERESES	0209	-1.278	1209	-866	2209	-2.589	3209	-1.067
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	652	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-433	1217	-1.457	2217	-826	3217	-1.478
7.1 Servicios exteriores	0218	-388	1218	-1.412	2218	-735	3218	-1.387
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-388	1219	-1.412	2219	-735	3219	-1.387
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	-45	1224	-46	2224	-91	3224	-92
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-35	1225	-34	2225	-70	3225	-67
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-10	1227	-12	2227	-21	3227	-24
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	-2.527	1231	-220	2231	-2.835	3231	-763
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-2.527	1232	-220	2232	-2.835	3232	-763
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	433	1238	365	2238	742	3238	670
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	3.805	1239	1.526	2239	5.507	3239	2.637
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: 30/06/2024

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	3.536	1300	3.838	2300	7.185	3300	7.590
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	3.581	1301	3.884	2301	7.276	3301	7.682
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	7.403	1302	7.055	2302	15.424	3302	12.817
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-4.202	1303	-3.834	2303	-8.866	3303	-6.843
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	120	1304	459	2304	171	3304	1.355
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	260	1306	204	2306	547	3306	353
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	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-45	1309	-46	2309	-91	3309	-92
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-35	1310	-34	2310	-69	3310	-67
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-10	1312	-12	2312	-21	3312	-25
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	-21.766	1322	-2.484	2322	-28.948	3322	-9.473
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	-323	1325	-426	2325	-8.379	3325	-4.037
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	7.975	1326	9.039	2326	16.280	3326	19.146
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	16.224	1327	21.396	2327	29.594	3327	40.750
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	5.356	1328	1.735	2328	7.313	3328	4.314
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	2	3329	250
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	1.101	1330	1.037	2330	1.949	3330	1.997
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-30.979	1331	-33.634	2331	-63.517	3331	-70.494
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-21.443	1332	-2.058	2332	-20.569	3332	-5.437
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	-21.443	1336	-2.058	2336	-20.569	3336	-5.437
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-18.230	1337	1.355	2337	-21.763	3337	-1.883
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	44.595	1338	56.467	2338	48.128	3338	59.705
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	26.365	1339	57.822	2339	26.365	3339	57.822

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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	120	1357	459	2357	171	3357	1.355
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	120	1358	459	2358	171	3358	1.355
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	-365	1360	45	2360	-461	3360	-99
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	246	1362	-505	2362	290	3362	-1.256
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: 30/06/2024

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	7,57	0401	21,88	0421	0,00	0441	8,62	1381	7,58	1401	20,31	1421	0,13	1441	9,32	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: 30/06/2024

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	230	0467	117	0474	90	0481	0	0488	206	0495	26.418	0502	0	0509	26.624
De 1 a 3 meses	0461	56	0468	63	0475	64	0482	0	0489	127	0496	8.123	0503	0	0510	8.250
De 3 a 6 meses	0462	46	0469	133	0476	71	0483	30	0490	235	0497	6.316	0504	0	0511	6.550
De 6 a 9 meses	0463	29	0470	127	0477	48	0484	69	0491	243	0498	3.972	0505	0	0512	4.215
De 9 a 12 meses	0464	33	0471	170	0478	55	0485	151	0492	376	0499	4.923	0506	0	0513	5.299
Más de 12 meses	0465	226	0472	7.214	0479	211	0486	3.549	0493	10.974	0500	28.722	0507	0	0514	39.696
Total	0466	620	0473	7.824	0480	538	0487	3.799	0494	12.161	0501	78.473	0508	0	1515	90.634

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	230	0522	117	0529	90	0536	0	0543	206	0550	26.418	0557	0	0564	26.624	0571	47.149	0578	47.149	0584	56,47
De 1 a 3 meses	0516	56	0523	63	0530	64	0537	0	0544	127	0551	8.123	0558	0	0565	8.250	0572	12.835	0579	12.835	0585	64,28
De 3 a 6 meses	0517	46	0524	133	0531	71	0538	30	0545	235	0552	6.316	0559	0	0566	6.550	0573	11.016	0580	11.016	0586	59,46
De 6 a 9 meses	0518	29	0525	127	0532	48	0539	69	0546	243	0553	3.972	0560	0	0567	4.215	0574	6.444	0581	6.444	0587	65,41
De 9 a 12 meses	0519	33	0526	170	0533	55	0540	151	0547	376	0554	4.923	0561	0	0568	5.299	0575	7.411	0582	7.411	0588	71,50
Más de 12 meses	0520	226	0527	7.214	0534	211	0541	3.549	0548	10.974	0555	28.722	0562	0	0569	39.696	0576	48.582	0583	48.582	0589	81,71
Total	0521	620	0528	7.824	0535	538	0542	3.799	0549	12.161	0556	78.473	0563	0	0570	90.634	0577	133.436			0590	67,92

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: 30/06/2024

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 10/07/2007	
Inferior a 1 año	0600	619	1600	394	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	1.274	1601	999	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	3.028	1602	1.907	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	5.546	1603	5.989	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	13.522	1604	8.664	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	57.485	1605	59.275	2605	0
Superior a 10 años	0606	599.797	1606	660.362	2606	3.000.000
Total	0607	681.270	1607	737.590	2607	3.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	15,17	1608	15,56	2608	29,39

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 10/07/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	18,41	1609	17,92	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: 30/06/2024

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 10/07/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	1.722	0630	78.936	1620	1.608	1630	72.621	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	2.380	0631	259.919	1621	2.465	1631	266.866	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	1.635	0632	251.436	1622	1.936	1632	296.216	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	450	0633	90.978	1623	501	1633	101.886	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	6.187	0638	681.270	1628	6.510	1638	737.590	2628	16.086	2638	3.000.000
Media ponderada (%)	0639	59,53	0649		1639	60,66	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: 30/06/2024

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 10/07/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	4,51	1650	3,87	2650	5,03
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,18	1651	6,57	2651	6,63
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,40	1652	1,40	2652	4,11

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: 30/06/2024

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 10/07/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	264	0683	20.111	1660	278	1683	21.563	2660	660	2683	94.850
Aragón	0661	64	0684	4.853	1661	66	1684	5.173	2661	183	2684	30.662
Asturias	0662	122	0685	8.536	1662	128	1685	9.207	2662	232	2685	28.884
Baleares	0663	134	0686	13.593	1663	138	1686	14.386	2663	383	2686	66.465
Canarias	0664	55	0687	4.670	1664	58	1687	5.252	2664	131	2687	20.463
Cantabria	0665	96	0688	7.740	1665	101	1688	8.584	2665	210	2688	32.047
Castilla-León	0666	132	0689	8.904	1666	137	1689	9.641	2666	299	2689	40.527
Castilla La Mancha	0667	241	0690	21.301	1667	252	1690	22.784	2667	724	2690	118.810
Cataluña	0668	999	0691	99.556	1668	1.069	1691	109.869	2668	3.674	2691	632.820
Ceuta	0669	21	0692	849	1669	22	1692	920	2669	56	2692	6.010
Extremadura	0670	28	0693	1.636	1670	28	1693	1.704	2670	63	2693	7.524
Galicia	0671	115	0694	9.182	1671	120	1694	9.827	2671	211	2694	29.795
Madrid	0672	3.580	0695	449.567	1672	3.758	1695	485.221	2672	8.144	2695	1.719.219
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	22	0697	1.840	1674	23	1697	1.973	2674	132	2697	18.809
Navarra	0675	33	0698	3.384	1675	34	1698	3.716	2675	93	2698	17.319
La Rioja	0676	10	0699	612	1676	10	1699	685	2676	38	2699	5.539
Comunidad Valenciana	0677	169	0700	12.297	1677	183	1700	13.752	2677	652	2700	90.277
País Vasco	0678	102	0701	12.639	1678	105	1701	13.331	2678	201	2701	39.979
Total España	0679	6.187	0702	681.270	1679	6.510	1702	737.590	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	6.187	0705	681.270	1682	6.510	1705	737.590	2682	16.086	2705	3.000.000

MADRID RMBS III, FTA

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: 30/06/2024
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 10/07/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,59			1710	0,55			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: 30/06/2024

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 10/07/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente			
		0720	Nominal unitario (€) 0721	0722	1720	Nominal unitario (€) 1721	1722	2720	Nominal unitario (€) 2721	2722			
ES0359093004	SERIE A1	6.580	0	0	6.580	0	0	6.580	100.000	658.000			
ES0359093012	SERIE A2	15.750	0	0	15.750	0	0	15.750	100.000	1.575.000			
ES0359093020	SERIE A3	4.970	74.812	371.814	4.970	87.592	435.331	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	641.814	1723	30.000	1724	705.331	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: 30/06/2024

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		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		0738	0739			
						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	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0				
ES0359093020	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,23	4,05	1.632	0	NO	371.814	0	0	373.446	0				
ES0359093038	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,30	4,12	248	3.573	NO	55.500	0	0	59.321	0				
ES0359093046	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,35	4,17	407	8.686	NO	90.000	0	0	99.093	0				
ES0359093053	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,60	4,42	345	11.328	NO	72.000	0	0	83.672	0				
ES0359093061	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,10	5,92	337	20.695	NO	52.500	0	0	73.532	0				
Total						0740	2.968	0741	44.282	0743	641.814	0744	0	0745	689.065	0746	0

	Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 10/07/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	4,27	0748	3,65	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: 30/06/2024

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	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	0	1.575.000	0	186.067	33.634	1.567.405	291	185.997	0	1.575.000	0	186.067	33.634	1.567.405	291	185.997
ES0359093020	SERIE A3	30.979	125.186	4.202	93.625	0	0	3.544	75.336	0	125.186	0	93.625	0	0	3.544	75.336
ES0359093038	SERIE B	0	0	0	7.526	0	0	0	7.526	0	0	0	0	0	0	0	7.526
ES0359093046	SERIE C	0	0	0	9.902	0	0	0	9.902	0	0	0	0	0	0	0	9.902
ES0359093053	SERIE D	0	0	0	6.349	0	0	0	6.349	0	0	0	0	0	0	0	6.349
ES0359093061	SERIE E	0	0	0	5.654	0	0	0	5.654	0	0	0	0	0	0	0	5.654
Total		0754	30.979	0755	2.358.186	0756	4.202	0757	350.321	1754	33.634	1755	2.225.405	1756	3.834	1757	331.962

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: 30/06/2024

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 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	13/03/2024	FCH	AA+	A+	AAA
ES0359093020	SERIE A3	26/10/2023	MDY	Aa1	Aa1	Aaa
ES0359093020	SERIE A3	15/03/2021	SYP	AA	AA	AAA
ES0359093038	SERIE B	13/03/2024	FCH	AA	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	13/03/2024	FCH	BBB	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	CCC	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: 30/06/2024

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 10/07/2007	
Inferior a 1 año	0765	44.372	1765	50.633	2765	50.809
Entre 1 y 2 años	0766	34.272	1766	35.213	2766	27.541
Entre 2 y 3 años	0767	36.037	1767	37.187	2767	27.162
Entre 3 y 4 años	0768	37.275	1768	38.975	2768	30.904
Entre 4 y 5 años	0769	37.991	1769	40.060	2769	34.888
Entre 5 y 10 años	0770	200.531	1770	211.746	2770	243.706
Superior a 10 años	0771	251.335	1771	291.517	2771	2.584.989
Total	0772	641.814	1772	705.331	2772	3.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	11,35	1773	12,02	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: 30/06/2024

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 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	54,20	1792	58,58	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: 30/06/2024

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 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	-3.795	-3.795		
Total							0808 -3.795	0809 -3.795	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2024

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 10/07/2007		Situación actual 30/06/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		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: 30/06/2024

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	4.604	7006	7.662	7009	0,74	7012	1,14	7015	0,78		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	4.604	7008	7.662	7011	0,74	7014	1,14	7017	0,78	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	160.727	7024	166.021	7027	20,54	7030	19,71	7033	20,65		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	2.026	7025	2.027	7028	0,26	7031	0,24	7034	0,25		
Total Fallidos					7023	162.753	7026	168.048	7029	20,80	7032	19,95	7035	20,91	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 RMBS III, 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 E - ES0359093061	10,00	29,94	30,61	4.9.4
SERIE C - ES0359093046	10,00	29,94	30,61	4.9.4
SERIE C - ES0359093046	1,75	0,74	0,78	4.9.4
SERIE A1 - ES0359093004	25,00	9,28	9,37	4.9.4
SERIE B - ES0359093038	3,70	8,65	8,25	4.9.4
SERIE B - ES0359093038	10,00	29,94	30,61	4.9.4
SERIE D - ES0359093053	1,50	0,74	0,78	4.9.4
SERIE D - ES0359093053	4,80	11,22	10,70	4.9.4
SERIE D - ES0359093053	10,00	29,94	30,61	4.9.4
SERIE E - ES0359093061	3,50	8,18	7,80	4.9.4
SERIE B - ES0359093038	2,00	0,74	0,78	4.9.4
SERIE A3 - ES0359093020	25,00	9,28	9,37	4.9.4
SERIE E - ES0359093061	1,25	0,74	0,78	4.9.4
SERIE A2 - ES0359093012	25,00	9,28	9,37	4.9.4
SERIE C - ES0359093046	6,00	14,02	13,38	4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE C - ES0359093046	14,65	24,15	24,08	3.4.6.2.
SERIE D - ES0359093053	10,47	24,15	24,08	3.4.6.2.
SERIE E - ES0359093061	8,94	24,15	24,08	3.4.6.2.
SERIE B - ES0359093038	20,30	24,15	24,08	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: 30/06/2024

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 en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3862	0,011	4862		5862	35	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	

S.05.5
Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2024

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	
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: 30/06/2024

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	0	0											
Cobros del periodo	0887	37.500	35.503											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-350	-442											
Pagos por derivados	0889	51	120											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	0	0											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-37.202	-35.181											
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: 30/06/2024

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