

MADRID RMBS III - Fondo de Titulización de Activos

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

	Euros
I. Situación al 22/02/24:	21,43
Saldo inicial Cta. Tesorería	21,43
II. Fondos recibidos del emisor	34.496.982,72
Principal:	
Según calendario hasta 30/04/24:	10.285.639,26
Amort. Anticipada hasta 30/04/24:	16.388.882,94
Intereses:	7.822.460,52
III. Ingresos de Inmuebles:	744.900,00
IV. Subtotal Recursos disponibles (I + II + III):	35.241.904,15
V. Total intereses Cuenta de Tesorería:	261.157,24
Intereses de la Cta.de Tesorería	261.157,24
VI. Recursos disponibles (IV + V):	35.503.061,39
VII. Gastos:	441.864,71
VIII. Liquidación SWAP:	119.737,59
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	6.703.336,91
Cantidad a Pagar por la Parte A (CaixaBank):	6.823.074,50
IX. Pago a los Bonos:	35.180.890,50
Bonos A3 :	
Intereses correspondientes al 22/05/24:	4.202.135,00
Retenciones practicadas a los bonos:	798.405,65
Amortización correspondiente al 22/05/24:	30.978.755,50
Bonos B:	
Intereses vencidos a 22/05/24:	588.716,25
Intereses pagados a 22/05/24:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados a 22/05/24:	3.573.467,40
Amortización correspondiente al 22/05/24:	0,00
Bonos C:	
Intereses vencidos a 22/05/24:	965.925,00
Intereses pagados a 22/05/24:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados a 22/05/24:	8.686.269,00
Amortización correspondiente al 22/05/24:	0,00
Bonos D:	
Intereses vencidos a 22/05/24:	817.740,00
Intereses pagados a 22/05/24:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados a 22/05/24:	11.327.558,40
Amortización correspondiente al 22/05/24:	0,00
Bonos E:	
Intereses vencidos a 22/05/24:	793.143,75
Intereses pagados a 22/05/24:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados a 22/05/24:	20.694.733,50
Amortización correspondiente al 22/05/24:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones :	-798.405,65
X. Saldo disponible (VI - VII + VIII - IX):	43,77
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva previo (22/02/24):	0,00
Aportación al Fondo de Reserva	0,00
Remuneración Fija Préstamo Participativo	0,00
Amortización Préstamo Participativo	0,00
Intereses Crédito Subordinado	0,00
Amortización Crédito Subordinado	0,00
Otros Recursos para el siguiente pago	43,77
Remuneración Variable Prést.Participativo	0,00
Fondo de Reserva (22/05/24):	0,00

Destinatarios: CNMV; AIAF



Nº: 1887/24

Titulización de Activos, SGFT,S.A.
 Orense, 58
 28020 Madrid
 Tel.:917020808
<http://www.tda-sgft.com>
 MADRID RMBS IIIliq.trim\May24

MADRID RMBS III

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 22 de Mayo de 2024

Importes en euros

I. BONOS A3 ES0359093020		Sobre 4970 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/07/2007):	497.000.000,00 €		100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	402.792.755,40 €		81.044,82 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	4.202.135,00 €		845,50 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	30.978.755,50 €		6.233,15 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	371.813.999,90 €		74.811,67 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	74,811670%		74,811670%
II. BONOS B ES0359093038		Sobre 555 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/07/2007):	55.500.000,00 €		100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	55.500.000,00 €		100.000,00 €
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	588.716,25 €		1.060,75 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	3.573.467,40 €		6.438,68 €
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	55.500.000,00 €		100.000,00 €
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%		100,000000%
III. BONOS C ES0359093046		Sobre 900 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/07/2007):	90.000.000,00 €		100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	90.000.000,00 €		100.000,00 €
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	965.925,00 €		1.073,25 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	8.686.269,00 €		9.651,41 €
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	90.000.000,00 €		100.000,00 €
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%		100,000000%
IV. BONOS D ES0359093053		Sobre 720 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/07/2007):	72.000.000,00 €		100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	72.000.000,00 €		100.000,00 €
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	817.740,00 €		1.135,75 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	11.327.558,40 €		15.732,72 €
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	72.000.000,00 €		100.000,00 €
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%		100,000000%
V. BONOS E ES0359093061		Sobre 525 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/07/2007):	52.500.000,00 €		100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	52.500.000,00 €		100.000,00 €
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	793.143,75 €		1.510,75 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	20.694.733,50 €		39.418,54 €
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €		0,00 €
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	52.500.000,00 €		100.000,00 €
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%		100,000000%
VI. EL FONDO		Importes en euros	
1. Saldo de participaciones hipotecarias a 30/04/24:			
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:			637.036.526,46 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:			152.942.666,81 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:			637.298.283,70 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:			281.063.060,39 €
2. Amortización del período 31/01/24 a 30/04/24:			26.674.522,20 €
a) Según calendario:			10.285.639,26 €
b) Amortización anticipada hasta 30/04/24:			16.388.882,94 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):			
a) Último año:			9,46%
b) Último semestre:			9,19%
c) Último trimestre:			9,49%
4. Porcentaje de fallidos (1):			30,60%
5. Nivel de Impago (2):			0,78%

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

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

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF



Nº: 1888/24

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

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

MADRID RMBS III\Infoinver.trim\May24

MADRID RMBS III , FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

INFORMACION CORRESPONDIENTE AL PERÍODO: 22/02/24 - 22/05/24

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO	
Fecha de Constitución del Fondo	11 de julio de 2007
Fecha Emisión Bonos	11 de julio de 2007
Fecha Final Amortización Bonos: (9,46% TAA)	22 de agosto de 2031
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Certificados de Transmisión de Hipoteca	Caixabank (Bankia)
Agente de Pagos	Société Générale, Sucursal en España
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Fitch Ibcra / Standard & Poor's / Moody's Investors Service
Calificación	<p>Bonos A3: (F) AA+ (sf) / (S&P) AA (sf) / (M) Aa1 (sf)</p> <p>Bonos B: (F) AA (sf) / (S&P) D (sf) / (M) B2 (sf)</p> <p>Bonos C: (F) BBB (sf) / (S&P) D (sf) / (M) Caa1 (sf)</p> <p>Bonos D: (F) CCC (sf) / (S&P) D (sf) / (M) C (sf)</p> <p>Bonos E: (F) C (sf) / (S&P) D (sf) / (M) C (sf)</p>

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)	
Nombre	Bonos de Titulización MADRID RMBS III
Serie A3:	
Código ISIN	ES0359093020
Nominal en circulación total (inicial)	497.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	371.813.999,90 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	74.811,67 Euros
Serie B:	
Código ISIN	ES0359093038
Nominal en circulación total (inicial)	55.500.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	55.500.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie C:	
Código ISIN	ES0359093046
Nominal en circulación total (inicial)	90.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	90.000.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie D:	
Código ISIN	ES0359093053
Nominal en circulación total (inicial)	72.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	72.000.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie E:	
Código ISIN	ES0359093061
Nominal en circulación total (inicial)	52.500.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	52.500.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA
* Liquidación del Período: 22/02/24-22/05/24
* Flujos de Caja del Período: 22/02/24-22/05/24
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 22 de Mayo de 2024

MADRID RMBS III**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/02/24 - 22/05/24**

	Euros	
	Ingresos	Pagos
I. INVERSIONES/FINANCIACIONES		
Amortización Bonos Titulización Hip.		30.978.755,50
Amortización Participaciones Hip.	26.674.522,20	
Amortización Ptmos. Subordinados		0,00
Ingresos de Inmuebles	744.900,00	
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH		4.202.135,00
Intereses recibidos de las PHs	7.822.460,52	
Intereses Ptmos. Subordinados		0,00
Intereses Inversiones Temporales	261.157,24	
III. GASTOS		
Comisiones Periódicas:		441.864,71
Neto SWAP	119.737,59	
Remuneración Variable Préstamo Participativo		0,00
Total Ingresos/Pagos	35.622.777,55	35.622.755,21
Saldo inicial 22/02/24	21,43	
A Inversiones Temporales		43,77
Total	35.622.798,98	35.622.798,98
Retenciones practicadas el 22/05/24	798.405,65	
A Inversiones temporales		798.405,65

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 1893/24**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

MADRID RMBS IIIfluj.trimMay24