

**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: 30/09/2023

**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: 30/09/2023**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	715.746	1001	798.958
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	715.746	1002	798.958
1. Activos titulizados	0003	715.746	1003	798.958
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	673.557	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	42.472	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
<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0039	0	1039	0
<b>III. Otros activos no corrientes</b>	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: 30/09/2023**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	136.871	1041	160.444
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042	37.051	1042	39.173
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	53.026	1043	61.566
1. Activos titulizados	0044	51.708	1044	60.277
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	40.980	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	1.214	1065	609
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	169	1066	64
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	10.545	1067	9.990
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	326	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	59	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	59	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	
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
<b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b>	0085	46.794	1085	59.705
1. Tesorería	0086	46.794	1086	59.705
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	852.617	1088	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: 30/09/2023**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	691.413	1089	789.533
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	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
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0094	691.413	1094	789.533
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	686.011	1095	784.131
1.1 Series no subordinadas	0096	416.011	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
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	0116	0	1116	0

**Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA**

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados: NO**

**Fecha: 30/09/2023**

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	163.950	1117	173.962
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0118	0	1118	0
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	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
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	0123	162.236	1123	172.636
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	89.628	1124	90.812
1.1 Series no subordinadas	0125	51.525	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	3.384	1128	2.026
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	34.719	1129	27.828
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	51.559	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	-4.525	1135	-373
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	827	1136	548
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	55.257	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	21.050	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	21.050	1146	31.010
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	0148	1.713	1148	1.327
1. Comisiones	0149	18	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	4	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	1.695	1157	1.307
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158	-2.746	1158	-4.093
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159	0	1159	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	-2.746	1160	-4.093
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161	0	1161	0
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	852.617	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: 30/09/2023

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	8.347	1201	1.892	2201	22.250	3201	3.857
1.1 Activos titulizados	0202	8.072	1202	1.892	2202	21.589	3202	3.857
1.2 Otros activos financieros	0203	275	1203	0	2203	660	3203	0
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-9.578	1204	-1.585	2204	-24.646	3204	-3.108
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-7.709	1205	-895	2205	-19.750	3205	-1.353
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1.869	1206	-681	2206	-4.897	3206	-1.719
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	-10	2207	0	3207	-36
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0208	190	1208	39	2208	289	3208	21
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	-1.041	1209	345	2209	-2.108	3209	770
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	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
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0217	-483	1217	-69	2217	-1.961	3217	-770
7.1 Servicios exteriores	0218	-438	1218	-24	2218	-1.825	3218	-633
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-438	1219	-24	2219	-1.825	3219	-633
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	-44	1224	-45	2224	-136	3224	-136
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-34	1225	-32	2225	-101	3225	-96
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-10	1227	-13	2227	-35	3227	-39
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
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0231	-416	1231	-96	2231	-1.178	3231	-316
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-416	1232	-96	2232	-1.178	3232	-316
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	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
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0238	425	1238	65	2238	1.095	3238	199
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0239	1.515	1239	-245	2239	4.152	3239	117
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	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: 30/09/2023**

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	3.738	1300	1.724	2300	11.327	3300	3.530
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	3.783	1301	1.769	2301	11.465	3301	3.666
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	7.881	1302	1.741	2302	20.698	3302	3.687
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-4.659	1303	0	2303	-11.501	3303	0
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	281	1304	44	2304	1.636	3304	23
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	279	1306	0	2306	632	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	-17	2308	0	3308	-44
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	0309	-45	1309	-45	2309	-137	3309	-135
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-34	1310	-32	2310	-101	3310	-96
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-12	1312	-13	2312	-36	3312	-40
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>	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>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>	0322	-14.766	1322	1.065	2322	-24.239	3322	-4.816
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b>	0325	-8.485	1325	629	2325	-12.522	3325	-993
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	8.147	1326	9.957	2326	27.293	3326	29.923
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	17.195	1327	10.280	2327	57.945	3327	24.139
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.939	1328	1.286	2328	6.253	3328	3.387
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	1.293	1330	195	2330	3.289	3330	920
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-37.059	1331	-21.088	2331	-107.553	3331	-59.362
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	0332	-6.281	1332	436	2332	-11.717	3332	-3.823
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	460	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	-6.281	1336	-24	2336	-11.717	3336	-3.823
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	0337	-11.028	1337	2.789	2337	-12.912	3337	-1.285
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	57.822	1338	46.980	2338	59.705	3338	51.054
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	46.794	1339	49.769	2339	46.794	3339	49.769

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
<b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>								
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
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>0356</b>	<b>0</b>	<b>1356</b>	<b>0</b>	<b>2356</b>	<b>0</b>	<b>3356</b>	<b>0</b>
<b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	281	1357	44	2357	1.636	3357	23
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	281	1358	44	2358	1.636	3358	23
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	-190	1360	-39	2360	-289	3360	-21
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	-91	1362	-5	2362	-1.347	3362	-2
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>0363</b>	<b>0</b>	<b>1363</b>	<b>0</b>	<b>2363</b>	<b>0</b>	<b>3363</b>	<b>0</b>
<b>3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>								
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
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>0369</b>	<b>0</b>	<b>1369</b>	<b>0</b>	<b>2369</b>	<b>0</b>	<b>3369</b>	<b>0</b>
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>0370</b>	<b>0</b>	<b>1370</b>	<b>0</b>	<b>2370</b>	<b>0</b>	<b>3370</b>	<b>0</b>



Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2023								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	6,91	0401	19,60	0421	0,00	0441	9,07	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	
Prestamos 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	

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

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	229	0467	115	0474	94	0481	0	0488	209	0495	26.982	0502	0	0509	27.191
De 1 a 3 meses	0461	65	0468	84	0475	75	0482	0	0489	158	0496	9.539	0503	0	0510	9.697
De 3 a 6 meses	0462	70	0469	163	0476	113	0483	57	0490	333	0497	10.717	0504	0	0511	11.050
De 6 a 9 meses	0463	44	0470	163	0477	53	0484	90	0491	306	0498	6.212	0505	0	0512	6.518
De 9 a 12 meses	0464	20	0471	123	0478	20	0485	70	0492	213	0499	3.022	0506	0	0513	3.235
Más de 12 meses	0465	216	0472	7.472	0479	140	0486	2.987	0493	10.599	0500	25.143	0507	0	0514	35.741
<b>Total</b>	0466	<b>644</b>	0473	<b>8.120</b>	0480	<b>494</b>	0487	<b>3.203</b>	0494	<b>11.817</b>	0501	<b>81.616</b>	0508	<b>0</b>	1515	<b>93.433</b>

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	229	0522	115	0529	94	0536	0	0543	209	0550	26.982	0557	0	0564	27.191	0571	47.202	0578	47.202	0584	57,61
De 1 a 3 meses	0516	65	0523	84	0530	75	0537	0	0544	158	0551	9.539	0558	0	0565	9.697	0572	15.063	0579	15.063	0585	64,38
De 3 a 6 meses	0517	70	0524	163	0531	113	0538	57	0545	333	0552	10.717	0559	0	0566	11.050	0573	16.307	0580	16.307	0586	67,76
De 6 a 9 meses	0518	44	0525	163	0532	53	0539	90	0546	306	0553	6.212	0560	0	0567	6.518	0574	9.680	0581	9.680	0587	67,34
De 9 a 12 meses	0519	20	0526	123	0533	20	0540	70	0547	213	0554	3.022	0561	0	0568	3.235	0575	4.923	0582	4.923	0588	65,72
Más de 12 meses	0520	216	0527	7.472	0534	140	0541	2.987	0548	10.599	0555	25.143	0562	0	0569	35.741	0576	43.450	0583	43.450	0589	82,26
<b>Total</b>	0521	<b>644</b>	0528	<b>8.120</b>	0535	<b>494</b>	0542	<b>3.203</b>	0549	<b>11.817</b>	0556	<b>81.616</b>	0563	<b>0</b>	0570	<b>93.433</b>	0577	<b>136.625</b>			0590	<b>68,39</b>

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: 30/09/2023

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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 10/07/2007	
Inferior a 1 año	0600	327	1600	254	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	866	1601	901	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	2.114	1602	1.659	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	4.979	1603	2.730	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	8.270	1604	7.412	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	61.278	1605	66.412	2605	0
Superior a 10 años	0606	689.720	1606	780.830	2606	3.000.000
<b>Total</b>	0607	<b>767.554</b>	1607	<b>860.199</b>	2607	<b>3.000.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	0608	<b>15,75</b>	1608	<b>16,34</b>	2608	<b>29,39</b>

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 10/07/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	17,68	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: 30/09/2023

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 30/09/2023				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	1.536	0630	69.315	1620	1.340	1630	58.969	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	2.506	0631	269.420	1621	2.708	1631	290.396	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	2.097	0632	320.909	1622	2.462	1632	382.675	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	526	0633	107.909	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
<b>Total</b>	0628	<b>6.665</b>	0638	<b>767.554</b>	1628	<b>7.126</b>	1638	<b>860.199</b>	2628	<b>16.086</b>	2638	<b>3.000.000</b>
<b>Media ponderada (%)</b>	0639	<b>61,22</b>	0649		1639	<b>62,97</b>	1649		2639	<b>92,35</b>	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: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 10/07/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,13	1650	0,82	2650	5,03
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,51	1651	5,03	2651	6,63
Tipo de interés nominal mínimo	0652	1,40	1652	0,40	2652	4,11

<b>S.05.1</b>
<b>Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/09/2023</b>
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK</b>

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO F**

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2023				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	287	0683	22.653	1660	313	1683	26.547	2660	660	2683	94.850
Aragón	0661	66	0684	5.273	1661	72	1684	6.390	2661	183	2684	30.662
Asturias	0662	130	0685	9.566	1662	138	1685	10.648	2662	232	2685	28.884
Baleares	0663	141	0686	15.120	1663	151	1686	16.740	2663	383	2686	66.465
Canarias	0664	58	0687	5.348	1664	62	1687	6.181	2664	131	2687	20.463
Cantabria	0665	103	0688	8.945	1665	104	1688	9.539	2665	210	2688	32.047
Castilla-León	0666	139	0689	10.240	1666	148	1689	11.632	2666	299	2689	40.527
Castilla La Mancha	0667	260	0690	23.962	1667	275	1690	26.105	2667	724	2690	118.810
Cataluña	0668	1.104	0691	115.597	1668	1.186	1691	130.070	2668	3.674	2691	632.820
Ceuta	0669	22	0692	944	1669	23	1692	1.050	2669	56	2692	6.010
Extremadura	0670	29	0693	1.849	1670	30	1693	1.975	2670	63	2693	7.524
Galicia	0671	126	0694	10.330	1671	132	1694	11.365	2671	211	2694	29.795
Madrid	0672	3.834	0695	502.828	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	2.165	1674	27	1697	2.470	2674	132	2697	18.809
Navarra	0675	35	0698	3.779	1675	39	1698	4.652	2675	93	2698	17.319
La Rioja	0676	10	0699	696	1676	10	1699	756	2676	38	2699	5.539
Comunidad Valenciana	0677	189	0700	14.535	1677	197	1700	15.767	2677	652	2700	90.277
País Vasco	0678	107	0701	13.724	1678	117	1701	15.639	2678	201	2701	39.979
<b>Total España</b>	0679	<b>6.665</b>	0702	<b>767.554</b>	1679	<b>7.126</b>	1702	<b>860.199</b>	2679	<b>16.086</b>	2702	<b>3.000.000</b>
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
<b>Total general</b>	0682	<b>6.665</b>	0705	<b>767.554</b>	1682	<b>7.126</b>	1705	<b>860.199</b>	2682	<b>16.086</b>	2705	<b>3.000.000</b>

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: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 30/09/2023				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	0,54			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: 30/09/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO A**

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			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	4.958	78.088	15.750	100.000	1.575.000			
ES0359093020	SERIE A3	4.970	94.072	467.536	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			
<b>Total</b>		0723	30.000	0724	737.536	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: 30/09/2023

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	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado							
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739					
ES0359093004	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,10	0,00	0	0	NO	0	0	0	0					
ES0359093012	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,20	0,00	0	0	NO	0	0	0	0					
ES0359093020	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,23	4,05	2.049	0	NO	467.536	0	469.585	0					
ES0359093038	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,30	4,12	247	1.796	NO	55.500	0	57.544	0					
ES0359093046	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,35	4,17	406	5.770	NO	90.000	0	96.177	0					
ES0359093053	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,60	4,42	344	8.858	NO	72.000	0	81.202	0					
ES0359093061	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,10	5,92	336	18.295	NO	52.500	0	71.131	0					
<b>Total</b>						0740	3.384	0741	34.719	0743	737.536	0744	0	0745	775.639	0746	0

	Situación actual 30/09/2023	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	2,99	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: 30/09/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO C**

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2023								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2022							
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	7.595	1.575.000	70	186.067	21.088	1.473.307	0	185.149	0	1.473.307	0	185.149	0	1.473.307	0	185.149
ES0359093020	SERIE A3	29.464	29.464	4.589	79.925	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
<b>Total</b>		0754	37.059	0755	2.262.464	0756	4.659	0757	336.621	1754	21.088	1755	2.131.307	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: 30/09/2023

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 30/09/2023	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: 30/09/2023

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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 10/07/2007	
Inferior a 1 año	0765	49.240	1765	34.138	2765	50.809
Entre 1 y 2 años	0766	36.114	1766	33.535	2766	27.541
Entre 2 y 3 años	0767	38.190	1767	35.939	2767	27.162
Entre 3 y 4 años	0768	40.154	1768	38.427	2768	30.904
Entre 4 y 5 años	0769	41.434	1769	40.770	2769	34.888
Entre 5 y 10 años	0770	219.224	1770	224.458	2770	243.706
Superior a 10 años	0771	313.180	1771	437.821	2771	2.584.989
<b>Total</b>	<b>0772</b>	<b>737.536</b>	<b>1772</b>	<b>845.088</b>	<b>2772</b>	<b>3.000.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>0773</b>	<b>12,38</b>	<b>1773</b>	<b>13,50</b>	<b>2773</b>	<b>25,06</b>

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2023		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	60,54	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: 30/09/2023

**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 30/09/2023	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		
<b>Total</b>							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: 30/09/2023

**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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 10/07/2007		Situación actual 30/09/2023		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			
<b>Total</b>	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: 30/09/2023

**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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación actual 30/09/2023		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	9.695	7006	2.296	7009	1,37	7012	0,29	7015	1,10		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	9.695	7008	2.296	7011	1,37	7014	0,29	7017	1,10	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	164.659	7024	167.408	7027	18,81	7030	17,20	7033	18,22		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	2.115	7025	2.269	7028	0,24	7031	0,23	7034	0,24		
Total Fallidos					7023	166.774	7026	169.678	7029	19,06	7032	17,43	7035	18,46	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2023		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: 30/09/2023

**INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO**

**CUADRO B**

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
<b>Amortización secuencial: series</b>	0854	0858	1858	2858
SERIE C - ES0359093046	10,00	32,83	33,52	4.9.4
SERIE C - ES0359093046	6,00	12,20	11,62	4.9.4
SERIE E - ES0359093061	3,50	7,12	6,78	4.9.4
SERIE D - ES0359093053	1,50	1,34	1,08	4.9.4
SERIE B - ES0359093038	2,00	1,34	1,08	4.9.4
SERIE D - ES0359093053	4,80	9,76	9,30	4.9.4
SERIE E - ES0359093061	10,00	32,83	33,52	4.9.4
SERIE A1 - ES0359093004	25,00	9,21	9,20	4.9.4
SERIE A2 - ES0359093012	25,00	9,21	9,20	4.9.4
SERIE D - ES0359093053	10,00	32,83	33,52	4.9.4
SERIE A3 - ES0359093020	25,00	9,21	9,20	4.9.4
SERIE C - ES0359093046	1,75	1,34	1,08	4.9.4
SERIE E - ES0359093061	1,25	1,34	1,08	4.9.4
SERIE B - ES0359093038	10,00	32,83	33,52	4.9.4
SERIE B - ES0359093038	3,70	7,53	7,17	4.9.4
<b>Diferimiento/postergamiento intereses: series</b>	0855	0859	1859	2859
SERIE E - ES0359093061	8,94	23,69	23,55	3.4.6.2.
SERIE B - ES0359093038	20,30	23,69	23,55	3.4.6.2.
SERIE C - ES0359093046	14,65	23,69	23,55	3.4.6.2.
SERIE D - ES0359093053	10,47	23,69	23,55	3.4.6.2.
<b>No Reducción del Fondo de Reserva</b>	0856	0860	1860	2860
		0,00	0,00	3.4.2.2. Modulo Adicional
<b>OTROS TRIGGERS</b>	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: 30/09/2023

**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: 30/09/2023

**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: 30/09/2023

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo							Total
		22/02/2023	22/05/2023	22/08/2023					
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885								
Saldo inicial	0886	0	0	0					
Cobros del periodo	0887	39.283	38.077	41.997					
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-310	-1.068	-560					
Pagos por derivados	0889	895	459	281					
Retención importe Fondo de Reserva	0890	0	0	0					
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-39.868	-37.468	-41.718					
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0					
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0					
Saldo disponible	0894	0	0	0					
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	0					0

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

**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**