

**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<br>30/06/2024 |      | Periodo anterior<br>31/12/2023 |
|---|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>ACTIVO</b>   |      |                              |      |                                |
| <b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>                           | 0001 | 631.657                      | 1001 | 687.058                        |
| <b>I. Activos financieros a largo plazo</b>             | 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                              |
| <b>II. Activos por impuesto diferido</b>                | 0039 | 0                            | 1039 | 0                              |
| <b>III. Otros activos no corrientes</b>                 | 0040 | 0                            | 1040 | 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<br>30/06/2024 |      | Periodo anterior<br>31/12/2023 |
|--|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>                                 | 0041 | 110.175                      | 1041 | 134.260                        |
| <b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>  | 0042 | 34.275                       | 1042 | 35.482                         |
| <b>V. Activos financieros a corto plazo</b>                | 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 |                                |
| <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 | 26.365                       | 1085 | 48.128                         |
| 1. Tesorería   | 0086 | 26.365                       | 1086 | 48.128                         |
| 2. Otros activos líquidos equivalentes                     | 0087 | 0                            | 1087 | 0                              |
| <b>TOTAL ACTIVO</b>  | 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<br>30/06/2024 |      | Periodo anterior<br>31/12/2023 |
|---|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>PASIVO</b>   |      |                              |      |                                |
| <b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>                             | 0089 | 596.210                      | 1089 | 658.808                        |
| <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 | 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                              |
| <b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>                 | 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<br>30/06/2024 |      | Periodo anterior<br>31/12/2023 |
|--|------|------------------------------|------|--------------------------------|
| <b>B) PASIVO CORRIENTE</b>   | 0117 | 148.130                      | 1117 | 164.727                        |
| <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 | 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                              |
| <b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>  | 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                          |
| <b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>       | 0158 | -2.508                       | 1158 | -2.218                         |
| <b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>                       | 0159 | 0                            | 1159 | 0                              |
| <b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>                                      | 0160 | -2.508                       | 1160 | -2.218                         |
| <b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>                 | 0161 | 0                            | 1161 | 0                              |
| <b>TOTAL PASIVO</b>  | 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 |
|--|------|------------------------------------|------|--------------------------------------|------|-----------------------------|------|-------------------------------|
| <b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>                                | 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                           |
| <b>2. Intereses y cargas asimilados</b>                                      | 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                             |
| <b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b> | 0208 | 365                                | 1208 | -45                                  | 2208 | 461                         | 3208 | 99                            |
| <b>A) MARGEN DE INTERESES</b>  | 0209 | -1.278                             | 1209 | -866                                 | 2209 | -2.589                      | 3209 | -1.067                        |
| <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 | 652                                  | 2216 | 0                           | 3216 | 0                             |
| <b>7. Otros gastos de explotación</b>  | 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                             |
| <b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>                            | 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                             |
| <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 | 433                                | 1238 | 365                                  | 2238 | 742                         | 3238 | 670                           |
| <b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>                               | 0239 | 3.805                              | 1239 | 1.526                                | 2239 | 5.507                       | 3239 | 2.637                         |
| <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: 30/06/2024**

| 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 |
|--|------|------------------------------------|------|--------------------------------------|------|-----------------------------|------|-------------------------------|
| <b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>                          | 0300 | 3.536                              | 1300 | 3.838                                | 2300 | 7.185                       | 3300 | 7.590                         |
| <b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>                    | 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                             |
| <b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>                  | 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                             |
| <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 | -21.766                            | 1322 | -2.484                               | 2322 | -28.948                     | 3322 | -9.473                        |
| <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 | -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                       |
| <b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>                     | 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                        |
| <b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>              | 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 |
|--|-------------|------------------------------------|-------------|--------------------------------------|-------------|-----------------------------|-------------|-------------------------------|
| <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        | 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                        |
| <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: 30/06/2024

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        |
| <b>Total</b>                     | 0466          | <b>620</b> | 0473                        | <b>7.824</b> | 0480                                 | <b>538</b> | 0487                                    | <b>3.799</b> | 0494  | <b>12.161</b> | 0501                           | <b>78.473</b> | 0508           | <b>0</b> | 1515        | <b>90.634</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          | 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        |
| <b>Total</b>                                 | 0521          | <b>620</b> | 0528                        | <b>7.824</b> | 0535                                 | <b>538</b> | 0542                                    | <b>3.799</b> | 0549  | <b>12.161</b> | 0556                           | <b>78.473</b> | 0563           | <b>0</b> | 0570        | <b>90.634</b> | 0577           | <b>133.436</b> |                                      |        | 0590                  | <b>67,92</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: 30/06/2024

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        |
| <b>Total</b>  | 0607                        | <b>681.270</b> | 1607                                       | <b>737.590</b> | 2607                         | <b>3.000.000</b> |
| <b>Vida residual media ponderada (años)</b>               | 0608                        | <b>15,17</b>   | 1608                                       | <b>15,56</b>   | 2608                         | <b>29,39</b>     |

| Antigüedad                        | Situación actual 30/06/2024 |       |  |       |                              |      |
|-----------------------------------|-----------------------------|-------|--|-------|------------------------------|------|
|                                   | 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 |

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 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                |
| <b>Total</b>  | 0628                        | <b>6.187</b> | 0638                | <b>681.270</b> | 1628                                       | <b>6.510</b> | 1638                | <b>737.590</b> | 2628                         | <b>16.086</b> | 2638                | <b>3.000.000</b> |
| <b>Media ponderada (%)</b>  | 0639                        | <b>59,53</b> | 0649                |                | 1639                                       | <b>60,66</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: 30/06/2024**

**Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK**

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

| Tipos de interés de los activos titulizados (%) | Situación actual<br>30/06/2024 |      | Situación cierre anual anterior<br>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           |
| <b>Total España</b>  | 0679                        | <b>6.187</b> | 0702                | <b>681.270</b> | 1679                                       | <b>6.510</b> | 1702                | <b>737.590</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>6.187</b> | 0705                | <b>681.270</b> | 1682                                       | <b>6.510</b> | 1705                | <b>737.590</b> | 2682                         | <b>16.086</b> | 2705                | <b>3.000.000</b> |

|  |
|--|
| <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: 30/06/2024</b>   |
| <b>Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK</b>        |

**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 (€)<br>0721 | 0722                | 1720                                       | Nominal unitario (€)<br>1721 | 1722                | 2720                         | Nominal unitario (€)<br>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              |        |      |           |
| <b>Total</b>     |                    | 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               |      |   |      |      |
| <b>Total</b>     |                    |                        |                      |        |               | 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   |
| <b>Total</b>     |                    | 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        |
| <b>Total</b>   | <b>0772</b>                 | <b>641.814</b> | <b>1772</b>                                | <b>705.331</b> | <b>2772</b>                  | <b>3.000.000</b> |
| <b>Vida residual media ponderada (años)</b>  | <b>0773</b>                 | <b>11,35</b>   | <b>1773</b>                                | <b>12,02</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: 30/06/2024**

**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                                     |                              |      |
| <b>Total</b>         |               |                              |  |   |  |   | 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<br>Naturaleza riesgo cubierto | Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros) |  |   |  |                              |  | Valor en libros (miles de euros) |  |   |  |                              |  | Otras características |  |
|--|---|--|---|--|------------------------------|--|----------------------------------|--|---|--|------------------------------|--|-----------------------|--|
|  | Situación actual<br>30/06/2024                      |  | Situación cierre anual<br>anterior 31/12/2023 |  | Situación inicial 10/07/2007 |  | Situación actual 30/06/2024      |  | Situación cierre anual<br>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                         |  |                       |  |
| <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: 30/06/2024

**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        |
|--|--------|----------|-------------------|---------------------------|
| <b>Amortización secuencial: series</b>               | 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                     |
| <b>Diferimiento/postergamiento intereses: series</b> | 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.                  |
| <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: 30/06/2024

**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   |
| <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: 30/06/2024</b>   |

**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 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|--|---------------|-------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
|  |               |       |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| <b>Ingresos y gastos del periodo de cálculo</b>  | 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**