

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: 30/06/2021

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)

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: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	938.603	1001	971.587
I. Activos financieros a largo plazo	0002	938.603	1002	971.587
1. Activos titulizados	0003	938.603	1003	971.587
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	907.033	1005	939.217
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	31.914	1025	32.714
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-344	1027	-344
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	102.856	1041	117.935
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	43.930	1042	44.541
V. Activos financieros a corto plazo	0043	46.892	1043	58.026
1. Activos titulizados	0044	46.343	1044	58.026
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	39.180	1046	51.150
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	148	1065	212
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	32	1066	43
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	8.320	1067	7.953
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	160	1068	167
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-1.498	1069	-1.498
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	549	1074	0
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	549	1077	0
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	12.033	1085	15.368
1. Tesorería	0086	12.033	1086	15.368
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	1.041.459	1088	1.089.522

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	923.517	1089	959.665
I. Provisiones a largo plazo	0090	0	1090	0
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	0	1092	0
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	923.517	1094	959.665
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	920.527	1095	955.594
1.1 Series no subordinadas	0096	650.527	1096	685.594
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	86	1101	1.168
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	-128.955	1105	-127.874
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	2.903	1108	2.903
3.1 Derivados de cobertura	0109	2.903	1109	2.903
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) PASIVO CORRIENTE	0117	121.752	1117	133.318
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118	0	1118	0
V. Provisiones a corto plazo	0119	0	1119	0
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	0
2. Provisión por margen de intermediación	0121	0	1121	0
3. Otras provisiones	0122	0	1122	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	121.502	1123	131.658
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	73.490	1124	84.658
1.1 Series no subordinadas	0125	47.501	1125	59.103
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	88	1128	93
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	25.901	1129	25.462
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	47.426	1131	46.413
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	0	1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	206	1136	214
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	47.219	1137	46.198
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	585	1139	585
3.1 Derivados de cobertura	0140	585	1140	585
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	2	1143	3
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	2	1146	3
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	250	1148	1.660
1. Comisiones	0149	18	1149	19
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	12	1150	13
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	6	1152	6
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	232	1157	1.640
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-3.810	1158	-3.461
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-3.810	1160	-3.461
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	1.041.459	1162	1.089.522

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2021		Acumulado anterior 30/06/2020
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	996	1201	1.541	2201	2.118	3201	3.056
1.1 Activos titulizados	0202	996	1202	1.541	2202	2.118	3202	3.056
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-741	1204	-860	2204	-1.479	3204	-1.680
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-217	1205	-284	2205	-434	3205	-544
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-508	1206	-569	2206	-1.013	3206	-1.121
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-16	1207	-6	2207	-32	3207	-14
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-1	1208	-62	2208	-155	3208	-193
A) MARGEN DE INTERESES	0209	253	1209	619	2209	484	3209	1.182
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210	0	3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211	0	3211	0
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212	0	3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213	0	3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214	0	3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	41	1216	31	2216	82	3216	63
7. Otros gastos de explotación	0217	-854	1217	-924	2217	-1.251	3217	-1.834
7.1 Servicios exteriores	0218	-808	1218	-875	2218	-1.159	3218	-1.736
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-808	1219	-875	2219	-1.159	3219	-1.736
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0220	0	1220	0	2220	0	3220	0
7.1.3 Publicidad y propaganda	0221	0	1221	0	2221	0	3221	0
7.1.4 Otros servicios	0222	0	1222	0	2222	0	3222	0
7.2 Tributos	0223	0	1223	0	2223	0	3223	0
7.3 Otros gastos de gestión corriente	0224	-46	1224	-49	2224	-92	3224	-98
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-31	1225	-34	2225	-63	3225	-67
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-14	1227	-15	2227	-29	3227	-31
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	0	2228	0	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-488	1231	-141	2231	-1.031	3231	-286
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-488	1232	-141	2232	-1.031	3232	-286
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	0	1234	0	2234	0	3234	0
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	0	1236	0	2236	0	3236	0
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	223	1238	259	2238	634	3238	815
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	824	1239	155	2239	1.082	3239	59
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2021		Acumulado anterior 30/06/2020
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	887	1300	1.335	2300	1.652	3300	2.595
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	892	1301	1.352	2301	1.662	3301	2.630
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	1.018	1302	1.473	2302	2.199	3302	3.001
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	0	1303	0	2303	0	3303	0
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-106	1305	-113	2305	-504	3305	-352
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-20	1308	-7	2308	-33	3308	-19
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-46	1309	-49	2309	-93	3309	-98
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-32	1310	-34	2310	-64	3310	-68
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-14	1312	-15	2312	-29	3312	-31
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	0	2313	0	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	41	1315	31	2315	82	3315	63
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	41	1321	31	2321	82	3321	63
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-13.155	1322	-3.589	2322	-4.987	3322	-6.687
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	-12.431	1325	-2.880	2325	-3.897	3325	-5.153
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	8.593	1326	9.407	2326	17.503	3326	18.980
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	6.061	1327	2.866	2327	20.334	3327	7.979
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.203	1328	864	2328	2.779	3328	2.088
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	763	1330	1.155	2330	2.155	3330	3.181
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-29.051	1331	-17.172	2331	-46.669	3331	-37.381
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-724	1332	-709	2332	-1.089	3332	-1.534
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	-724	1336	-709	2336	-1.089	3336	-1.534
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-12.268	1337	-2.254	2337	-3.335	3337	-4.092
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	24.301	1338	14.304	2338	15.368	3338	16.142
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	12.033	1339	12.050	2339	12.033	3339	12.050

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2021		Acumulado anterior 30/06/2020
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-106	1357	-113	2357	-504	3357	-352
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-106	1358	-113	2358	-504	3358	-352
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	1	1360	62	2360	155	3360	193
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	104	1362	51	2362	349	3362	159
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2021								Situación cierre anual anterior 31/12/2020								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	4,08	0401	15,82	0421	0,00	0441	2,88	1381	3,94	1401	15,17	1421	0,00	1441	1,63	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: 30/06/2021

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	369	0467	159	0474	21	0481	0	0488	181	0495	44.293	0502	0	0509	44.473
De 1 a 3 meses	0461	66	0468	73	0475	11	0482	0	0489	84	0496	8.628	0503	0	0510	8.712
De 3 a 6 meses	0462	24	0469	64	0476	5	0483	3	0490	72	0497	3.430	0504	0	0511	3.501
De 6 a 9 meses	0463	20	0470	72	0477	5	0484	8	0491	85	0498	2.379	0505	0	0512	2.465
De 9 a 12 meses	0464	12	0471	58	0478	4	0485	7	0492	69	0499	1.438	0506	0	0513	1.507
Más de 12 meses	0465	207	0472	6.006	0479	146	0486	2.438	0493	8.590	0500	26.789	0507	0	0514	35.379
Total	0466	698	0473	6.432	0480	192	0487	2.456	0494	9.080	0501	86.956	0508	0	1515	96.036

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	369	0522	159	0529	21	0536	0	0543	181	0550	44.293	0557	0	0564	44.473	0571	70.831	0578	70.831	0584	62,79
De 1 a 3 meses	0516	66	0523	73	0530	11	0537	0	0544	84	0551	8.628	0558	0	0565	8.712	0572	13.514	0579	13.514	0585	64,46
De 3 a 6 meses	0517	24	0524	64	0531	5	0538	3	0545	72	0552	3.430	0559	0	0566	3.501	0573	5.698	0580	5.698	0586	61,44
De 6 a 9 meses	0518	20	0525	72	0532	5	0539	8	0546	85	0553	2.379	0560	0	0567	2.465	0574	3.840	0581	3.840	0587	64,18
De 9 a 12 meses	0519	12	0526	58	0533	4	0540	7	0547	69	0554	1.438	0561	0	0568	1.507	0575	2.138	0582	2.138	0588	70,47
Más de 12 meses	0520	207	0527	6.006	0534	146	0541	2.438	0548	8.590	0555	26.789	0562	0	0569	35.379	0576	42.731	0583	42.731	0589	82,79
Total	0521	698	0528	6.432	0535	192	0542	2.456	0549	9.080	0556	86.956	0563	0	0570	96.036	0577	138.752			0590	69,21

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: 30/06/2021

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 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 10/07/2007	
Inferior a 1 año	0600	104	1600	61	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	649	1601	496	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	1.176	1602	1.023	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	2.217	1603	2.068	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	4.260	1604	3.220	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	76.410	1605	71.759	2605	0
Superior a 10 años	0606	901.630	1606	952.408	2606	3.000.000
Total	0607	986.448	1607	1.031.034	2607	3.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	17,61	1608	18,10	2608	29,39

Antigüedad	Situación actual 30/06/2021						Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 10/07/2007	
	Antigüedad media ponderada (años)	0609	15,46	1609	14,97	2609	1,68			

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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 30/06/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				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	1.002	0630	44.443	1620	913	1630	40.246	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	2.556	0631	265.572	1621	2.352	1631	240.094	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	3.250	0632	506.065	1622	3.611	1632	557.701	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	815	0633	170.368	1623	922	1633	192.993	2623	16.086	2633	3.000.000
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	7.623	0638	986.448	1628	7.798	1638	1.031.034	2628	16.086	2638	3.000.000
Media ponderada (%)	0639	66,14	0649		1639	67,23	1649		2639	92,35	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 10/07/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,54	1650	0,61	2650	5,03
Tipo de interés nominal máximo	0651	2,64	1651	2,77	2651	6,63
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,00	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: 30/06/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				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	343	0683	31.930	1660	352	1683	33.227	2660	660	2683	94.850
Aragón	0661	74	0684	7.224	1661	76	1684	7.541	2661	183	2684	30.662
Asturias	0662	144	0685	12.176	1662	146	1685	12.643	2662	232	2685	28.884
Baleares	0663	173	0686	20.751	1663	178	1686	21.750	2663	383	2686	66.465
Canarias	0664	67	0687	7.211	1664	69	1687	7.568	2664	131	2687	20.463
Cantabria	0665	108	0688	10.623	1665	109	1688	10.955	2665	210	2688	32.047
Castilla-León	0666	158	0689	13.348	1666	164	1689	14.064	2666	299	2689	40.527
Castilla La Mancha	0667	288	0690	29.461	1667	294	1690	30.561	2667	724	2690	118.810
Cataluña	0668	1.291	0691	152.274	1668	1.314	1691	158.758	2668	3.674	2691	632.820
Ceuta	0669	28	0692	1.526	1669	29	1692	1.616	2669	56	2692	6.010
Extremadura	0670	35	0693	2.500	1670	35	1693	2.582	2670	63	2693	7.524
Galicia	0671	145	0694	13.504	1671	145	1694	13.839	2671	211	2694	29.795
Madrid	0672	4.346	0695	638.468	1672	4.453	1695	668.017	2672	8.144	2695	1.719.219
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	33	0697	3.361	1674	34	1697	3.533	2674	132	2697	18.809
Navarra	0675	42	0698	5.402	1675	42	1698	5.519	2675	93	2698	17.319
La Rioja	0676	10	0699	849	1676	10	1699	871	2676	38	2699	5.539
Comunidad Valenciana	0677	217	0700	18.725	1677	223	1700	19.928	2677	652	2700	90.277
País Vasco	0678	121	0701	17.115	1678	125	1701	18.064	2678	201	2701	39.979
Total España	0679	7.623	0702	986.448	1679	7.798	1702	1.031.034	2679	16.086	2702	3.000.000
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	7.623	0705	986.448	1682	7.798	1705	1.031.034	2682	16.086	2705	3.000.000

S.05.1
Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: CAIXABANK

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 10/07/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,46			1710	0,46			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: 30/06/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2021			Situación cierre anual anterior 31/12/2020			Situación inicial 10/07/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Principal pendiente		Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0359093004	SERIE A1	6.580	0	0	6.580	0	0	6.580	100.000	658.000			
ES0359093012	SERIE A2	15.750	12.764	201.028	15.750	15.727	247.697	15.750	100.000	1.575.000			
ES0359093020	SERIE A3	4.970	100.000	497.000	4.970	100.000	497.000	4.970	100.000	497.000			
ES0359093038	SERIE B	555	100.000	55.500	555	100.000	55.500	555	100.000	55.500			
ES0359093046	SERIE C	900	100.000	90.000	900	100.000	90.000	900	100.000	90.000			
ES0359093053	SERIE D	720	100.000	72.000	720	100.000	72.000	720	100.000	72.000			
ES0359093061	SERIE E	525	100.000	52.500	525	100.000	52.500	525	100.000	52.500			
Total		0723	30.000	0724	968.028	1723	30.000	1724	1.014.697	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: 30/06/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas		
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido		Principal impagado		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas			
									0730	0731	0732	0733			0734	0735	0742
ES0359093004	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,10	0,00	0	0	NO	0	0	0	0	0	0			
ES0359093012	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,20	0,00	0	0	NO	201.028	0	0	201.028	0	0			
ES0359093020	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,23	0,00	0	0	NO	497.000	0	0	497.000	0	0			
ES0359093038	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,30	0,00	0	470	NO	55.500	0	0	55.970	0	0			
ES0359093046	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,35	0,00	0	3.573	NO	90.000	0	0	93.573	0	0			
ES0359093053	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,60	0,06	4	6.833	NO	72.000	0	0	78.837	0	0			
ES0359093061	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,10	1,56	84	15.025	NO	52.500	0	0	67.609	0	0			
Total						0740	88	0741	25.901	0743	968.028	0744	0	0745	994.017	0746	0

	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 10/07/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,09	0748	0,10	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: 30/06/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2021								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2020							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753	1750	1751	1752	1753
ES0359093004	SERIE A1	0	658.000	0	41.199	0	658.000	0	41.199	0	658.000	0	41.199	0	658.000	0	41.199
ES0359093012	SERIE A2	29.051	1.373.972	0	185.149	0	1.373.972	17.172	185.149	17.172	1.295.775	0	185.149	0	1.295.775	0	185.149
ES0359093020	SERIE A3	0	0	0	68.399	0	68.399	0	68.399	0	0	0	68.399	0	0	0	68.399
ES0359093038	SERIE B	0	0	0	7.526	0	7.526	0	7.526	0	0	0	7.526	0	0	0	7.526
ES0359093046	SERIE C	0	0	0	9.902	0	9.902	0	9.902	0	0	0	9.902	0	0	0	9.902
ES0359093053	SERIE D	0	0	0	6.349	0	6.349	0	6.349	0	0	0	6.349	0	0	0	6.349
ES0359093061	SERIE E	0	0	0	5.654	0	5.654	0	5.654	0	0	0	5.654	0	0	0	5.654
Total		0754	29.051	0755	2.031.972	0756	0	0757	324.177	1754	17.172	1755	1.953.775	1756	0	1757	324.177

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2021

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 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	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	11/07/2019	FCH	A-	A-	AAA
ES0359093012	SERIE A2	27/11/2020	MDY	Aa3	Aa3	Aaa
ES0359093012	SERIE A2	15/03/2021	SYP	AA+	AA	AAA
ES0359093020	SERIE A3	11/07/2019	FCH	A-	A-	AAA
ES0359093020	SERIE A3	27/11/2020	MDY	Aa3	Aa3	Aaa
ES0359093020	SERIE A3	15/03/2021	SYP	AA	AA-	AAA
ES0359093038	SERIE B	29/11/2018	FCH	BB+	BB+	AA
ES0359093038	SERIE B	24/10/2014	MDY	B2	B2	Aa2
ES0359093038	SERIE B	12/06/2014	SYP	D	D	AA
ES0359093046	SERIE C	11/07/2019	FCH	B	B	A
ES0359093046	SERIE C	27/11/2020	MDY	Caa1	Caa1	A2
ES0359093046	SERIE C	24/02/2010	SYP	D	D	A
ES0359093053	SERIE D	10/03/2014	FCH	CC	CC	BBB
ES0359093053	SERIE D	11/09/2009	MDY	C	C	Baa2
ES0359093053	SERIE D	22/05/2009	SYP	D	D	BBB
ES0359093061	SERIE E	10/03/2014	FCH	C	C	BB
ES0359093061	SERIE E	11/09/2009	MDY	C	C	Ba3
ES0359093061	SERIE E	22/05/2009	SYP	D	D	BB

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2021

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 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 10/07/2007	
Inferior a 1 año	0765	39.541	1765	31.420	2765	50.809
Entre 1 y 2 años	0766	44.475	1766	47.014	2766	27.541
Entre 2 y 3 años	0767	46.225	1767	48.806	2767	27.162
Entre 3 y 4 años	0768	47.980	1768	50.594	2768	30.904
Entre 4 y 5 años	0769	49.672	1769	51.636	2769	34.888
Entre 5 y 10 años	0770	259.828	1770	260.536	2770	243.706
Superior a 10 años	0771	480.307	1771	524.691	2771	2.584.989
Total	0772	968.028	1772	1.014.697	2772	3.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	13,13	1773	13,46	2773	25,06

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		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	Bankia	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	70,22	1792	71,59	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: 30/06/2021

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 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 10/07/2007	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Swap de Bases	BANCO SANTANDER	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	-3.488	-3.488		
Total							0808 -3.488	0809 -3.488	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 10/07/2007		Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 10/07/2007			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	2.326	7006	2.235	7009	0,25	7012	0,23	7015	0,18		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	2.326	7008	2.235	7011	0,25	7014	0,23	7017	0,18	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	174.800	7024	178.018	7027	15,77	7030	15,41	7033	15,65		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	2.396	7025	1.855	7028	0,22	7031	0,16	7034	0,21		
Total Fallidos					7023	177.196	7026	179.872	7029	15,98	7032	15,57	7035	15,86	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		
	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: 30/06/2021

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
SERIE E - ES0359093061	1,25	0,24	0,20	4.9.4
SERIE C - ES0359093046	10,00	40,37	40,76	4.9.4
SERIE A1 - ES0359093004	25,00	9,32	9,33	4.9.4
SERIE D - ES0359093053	4,80	7,44	7,22	4.9.4
SERIE B - ES0359093038	10,00	40,37	40,76	4.9.4
SERIE A2 - ES0359093012	25,00	9,32	9,33	4.9.4
SERIE C - ES0359093046	1,75	0,24	0,20	4.9.4
SERIE B - ES0359093038	3,70	5,73	5,57	4.9.4
SERIE C - ES0359093046	6,00	9,30	9,03	4.9.4
SERIE D - ES0359093053	10,00	40,37	40,76	4.9.4
SERIE E - ES0359093061	3,50	5,42	5,27	4.9.4
SERIE B - ES0359093038	2,00	0,24	0,20	4.9.4
SERIE D - ES0359093053	1,50	0,24	0,20	4.9.4
SERIE E - ES0359093061	10,00	40,37	40,76	4.9.4
SERIE A3 - ES0359093020	25,00	9,32	9,33	4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE D - ES0359093053	10,47	23,19	23,17	3.4.6.2.
SERIE E - ES0359093061	8,94	23,19	23,17	3.4.6.2.
SERIE C - ES0359093046	14,65	23,19	23,17	3.4.6.2.
SERIE B - ES0359093038	20,30	23,19	23,17	3.4.6.2.
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		0,00	0,00	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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	30	6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES, S.E.	1864		2864	Saldo Nominal pendiente de cobro de los Certificados en la Fecha de Pago inmediatamente anterior	3864	0,005	4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	
Contrapartida	0870	CAIXABANK
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo Adicional 3.4.6.4.

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)	Fecha cálculo	Total												
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872													
Margen de intereses	0873													
Deterioro de activos financieros (neto)	0874													
Dotaciones a provisiones (neto)	0875													
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876													
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877													
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878													
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879													
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880													
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881													
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882													
Comisión variable pagada	0883													
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884													

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total		
		22/02/2021	24/05/2021											
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885													
Saldo inicial	0886	0	0											
Cobros del periodo	0887	18.416	30.002											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-400	-845											
Pagos por derivados	0889	-398	-106											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	0	0											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-17.618	-29.051											
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

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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