

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 8801
NIF Fondo: V85160935
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2019

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:
(sólo se cumplimentará en el supuesto de que se produzca el reenvío con alguna modificación de la información periódica)

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	1.047.169	1001	1.097.186
I. Activos financieros a largo plazo	0002	1.047.169	1002	1.097.186
1. Activos titulizados	0003	1.047.169	1003	1.097.186
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	1.012.585	1005	1.057.850
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	35.162	1025	39.914
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-578	1027	-578
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: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	127.178	1041	134.807
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	48.257	1042	51.663
V. Activos financieros a corto plazo	0043	65.434	1043	65.966
1. Activos titulizados	0044	65.434	1044	65.966
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	59.420	1046	59.364
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	285	1065	284
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	70	1066	54
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	7.152	1067	7.722
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	180	1068	214
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-1.673	1069	-1.673
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	0	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	0	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	13.486	1085	17.178
1. Tesorería	0086	13.486	1086	17.178
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	1.174.347	1088	1.231.994

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	1.048.411	1089	1.108.524
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	1.048.411	1094	1.108.524
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	1.034.352	1095	1.092.900
1.1 Series no subordinadas	0096	764.352	1096	822.900
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	3.722	1101	5.288
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	-125.319	1105	-123.754
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	10.336	1108	10.336
3.1 Derivados de cobertura	0109	10.336	1109	10.336
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: 30/09/2019

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2019		Periodo anterior 31/12/2018
B) PASIVO CORRIENTE	0117	137.395	1117	135.131
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	135.745	1123	133.649
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	90.804	1124	90.442
1.1 Series no subordinadas	0125	66.572	1125	67.086
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	109	1128	127
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	24.123	1129	23.229
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	43.637	1131	41.903
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	235	1136	249
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	43.403	1137	41.654
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	1.298	1139	1.298
3.1 Derivados de cobertura	0140	1.298	1140	1.298
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	6	1143	6
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	6	1146	6
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	1.650	1148	1.482
1. Comisiones	0149	21	1149	22
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	15	1150	15
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	7	1152	7
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	1.629	1157	1.460
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-11.459	1158	-11.662
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-11.459	1160	-11.662
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	1.174.347	1162	1.231.994

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2019		Acumulado anterior 30/09/2018
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	2.016	1201	1.964	2201	6.095	3201	6.023
1.1 Activos titulizados	0202	2.016	1202	1.964	2202	6.095	3202	6.023
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-879	1204	-901	2204	-2.677	3204	-2.666
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-283	1205	-296	2205	-876	3205	-871
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-574	1206	-586	2206	-1.734	3206	-1.735
2.3 Otros pasivos financieros	0207	-22	1207	-20	2207	-66	3207	-60
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-474	1208	-213	2208	-1.069	3208	-718
A) MARGEN DE INTERESES	0209	663	1209	849	2209	2.348	3209	2.639
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	37	1216	30	2216	82	3216	58
7. Otros gastos de explotación	0217	-983	1217	-1.030	2217	-2.647	3217	-2.525
7.1 Servicios exteriores	0218	-932	1218	-975	2218	-2.491	3218	-2.359
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-932	1219	-975	2219	-2.491	3219	-2.359
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	-51	1224	-55	2224	-156	3224	-167
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-35	1225	-38	2225	-107	3225	-114
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-16	1227	-17	2227	-49	3227	-52
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	-1.114	1231	-746	2231	-4.027	3231	-3.515
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-1.114	1232	-746	2232	-4.027	3232	-3.515
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	548	1238	445	2238	2.679	3238	1.392
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	848	1239	451	2239	1.565	3239	1.952
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: 30/09/2019

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2019		Acumulado anterior 30/09/2018
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	1.632	1300	1.698	2300	5.104	3300	5.109
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	1.646	1301	1.723	2301	5.179	3301	5.218
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	2.034	1302	1.962	2302	6.112	3302	6.080
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	-367	1305	-219	2305	-867	3305	-803
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	-22	1308	-20	2308	-66	3308	-60
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-51	1309	-55	2309	-157	3309	-167
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-35	1310	-38	2310	-108	3310	-115
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-16	1312	-17	2312	-49	3312	-52
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	37	1315	30	2315	82	3315	58
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	37	1321	30	2321	82	3321	58
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	-3.650	1322	-2.434	2322	-8.796	3322	-5.688
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	-2.087	1325	-1.460	2325	-6.254	3325	-3.327
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	10.443	1326	9.483	2326	29.372	3326	29.040
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	3.471	1327	3.983	2327	10.673	3327	12.742
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.136	1328	1.289	2328	3.665	3328	3.704
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	1.579	1330	1.448	2330	9.098	3330	4.641
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	-18.716	1331	-17.663	2331	-59.062	3331	-53.455
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-1.564	1332	-974	2332	-2.542	3332	-2.361
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	-1.564	1336	-974	2336	-2.542	3336	-2.361
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-2.019	1337	-735	2337	-3.692	3337	-579
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	15.505	1338	13.611	2338	17.178	3338	13.455
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	13.486	1339	12.876	2339	13.486	3339	12.876

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2019		Acumulado anterior 30/09/2018
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	-367	1357	-219	2357	-867	3357	-803
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-367	1358	-219	2358	-867	3358	-803
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	474	1360	213	2360	1.069	3360	718
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	-108	1362	5	2362	-202	3362	85
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: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2019								Situación cierre anual anterior 31/12/2018								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	3,80	0401	13,94	0421	0,00	0441	1,40	1381	4,09	1401	13,15	1421	0,00	1441	1,51	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: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

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	533	0467	197	0474	46	0481	0	0488	244	0495	75.185	0502	0	0509	75.429
De 1 a 3 meses	0461	99	0468	92	0475	23	0482	0	0489	115	0496	13.635	0503	0	0510	13.750
De 3 a 6 meses	0462	24	0469	54	0476	9	0483	6	0490	69	0497	3.224	0504	0	0511	3.293
De 6 a 9 meses	0463	22	0470	76	0477	6	0484	13	0491	95	0498	2.886	0505	0	0512	2.981
De 9 a 12 meses	0464	8	0471	48	0478	3	0485	9	0492	60	0499	1.466	0506	0	0513	1.527
Más de 12 meses	0465	218	0472	4.782	0479	162	0486	2.394	0493	7.337	0500	29.779	0507	0	0514	37.116
Total	0466	904	0473	5.248	0480	250	0487	2.422	0494	7.921	0501	126.175	0508	0	1515	134.095

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	533	0522	197	0529	46	0536	0	0543	244	0550	75.185	0557	0	0564	75.429	0571	110.877	0578	110.877	0584	68,03
De 1 a 3 meses	0516	99	0523	92	0530	23	0537	0	0544	115	0551	13.635	0558	0	0565	13.750	0572	20.431	0579	20.431	0585	67,30
De 3 a 6 meses	0517	24	0524	54	0531	9	0538	6	0545	69	0552	3.224	0559	0	0566	3.293	0573	4.591	0580	4.591	0586	71,73
De 6 a 9 meses	0518	22	0525	76	0532	6	0539	13	0546	95	0553	2.886	0560	0	0567	2.981	0574	4.255	0581	4.255	0587	70,06
De 9 a 12 meses	0519	8	0526	48	0533	3	0540	9	0547	60	0554	1.466	0561	0	0568	1.527	0575	2.129	0582	2.129	0588	71,69
Más de 12 meses	0520	218	0527	4.782	0534	162	0541	2.394	0548	7.337	0555	29.779	0562	0	0569	37.116	0576	43.482	0583	43.482	0589	85,36
Total	0521	904	0528	5.248	0535	250	0542	2.422	0549	7.921	0556	126.175	0563	0	0570	134.095	0577	185.764			0590	72,19

S.05.1

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 10/07/2007	
Inferior a 1 año	0600	75	1600	70	2600	0
Entre 1 y 2 años	0601	187	1601	182	2601	0
Entre 2 y 3 años	0602	539	1602	356	2602	0
Entre 3 y 4 años	0603	1.473	1603	1.323	2603	0
Entre 4 y 5 años	0604	2.385	1604	2.047	2604	0
Entre 5 y 10 años	0605	64.318	1605	50.397	2605	0
Superior a 10 años	0606	1.045.341	1606	1.110.476	2606	3.000.000
Total	0607	1.114.319	1607	1.164.851	2607	3.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	19,14	1608	19,79	2608	29,39

Antigüedad	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 10/07/2007	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	13,74	1609	13,00	2609	1,68

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				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	678	0630	30.777	1620	533	1630	24.603	2620	0	2630	0
40% - 60%	0621	1.969	0631	192.609	1621	1.794	1631	173.378	2621	0	2631	0
60% - 80%	0622	4.184	0632	646.326	1622	4.403	1632	676.569	2622	0	2632	0
80% - 100%	0623	1.188	0633	244.606	1623	1.427	1633	290.301	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	8.019	0638	1.114.319	1628	8.157	1638	1.164.851	2628	16.086	2638	3.000.000
Media ponderada (%)	0639	69,86	0649		1639	71,42	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: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 10/07/2007	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,72	1650	0,69	2650	5,03
Tipo de interés nominal máximo	0651	3,74	1651	3,68	2651	6,63
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,03	1652	0,08	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: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				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	367	0683	36.469	1660	373	1683	38.691	2660	660	2683	94.850
Aragón	0661	78	0684	8.270	1661	79	1684	8.734	2661	183	2684	30.662
Asturias	0662	150	0685	13.735	1662	152	1685	14.341	2662	232	2685	28.884
Baleares	0663	185	0686	23.834	1663	188	1686	24.892	2663	383	2686	66.465
Canarias	0664	73	0687	8.472	1664	73	1687	8.753	2664	131	2687	20.463
Cantabria	0665	112	0688	11.820	1665	115	1688	12.616	2665	210	2688	32.047
Castilla-León	0666	170	0689	15.571	1666	173	1689	16.539	2666	299	2689	40.527
Castilla La Mancha	0667	301	0690	33.336	1667	306	1690	34.924	2667	724	2690	118.810
Cataluña	0668	1.370	0691	174.884	1668	1.400	1691	184.594	2668	3.674	2691	632.820
Ceuta	0669	30	0692	1.878	1669	31	1692	2.026	2669	56	2692	6.010
Extremadura	0670	36	0693	2.971	1670	38	1693	3.165	2670	63	2693	7.524
Galicia	0671	152	0694	15.164	1671	155	1694	15.851	2671	211	2694	29.795
Madrid	0672	4.555	0695	716.373	1672	4.621	1695	744.949	2672	8.144	2695	1.719.219
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	34	0697	3.746	1674	35	1697	4.011	2674	132	2697	18.809
Navarra	0675	43	0698	5.896	1675	43	1698	6.095	2675	93	2698	17.319
La Rioja	0676	10	0699	923	1676	10	1699	952	2676	38	2699	5.539
Comunidad Valenciana	0677	226	0700	21.539	1677	236	1700	23.337	2677	652	2700	90.277
País Vasco	0678	127	0701	19.438	1678	129	1701	20.381	2678	201	2701	39.979
Total España	0679	8.019	0702	1.114.319	1679	8.157	1702	1.164.851	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	8.019	0705	1.114.319	1682	8.157	1705	1.164.851	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: 30/09/2019

Entidades cedentes de los activos titulizados: BANKIA

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2019				Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Situación inicial 10/07/2007			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,44			1710	0,43			2710	0,25		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2019			Situación cierre anual anterior 31/12/2018			Situación inicial 10/07/2007					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente			
		0720	Nominal unitario (€) 0721	0722	1720	Nominal unitario (€) 1721	1722	2720	Nominal unitario (€) 2721	2722			
ES0359093004	SERIE A1	6.580	0	0	6.580	0	0	6.580	100.000	658.000			
ES0359093012	SERIE A2	15.750	21.202	333.924	15.750	24.952	392.986	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	1.100.924	1723	30.000	1724	1.159.986	2723	30.000	2724	3.000.000

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2019

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	Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas				
						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	0			
ES0359093012	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,20	0,00	0	0	NO	333.924	0	333.924	0	0	0			
ES0359093020	SERIE A3	NS	EURIBOR 3 m	0,23	0,00	0	0	NO	497.000	0	497.000	0	0	0			
ES0359093038	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,30	0,00	0	467	NO	55.500	0	55.967	0	0	0			
ES0359093046	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,35	0,00	0	3.557	NO	90.000	0	93.557	0	0	0			
ES0359093053	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,60	0,18	14	6.627	NO	72.000	0	78.641	0	0	0			
ES0359093061	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,10	1,68	95	13.472	NO	52.500	0	66.067	0	0	0			
Total						0740	109	0741	24.123	0743	1.100.924	0744	0	0745	1.125.156	0746	0

	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 10/07/2007	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,10	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: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2019								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2018							
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	41.199		
ES0359093012	SERIE A2	18.716	1.241.076	0	185.149	17.663	1.163.727	0	185.149	17.663	1.163.727	0	185.149	0	185.149		
ES0359093020	SERIE A3	0	0	0	68.399	0	0	0	68.399	0	0	0	68.399	0	68.399		
ES0359093038	SERIE B	0	0	0	7.526	0	0	0	7.526	0	0	0	7.526	0	7.526		
ES0359093046	SERIE C	0	0	0	9.902	0	0	0	9.902	0	0	0	9.902	0	9.902		
ES0359093053	SERIE D	0	0	0	6.349	0	0	0	6.349	0	0	0	6.349	0	6.349		
ES0359093061	SERIE E	0	0	0	5.654	0	0	0	5.654	0	0	0	5.654	0	5.654		
Total		0754	18.716	0755	1.899.076	0756	0	0757	324.177	1754	17.663	1755	1.821.727	1756	0	1757	324.177

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	Situación inicial 10/07/2007
				0762	0763	0764
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-	BBB	AAA
ES0359093012	SERIE A2	29/06/2018	MDY	A1	A1	Aaa
ES0359093012	SERIE A2	04/05/2018	SYP	AA	AA	AAA
ES0359093020	SERIE A3	11/07/2019	FCH	A-	BBB	AAA
ES0359093020	SERIE A3	29/06/2018	MDY	A1	A1	Aaa
ES0359093020	SERIE A3	04/05/2018	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	11/09/2009	MDY	Ca	Ca	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: 30/09/2019

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 10/07/2007	
Inferior a 1 año	0765	26.757	1765	28.914	2765	50.809
Entre 1 y 2 años	0766	47.540	1766	44.617	2766	27.541
Entre 2 y 3 años	0767	49.477	1767	46.597	2767	27.162
Entre 3 y 4 años	0768	51.354	1768	48.636	2768	30.904
Entre 4 y 5 años	0769	50.442	1769	50.595	2769	34.888
Entre 5 y 10 años	0770	263.417	1770	278.153	2770	243.706
Superior a 10 años	0771	611.937	1771	662.473	2771	2.584.989
Total	0772	1.100.924	1772	1.159.986	2772	3.000.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	14,38	1773	15,32	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: 30/09/2019

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		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	Bankia	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	73,85	1792	75,21	2792	91,00
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/09/2019	Situación cierre anual anterior 31/12/2018	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	-11.635	-11.635		
Total							0808 -11.635	0809 -11.635	0810	

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación inicial 10/07/2007		Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		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: 30/09/2019

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	2.676	7006	3.307	7009	0,25	7012	0,30	7015	0,31		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	2.676	7008	3.307	7011	0,25	7014	0,30	7017	0,31	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	6	7020		7021	190.136	7024	210.749	7027	15,22	7030	16,03	7033	15,26		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	1.962	7025	1.395	7028	0,16	7031	0,11	7034	0,12		
Total Fallidos					7023	192.098	7026	212.143	7029	15,38	7032	16,13	7035	15,38	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2019		Situación cierre anual anterior 31/12/2018		
	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: 30/09/2019

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 D - ES0359093053	1,50	0,24	0,26	4.9.4
SERIE E - ES0359093061	10,00	44,67	45,01	4.9.4
SERIE A2 - ES0359093012	25,00	9,43	9,42	4.9.4
SERIE D - ES0359093053	10,00	44,67	45,01	4.9.4
SERIE E - ES0359093061	3,50	4,77	4,69	4.9.4
SERIE E - ES0359093061	1,25	0,24	0,26	4.9.4
SERIE C - ES0359093046	10,00	44,67	45,01	4.9.4
SERIE A3 - ES0359093020	25,00	9,43	9,42	4.9.4
SERIE B - ES0359093038	3,70	5,04	4,96	4.9.4
SERIE B - ES0359093038	10,00	44,67	45,01	4.9.4
SERIE A1 - ES0359093004	25,00	9,43	9,42	4.9.4
SERIE C - ES0359093046	1,75	0,24	0,26	4.9.4
SERIE B - ES0359093038	2,00	0,24	0,26	4.9.4
SERIE D - ES0359093053	4,80	6,54	6,43	4.9.4
SERIE C - ES0359093046	6,00	8,17	8,04	4.9.4
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE B - ES0359093038	20,30	22,86	22,82	3.4.6.2.
SERIE C - ES0359093046	14,65	22,86	22,82	3.4.6.2.
SERIE D - ES0359093053	10,47	22,86	22,82	3.4.6.2.
SERIE E - ES0359093061	8,94	22,86	22,82	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: 30/09/2019

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: 30/09/2019

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	Bankia
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo Adicional 3.4.6.4.

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

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo								Total	
		22/02/2019	22/05/2019	22/08/2019							
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885										
Saldo inicial	0886	0	0	0							
Cobros del periodo	0887	22.145	20.371	20.067							
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-697	-972	-984							
Pagos por derivados	0889	-235	-265	-367							
Retención importe Fondo de Reserva	0890	0	0	0							
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-21.213	-19.133	-18.716							
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0							
Resto pagos/retenciones	0893	0	0	0							
Saldo disponible	0894	0	0	0							
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	0							0

Denominación Fondo: MADRID RMBS III, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2019

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