

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.00

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Número de registro del Fondo: **8801**

NIF Fondo: **V-85160935**

Denominación del compartimento:

Número de registro del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

NIF gestora: **A-80352750**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA



Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:

Como consecuencia del proceso de auditoría, se ha modificado el estado S05_1B.

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
Estados agregados: No
Periodo: 2º Semestre
Ejercicio: 2011

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2011		Periodo Anterior 31/12/2010
---------------------------------	--	-------------------------------------	--	---------------------------------------

ACTIVO				
---------------	--	--	--	--

A) ACTIVO NO CORRIENTE	0008	1.764.332	1008	1.916.955
-------------------------------	------	-----------	------	-----------

I. Activos financieros a largo plazo	0010	1.764.332	1010	1.916.955
1. Valores representativos de deuda	0100	0	1100	0
1.1 Bancos centrales	0101	0	1101	0
1.2 Administraciones Públicas españolas	0102	0	1102	0
1.3 Entidades de crédito	0103	0	1103	0
1.4 Otros sectores residentes	0104	0	1104	0
1.5 Administraciones Públicas no residentes	0105	0	1105	0
1.6 Otros sectores no residentes	0106	0	1106	0
1.7 Activos dudosos	0107	0	1107	0
1.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0108		1108	
1.9 Intereses y gastos devengados no vencidos	0109	0	1109	0
1.10 Ajustes por operaciones de cobertura	0110	0	1110	0
2. Derechos de crédito	0200	1.764.332	1200	1.916.955
2.1 Participaciones hipotecarias	0201	0	1201	0
2.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0202	1.678.831	1202	1.802.584
2.3 Préstamos hipotecarios	0203	0	1203	0
2.4 Cédulas Hipotecarias	0204	0	1204	0
2.5 Préstamos a promotores	0205	0	1205	0
2.6 Préstamos a PYMES	0206	0	1206	0
2.7 Préstamos a empresas	0207	0	1207	0
2.8 Préstamos Corporativos	0208	0	1208	0
2.9 Cédulas territoriales	0209	0	1209	0
2.10 Bonos de Tesorería	0210	0	1210	0
2.11 Deuda Subordinada	0211	0	1211	0
2.12 Créditos AAPP	0212	0	1212	0
2.13 Préstamos Consumo	0213	0	1213	0
2.14 Préstamos automoción	0214	0	1214	0
2.15 Cuotas de Arrendamiento financiero (leasing)	0215	0	1215	0
2.16 Cuentas a cobrar	0216	0	1216	0
2.17 Derechos de crédito futuros	0217	0	1217	0
2.18 Bonos de titulación	0218	0	1218	0
2.19 Otros	0219	0	1219	0
2.20 Activos dudosos	0220	89.518	1220	130.954
2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0221	-4.017	1221	-16.583
2.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0222	0	1222	0
2.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0223	0	1223	0
3. Derivados	0230	0	1230	0
3.1 Derivados de cobertura	0231	0	1231	0
3.2 Derivados de negociación	0232	0	1232	0
4. Otros activos financieros	0240	0	1240	0
4.1 Garantías financieras	0241	0	1241	0
4.2 Otros	0242	0	1242	0

II. Activos por impuesto diferido	0250	0	1250	0
--	------	---	------	---

III. Otros activos no corrientes	0260	0	1260	0
---	------	---	------	---

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.				
Estados agregados: No				
Periodo: 2º Semestre				
Ejercicio: 2011				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2011		Periodo Anterior 31/12/2010
B) ACTIVO CORRIENTE	0270	146.483	1270	108.125
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0280	60.140	1280	13.227
V. Activos financieros a corto plazo	0290	57.448	1290	61.498
1. Deudores y otras cuentas a cobrar	0300	3.043	1300	3.376
2. Valores representativos de deuda	0310	0	1310	0
2.1 Bancos centrales	0311	0	1311	0
2.2 Administraciones Públicas españolas	0312	0	1312	0
2.3 Entidades de crédito	0313	0	1313	0
2.4 Otros sectores residentes	0314	0	1314	0
2.5 Administraciones Públicas no residentes	0315	0	1315	0
2.6 Otros sectores no residentes	0316	0	1316	0
2.7 Activos dudosos	0317	0	1317	0
2.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0318		1318	
2.9 Intereses y gastos devengados no vencidos	0319	0	1319	0
2.10 Ajustes por operaciones de cobertura	0320	0	1320	0
2.11 Intereses vencidos e impagados	0330	0	1330	0
3. Derechos de crédito	0400	54.380	1400	58.103
3.1 Participaciones hipotecarias	0401	0	1401	0
3.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0402	49.223	1402	54.253
3.3 Préstamos hipotecarios	0403	0	1403	0
3.4 Cédulas Hipotecarias	0404	0	1404	0
3.5 Préstamos a promotores	0405	0	1405	0
3.6 Préstamos a PYMES	0406	0	1406	0
3.7 Préstamos a empresas	0407	0	1407	0
3.8 Préstamos Corporativos	0408	0	1408	0
3.9 Cédulas territoriales	0409	0	1409	0
3.10 Bonos de Tesorería	0410	0	1410	0
3.11 Deuda Subordinada	0411	0	1411	0
3.12 Créditos AAPP	0412	0	1412	0
3.13 Préstamos Consumo	0413	0	1413	0
3.14 Préstamos automoción	0414	0	1414	0
3.15 Arrendamiento financiero	0415	0	1415	0
3.16 Cuentas a cobrar	0416	0	1416	0
3.17 Derechos de crédito futuros	0417	0	1417	0
3.18 Bonos de titulización	0418	0	1418	0
3.19 Otros	0419	0	1419	0
3.20 Activos dudosos	0420	5.365	1420	323
3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0421	-3.792	1421	
3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0422	2.051	1422	3.527
3.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0423	0	1423	0
3.24 Intereses vencidos e impagados	0424	1.533	1424	
4. Derivados	0430	0	1430	0
4.1 Derivados de cobertura	0431	0	1431	0
4.2 Derivados de negociación	0432	0	1432	0
5. Otros activos financieros	0440	25	1440	19
5.1 Garantías financieras	0441	0	1441	0
5.2 Otros	0442	25	1442	19
VI. Ajustes por periodificaciones	0450	0	1450	0
1. Comisiones	0451	0	1451	0
2. Otros	0452	0	1452	0
VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes	0460	28.895	1460	33.400
1. Tesorería	0461	28.895	1461	33.400
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462	0	1462	0

TOTAL ACTIVO	0500	1.910.815	1500	2.025.080
--------------	------	-----------	------	-----------

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.				
Estados agregados: No				
Periodo: 2º Semestre				
Ejercicio: 2011				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2011		Periodo Anterior 31/12/2010
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0650	1.837.071	1650	1.955.122
I. Provisiones a largo plazo	0660	0	1660	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0700	1.837.071	1700	1.955.122
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	1.714.774	1710	1.814.948
1.1 Series no subordinadas	0711	947.774	1711	1.047.948
1.2 Series subordinadas	0712	767.000	1712	767.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0713		1713	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0714	0	1714	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0715	0	1715	0
2. Deudas con entidades de crédito	0720	103.996	1720	127.223
2.1 Préstamo subordinado	0721	129.041	1721	129.041
2.2 Crédito línea de liquidez	0722	0	1722	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0723	0	1723	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0724	-25.045	1724	-1.818
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0725	0	1725	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0726	0	1726	0
3. Derivados	0730	18.301	1730	12.951
3.1 Derivados de cobertura	0731	18.301	1731	12.951
3.2 Derivados de negociación	0732	0	1732	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0733		1733	
4. Otros pasivos financieros	0740	0	1740	0
4.1 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0741		1741	
4.2 Otros	0742	0	1742	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0750	0	1750	0
B) PASIVO CORRIENTE	0760	90.468	1760	82.060
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0770	0	1770	0
V. Provisiones a corto plazo	0780	0	1780	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0800	90.429	1800	82.020
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	0	1810	0
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	66.498	1820	63.151
2.1 Series no subordinadas	0821	54.588	1821	54.577
2.2 Series subordinadas	0822	0	1822	0
2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0823		1823	
2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0824	3.368	1824	8.574
2.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0825	0	1825	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0826	8.542	1826	
3. Deudas con entidades de crédito	0830	22.252	1830	17.781
3.1 Préstamo subordinado	0831	0	1831	0
3.2 Crédito línea de liquidez	0832	0	1832	0
3.3 Otras deudas con entidades de crédito	0833	0	1833	0
3.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0834		1834	
3.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0835	498	1835	17.781
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836	0	1836	0
3.7 Intereses vencidos e impagados	0837	21.754	1837	
4. Derivados	0840	1.679	1840	1.088
4.1 Derivados de cobertura	0841	1.679	1841	1.088
4.2 Derivados de negociación	0842	0	1842	0
4.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0843		1843	
5. Otros pasivos financieros	0850	0	1850	0
5.1 Importe bruto	0851	0	1851	0
5.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0852		1852	

VII. Ajustes por periodificación	0900	39	1900	40
1. Comisiones	0910	33	1910	35
1.1 Comisión sociedad gestora	0911	23	1911	24
1.2 Comisión administrador	0912	0	1912	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0913	10	1913	11
1.4 Comisión variable - resultados realizados	0914	0	1914	0
1.5 Comisión variable - resultados no realizados	0915	0	1915	0
1.6 Otras comisiones del cedente	0916	0	1916	0
1.7 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0917		1917	
1.8 Otras comisiones	0918	0	1918	0
2. Otros	0920	6	1920	5
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0930	-16.724	1930	-12.102
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0940	0	1940	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0950	-16.724	1950	-12.102
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0960	0	1960	0
XI. Gastos de constitución en transición	0970		1970	
TOTAL PASIVO	1000	1.910.815	2000	2.025.080

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.02

Denominación del Fondo: MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS								
Denominación del compartimento:								
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.								
Estados agregados: No								
Periodo: 2º Semestre								
Ejercicio: 2011								

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. Corriente Actual 2º semestre		P. Corriente Anterior 2º semestre		Acumulado Actual 31/12/2011		Acumulado Anterior 31/12/2010
1. Intereses y rendimientos asimilados	0100	25.645	1100	24.204	2100	47.491	3100	50.575
1.1 Valores representativos de deuda	0110	0	1110	0	2110	0	3110	0
1.2 Derechos de crédito	0120	25.496	1120	24.096	2120	47.214	3120	50.331
1.3 Otros activos financieros	0130	149	1130	108	2130	277	3130	244
2. Intereses y cargas asimiladas	0200	-18.688	1200	-16.665	2200	-34.021	3200	-33.528
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210	-16.320	1210	-11.207	2210	-29.549	3210	-21.069
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220	-2.368	1220	-1.955	2220	-4.472	3220	-3.760
2.3 Otros pasivos financieros	0230		1230	-3.503	2230		3230	-8.699
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0240	-4.164	1240		2240	-7.334	3240	
A) MARGEN DE INTERESES	0250	2.793	1250	7.539	2250	6.136	3250	17.047
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0300	-2	1300	-1	2300	-1	3300	-1
4.1 Ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0310	0	1310	0	2310	0	3310	0
4.2 Activos financieros disponibles para la venta	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0
4.3 Otros	0330	-2	1330	-1	2330	-1	3330	-1
5. Diferencias de cambio (neto)	0400	0	1400	0	2400	0	3400	0
6. Otros ingresos de explotación	0500	0	1500	0	2500	0	3500	0
7. Otros gastos de explotación	0600	-186	1600	-88.895	2600	-348	3600	-375
7.1 Servicios exteriores	0610	-22	1610	-5	2610	-23	3610	-6
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611	-22	1611	-5	2611	-23	3611	-6
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0612		1612		2612		3612	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0613		1613		2613		3613	
7.1.4 Otros servicios	0614		1614		2614		3614	
7.2 Tributos	0620	0	1620	0	2620	0	3620	0
7.3 Otros gastos de gestión corrientes	0630	-164	1630	-88.890	2630	-325	3630	-369
7.3.1 Comisión de sociedad gestora	0631	-109	1631	-115	2631	-220	3631	-235
7.3.2 Comisión administrador	0632		1632	-17	2632		3632	-17
7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos	0633	-50	1633	-52	2633	-100	3633	-107
7.3.4 Comisión variable - resultados realizados (neto)	0634	0	1634	-88.696	2634	0	3634	0
7.3.5 Comisión variables - resultados no realizados (neto)	0635	0	1635	0	2635	0	3635	0
7.3.6 Otras comisiones del cedente	0636		1636		2636		3636	
7.3.7 Otros gastos	0637	-5	1637	-10	2637	-5	3637	-10
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0700	-18.148	1700	81.357	2700	-28.900	3700	81.357
8.1 Deterioro neto de valores representativos de deuda	0710	0	1710	0	2710	0	3710	0
8.2 Deterioro neto de derechos de crédito	0720	-18.148	1720	81.357	2720	-28.900	3720	81.357
8.3 Deterioro neto de derivados	0730	0	1730	0	2730	0	3730	0
8.4 Deterioro neto de otros activos financieros	0740	0	1740	0	2740	0	3740	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0750	0	1750	0	2750	0	3750	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0800	-113	1800	0	2800	-113	3800	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0850	15.656	1850	0	2850	23.226	3850	-98.028
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0900	0	1900	0	2900	0	3900	0
12. Impuesto sobre beneficios	0950	0	1950	0	2950	0	3950	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	3000	0	4000	0	5000	0	6000	0

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.03

Denominación del Fondo: MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
Estados agregados: No
Periodo: 2º Semestre
Ejercicio: 2011

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		Periodo Actual 31/12/2011		Mismo Periodo año Anterior 31/12/2010
A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN	8000	17.025	9000	23.507
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	8100	16.285	9100	22.399
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	48.245	9110	49.150
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-26.214	9120	-17.118
1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados	8130	-6.017	9130	-9.885
1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras	8140	271	9140	252
1.5 Intereses pagados por préstamos y créditos en entidades de crédito	8150		9150	
1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	8160	0	9160	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo	8200	-321	9200	-346
2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora	8210	-221	9210	-238
2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados	8220		9220	
2.3 Comisiones pagadas al agente financiero	8230	-100	9230	-108
2.4 Comisiones variables pagadas	8240		9240	
2.5 Otras comisiones	8250		9250	
3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo	8300	1.061	9300	1.454
3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos	8310	0	9310	0
3.2 Pagos de provisiones	8320		9320	
3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta	8325	803	9325	
3.4 Otros	8330	258	9330	1.454
B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION	8350	-21.530	9350	-60.518
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	8400	0	9400	0
4.1 Cobros por emisión de valores de titulización	8410	0	9410	0
4.2 Pagos por emisión de valores de titulización (aseguramiento colocación)	8420		9420	
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	8500		9500	
5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito	8510		9510	
5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras	8520		9520	
6. Flujos de caja netos por amortizaciones	8600	-21.502	9600	-60.475
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	78.661	9610	183.450
6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados	8620	0	9620	0
6.3 Pagos por amortización de valores de titulización	8630	-100.163	9630	-243.925
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	8700	-28	9700	-43
7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos	8710	0	9710	0
7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos	8720		9720	
7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso	8730	0	9730	0
7.4 Administraciones públicas - Pasivo	8740	0	9740	0
7.5 Otros deudores y acreedores	8750	-28	9750	-43
7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras	8770	0	9770	0
7.7 Cobros de Subvenciones	8780	0	9780	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	8800	-4.505	9800	-37.011
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	33.400	9900	70.411
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	28.895	9990	33.400

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.04

Denominación del Fondo: MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
Estados agregados: No
Periodo: 2º Semestre
Ejercicio: 2011

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS <i>(miles de euros)</i>		Periodo Actual 31/12/2011		Mismo Periodo año Anterior 31/12/2010
1 Activos financieros disponibles para la venta				
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6010	0	7010	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6020	0	7020	0
1.1.2 Efecto fiscal	6021	0	7021	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6022	0	7022	0
1.3 Otras reclasificaciones	6030	0	7030	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6040	0	7040	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	6100	0	7100	0
2 Cobertura de los flujos de efectivo				
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6110	-11.956	7110	-38.829
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6120	-11.956	7120	-38.829
2.1.2 Efecto fiscal	6121	0	7121	0
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6122	7.334	7122	8.699
2.3 Otras reclasificaciones	6130	0	7130	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6140	4.622	7140	30.130
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	6200	0	7200	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 periodo	6310	0	7310	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6320	0	7320	0
3.1.2 Efecto fiscal	6321	0	7321	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6322	0	7322	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6330	0	7330	0
Total Ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	6400	0	7400	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	6500	0	7500	0

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

Tipología de activos titulizados	Situación actual 31/12/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 11/07/2007			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)		
Participaciones hipotecarias	0001		0030		0060		0090		0120		0150	
Certificados de transmisión hipotecaria	0002	10.495	0031	1.822.936	0061	11.206	0091	1.988.115	0121	16.086	0151	3.000.000
Préstamos hipotecarios	0003		0032		0062		0092		0122		0152	
Cédulas hipotecarias	0004		0033		0063		0093		0123		0153	
Préstamos a promotores	0005		0034		0064		0094		0124		0154	
Préstamos a PYMES	0007		0036		0066		0096		0126		0156	
Préstamos a empresas	0008		0037		0067		0097		0127		0157	
Préstamos Corporativos	0009		0038		0068		0098		0128		0158	
Cédulas territoriales	0010		0039		0069		0099		0129		0159	
Bonos de tesorería	0011		0040		0070		0100		0130		0160	
Deuda subordinada	0012		0041		0071		0101		0131		0161	
Créditos AAPP	0013		0042		0072		0102		0132		0162	
Préstamos consumo	0014		0043		0073		0103		0133		0163	
Préstamos automoción	0015		0044		0074		0104		0134		0164	
Arrendamiento financiero	0016		0045		0075		0105		0135		0165	
Cuentas a cobrar	0017		0046		0076		0106		0136		0166	
Derechos de crédito futuros	0018		0047		0077		0107		0137		0167	
Bonos de titulización	0019		0048		0078		0108		0138		0168	
Otros	0020		0049		0079		0109		0139		0169	
Total	0021	10.495	0050	1.822.936	0080	11.206	0110	1.988.115	0140	16.086	0170	3.000.000

(1) Entendido como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **2º Semestre**
 Ejercicio: **2011**
 Entidades cedentes de los activos titulizados: CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO B

Movimiento de la cartera de activos titulizados/Tasa de amortización anticipada	Situación actual 31/12/2011		Situación cierre anual anterior 31/12/2010	
Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior	0196	-38.883	0206	-11.285
Derechos de crédito dados de baja por dación/adjudicación de bienes desde el cierre anual anterior	0197	-47.635	0207	-17.306
Amortización ordinaria desde el cierre anual anterior	0200	-37.534	0210	-145.931
Amortización anticipada desde el cierre anual anterior	0201	-41.127	0211	-66.109
Total importe amortizado acumulado, incluyendo adjudicaciones y otros pagos en especie, desde el origen del Fondo	0202	-1.138.738	0212	-1.011.885
Importe de principal pendiente de amortización de los nuevos activos incorporados en el periodo (1)	0203	0	0213	0
Principal pendiente cierre del periodo (2)	0204	1.822.936	0214	1.988.115
Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)	0205	2,07	0215	3,00

(1) En fondos abiertos, importe de principal pendiente de reembolso en la fecha de presentación de la información de los nuevos activos incorporados en el periodo

(2) Importe del principal pendiente de reembolso de la totalidad de los activos (incluidas las nuevas incorporaciones del periodo) a fecha del informe

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO C

Total Impagados (1)	Nº de activos	Importe impagado							Deuda Total			
		Principal pendiente vencido	Intereses ordinarios (2)		Total	Principal pendiente no vencido						
Hasta 1 mes	0700	849	0710	167	0720	277	0730	444	0740	144.280	0750	144.724
De 1 a 3 meses	0701	386	0711	223	0721	379	0731	602	0741	67.343	0751	67.945
De 3 a 6 meses	0703	136	0713	167	0723	313	0733	480	0743	25.635	0753	26.115
De 6 a 9 meses	0704	82	0714	174	0724	308	0734	482	0744	15.303	0754	15.785
De 9 a 12 meses	0705	50	0715	144	0725	244	0735	388	0745	8.534	0755	8.922
De 12 meses a 2 años	0706	96	0716	566	0726	628	0736	1.194	0746	14.277	0756	15.471
Más de 2 años	0708	163	0718	1.529	0728	3.436	0738	4.965	0748	28.556	0758	33.521
Total	0709	1.762	0719	2.970	0729	5.585	0739	8.555	0749	303.928	0759	312.483

(1) La distribución de los activos vencidos impagados entre los distintos tramos señalados se realizará en función de la antigüedad de la primera cuota vencida y no cobrada. Los intervalos se entenderán excluido el de inicio e incluido el final (p.e. De 1 a 3 meses, esto es: superior a 1 mes y menor o igual a 3 meses)

(2) Importe de intereses cuyo devengo, en su caso, se ha interrumpido conforme lo establecido en el apartado 12 de la norma 13ª de la Circular(p.e. De 1 a 3 meses, esto es: superior a 1 mes y menor o igual a 3 meses)

Impagados con garantía real (2)	Nº de activos	Importe impagado							Deuda Total	Valor garantía (3)	Valor Garantía con Tasación > 2 años (4)	% Deuda/v. Tasación				
		Principal pendiente vencido	Intereses ordinarios		Total	Principal pendiente no vencido										
Hasta 1 mes	0772	849	0782	167	0792	277	0802	444	0812	144.280	0822	144.724	0832	168.132	0842	86,08
De 1 a 3 meses	0773	386	0783	223	0793	379	0803	602	0813	67.343	0823	67.945	0833	78.306	0843	86,77
De 3 a 6 meses	0774	136	0784	167	0794	313	0804	480	0814	25.635	0824	26.115	0834	29.034	0844	89,94
De 6 a 9 meses	0775	82	0785	174	0795	308	0805	482	0815	15.303	0825	15.785	0835	17.918	0845	88,09
De 9 a 12 meses	0776	50	0786	144	0796	244	0806	388	0816	8.534	0826	8.922	0836	9.722	0846	91,76
De 12 meses a 2 años	0777	96	0787	566	0797	628	0807	1.194	0817	14.277	0827	15.471	0837	18.833	0847	82,14
Más de 2 años	0778	163	0788	1.529	0798	3.436	0808	4.965	0818	28.556	0828	33.521	0838	33.235	0848	100,86
Total	0779	1.762	0789	2.970	0799	5.585	0809	8.555	0819	303.928	0829	312.483	0839	355.180	0849	87,98

(2) La distribución de los activos vencidos impagados entre los distintos tramos señalados se realizará en función de la antigüedad de la primera cuota vencida y no cobrada. Los intervalos se entenderán excluido el de inicio e incluido el final (p.e. De 1 a 2 meses, estos es: superior a 1 mes y menor o igual a 2 meses)

(3) Cumplimentar con la última valoración disponible de tasación del inmueble o valor razonable de la garantía real (acciones o deuda pignoral, etc.) si el valor de las mismas se ha considerado en el momento inicial del Fondo

(4) Se incluirá el valor de las garantías que tengan una tasación superior a dos años

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.

Estados agregados: No

Periodo: 2º Semestre

Ejercicio: 2011

Entidades cedentes de los activos titulizados: CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

CUADRO D	Situación actual 31/12/2011						Situación cierre anual anterior 31/12/2010						Escenario inicial					
	Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)		Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)		Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)	
Participaciones hipotecarias	0850		0868		0886		0904		0922		0940		0958		0976		0994	
Certificados de transmisión de hipoteca	0851	5,20	0869	2,70	0887	0,11	0905	6,59	0923	0,56	0941	0,00	0959	0,00	0977	0,00	0995	0,00
Préstamos hipotecarios	0852		0870		0888		0906		0924		0942		0960		0978		0996	
Cédulas Hipotecarias	0853		0871		0889		0907		0925		0943		0961		0979		0997	
Préstamos a promotores	0854		0872		0890		0908		0926		0944		0962		0980		0998	
Préstamos a PYMES	0855		0873		0891		0909		0927		0945		0963		0981		0999	
Préstamos a empresas	0856		0874		0892		0910		0928		0946		0964		0982		1000	
Préstamos Corporativos	0857		0875		0893		0911		0929		0947		0965		0983		1001	
Cédulas Territoriales	1066		1084		1102		1120		1138		1156		1174		1192		1210	
Bonos de Tesorería	0858		0876		0894		0912		0930		0948		0966		0984		1002	
Deuda subordinada	0859		0877		0895		0913		0931		0949		0967		0985		1003	
Créditos AAPP	0860		0878		0896		0914		0932		0950		0968		0986		1004	
Préstamos Consumo	0861		0879		0897		0915		0933		0951		0969		0987		1005	
Préstamos automoción	0862		0880		0898		0916		0934		0952		0970		0988		1006	
Cuotas arrendamiento financiero	0863		0881		0899		0917		0935		0953		0971		0989		1007	
Cuentas a cobrar	0864		0882		0900		0918		0936		0954		0972		0990		1008	
Derechos de crédito futuros	0865		0883		0901		0919		0937		0955		0973		0991		1009	
Bonos de titulización	0866		0884		0902		0920		0938		0956		0974		0992		1010	
Otros	0867		0885		0903		0921		0939		0957		0975		0993		1011	

(1) Estos ratios se referirán exclusivamente a la cartera de activos cedidos al Fondo(presentados en el balance en la partida de "derechos de crédito") y se expresaran en términos porcentuales

(A) Determinada por el cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos a la fecha de presentación de la información, y el principal pendiente (sin incluir intereses, e incluyendo principales impagados) del total activos dados de alta en el balance a la fecha de presentación de la información. La clasificación como dudosos se realizará con arreglo a lo previsto en las Normas 13ª y 23ª

(B) Determinada por el cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos a la fecha de presentación de la información, y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en el balance a la fecha de presentación de la información más el principal de los activos clasificados como fallidos. Se considerará la definición de fallidos recogida en la Circular (no necesariamente coincidentes con la definición de la escritura o folleto, recogidas en el estado 5.4)

(D) Determinada por el cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo período del año anterior y el importe de principal de activos clasificados como fallidos al cierre del mismo período del año anterior

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Periodo: **2º Semestre**
 Ejercicio: **2011**
 Entidades cedentes de los activos titulizados: CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO E Vida residual de los activos cedidos al Fondo (1)	Situación actual 31/12/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 11/07/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior a 1 año	1300	1	1310	1	1320	0	1330	0	1340	0	1350	0
Entre 1 y 2 años	1301	3	1311	24	1321	2	1331	13	1341	0	1351	0
Entre 2 y 3 años	1302	1	1312	13	1322	3	1332	41	1342	0	1352	0
Entre 3 y 5 años	1303	1	1313	29	1323	1	1333	17	1343	0	1353	0
Entre 5 y 10 años	1304	53	1314	3.078	1324	31	1334	1.861	1344	0	1354	0
Superior a 10 años	1305	10.436	1315	1.819.793	1325	11.169	1335	1.986.183	1345	16.086	1355	3.000.000
Total	1306	10.495	1316	1.822.938	1326	11.206	1336	1.988.115	1346	16.086	1356	3.000.000
Vida residual media ponderada (años)	1307	25,72			1327	26,60			1347	29,39		

(1) Los intervalos se entenderán excluido el inicio del mismo e incluido el final (p.e. Entre 1 y 2 años: superior a 1 año y menor o igual a 2 años)

Antigüedad	Situación actual 31/12/2011		Situación cierre anual anterior 31/12/2010		Situación inicial 11/07/2007	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	6,11	0632	5,12	0634	1,72

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)

CUADRO A		Situación actual 31/12/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Escenario inicial 11/07/2007			
		Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Principal pendiente	Vida media de los pasivos (1)
Serie (2)	Denominación serie	0001	0002	0003	0004	0005	0006	0007	0008	0009	0070	0080	0090
ES0359093004	SERIE A1	6.580	0	0	0,00	6.580	0	0	0,00	6.580	100	658.000	0,84
ES0359093012	SERIE A2	15.750	64	1.002.362	3,39	15.750	70	1.102.524	3,56	15.750	100	1.575.000	3,94
ES0359093020	SERIE A3	4.970	100	497.000	11,47	4.970	100	497.000	11,97	4.970	100	497.000	10,42
ES0359093038	SERIE B	555	100	55.500	7,34	555	100	55.500	7,84	555	100	55.500	7,55
ES0359093046	SERIE C	900	100	90.000	7,34	900	100	90.991	7,84	900	100	90.000	7,55
ES0359093053	SERIE D	720	100	72.000	7,34	720	100	74.024	7,84	720	100	72.000	7,55
ES0359093061	SERIE E	525	100	52.500	7,34	525	100	55.369	7,84	525	100	52.500	7,55
Total		8006	30.000	8025	1.769.362	8045	30.000	8065	1.875.408	8085	30.000	8105	3.000.000

(1) Importes en años. En caso de ser estimado se indicará en las notas explicativas las hipótesis de estimación

(2) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)

CUADRO B

Serie (1)	Denominación serie	Grado de subordinación (2)	Índice de referencia (3)	Margen (4)	Tipo aplicado	Intereses				Principal pendiente		Corrección de valor por repercusión de pérdidas						
						Base de cálculo de intereses	Días Acumulados (5)	Intereses Acumulados (6)	Intereses impagados	Principal no vencido	Principal impagado	Total pendiente						
														9950	9960	9970	9980	9990
ES0359093004	SERIE A1	NS	EURIBOR 3 m	0,10	0,00	360	39	0	0	0	0	0						
ES0359093012	SERIE A2	NS	EURIBOR 3 m	0,20	1,67	360	39	1.808	0	1.002.362	0	1.004.170						
ES0359093020	SERIE A3	S	EURIBOR 3 m	0,23	1,70	360	39	913	0	497.000	0	497.913						
ES0359093038	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,30	1,77	360	39	106	0	55.500	0	55.606						
ES0359093046	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	0,35	1,82	360	39	177	839	90.000	0	91.016						
ES0359093053	SERIE D	S	EURIBOR 3 m	0,60	2,07	360	39	161	3.038	72.000	0	75.199						
ES0359093061	SERIE E	S	EURIBOR 3 m	2,10	3,57	360	39	203	4.664	52.500	0	57.367						
Total								9228	3.368	9105	8.541	9085	1.769.362	9095	0	9115	1.781.271	9227

(1) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

(2) La gestora deberá indicar si la serie es subordinada o no subordinada (S=Subordinada; NS=No subordinada)

(3) La gestora deberá cumplimentar el índice de referencia que corresponda en cada caso (EURIBOR un año, EURIBOR a tres meses...). En el caso de tipos fijos esta columna se cumplimentará con el término "fijo"

(4) En el caso de tipos fijos esta columna no se cumplimentará

(5) Días acumulados desde la última fecha de pago

(6) Intereses acumulados desde la última fecha de pago

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)

CUADRO C			Situación actual 31/12/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010											
			Amortización principal		Intereses		Amortización principal		Intereses									
Serie (1)	Denominación serie	Fecha final (2)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)								
		7290	7300	7310	7320	7330	7340	7350	7360	7370								
ES0359093004	SERIE A1	22-02-2050	0	658.000	0	41.199	0	658.000	0	41.199								
ES0359093012	SERIE A2	22-02-2050	100.163	572.639	15.772	166.172	243.925	472.476	11.663	150.400								
ES0359093020	SERIE A3	22-02-2050	0	0	7.572	56.684	0	0	4.872	49.112								
ES0359093038	SERIE B	22-02-2050	0	0	885	6.501	0	0	583	5.616								
ES0359093046	SERIE C	22-02-2050	0	0	1.633	9.902	0	0	0	8.269								
ES0359093053	SERIE D	22-02-2050	0	0	353	6.349	0	0	0	5.996								
ES0359093061	SERIE E	22-02-2050	0	0	0	5.654	0	0	0	5.654								
Total			7305	100.163	7315	1.230.639	7325	26.215	7335	292.461	7345	243.925	7355	1.130.476	7365	17.118	7375	266.246

(1) La gestora deberá complementar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

(2) Entendiendo como fecha final aquella que de acuerdo con la documentación contractual determine la extinción del Fondo, siempre que no se haya producido previamente una causa de liquidación anticipada

(3) Total de pagos realizados desde el último cierre anual

(4) Total de pagos realizados desde la fecha de constitución del Fondo

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.

Estados agregados: No

Periodo: 2º Semestre

Ejercicio: 2011

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

CUADRO D

Serie (1)	Denominación serie	Calificación				
		Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Situación actual	Situación anual cierre anterior	Situación inicial
		3310	3330	3350	3360	3370
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	28-07-2011	FCH	BBB	A+	AAA
ES0359093012	SERIE A2	11-09-2009	MDY	Aa2	Aa2	Aaa
ES0359093012	SERIE A2	29-04-2009	SYP	AA	AA	AAA
ES0359093020	SERIE A3	28-07-2011	FCH	BBB	A+	AAA
ES0359093020	SERIE A3	11-09-2009	MDY	A3	A3	Aaa
ES0359093020	SERIE A3	29-04-2009	SYP	AA	AA	AAA
ES0359093038	SERIE B	28-07-2011	FCH	BBB-	BBB	AA
ES0359093038	SERIE B	11-09-2009	MDY	B1	B1	Aa2
ES0359093038	SERIE B	24-02-2010	SYP	B	B	AA
ES0359093046	SERIE C	18-03-2009	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	18-03-2009	FCH	CCC	CCC	BBB
ES0359093053	SERIE D	11-09-2009	MDY	C	C	Baa2
ES0359093053	SERIE D	22-05-2009	SYP	D	D	BBB
ES0359093061	SERIE E	18-03-2009	FCH	CC	CC	BB
ES0359093061	SERIE E	11-09-2009	MDY	C	C	Ba3
ES0359093061	SERIE E	22-05-2009	SYP	D	D	BB

(1) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

(2) La gestora deberá cumplimentar la calificación crediticia otorgada por cda agencia de rating, cuya denominación también deberá ser cumplimentada, para serie - MDY para Moody's; SYP para Standard & Poors; FCH para Fitch; DBRS para Dominion Bond Rating Service -

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.3

Denominación del Fondo: MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS Denominación del compartimento: Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. Estados agregados: No Periodo: 2º Semestre Ejercicio: 2011

INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS <i>(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)</i>		Situación actual 31/12/2011		Situación cierre anual anterior 31/12/2010
1. Importe del Fondo de Reserva	0010	0	1010	0
2. Porcentaje que representa el Fondo de Reserva, u otras mejoras equivalentes, sobre el total de activos titulizados	0020	0,00	1020	0,00
3. Exceso de spread (%) (1)	0040	1,05	1040	0,99
4. Permuta financiera de intereses (S/N)	0050	Si	1050	Si
5. Permuta financiera de tipos de cambio (S/N)	0070	No	1070	No
6. Otras permutas financieras (S/N)	0080	No	1080	No
7. Importe disponible de la línea/s de liquidez (2)	0090	0	1090	
8. Subordinación de series (S/N)	0110	Si	1110	Si
9. Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total de bonos (3)	0120	56,65	1120	58,97
10. Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales	0150		1150	
11. Porcentaje que representa el aval sobre el total de los pasivos emitidos	0160		1160	
12. Importe máximo de riesgo cubierto por derivados de crédito u otras garantías financieras adquiridas	0170	0	1170	0
13. Otros (S/N) (4)	0180	No	1180	No
(1) Diferencial existente entre los tipos de interés medios ponderados percibidos de la cartera de activos titulizados conforme se establece en el Cuadro 5.5.E y el tipo de interés medio de los pasivos emitidos cuya finalidad ha sido la adquisición de los activos (2) Se incluirá el importe total disponible de las distintas líneas de liquidez en caso de que haya más de una (3) Entendiendo como no subordinadas aquellas series que en la fecha se encuentren, respecto a las demás, en una posición anterior para el cobro de capital conforme al orden de prelación de pagos (4) La gestora deberá incluir una descripción de dichas mejoras crediticias en las notas explicativas en caso de que las consideren relevantes				

Información sobre contrapartes de las mejoras crediticias		NIF		Denominación
Contraparte del Fondo de Reserva u otras mejores equivalentes (5)	0200		1210	Caja Madrid
Permutas financieras de tipos de interés	0210		1220	BBVA
Permutas financieras de tipos de cambio	0220		1230	N/A
Otras permutas financieras	0230		1240	N/A
Contraparte de la Línea de Liquidez	0240		1250	N/A
Entidad Avalista	0250		1260	N/A
Contraparte del derivado de crédito	0260		1270	N/A

(5) Si el Fondo de Reserva se ha constituido a través de títulos emitidos y se desconoce el titular de esos títulos no se cumplimentará

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.4

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

CIRCUNSTANCIAS ESPECÍFICAS ESTABLECIDAS CONTRACTUALMENTE EN EL FONDO

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

Concepto (1)	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio (2)				Ref. Folleto		
	0100	0200	0030	0090	Situación actual	Periodo anterior	Situación actual	Periodo anterior	Situación actual	Periodo anterior	Última Fecha Pago				
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	0010		0030	90	0100	24.772	0200	8.687	0300	0,01	0400	0,00	1120	0,01	
2. Activos Morosos por otras razones					0110		0210		0310		0410		1130		
Total Morosos					0120	24.772	0220	8.687	0320	0,01	0420	0,00	1140	0,01	1280
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	0050		0060		0130	198.638	0230	144.420	0330	0,11	0430	0,08	1050	0,11	
4. Activos Fallidos por otras razones		6			0140		0240		0340		0440		1160		
Total Fallidos					0150	198.638	0250	144.420	0350	0,11	0450	0,08	1200	0,11	1290

(1) En caso de existir definiciones adicionales a las recogidas en la presente tabla (moros cualificadas, fallidos subjetivos, etc) respecto a las que se establezca algún trigger se indicarán en la tabla de Otros ratios relevantes, indicando el nombre del ratio

(2) Los ratios se corresponden al importe total de activos fallidos o morosos entre el saldo vivo de los activos cedidos al fondo según se defina en la documentación contractual. En la columna Ref. Folleto se indicará el epígrafe o capítulo del folleto en el que el concepto esté definido

Otros ratios relevantes	Ratio (2)				Ref. Folleto
	Situación actual	periodo anterior	Última Fecha Pago		
N/A	0160	0260	0360	0460	

TRIGGERS (3)	Límite	% Actual	Última Fecha Pago		Ref. Folleto
			0540	0560	
Amortización secuencial: series (4)	0500	0520	0540	0560	
SERIE C ES0359093046	6,00	5,09	5,03		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359093046	1,75	1,33	1,29		4.9.4 Nota de Valores
SERIE C ES0359093046	10,00	64,44	65,22		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359093038	3,70	3,14	3,10		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359093038	2,00	1,33	1,29		4.9.4 Nota de Valores
SERIE B ES0359093038	10,00	64,44	65,22		4.9.4 Nota de Valores
SERIE A1 ES0359093004	25,00	6,62	6,44		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359093053	4,80	4,07	4,02		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359093053	1,50	1,33	1,29		4.9.4 Nota de Valores
SERIE D ES0359093053	10,00	64,44	65,22		4.9.4 Nota de Valores
SERIE A2 ES0359093012	25,00	6,62	6,44		4.9.4 Nota de Valores

SERIE E ES0359093061		3,50		2,97		2,93		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359093061		1,25		1,33		1,29		4.9.4 Nota de Valores
SERIE E ES0359093061		10,00		64,44		65,22		4.9.4 Nota de Valores
SERIE A3 ES0359093020		25,00		6,62		6,44		4.9.4 Nota de Valores
Diferimiento/postergamiento intereses: series (5)		0506		0526		0546		0566
SERIE B ES0359093038		20,30		16,71		16,38		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE C ES0359093046		14,65		16,71		16,38		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE E ES0359093061		8,94		16,71		16,38		3.4.6.2. Modulo Adicional
SERIE D ES0359093053		10,47		16,71		16,38		3.4.6.2. Modulo Adicional
No Reducción del Fondo de Reserva (6)	0512		0532	0,00	0552	0,00	0572	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS (3)		0513		0523		0553		0573
N/A								

(3) En caso de existir triggers adicionales a los recogidos en la presente tabla se indicarán su nombre o concepto debajo de OTROS TRIGGERS. Si los triggers recogidos expresamente en la tabla no están previstos en el Fondo, no se cumplimentarán

(4) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto al modo de amortización (prorrata/secuencial) de algunas de las series se indicarán las series afectadas indicando su ISIN, y en su defecto el nombre, el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

(5) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto al diferimiento o postergamiento de intereses de algunas de las series se indicarán las series afectadas indicando su ISIN o nombre, el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

(6) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto a la no reducción del fondo de reserva se indicará el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

--

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.

Estados agregados: No

Periodo: 2º Semestre

Ejercicio: 2011

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO A Distribución geográfica de activos titulizados	Situación actual 31/12/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 11/07/2007			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)		
Andalucía	0400	450	0426	59.281	0452	468	0478	62.874	0504	660	0530	94.850
Aragón	0401	101	0427	14.557	0453	114	0479	17.210	0505	183	0531	30.662
Asturias	0402	178	0428	20.556	0454	183	0480	21.394	0506	232	0532	28.884
Baleares	0403	253	0429	40.782	0455	262	0481	42.827	0507	383	0533	66.465
Canarias	0404	87	0430	12.761	0456	93	0482	13.859	0508	131	0534	20.463
Cantabria	0405	141	0431	19.510	0457	146	0483	20.939	0509	210	0535	32.047
Castilla-León	0406	210	0432	25.805	0458	219	0484	27.985	0510	299	0536	40.527
Castilla La Mancha	0407	414	0433	61.276	0459	453	0485	69.492	0511	724	0537	118.810
Cataluña	0408	2.106	0434	336.716	0460	2.255	0486	367.737	0512	3.674	0538	632.820
Ceuta	0409	38	0435	3.627	0461	41	0487	3.996	0513	56	0539	6.010
Extremadura	0410	43	0436	4.614	0462	47	0488	5.061	0514	63	0540	7.524
Galicia	0411	177	0437	22.384	0463	179	0489	22.989	0515	211	0541	29.795
Madrid	0412	5.682	0438	1.110.682	0464	6.065	0490	1.210.931	0516	8.144	0542	1.719.219
Meilla	0413	0	0439	0	0465	0	0491	0	0517	0	0543	0
Murcia	0414	67	0440	9.386	0466	82	0492	11.526	0518	132	0544	18.809
Navarra	0415	61	0441	10.267	0467	63	0493	10.855	0519	93	0545	17.319
La Rioja	0416	15	0442	1.741	0468	15	0494	1.779	0520	38	0546	5.539
Comunidad Valenciana	0417	322	0443	40.729	0469	368	0495	47.670	0521	652	0547	90.277
País Vasco	0418	150	0444	28.262	0470	153	0496	28.991	0522	201	0548	39.979
Total España	0419	10.495	0445	1.822.936	0471	11.206	0497	1.988.115	0523	16.086	0549	2.999.999
Otros países Unión europea	0420	0	0446	0	0472	0	0498	0	0524	0	0550	0
Resto	0422	0	0448	0	0474	0	0500	0	0526	0	0552	0
Total general	0425	10.495	0450	1.822.936	0475	11.206	0501	1.988.115	0527	16.086	0553	2.999.999

(1) Entendiendo como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.

Estados agregados: No

Periodo: 2º Semestre

Ejercicio: 2011

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO B

Divisa/Activos titulizados	Situación actual 31/12/2011						Situación cierre anual anterior 31/12/2010						Situación inicial 11/07/2007					
	Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)	
Euro - EUR	0571	10.495	0577	1.822.936	0583	1.822.936	0600	11.206	0606	1.988.115	0611	1.988.115	0620	16.086	0626	3.000.000	0631	3.000.000
EEUU Dólar - USD	0572	0	0578	0	0584	0	0601	0	0607	0	0612	0	0621	0	0627	0	0632	0
Japón Yen - JPY	0573	0	0579	0	0585	0	0602	0	0608	0	0613	0	0622	0	0628	0	0633	0
Reino Unido Libra - GBP	0574	0	0580	0	0586	0	0603	0	0609	0	0614	0	0623	0	0629	0	0634	0
Otras	0575	0			0587	0	0604	0			0615	0	0624	0			0635	0
Total	0576	10.495			0588	1.822.936	0605	11.206			0616	1.988.115	0625	16.086			0636	3.000.000

(1) Entendiendo como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO C

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (1)	Situación actual 31/12/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 11/07/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	1100	46	1110	2.493	1120	27	1130	1.183	1140	0	1150	0
40% - 60%	1101	129	1111	13.880	1121	95	1131	10.728	1141	0	1151	0
60% - 80%	1102	3.694	1112	539.651	1122	2.664	1132	382.314	1142	0	1152	0
80% - 100%	1103	6.626	1113	1.266.912	1123	8.420	1133	1.593.891	1143	0	1153	3.000.000
100% - 120%	1104	0	1114	0	1124	0	1134	0	1144	0	1154	0
120% - 140%	1105	0	1115	0	1125	0	1135	0	1145	0	1155	0
140% - 160%	1106	0	1116	0	1126	0	1136	0	1146	0	1156	0
superior al 160%	1107	0	1117	0	1127	0	1137	0	1147	0	1157	0
Total	1108	10.495	1118	1.822.936	1128	11.206	1138	1.988.116	1148	0	1158	3.000.000
Media ponderada (%)			1119	85,33			1139	87,18			1159	92,35

(1) Distribución según el valor de la razón entre el importe pendiente de amortizar de los préstamos con garantía real y la última valoración disponible de tasación de los inmuebles hipotecados, o valor razonable de otras garantías reales, siempre que el valor de las mismas se haya considerado en el momento inicial del Fondo, expresada en porcentaje

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO D

Rendimiento índice del periodo	Número de activos vivos		Principal Pendiente		Margen ponderado s/ índice de referencia		Tipo de interés medio ponderado (2)	
Índice de referencia (1)	1400		1410		1420		1430	
IRPH	2.339		320.476		0,27		3,38	
EURIBOR	8.156		1.502.460		0,75		2,54	
Total	1405	10.495	1415	1.822.936	1425	0,67	1435	2,69

(1) La gestora deberá cumplimentar el índice de referencia que corresponda en cada caso (EURIBOR un año, LIBRO, etc.)

(2) En el caso de tipos fijos no se cumplimentará la columna de margen ponderado y se indicará el tipo de interés medio ponderado de los activos a tipo fijo en la columna "tipo de interés medio ponderado"

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.

Estados agregados: No

Periodo: 2º Semestre

Ejercicio: 2011

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO E Tipo de interés nominal	Situación actual 31/12/2011				Situación cierre anual anterior 31/12/2010				Situación inicial 11/07/2007			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior al 1%	1500	0	1521	0	1542	0	1563	0	1584	0	1605	0
1% - 1,49%	1501	0	1522	0	1543	0	1564	0	1585	0	1606	0
1,5% - 1,99%	1502	1	1523	173	1544	3.730	1565	812.196	1586	0	1607	0
2% - 2,49%	1503	4.128	1524	858.105	1545	2.830	1566	477.987	1587	0	1608	0
2,5% - 2,99%	1504	2.533	1525	414.542	1546	2.485	1567	398.892	1588	0	1609	0
3% - 3,49%	1505	2.816	1526	426.041	1547	2.068	1568	284.676	1589	0	1610	0
3,5% - 3,99%	1506	1.014	1527	123.578	1548	93	1569	14.364	1590	0	1611	0
4% - 4,49%	1507	3	1528	498	1549	0	1570	0	1591	2.223	1612	529.525
4,5% - 4,99%	1508	0	1529	0	1550	0	1571	0	1592	4.318	1613	862.065
5% - 5,49%	1509	0	1530	0	1551	0	1572	0	1593	6.453	1614	1.101.642
5,5% - 5,99%	1510	0	1531	0	1552	0	1573	0	1594	2.638	1615	439.416
6% - 6,49%	1511	0	1532	0	1553	0	1574	0	1595	452	1616	66.872
6,5% - 6,99%	1512	0	1533	0	1554	0	1575	0	1596	2	1617	481
7% - 7,49%	1513	0	1534	0	1555	0	1576	0	1597	0	1618	0
7,5% - 7,99%	1514	0	1535	0	1556	0	1577	0	1598	0	1619	0
8% - 8,49%	1515	0	1536	0	1557	0	1578	0	1599	0	1620	0
8,5% - 8,99%	1516	0	1537	0	1558	0	1579	0	1600	0	1621	0
9% - 9,49%	1517	0	1538	0	1559	0	1580	0	1601	0	1622	0
9,5% - 9,99%	1518	0	1539	0	1560	0	1581	0	1602	0	1623	0
Superior al 10%	1519	0	1540	0	1561	0	1582	0	1603	0	1624	0
Total	1520	10.495	1541	1.822.937	1562	11.206	1583	1.988.115	1604	16.086	1625	3.000.001
Tipo de interés medio ponderado de los activos(%)			9542	2,68			9584	2,32			1626	5,03
Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%)			9543	1,63			9585				1627	

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

CUADRO F

Concentración	Situación actual 31/12/2011			Situación cierre anual anterior 31/12/2010			Situación inicial 11/07/2007		
	Porcentaje	CNAE (2)		Porcentaje	CNAE (2)		Porcentaje	CNAE (2)	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	2000			2030			2060		
Sector: (1)	2010	2020		2040	2050		2070	2080	

(1) Indíquese denominación del sector con mayor concentración

(2) Incluir código CNAE con dos niveles de agregación

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**

Estados agregados: **No**

Periodo: **2º Semestre**

Ejercicio: **2011**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO G

Divisa/Pasivos emitidos por el fondo	Situación actual 31/12/2011						Situación inicial 11/07/2007					
	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros		Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros	
Euro - EUR	3000	30.000	3060	1.769.362	3110	1.769.362	3170	30.000	3230	3.000.000	3250	3.000.000
EEUU Dólar - USDR	3010	0	3070	0	3120	0	3180	0	3240	0	3260	0
Japón Yen - JPY	3020	0	3080	0	3130	0	3190	0	3250	0	3270	0
Reino Unido Libra - GBP	3030	0	3090	0	3140	0	3200	0	3260	0	3280	0
Otras	3040	0			3150	0	3210	0			3290	0
Total	3050	30.000			3160	1.769.362	3220	30.000			3300	3.000.000

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.06

Denominación del Fondo: **MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
Estados agregados: **No**
Periodo: **2º Semestre**
Ejercicio: **2011**

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene
Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

N/A