

MADRID RMBS III - Fondo de Titulización de Activos

LIQUIDACION DEL PERIODO 22/11/19 - 24/02/20

	Euros
I. Situación al 22/11/19:	57,96
Saldo inicial Cta. Tesorería	57,96
II. Fondos recibidos del emisor	19.192.410,12
Principal:	
Según calendario hasta 31/01/20:	10.918.559,05
Amort. Anticipada hasta 31/01/20:	6.609.618,99
Intereses:	1.664.232,08
III. Ingresos de Inmuebles:	2.182.105,41
IV. Subtotal Recursos disponibles (I + II + III):	21.374.573,49
V. Total intereses Cuenta de Tesorería:	-16.337,28
Intereses de la Cta.de Tesorería	-16.337,28
VI. Recursos disponibles (IV + V):	21.358.236,21
VII. Gastos:	910.745,02
VIII. Liquidación SWAP:	-239.243,29
Cantidad a Pagar por la Parte B (Fondo):	-716.715,84
Cantidad a Pagar por la Parte A (Banco Santander):	-955.959,13
IX. Pago a los Bonos:	20.208.195,00
Bonos A2 :	
Intereses correspondientes al 24/02/20:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 24/02/20:	20.208.195,00
Bonos A3 :	
Intereses correspondientes al 24/02/20:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Amortización correspondiente al 24/02/20:	0,00
Bonos B:	
Intereses vencidos a 24/02/20:	0,00
Intereses pagados a 24/02/20:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados a 24/02/20:	467.054,70
Amortización correspondiente al 24/02/20:	0,00
Bonos C:	
Intereses vencidos a 24/02/20:	0,00
Intereses pagados a 24/02/20:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados a 24/02/20:	3.556.746,00
Amortización correspondiente al 24/02/20:	0,00
Bonos D:	
Intereses vencidos a 24/02/20:	36.475,20
Intereses pagados a 24/02/20:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados a 24/02/20:	6.696.324,00
Amortización correspondiente al 24/02/20:	0,00
Bonos E:	
Intereses vencidos a 24/02/20:	232.218,00
Intereses pagados a 24/02/20:	0,00
Retenciones practicadas a los bonos:	0,00
Intereses impagados a 24/02/20:	13.929.347,25
Amortización correspondiente al 24/02/20:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones :	0,00
X. Saldo disponible (VI - VII + VIII - IX):	52,90
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva previo (22/11/19):	0,00
Aportación al Fondo de Reserva	0,00
Remuneración Fija Préstamo Participativo	0,00
Amortización Préstamo Participativo	0,00
Intereses Crédito Subordinado	0,00
Amortización Crédito Subordinado	0,00
Otros Recursos para el siguiente pago	52,90
Remuneración Variable Prést. Participativo	0,00
Fondo de Reserva (24/02/20):	0,00

Destinatarios: CNMV; AIAF



Nº: 609/20

Titulización de Activos, SGFT,S.A.
 Orense, 58
 28020 Madrid
 Tel.:917020808
<http://www.tda-sgft.com>
 MADRID RMBS IIIniq.trim/Feb20

MADRID RMBS III

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 24 de Febrero de 2020

Importes en euros

I. BONOS A2 ES0359093012	Sobre 15750 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/07/2007):	1.575.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	316.605.870,00 €	20.101,96 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	20.208.195,00 €	1.283,06 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	296.397.675,00 €	18.818,90 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	18,818900%	18,818900%

II. BONOS A3 ES0359093020	Sobre 4970 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/07/2007):	497.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	497.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	497.000.000,00 €	100.000,00 €
6. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

III. BONOS B ES0359093038	Sobre 555 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/07/2007):	55.500.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	55.500.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	467.054,70 €	841,54 €
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	55.500.000,00 €	100.000,00 €
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

IV. BONOS C ES0359093046	Sobre 900 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/07/2007):	90.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	90.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	3.556.746,00 €	3.951,94 €
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	90.000.000,00 €	100.000,00 €
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

V. BONOS D ES0359093053	Sobre 720 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/07/2007):	72.000.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	72.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	36.475,20 €	50,66 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	6.696.324,00 €	9.300,45 €
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	72.000.000,00 €	100.000,00 €
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

VI. BONOS E ES0359093061	Sobre 525 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (18/07/2007):	52.500.000,00 €	100.000,00 €
2. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	52.500.000,00 €	100.000,00 €
3. Intereses devengados en esta Fecha de Pago:	232.218,00 €	442,32 €
4. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
5. Intereses impagados tras esta Fecha de Pago:	13.929.347,25 €	26.532,09 €
6. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
7. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	52.500.000,00 €	100.000,00 €
8. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%

VII. EL FONDO	Importes en euros
1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/01/20:	
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:	1.033.135.322,23 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:	172.901.934,94 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:	1.033.409.831,43 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:	280.938.552,33 €
2. Amortización del período 31/10/19 a 31/01/20:	17.528.178,04 €
a) Según calendario:	10.918.559,05 €
b) Amortización anticipada hasta 31/01/20:	6.609.618,99 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):	
a) Último año:	1,62%
b) Último semestre:	1,94%
c) Último trimestre:	2,49%
4. Porcentaje de fallidos (1):	21,37%
5. Nivel de Impago (2):	0,23%

(1) Saldo pendiente de las participaciones hipotecarias fallidas según definición del Folleto de Emisión (retraso de 6 meses y otras causas), sobre el saldo pendiente total.

(2) Importe de principal de las Participaciones Hipotecarias con morosidad superior a 90 días en la Fecha de Cobro inmediata anterior a la Fecha de Pago en curso, sobre el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias.

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF



Nº: 610/20

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

<http://www.tda-sgft.com>

MADRID RMBS III\Infoinver.trim\Feb20

MADRID RMBS III , FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL PERÍODO: 22/11/19 - 24/02/20

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO	
Fecha de Constitución del Fondo	11 de julio de 2007
Fecha Emisión Bonos	11 de julio de 2007
Fecha Final Amortización Bonos: (1,62% TAA)	22 de noviembre de 2035
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Certificados de Transmisión de Hipoteca	BANKIA (Caja Madrid)
Agente de Pagos	BNP PARIBAS
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Fitch Ibca / Standard & Poor's / Moody's Investors Service
Calificación	Bonos A2: (F) A- (sf) / (S&P) AA (sf) / (M) A1 (sf) Bonos A3: (F) A- (sf) / (S&P) AA- (sf) / (M) A1 (sf) Bonos B: (F) BB+ (sf) / (S&P) D (sf) / (M) B2 (sf) Bonos C: (F) B (sf) / (S&P) D (sf) / (M) Ca (sf) Bonos D: (F) CC (sf) / (S&P) D (sf) / (M) C (sf) Bonos E: (F) C (sf) / (S&P) D (sf) / (M) C (sf)

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO	
Nombre	Bonos de Titulización MADRID RMBS III
Serie A2:	
Código ISIN	ES0359093012
Nominal en circulación total (inicial)	1.575.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	296.397.675,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	18.818,90 Euros

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)	
Nombre	Bonos de Titulización MADRID RMBS III
Serie A3:	
Código ISIN	ES0359093020
Nominal en circulación total (inicial)	497.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	497.000.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie B:	
Código ISIN	ES0359093038
Nominal en circulación total (inicial)	55.500.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	55.500.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie C:	
Código ISIN	ES0359093046
Nominal en circulación total (inicial)	90.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	90.000.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie D:	
Código ISIN	ES0359093053
Nominal en circulación total (inicial)	72.000.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	72.000.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie E:	
Código ISIN	ES0359093061
Nominal en circulación total (inicial)	52.500.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	52.500.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA
* Liquidación del Período: 22/11/19-24/02/20
* Flujos de Caja del Período: 22/11/19-24/02/20
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 24 de Febrero de 2020

MADRID RMBS III**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 22/11/19 - 24/02/20**

	Euros	
	Ingresos	Pagos
I. INVERSIONES/FINANCIACIONES		
Amortización Bonos Titulización Hip.		20.208.195,00
Amortización Participaciones Hip.	17.528.178,04	
Amortización Ptmos. Subordinados		0,00
Ingresos de Inmuebles	2.182.105,41	
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH		0,00
Intereses recibidos de las PHs	1.664.232,08	
Intereses Ptmos. Subordinados		0,00
Intereses Inversiones Temporales	-16.337,28	
III. GASTOS		
Comisiones Periódicas:		910.745,02
Neto SWAP		239.243,29
Remuneración Variable Préstamo Participativo		0,00
Total Ingresos/Pagos	21.358.178,25	21.358.183,31
Saldo inicial 22/11/19	57,96	
A Inversiones Temporales		52,90
Total	21.358.236,21	21.358.236,21
Retenciones practicadas el 24/02/20	0,00	
A Inversiones temporales		0,00

Destinatarios: CNMV; AIAF.

**Nº: 615/20**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

<http://www.tda-sgft.com>

MADRID RMBS IIIfluj.trimFeb20