

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION
Número de registro del Fondo: 11140
NIF Fondo: V02673549
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: SI
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2021

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

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

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	15.086.165	1001	13.259.943
I. Activos financieros a largo plazo	0002	15.086.165	1002	13.259.943
1. Activos titulizados	0003	15.086.165	1003	13.259.943
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	15.080.254	1005	13.259.943
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	5.911	1025	0
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	0	1027	0
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: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	805.745	1041	939.742
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	685.744	1043	715.260
1. Activos titulizados	0044	553.589	1044	550.564
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	542.763	1046	539.633
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	10.518	1065	10.928
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	10	1066	3
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	283	1067	0
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	15	1068	0
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	0	1069	0
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	132.155	1074	164.696
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	132.155	1077	164.696
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	120.000	1085	224.482
1. Tesorería	0086	120.000	1086	224.482
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	15.891.909	1088	14.199.685

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	15.485.365	1089	13.793.843
I. Provisiones a largo plazo	0090	21.550	1090	19.916
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	21.550	1092	19.916
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	15.463.815	1094	13.773.927
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	15.206.954	1095	13.516.867
1.1 Series no subordinadas	0096	12.943.954	1096	11.497.267
1.2 Series subordinadas	0097	2.263.000	1097	2.019.600
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	120.000	1101	120.200
2.1 Préstamo subordinado	0102	120.000	1102	120.200
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	0	1105	0
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	136.860	1108	136.860
3.1 Derivados de cobertura	0109	136.860	1109	136.860
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

S.01

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2021		Periodo anterior 31/12/2020
B) PASIVO CORRIENTE	0117	570.779	1117	568.358
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	570.691	1123	568.345
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	543.135	1124	540.788
1.1 Series no subordinadas	0125	543.046	1125	539.633
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	89	1128	1.156
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	0	1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	0	1131	0
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	0	1136	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	27.556	1139	27.556
3.1 Derivados de cobertura	0140	27.556	1140	27.556
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	88	1148	13
1. Comisiones	0149	88	1149	8
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	0	1150	6
1.2 Comisión administrador	0151	87	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	1
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	0	1157	5
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	-164.234	1158	-162.516
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	-164.234	1160	-162.516
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	15.891.909	1162	14.199.685

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2021		Acumulado anterior 30/09/2020
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	33.778	1201	0	2201	101.172	3201	0
1.1 Activos titulizados	0202	33.778	1202	0	2202	101.172	3202	0
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-4.174	1204	0	2204	-12.162	3204	0
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-4.174	1205	0	2205	-12.162	3205	0
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	0	1206	0	2206	0	3206	0
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	-8.350	1208	0	2208	-22.721	3208	0
A) MARGEN DE INTERESES	0209	21.253	1209	0	2209	66.289	3209	0
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	0	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-21.178	1217	0	2217	-64.655	3217	0
7.1 Servicios exteriores	0218	-1	1218	0	2218	-480	3218	0
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	0	2219	-480	3219	0
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	-21.177	1224	0	2224	-64.175	3224	0
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-19	1225	0	2225	-57	3225	0
7.3.2 Comisión administrador	0226	-3.976	1226	0	2226	-12.513	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-5	1227	0	2227	-15	3227	0
7.3.4 Comisión variable	0228	-17.177	1228	0	2228	-51.590	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	0	1231	0	2231	0	3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	0	2232	0	3232	0
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	-75	1234	0	2234	-1.634	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	-75	1236	0	2236	-1.634	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	0	1238	0	2238	0	3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	0	1239	0	2239	0	3239	0
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: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2021		Acumulado anterior 30/09/2020
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-56	1300	0	2300	-203	3300	0
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	21.120	1301	0	2301	63.892	3301	0
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	33.645	1302	0	2302	101.559	3302	0
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-4.176	1303	0	2303	-13.228	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	-8.349	1305	0	2305	-24.439	3305	0
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	0	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-21.176	1309	0	2309	-64.095	3309	0
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-19	1310	0	2310	-63	3310	0
2.2 Comisión administrador	0311	-3.975	1311	0	2311	-12.426	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	0	2312	-16	3312	0
2.4 Comisión variable	0313	-17.177	1313	0	2313	-51.590	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	0	1315	0	2315	0	3315	0
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	56	1322	0	2322	-104.279	3322	0
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	1.693.500	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	-381.857	1324	0	2324	-2.965.390	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	381.913	1325	0	2325	1.168.296	3325	0
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	184.579	1326	0	2326	518.897	3326	0
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	197.286	1327	0	2327	649.287	3327	0
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	49	1328	0	2328	112	3328	0
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	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	0	1331	0	2331	0	3331	0
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-1	1332	0	2332	-686	3332	0
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	-200	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-1	1336	0	2336	-486	3336	0
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	0	1337	0	2337	-104.482	3337	0
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	120.000	1338	0	2338	224.482	3338	0
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	120.000	1339	0	2339	120.000	3339	0

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2021		Acumulado anterior 30/09/2020
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-8.349	1357	0	2357	-24.439	3357	0
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-8.349	1358	0	2358	-24.439	3358	0
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	8.350	1360	0	2360	22.721	3360	0
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	-1	1362	0	2362	1.718	3362	0
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: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2021								Situación cierre anual anterior 31/12/2020								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	0,04	0401	0,00	0421	0,00	0441	5,68	1381	0,00	1401	0,00	1421	0,00	1441	0,76	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	6,00
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: SOL LION II, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

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	71	0467	22	0474	3	0481	0	0488	25	0495	7.984	0502	0	0509	8.009
De 1 a 3 meses	0461	56	0468	35	0475	7	0482	0	0489	42	0496	5.722	0503	0	0510	5.764
De 3 a 6 meses	0462	35	0469	53	0476	9	0483	4	0490	65	0497	3.823	0504	0	0511	3.888
De 6 a 9 meses	0463	17	0470	36	0477	4	0484	5	0491	45	0498	1.621	0505	0	0512	1.666
De 9 a 12 meses	0464	7	0471	17	0478	3	0485	4	0492	23	0499	645	0506	0	0513	669
Más de 12 meses	0465	0	0472	0	0479	0	0486	0	0493	0	0500	0	0507	0	0514	0
Total	0466	186	0473	163	0480	25	0487	13	0494	201	0501	19.794	0508	0	1515	19.995

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	71	0522	22	0529	3	0536	0	0543	25	0550	7.984	0557	0	0564	8.009	0571	13.725	0578	13.725	0584	58,35
De 1 a 3 meses	0516	56	0523	35	0530	7	0537	0	0544	42	0551	5.722	0558	0	0565	5.764	0572	9.149	0579	9.149	0585	63,00
De 3 a 6 meses	0517	35	0524	53	0531	9	0538	4	0545	65	0552	3.823	0559	0	0566	3.888	0573	7.267	0580	7.267	0586	53,51
De 6 a 9 meses	0518	17	0525	36	0532	4	0539	5	0546	45	0553	1.621	0560	0	0567	1.666	0574	2.866	0581	2.866	0587	58,12
De 9 a 12 meses	0519	7	0526	17	0533	3	0540	4	0547	23	0554	645	0561	0	0568	669	0575	1.271	0582	1.271	0588	52,59
Más de 12 meses	0520	0	0527	0	0534	0	0541	0	0548	0	0555	0	0562	0	0569	0	0576	0	0583	0	0589	0,00
Total	0521	186	0528	163	0535	25	0542	13	0549	201	0556	19.794	0563	0	0570	19.995	0577	34.278			0590	58,33

S.05.1

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 25/11/2020	
Inferior a 1 año	0600	2.843	1600	1.292	2600	975
Entre 1 y 2 años	0601	11.837	1601	8.347	2601	8.632
Entre 2 y 3 años	0602	22.728	1602	18.883	2602	20.258
Entre 3 y 4 años	0603	39.662	1603	31.181	2603	34.068
Entre 4 y 5 años	0604	59.211	1604	47.164	2604	52.869
Entre 5 y 10 años	0605	586.562	1605	485.450	2605	540.322
Superior a 10 años	0606	14.906.368	1606	13.207.258	2606	13.768.481
Total	0607	15.629.211	1607	13.799.575	2607	14.425.606
Vida residual media ponderada (años)	0608	25,85	1608	26,01	2608	25,79

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 25/11/2020	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	5,61	1609	5,27	2609	5,44

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 25/11/2020			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	45.381	0630	2.612.761	1620	37.592	1630	2.207.081	2620	40.853	2630	2.401.942
40% - 60%	0621	41.676	0631	4.409.565	1621	36.942	1631	3.987.973	2621	38.805	2631	4.197.863
60% - 80%	0622	68.382	0632	8.351.599	1622	59.145	1632	7.261.501	2622	60.324	2632	7.420.206
80% - 100%	0623	1.891	0633	255.285	1623	2.797	1633	343.021	2623	3.283	2633	405.595
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	157.330	0638	15.629.211	1628	136.476	1638	13.799.575	2628	143.265	2638	14.425.606
Media ponderada (%)	0639	58,25	0649		1639	58,54	1649		2639	58,25	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 25/11/2020	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,94	1650	1,03	2650	1,02
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,67	1651	4,41	2651	4,41
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,00	2652	0,00

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 25/11/2020			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	26.747	0683	2.196.909	1660	24.446	1683	2.074.321	2660	25.798	2683	2.181.474
Aragón	0661	2.347	0684	190.125	1661	1.986	1684	164.164	2661	2.038	2684	169.227
Asturias	0662	1.388	0685	102.513	1662	1.257	1685	94.967	2662	1.294	2685	98.769
Baleares	0663	4.220	0686	514.211	1663	3.613	1686	439.255	2663	3.691	2686	449.647
Canarias	0664	7.364	0687	652.013	1664	6.320	1687	568.716	2664	6.548	2687	586.488
Cantabria	0665	1.300	0688	109.009	1665	1.169	1688	100.925	2665	1.210	2688	104.191
Castilla-León	0666	4.477	0689	357.823	1666	3.874	1689	316.666	2666	4.058	2689	332.846
Castilla La Mancha	0667	4.291	0690	361.116	1667	3.578	1690	305.431	2667	3.835	2690	326.690
Cataluña	0668	38.514	0691	4.527.752	1668	32.546	1691	3.860.612	2668	33.476	2691	3.975.503
Ceuta	0669	24	0692	1.751	1669	25	1692	1.793	2669	26	2692	1.912
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	0	1693	0	2670	0	2693	0
Galicia	0671	3.038	0694	239.773	1671	2.533	1694	204.472	2671	2.792	2694	223.152
Madrid	0672	44.321	0695	4.799.823	1672	38.338	1695	4.257.260	2672	40.701	2695	4.487.714
Melilla	0673	14	0696	964	1673	12	1696	807	2673	13	2696	911
Murcia	0674	3.097	0697	244.362	1674	2.455	1697	202.163	2674	2.835	2697	226.980
Navarra	0675	337	0698	30.855	1675	291	1698	26.560	2675	306	2698	28.167
La Rioja	0676	302	0699	24.293	1676	216	1699	18.304	2676	245	2699	20.109
Comunidad Valenciana	0677	13.748	0700	1.106.564	1677	12.282	1700	1.014.220	2677	12.721	2700	1.050.115
País Vasco	0678	1.801	0701	169.354	1678	1.535	1701	148.938	2678	1.678	2701	161.712
Total España	0679	157.330	0702	15.629.211	1679	136.476	1702	13.799.575	2679	143.265	2702	14.425.606
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	157.330	0705	15.629.211	1682	136.476	1705	13.799.575	2682	143.265	2705	14.425.606

SOL LION II, FT

S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION II, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2021
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 25/11/2020			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,08			1710	0,08			2710	0,08		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2021			Situación cierre anual anterior 31/12/2020			Situación inicial 25/11/2020					
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			
ES0305515001	BONO A1	52.623	100.000	5.262.300	46.965	100.000	4.696.500	52.623	100.000	5.262.300			
ES0305515019	BONO A2	10.525	100.000	1.052.500	9.393	100.000	939.300	10.525	100.000	1.052.500			
ES0305515027	BONO A3	39.993	100.000	3.999.300	35.693	100.000	3.569.300	39.993	100.000	3.999.300			
ES0305515035	BONO A4	10.523	100.000	1.052.300	9.392	100.000	939.200	10.523	100.000	1.052.300			
ES0305515043	BONO A5	8.420	100.000	842.000	7.514	100.000	751.400	8.420	100.000	842.000			
ES0305515050	BONO A6	12.786	100.000	1.278.600	11.412	100.000	1.141.200	12.786	100.000	1.278.600			
ES0305515068	BONO B	18.419	100.000	1.841.900	16.438	100.000	1.643.800	18.419	100.000	1.841.900			
ES0305515076	BONO C	4.211	100.000	421.100	3.758	100.000	375.800	4.211	100.000	421.100			
Total		0723	157.500	0724	15.750.000	1723	140.565	1724	14.056.500	2723	157.500	2724	15.750.000

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas					
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado	0738	0739					
													0730	0731	0732	0733	0734
ES0305515001	BONO A1	NS	EURIBOR 3M	0,25	0,00	0	0	SI	5.262.300	0	5.262.300	0					
ES0305515019	BONO A2	NS	EURIBOR 3M	0,35	0,00	0	0	SI	1.052.500	0	1.052.500	0					
ES0305515027	BONO A3	NS	EURIBOR 3M	0,45	0,00	0	0	SI	3.999.300	0	3.999.300	0					
ES0305515035	BONO A4	NS	EURIBOR 3M	0,55	0,01	0	0	SI	1.052.300	0	1.052.300	0					
ES0305515043	BONO A5	NS	EURIBOR 3M	0,65	0,11	5	0	SI	842.000	0	842.005	0					
ES0305515050	BONO A6	NS	EURIBOR 3M	0,75	0,21	15	0	SI	1.278.600	0	1.278.615	0					
ES0305515068	BONO B	S	EURIBOR 3M	1,00	0,46	47	0	SI	1.841.900	0	1.841.947	0					
ES0305515076	BONO C	S	EURIBOR 3M	1,50	0,96	22	0	SI	421.100	0	421.122	0					
Total						0740	89	0741	0	0743	15.750.000	0744	0	0745	15.750.089	0746	0

	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 25/11/2020	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,10	0748	0,11	0749	0,11

S.05.2
Denominación Fondo: SOL LION II, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2021
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2021								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2020							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0305515001	BONO A1	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
ES0305515019	BONO A2	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
ES0305515027	BONO A3	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
ES0305515035	BONO A4	0	0	32	151	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
ES0305515043	BONO A5	0	0	241	789	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
ES0305515050	BONO A6	0	0	693	2.213	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
ES0305515068	BONO B	0	0	2.175	6.841	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
ES0305515076	BONO C	0	0	1.035	3.234	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
Total		0754	0	0755	0	0756	4.176	0757	13.228	1754	0	1755	0	1756	0	1757	0

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/09/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 25/11/2020
				0760	0761	0762
ES0305515001	BONO A1	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515001	BONO A1	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515019	BONO A2	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515019	BONO A2	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515027	BONO A3	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515027	BONO A3	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515035	BONO A4	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515035	BONO A4	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515043	BONO A5	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515043	BONO A5	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515050	BONO A6	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515050	BONO A6	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515068	BONO B	04/12/2020	DBRS	NR	NR	NR
ES0305515068	BONO B	04/12/2020	FCH	NR	NR	NR
ES0305515076	BONO C	04/12/2020	DBRS	NR	NR	NR
ES0305515076	BONO C	04/12/2020	FCH	NR	NR	NR

S.05.2
Denominación Fondo: SOL LION II, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 30/09/2021
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 25/11/2020	
Inferior a 1 año	0765	0	1765	0	2765	0
Entre 1 y 2 años	0766	0	1766	0	2766	0
Entre 2 y 3 años	0767	209.796	1767	0	2767	0
Entre 3 y 4 años	0768	830.500	1768	729.481	2768	817.367
Entre 4 y 5 años	0769	810.201	1769	668.910	2769	749.499
Entre 5 y 10 años	0770	3.446.726	1770	3.232.854	2770	3.622.342
Superior a 10 años	0771	10.452.777	1771	9.425.256	2771	10.560.792
Total	0772	15.750.000	1772	14.056.500	2772	15.750.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	14,93	1773	17,63	2773	17,63

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 25/11/2020	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	120.000	1775	120.000	2775	120.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	120.000	1776	120.000	2776	120.000
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	0,76	1777	0,85	2777	0,76
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Ing Direct N.V.	1778	Ing Direct N.V.	2778	Ing Direct N.V.
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	85,63	1792	85,63	2792	85,63
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: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/09/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 25/11/2020	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Permuta Financiera de Intereses	Ing Direct N.V.	TRIMESTRAL	Tipos fijo 0,5%	Ver Nota S.06	Tipo Rerefencia de los Bonos	Ver Nota S.06	-164.417	-164.417		
Total							0808 - 164.417	0809 - 164.417	0810	

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 25/11/2020		Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 25/11/2020			
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: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	8.419	7006	0	7009	0,05	7012	0,00	7015	0,05		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	8.419	7008	0	7011	0,05	7014	0,00	7017	0,05	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	13	7020		7021	0	7024	0	7027	0,00	7030	0,00	7033	0,00		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	0	7026	0	7029	0,00	7032	0,00	7035	0,00	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
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: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862	19	2862		3862		4862		5862		6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	Ing Direct N.V.	1863	150	2863		3863		4863		5863		6863	TRIMESTRAL	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	Ing Direct N.V.	1864	5	2864		3864		4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: SOL LION II, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	Integrado en el pago de los intereses de los bonistas
Contrapartida	0870	Bonista
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Cláusula 13.4 Intereses de los Bonos Iniciales

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: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo								Total	
		29/03/2021	28/06/2021	28/09/2021							
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885										
Saldo inicial	0886	120.045	120.022	120.000							
Cobros del periodo	0887	507.566	451.037	415.558							
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-4.657	-4.201	-4.000							
Pagos por derivados	0889	-8.094	-7.997	-8.349							
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-120.000	-120.000	-120.000							
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-4.922	-4.130	-4.176							
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-200	0	0							
Resto pagos/retenciones	0893	-473.546	-416.487	-381.857							
Saldo disponible	0894	16.192	18.243	17.177							
Liquidación de comisión variable	0895	16.170	18.243	17.177							51.590

S.06

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2021

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

INFORME SOBRE EL CUMPLIMIENTO DE LAS POLÍTICAS DE GESTIÓN DE ACTIVOS Y DE RIESGOS