

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: 30/09/2023

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: 30/09/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	14.246.595	1001	15.153.727
I. Activos financieros a largo plazo	0002	14.246.595	1002	15.153.727
1. Activos titulizados	0003	13.886.603	1003	14.793.735
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	13.843.375	1005	14.769.714
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	43.239	1025	24.031
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-10	1027	-10
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	359.992	1029	359.992
2.1 Derivados de cobertura	0030	359.992	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	359.992
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: 30/09/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	2.156.729	1041	1.208.237
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	859.035	1043	1.044.860
1. Activos titulizados	0044	527.004	1044	620.891
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	478.534	1046	591.975
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	46.161	1065	27.515
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	92	1066	25
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	1.970	1067	1.309
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	259	1068	79
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-13	1069	-13
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	78.949	1071	78.949
2.1 Derivados de cobertura	0072	78.949	1072	78.949
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	253.081	1074	345.020
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	253.081	1077	345.020
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	1.297.694	1085	163.377
1. Tesorería	0086	1.297.694	1086	163.377
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	16.403.324	1088	16.361.965

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: 30/09/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	15.938.843	1089	15.914.518
I. Provisiones a largo plazo	0090	68.843	1090	44.518
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	68.843	1092	44.518
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	15.870.000	1094	15.870.000
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	15.750.000	1095	15.750.000
1.1 Series no subordinadas	0096	13.487.000	1096	13.487.000
1.2 Series subordinadas	0097	2.263.000	1097	2.263.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	0	1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	120.000	1101	120.000
2.1 Préstamo subordinado	0102	120.000	1102	120.000
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	0	1108	0
3.1 Derivados de cobertura	0109	0	1109	0
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: 30/09/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) PASIVO CORRIENTE	0117	26.108	1117	8.933
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	25.816	1123	8.851
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	22.646	1124	8.444
1.1 Series no subordinadas	0125	0	1125	0
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	3.895	1128	3.480
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	18.751	1129	4.964
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	3.170	1131	407
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	27	1136	407
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	3.143	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	0	1139	0
3.1 Derivados de cobertura	0140	0	1140	0
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	293	1148	82
1. Comisiones	0149	293	1149	76
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	0	1150	1
1.2 Comisión administrador	0151	292	1151	75
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
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	6
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	438.373	1158	438.513
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	438.373	1160	438.513
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	16.403.324	1162	16.361.965

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	142.382	1201	49.286	2201	382.546	3201	119.465
1.1 Activos titulizados	0202	142.382	1202	49.286	2202	382.546	3202	119.465
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-165.975	1204	-12.999	2204	-414.420	3204	-21.594
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-164.845	1205	-12.991	2205	-411.657	3205	-21.586
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1.130	1206	-8	2206	-2.763	3206	-8
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	23.791	1208	-5.523	2208	56.545	3208	-21.804
A) MARGEN DE INTERESES	0209	198	1209	30.764	2209	24.670	3209	76.067
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	-100	1217	-21.513	2217	-346	3217	-64.510
7.1 Servicios exteriores	0218	-1	1218	-1	2218	-50	3218	-35
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	-1	2219	-50	3219	-35
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	-99	1224	-21.512	2224	-296	3224	-64.475
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-21	1225	-20	2225	-64	3225	-61
7.3.2 Comisión administrador	0226	-73	1226	-73	2226	-217	3226	-217
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-5	1227	-5	2227	-15	3227	-15
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	-21.414	2228	0	3228	-64.182
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	-98	1234	-9.252	2234	-24.325	3234	-11.557
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	-98	1236	-9.252	2236	-24.325	3236	-11.557
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: 30/09/2023

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	3.762	1300	3.683	2300	22.522	3300	5.456
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	3.788	1301	25.194	2301	22.601	3301	69.931
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	139.172	1302	43.676	2302	363.652	3302	112.371
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-159.123	1303	-11.778	2303	-397.455	3303	-20.234
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	23.739	1304	0	2304	56.405	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	-5.765	2305	0	3305	-22.206
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	-939	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-26	1309	-21.512	2309	-79	3309	-64.476
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-21	1310	-20	2310	-64	3310	-61
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	-73	2311	0	3311	-218
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	-5	2312	-15	3312	-15
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	-21.414	2313	0	3313	-64.182
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	249.405	1322	-4.621	2322	1.111.794	3322	-5.460
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	-404.444	1324	-578.613	2324	-1.114.578	3324	-1.468.829
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	653.850	1325	573.993	2325	2.226.429	3325	1.463.410
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	153.614	1326	144.369	2326	479.911	3326	449.117
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	499.721	1327	429.496	2327	1.744.852	3327	1.013.909
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	515	1328	128	2328	1.667	3328	384
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	-1	2332	-56	3332	-41
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-1	1336	-1	2336	-56	3336	-41
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	253.167	1337	-938	2337	1.134.316	3337	-5
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	1.044.527	1338	120.939	2338	163.377	3338	120.005
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	1.297.694	1339	120.000	2339	1.297.694	3339	120.000

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2023		Acumulado anterior 30/09/2022
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	23.739	1357	-5.765	2357	56.405	3357	-22.206
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	23.739	1358	-5.765	2358	56.405	3358	-22.206
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	-23.791	1360	5.523	2360	-56.545	3360	21.804
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	52	1362	242	2362	140	3362	402
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: 30/09/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2023								Situación cierre anual anterior 31/12/2022								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	0,31	0401	0,00	0421	0,00	0441	16,10	1381	0,16	1401	0,00	1421	0,00	1441	11,28	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: 30/09/2023

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	192	0467	27	0474	31	0481	0	0488	58	0495	20.581	0502	0	0509	20.639
De 1 a 3 meses	0461	148	0468	56	0475	61	0482	0	0489	117	0496	15.921	0503	0	0510	16.038
De 3 a 6 meses	0462	130	0469	125	0476	104	0483	46	0490	276	0497	14.913	0504	0	0511	15.188
De 6 a 9 meses	0463	81	0470	134	0477	53	0484	61	0491	247	0498	8.965	0505	0	0512	9.212
De 9 a 12 meses	0464	49	0471	114	0478	36	0485	62	0492	212	0499	5.582	0506	0	0513	5.794
Más de 12 meses	0465	147	0472	778	0479	66	0486	298	0493	1.141	0500	14.600	0507	0	0514	15.741
Total	0466	747	0473	1.234	0480	352	0487	467	0494	2.052	0501	80.560	0508	0	1515	82.612

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	192	0522	27	0529	31	0536	0	0543	58	0550	20.581	0557	0	0564	20.639	0571	33.077	0578	33.077	0584	62,40
De 1 a 3 meses	0516	148	0523	56	0530	61	0537	0	0544	117	0551	15.921	0558	0	0565	16.038	0572	25.374	0579	25.374	0585	63,21
De 3 a 6 meses	0517	130	0524	125	0531	104	0538	46	0545	276	0552	14.913	0559	0	0566	15.188	0573	24.417	0580	24.417	0586	62,20
De 6 a 9 meses	0518	81	0525	134	0532	53	0539	61	0546	247	0553	8.965	0560	0	0567	9.212	0574	14.305	0581	14.305	0587	64,40
De 9 a 12 meses	0519	49	0526	114	0533	36	0540	62	0547	212	0554	5.582	0561	0	0568	5.794	0575	9.157	0582	9.157	0588	63,27
Más de 12 meses	0520	147	0527	778	0534	66	0541	298	0548	1.141	0555	14.600	0562	0	0569	15.741	0576	25.648	0583	25.648	0589	61,37
Total	0521	747	0528	1.234	0535	352	0542	467	0549	2.052	0556	80.560	0563	0	0570	82.612	0577	131.978			0590	62,60

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: 30/09/2023

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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 25/11/2020	
Inferior a 1 año	0600	4.221	1600	4.250	2600	721
Entre 1 y 2 años	0601	15.826	1601	13.896	2601	8.656
Entre 2 y 3 años	0602	29.799	1602	29.363	2602	20.558
Entre 3 y 4 años	0603	40.648	1603	42.207	2603	35.007
Entre 4 y 5 años	0604	53.962	1604	54.754	2604	54.055
Entre 5 y 10 años	0605	621.308	1605	618.110	2605	603.920
Superior a 10 años	0606	13.601.355	1606	14.624.449	2606	19.932.215
Total	0607	14.367.118	1607	15.387.029	2607	20.655.132
Vida residual media ponderada (años)	0608	25,27	1608	25,62	2608	27,05

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 25/11/2020	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	6,29	1609	5,98	2609	5,22

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

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 30/09/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				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	49.867	0630	2.774.852	1620	49.478	1630	2.745.856	2620	45.536	2630	2.789.742
40% - 60%	0621	40.480	0631	3.990.117	1621	42.319	1631	4.295.227	2621	47.814	2631	5.277.450
60% - 80%	0622	63.657	0632	7.559.008	1622	68.583	1632	8.256.605	2622	91.737	2632	11.809.053
80% - 100%	0623	308	0633	43.141	1623	646	1633	89.341	2623	5.676	2633	773.246
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	154.312	0638	14.367.118	1628	161.026	1638	15.387.029	2628	190.763	2638	20.649.491
Media ponderada (%)	0639	56,36	0649		1639	57,19	1649		2639	60,84	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: 30/09/2023

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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 25/11/2020	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,05	1650	1,31	2650	1,10
Tipo de interés nominal máximo	0651	8,50	1651	7,61	2651	6,34
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,75	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: 30/09/2023

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 30/09/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				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	26.972	0683	2.083.120	1660	27.920	1683	2.216.510	2660	33.008	2683	2.950.618
Aragón	0661	2.359	0684	177.173	1661	2.473	1684	192.737	2661	2.816	2684	245.374
Asturias	0662	1.257	0685	84.319	1662	1.358	1685	94.116	2662	1.608	2685	129.200
Baleares	0663	4.290	0686	503.802	1663	4.377	1686	522.138	2663	5.140	2686	674.254
Canarias	0664	7.390	0687	619.160	1664	7.556	1687	645.492	2664	8.574	2687	809.323
Cantabria	0665	1.329	0688	102.004	1665	1.375	1688	109.898	2665	1.621	2688	145.492
Castilla-León	0666	4.365	0689	322.160	1666	4.577	1689	348.333	2666	5.403	2689	462.639
Castilla La Mancha	0667	4.646	0690	374.090	1667	4.415	1690	358.719	2667	5.541	2690	504.392
Cataluña	0668	37.180	0691	4.158.788	1668	39.577	1691	4.504.820	2668	45.265	2691	5.763.069
Ceuta	0669	2	0692	329	1669	25	1692	1.867	2669	3	2692	446
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	0	1693	0	2670	24	2693	1.438
Galicia	0671	2.958	0694	218.191	1671	3.099	1694	234.326	2671	3.624	2694	313.361
Madrid	0672	40.443	0695	4.079.642	1672	43.572	1695	4.508.208	2672	53.030	2695	6.420.431
Melilla	0673	3	0696	355	1673	14	1696	946	2673	3	2696	376
Murcia	0674	3.104	0697	227.992	1674	3.207	1697	241.709	2674	3.674	2697	311.023
Navarra	0675	332	0698	30.279	1675	343	1698	30.359	2675	417	2698	43.654
La Rioja	0676	311	0699	24.414	1676	331	1699	26.722	2676	368	2699	32.341
Comunidad Valenciana	0677	15.768	0700	1.220.671	1677	15.050	1700	1.194.276	2677	18.640	2700	1.633.622
País Vasco	0678	1.603	0701	140.628	1678	1.757	1701	155.853	2678	2.041	2701	214.078
Total España	0679	154.312	0702	14.367.118	1679	161.026	1702	15.387.029	2679	190.800	2702	20.655.132
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	154.312	0705	14.367.118	1682	161.026	1705	15.387.029	2682	190.800	2705	20.655.132

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: 30/09/2023
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 25/11/2020			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,07			1710	0,07			2710	0,09		
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: 30/09/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			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	52.623	100.000	5.262.300	52.623	100.000	5.262.300			
ES0305515019	BONO A2	10.525	100.000	1.052.500	10.525	100.000	1.052.500	10.525	100.000	1.052.500			
ES0305515027	BONO A3	39.993	100.000	3.999.300	39.993	100.000	3.999.300	39.993	100.000	3.999.300			
ES0305515035	BONO A4	10.523	100.000	1.052.300	10.523	100.000	1.052.300	10.523	100.000	1.052.300			
ES0305515043	BONO A5	8.420	100.000	842.000	8.420	100.000	842.000	8.420	100.000	842.000			
ES0305515050	BONO A6	12.786	100.000	1.278.600	12.786	100.000	1.278.600	12.786	100.000	1.278.600			
ES0305515068	BONO B	18.419	100.000	1.841.900	18.419	100.000	1.841.900	18.419	100.000	1.841.900			
ES0305515076	BONO C	4.211	100.000	421.100	4.211	100.000	421.100	4.211	100.000	421.100			
Total		0723	157.500	0724	15.750.000	1723	157.500	1724	15.750.000	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: 30/09/2023

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					
			0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737							
ES0305515001	BONO A1	NS	EURIBOR 3M	0,25	4,19	1.225	0	SI	5.262.300	0	5.263.525	0					
ES0305515019	BONO A2	NS	EURIBOR 3M	0,35	4,29	251	0	SI	1.052.500	0	1.052.751	0					
ES0305515027	BONO A3	NS	EURIBOR 3M	0,45	4,39	976	0	SI	3.999.300	0	4.000.276	0					
ES0305515035	BONO A4	NS	EURIBOR 3M	0,55	4,49	263	0	SI	1.052.300	0	1.052.563	0					
ES0305515043	BONO A5	NS	EURIBOR 3M	0,65	4,59	215	0	SI	842.000	0	842.215	0					
ES0305515050	BONO A6	NS	EURIBOR 3M	0,75	4,69	333	0	SI	1.278.600	0	1.278.933	0					
ES0305515068	BONO B	S	EURIBOR 3M	1,00	4,94	506	1.745	SI	1.841.900	0	1.844.150	0					
ES0305515076	BONO C	S	EURIBOR 3M	1,50	5,44	127	17.006	SI	421.100	0	438.233	0					
Total						0740	3.895	0741	18.751	0743	15.750.000	0744	0	0745	15.772.646	0746	0

	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 25/11/2020	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	3,22	0748	0,76	0749	0,11

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: 30/09/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2023								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2022							
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	51.466	146.256	0	0	430	430								
ES0305515019	BONO A2	0	0	10.563	30.588	0	0	355	355								
ES0305515027	BONO A3	0	0	41.158	121.307	0	0	2.371	2.371								
ES0305515035	BONO A4	0	0	11.098	33.604	0	0	893	1.243								
ES0305515043	BONO A5	0	0	9.096	29.186	0	0	930	2.438								
ES0305515050	BONO A6	0	0	14.139	47.927	0	0	1.738	6.014								
ES0305515068	BONO B	0	0	21.605	80.288	0	0	3.681	16.985								
ES0305515076	BONO C	0	0	0	7.688	0	0	1.380	7.688								
Total		0754	0	0755	0	0756	159.123	0757	496.846	1754	0	1755	0	1756	11.778	1757	37.524

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: 30/09/2023

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 30/09/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	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

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: 30/09/2023

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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 25/11/2020	
Inferior a 1 año	0765	2.355.020	1765	0	2765	0
Entre 1 y 2 años	0766	2.541.809	1766	2.120.591	2766	0
Entre 2 y 3 años	0767	2.034.937	1767	1.876.925	2767	0
Entre 3 y 4 años	0768	1.663.362	1768	1.634.041	2768	817.367
Entre 4 y 5 años	0769	1.421.261	1769	1.432.405	2769	749.499
Entre 5 y 10 años	0770	5.733.612	1770	5.260.200	2770	3.622.342
Superior a 10 años	0771	0	1771	3.425.837	2771	10.560.792
Total	0772	15.750.000	1772	15.750.000	2772	15.750.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	5,42	1773	7,91	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: 30/09/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		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	0,76	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	85,53	1792	85,60	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: 30/09/2023

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 30/09/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	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	438.942	438.942		
Total							0808 438.942	0809 438.942	0810	

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 25/11/2020		Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		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: 30/09/2023

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 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	35.071	7006	21.234	7009	0,24	7012	0,14	7015	0,24		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	35.071	7008	21.234	7011	0,24	7014	0,14	7017	0,24	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	13	7020		7021	17.847	7024	8.594	7027	0,12	7030	0,06	7033	0,12		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	17.847	7026	8.594	7029	0,12	7032	0,06	7035	0,12	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2023

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: 30/09/2023

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	21	2862		3862		4862		5862		6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	Ing Direct N.V.	1863	73	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: 30/09/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

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: 30/09/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo						Total
		28/03/2023	28/06/2023	28/09/2023				
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885							
Saldo inicial	0886	163.332	697.105	1.044.527				
Cobros del periodo	0887	933.837	863.222	793.022				
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-31	-32	-28				
Pagos por derivados	0889	12.838	19.828	23.739				
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-120.000	-120.000	-120.000				
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-100.552	-137.780	-159.123				
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	0	0				
Resto pagos/retenciones	0893	-312.319	-397.816	-404.444				
Saldo disponible	0894	577.105	924.527	1.177.694				
Liquidación de comisión variable	0895	0	0	0				0

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: 30/09/2023

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