

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Número de registro del Fondo: 9395
NIF Fondo: V85683431
Denominación del compartimento:
Número de registro del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
NIF Gestora: A80352750
Fondo Abierto: NO
Fondo Privado: NO
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2020

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)

S.01
Denominación Fondo: SOL LION, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2020		Periodo anterior 31/12/2019
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	1.338.311	1001	1.383.394
I. Activos financieros a largo plazo	0002	1.338.311	1002	1.383.394
1. Activos titulizados	0003	1.318.785	1003	1.363.868
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	1.311.638	1005	1.357.100
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	7.147	1025	6.769
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	19.526	1029	19.526
2.1 Derivados de cobertura	0030	19.526	1030	19.526
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

S.01
Denominación Fondo: SOL LION, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	219.354	1041	236.172
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	144.491	1043	157.735
1. Activos titulizados	0044	124.410	1044	126.651
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	122.703	1046	125.165
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	124	1065	169
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	1	1066	1
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	1.576	1067	1.311
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	5	1068	5
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	5.706	1071	5.706
2.1 Derivados de cobertura	0072	5.706	1072	5.706
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	14.374	1074	25.378
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	14.374	1077	25.378
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	74.863	1085	78.437
1. Tesorería	0086	74.863	1086	78.437
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	1.557.665	1088	1.619.566

Denominación Fondo: SOL LION, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2020		Periodo anterior 31/12/2019
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	1.408.601	1089	1.468.134
I. Provisiones a largo plazo	0090	8.273	1090	7.737
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	8.273	1092	7.737
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	1.400.328	1094	1.460.397
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	1.341.689	1095	1.399.363
1.1 Series no subordinadas	0096	1.223.009	1096	1.275.836
1.2 Series subordinadas	0097	118.680	1097	123.527
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	58.639	1101	61.034
2.1 Préstamo subordinado	0102	58.639	1102	61.034
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

Denominación Fondo: SOL LION, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2020		Periodo anterior 31/12/2019
B) PASIVO CORRIENTE	0117	124.373	1117	126.573
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	124.352	1123	126.552
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	124.352	1124	126.552
1.1 Series no subordinadas	0125	124.279	1125	126.476
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	73	1128	76
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	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	20	1148	20
1. Comisiones	0149	13	1149	13
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	11	1150	11
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	2	1152	2
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	8	1157	8
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	24.692	1158	24.860
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	24.692	1160	24.860
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	1.557.665	1162	1.619.566

Denominación Fondo: SOL LION, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2020		Acumulado anterior 31/03/2019
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	386	1201	1.000	2201	386	3201	1.000
1.1 Activos titulizados	0202	386	1202	1.000	2202	386	3202	1.000
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-189	1204	-389	2204	-189	3204	-389
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-189	1205	-389	2205	-189	3205	-389
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	1.437	1208	1.522	2208	1.437	3208	1.522
A) MARGEN DE INTERESES	0209	1.634	1209	2.132	2209	1.634	3209	2.132
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	-1.098	1217	-2.568	2217	-1.098	3217	-2.568
7.1 Servicios exteriores	0218	-2	1218	-2	2218	-2	3218	-2
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-2	1219	-2	2219	-2	3219	-2
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	-1.095	1224	-2.566	2224	-1.095	3224	-2.566
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-30	1225	-30	2225	-30	3225	-30
7.3.2 Comisión administrador	0226	0	1226	0	2226	0	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-5	1227	-5	2227	-5	3227	-5
7.3.4 Comisión variable	0228	-1.060	1228	-2.531	2228	-1.060	3228	-2.531
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	-536	1234	435	2234	-536	3234	435
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	-536	1236	435	2236	-536	3236	435
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, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2020		Acumulado anterior 31/03/2019
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	411	1300	-254	2300	411	3300	-254
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	1.506	1301	2.312	2301	1.506	3301	2.312
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	430	1302	980	2302	430	3302	980
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-193	1303	-402	2303	-193	3303	-402
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	1.269	1304	1.734	2304	1.269	3304	1.734
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	0	2305	0	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	-1.095	1309	-2.566	2309	-1.095	3309	-2.566
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-30	1310	-30	2310	-30	3310	-30
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	0	2311	0	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	-5	2312	-5	3312	-5
2.4 Comisión variable	0313	-1.060	1313	-2.531	2313	-1.060	3313	-2.531
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	-3.984	1322	-4.602	2322	-3.984	3322	-4.602
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	0	1324	0	2324	0	3324	0
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	-1.587	1325	-2.015	2325	-1.587	3325	-2.015
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	42.457	1326	44.141	2326	42.457	3326	44.141
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	15.581	1327	17.836	2327	15.581	3327	17.836
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	247	1328	630	2328	247	3328	630
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	-59.871	1331	-64.623	2331	-59.871	3331	-64.623
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-2.397	1332	-2.587	2332	-2.397	3332	-2.587
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	-2.395	1334	-2.585	2334	-2.395	3334	-2.585
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-2	1336	-2	2336	-2	3336	-2
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-3.574	1337	-4.856	2337	-3.574	3337	-4.856
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	78.437	1338	88.499	2338	78.437	3338	88.499
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	74.863	1339	83.643	2339	74.863	3339	83.643

Denominación Fondo: SOL LION, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2020		Acumulado anterior 31/03/2019
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	1.269	1357	1.734	2357	1.269	3357	1.734
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	1.269	1358	1.734	2358	1.269	3358	1.734
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	-1.437	1360	-1.522	2360	-1.437	3360	-1.522
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	168	1362	-213	2362	168	3362	-213
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, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/03/2020								Situación cierre anual anterior 31/12/2019								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	0,60	0401	0,00	0421	0,00	0441	4,85	1381	0,54	1401	0,00	1421	0,00	1441	4,84	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	8,00
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	

Denominación Fondo: SOL LION, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

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	26	0467	23	0474	1	0481	0	0488	24	0495	1.389	0502	0	0509	1.413
De 1 a 3 meses	0461	24	0468	33	0475	0	0482	0	0489	33	0496	1.626	0503	0	0510	1.659
De 3 a 6 meses	0462	25	0469	44	0476	0	0483	0	0490	44	0497	1.749	0504	0	0511	1.793
De 6 a 9 meses	0463	9	0470	24	0477	0	0484	0	0491	25	0498	571	0505	0	0512	596
De 9 a 12 meses	0464	6	0471	29	0478	0	0485	0	0492	29	0499	331	0506	0	0513	360
Más de 12 meses	0465	66	0472	933	0479	5	0486	37	0493	975	0500	5.042	0507	0	0514	6.017
Total	0466	156	0473	1.085	0480	7	0487	38	0494	1.130	0501	10.708	0508	0	1515	11.838

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	26	0522	23	0529	1	0536	0	0543	24	0550	1.389	0557	0	0564	1.413	0571	5.633	0578	5.633	0584	25,09
De 1 a 3 meses	0516	24	0523	33	0530	0	0537	0	0544	33	0551	1.626	0558	0	0565	1.659	0572	5.380	0579	5.380	0585	30,83
De 3 a 6 meses	0517	25	0524	44	0531	0	0538	0	0545	44	0552	1.749	0559	0	0566	1.793	0573	5.269	0580	5.269	0586	34,02
De 6 a 9 meses	0518	9	0525	24	0532	0	0539	0	0546	25	0553	571	0560	0	0567	596	0574	1.770	0581	1.770	0587	33,67
De 9 a 12 meses	0519	6	0526	29	0533	0	0540	0	0547	29	0554	331	0561	0	0568	360	0575	1.381	0582	1.381	0588	26,08
Más de 12 meses	0520	66	0527	933	0534	5	0541	37	0548	975	0555	5.042	0562	0	0569	6.017	0576	14.560	0583	14.560	0589	41,33
Total	0521	156	0528	1.085	0535	7	0542	38	0549	1.130	0556	10.708	0563	0	0570	11.838	0577	33.993			0590	34,83

S.05.1

Denominación Fondo: SOL LION, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

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 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 14/05/2009	
Inferior a 1 año	0600	2.505	1600	2.687	2600	147
Entre 1 y 2 años	0601	5.906	1601	5.929	2601	759
Entre 2 y 3 años	0602	10.610	1602	10.968	2602	1.992
Entre 3 y 4 años	0603	13.265	1603	13.167	2603	4.699
Entre 4 y 5 años	0604	23.492	1604	22.241	2604	9.215
Entre 5 y 10 años	0605	204.401	1605	203.642	2605	139.111
Superior a 10 años	0606	1.182.887	1606	1.231.710	2606	4.344.077
Total	0607	1.443.064	1607	1.490.344	2607	4.500.000
Vida residual media ponderada (años)	0608	14,32	1608	14,50	2608	23,30

Antigüedad	Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 14/05/2009	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	13,57	1609	13,32	2609	2,83

S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2020
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 31/03/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 14/05/2009			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	18.484	0630	966.784	1620	18.666	1630	981.417	2620	15.343	2630	1.170.291
40% - 60%	0621	4.246	0631	459.548	1621	4.486	1631	487.237	2621	12.155	2631	1.533.714
60% - 80%	0622	123	0632	16.732	1622	158	1632	21.690	2622	10.010	2632	1.556.842
80% - 100%	0623	0	0633	0	1623	0	1633	0	2623	1.192	2633	239.153
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	22.853	0638	1.443.064	1628	23.310	1638	1.490.344	2628	38.700	2638	4.500.000
Media ponderada (%)	0639	32,92	0649		1639	33,35	1649		2639	53,21	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: SOL LION, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

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 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 14/05/2009	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,20	1650	0,24	2650	3,83
Tipo de interés nominal máximo	0651	5,05	1651	5,05	2651	6,00
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,01	1652	0,00	2652	2,20

S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2020
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 31/03/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 14/05/2009			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	4.627	0683	254.734	1660	4.714	1683	262.964	2660	7.635	2683	757.747
Aragón	0661	228	0684	11.948	1661	233	1684	12.282	2661	408	2684	42.201
Asturias	0662	269	0685	13.449	1662	278	1685	13.888	2662	478	2685	44.264
Baleares	0663	423	0686	30.328	1663	431	1686	31.219	2663	728	2686	92.532
Canarias	0664	629	0687	39.924	1664	640	1687	40.934	2664	1.005	2687	109.066
Cantabria	0665	189	0688	9.888	1665	195	1688	10.246	2665	341	2688	34.409
Castilla-León	0666	540	0689	26.453	1666	551	1689	27.394	2666	942	2689	93.273
Castilla La Mancha	0667	864	0690	53.638	1667	886	1690	55.406	2667	1.430	2690	159.270
Cataluña	0668	4.177	0691	311.542	1668	4.253	1691	321.176	2668	6.856	2691	924.455
Ceuta	0669	0	0692	0	1669	0	1692	0	2669	0	2692	0
Extremadura	0670	222	0693	9.777	1670	228	1693	10.115	2670	409	2693	34.214
Galicia	0671	456	0694	21.806	1671	466	1694	22.530	2671	780	2694	70.205
Madrid	0672	6.523	0695	451.694	1672	6.666	1695	467.432	2672	11.794	2695	1.522.156
Melilla	0673	0	0696	0	1673	0	1696	0	2673	0	2696	0
Murcia	0674	576	0697	33.787	1674	590	1697	35.317	2674	858	2697	91.710
Navarra	0675	49	0698	2.940	1675	50	1698	3.052	2675	95	2698	11.033
La Rioja	0676	42	0699	2.318	1676	42	1699	2.371	2676	68	2699	7.288
Comunidad Valenciana	0677	2.729	0700	150.990	1677	2.769	1700	155.435	2677	4.323	2700	441.977
País Vasco	0678	310	0701	17.847	1678	318	1701	18.586	2678	550	2701	64.199
Total España	0679	22.853	0702	1.443.064	1679	23.310	1702	1.490.344	2679	38.700	2702	4.500.000
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	22.853	0705	1.443.064	1682	23.310	1705	1.490.344	2682	38.700	2705	4.500.000

SOL LION, FTA

S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2020
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/03/2020				Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Situación inicial 14/05/2009			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,36			1710	0,35			2710	0,26		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: SOL LION, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2020

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2020			Situación cierre anual anterior 31/12/2019			Situación inicial 14/05/2009					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Nominal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0317104000	SERIE A	43.200	31.187	1.347.288	43.200	32.461	1.402.312	43.200	100.000	4.320.000			
ES0317104018	SERIE B	900	65.933	59.340	900	68.626	61.764	900	100.000	90.000			
ES0317104026	SERIE C	900	65.933	59.340	900	68.626	61.764	900	100.000	90.000			
Total		0723	45.000	0724	1.465.968	1723	45.000	1724	1.525.839	2723	45.000	2724	4.500.000

S.05.2
Denominación Fondo: SOL LION, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/03/2020
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	0735			0742	0736
ES0317104000	SERIE A	NS	EURIBOR 3 m	0,35	0,00	0	0	SI	1.347.288	0	1.347.288	0	0	0	0		
ES0317104018	SERIE B	S	EURIBOR 3 m	0,80	0,39	23	0	SI	59.340	0	59.363	0	0	0	0		
ES0317104026	SERIE C	S	EURIBOR 3 m	1,25	0,84	50	0	SI	59.340	0	59.390	0	0	0	0		
Total						0740	73	0741	0	0743	1.465.968	0744	0	0745	1.466.041	0746	0

	Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 14/05/2009	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,06	0748	0,08	0749	1,62

SOL LION, FTA

S.05.2
Denominación Fondo: SOL LION, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/03/2020
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2020								Situación periodo comparativo anterior 31/03/2019							
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								
ES0317104000	SERIE A	55.024	2.972.712	0	221.709	59.391	2.781.160	142	221.419								
ES0317104018	SERIE B	2.424	30.660	61	10.012	2.616	22.223	89	9.726								
ES0317104026	SERIE C	2.424	30.660	131	14.214	2.616	22.223	172	13.634								
Total		0754	59.871	0755	3.034.032	0756	193	0757	245.935	1754	64.623	1755	2.825.606	1756	402	1757	244.779

S.05.2
Denominación Fondo: SOL LION, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Periodo de la declaración: 31/03/2020
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 31/03/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 14/05/2009
				0762	0763	0764
ES0317104000	SERIE A	07/08/2014	FCH	AA+	AA+	
ES0317104000	SERIE A	17/05/2018	SYP	AAA	AAA	AAA
ES0317104018	SERIE B	16/03/2017	FCH	AA-	AA-	
ES0317104018	SERIE B	29/05/2019	SYP	AA+	AA+	A
ES0317104026	SERIE C	01/03/2018	FCH	A+	A+	
ES0317104026	SERIE C	29/05/2019	SYP	AA	AA	BBB

SOL LION, FTA

S.05.2

Denominación Fondo: SOL LION, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 31/03/2020

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 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 14/05/2009	
Inferior a 1 año	0765	122.111	1765	123.793	2765	158.861
Entre 1 y 2 años	0766	112.429	1766	113.527	2766	178.204
Entre 2 y 3 años	0767	110.020	1767	111.454	2767	181.448
Entre 3 y 4 años	0768	107.527	1768	109.133	2768	184.486
Entre 4 y 5 años	0769	104.885	1769	107.018	2769	186.856
Entre 5 y 10 años	0770	454.988	1770	469.874	2770	942.821
Superior a 10 años	0771	454.008	1771	491.041	2771	2.667.325
Total	0772	1.465.968	1772	1.525.839	2772	4.500.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	10,15	1773	10,40	2773	23,78

Denominación Fondo: SOL LION, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 14/05/2009	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	58.639	1775	61.034	2775	67.500
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	58.639	1776	61.034	2776	67.500
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	4,00	1777	4,00	2777	1,50
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	ING	1778	ING	2778	ING
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	91,90	1792	91,90	2792	96,00
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

SOL LION, FTA

S.05.3

Denominación Fondo: SOL LION, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

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 31/03/2020	Situación cierre anual anterior 31/12/2019	Situación inicial 14/05/2009	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Pago interés recibido cartera/Recibo interes sobre cartera	ING	TRIMESTRAL	Tipos Interés de la cartera	Saldo Nominal Pendiente de Cobro de los préstamos al inicio del periodo	Tipo de Referencia de los Bonos + MMP + 0,50%	Saldo Nominal Pendiente de Vencimiento no Fallido al inicio del periodo	25.233	25.233		
Total							0808 25.233	0809 25.233	0810	

Denominación Fondo: SOL LION, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

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 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 14/05/2009		Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación inicial 14/05/2009			
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, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

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 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019		Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	2.913	7006	3.928	7009	0,20	7012	0,26	7015	0,25		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	2.913	7008	3.928	7011	0,20	7014	0,26	7017	0,25	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	18	7020		7021	7.370	7024	6.818	7027	0,51	7030	0,46	7033	0,48		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	224	7025	229	7028	0,02	7031	0,02	7034	0,02		
Total Fallidos					7023	7.594	7026	7.047	7029	0,53	7032	0,47	7035	0,49	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 31/03/2020		Situación cierre anual anterior 31/12/2019			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

Denominación Fondo: SOL LION, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO


CUADRO B

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
SERIE B - ES0317104018	4,00	4,05	4,05	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE B - ES0317104018	10,00	31,90	32,58	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE C - ES0317104026	4,00	4,05	4,05	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE C - ES0317104026	2,00	0,20	0,18	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE B - ES0317104018	2,50	0,20	0,18	Nota de Valores 4.9.2.2
SERIE C - ES0317104026	10,00	31,90	32,58	Nota de Valores 4.9.2.2
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
SERIE C - ES0317104026	7,50	0,72	0,71	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.5.2.2
SERIE B - ES0317104018	10,00	0,72	0,71	Modulo Adicional a la Nota de Valores 3.4.5.2.2
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
		4,00	4,00	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

Denominación Fondo: SOL LION, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

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	28	2862		3862		4862		5862		6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863		1863		2863		3863		4863		5863		6863		7863		8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	ING Direct NV, Sucursal en España	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, FTA
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/03/2020

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	ING
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	Módulo Adicional 3.4.3.2

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													

SOL LION, FTA

S.05.5

Denominación Fondo: SOL LION, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885	24/02/2020											
Saldo inicial	0886	61.034											
Cobros del periodo	0887	61.161											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-37											
Pagos por derivados	0889	0											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-58.639											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-60.064											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-2.395											
Resto pagos/retenciones	0893	0											
Saldo disponible	0894	1.060											
Liquidación de comisión variable	0895	1.060											1.060

Denominación Fondo: SOL LION, FTA

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2020

NOTAS EXPLICATIVAS



INFORME DE AUDITOR

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