

**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: 31/03/2023

**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)

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: 31/03/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	14.724.514	1001	15.153.727
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	14.724.514	1002	15.153.727
1. Activos titulizados	0003	14.364.521	1003	14.793.735
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	14.335.709	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	28.822	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	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	359.992	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
<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0039	0	1039	0
<b>III. Otros activos no corrientes</b>	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: 31/03/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	1.658.616	1041	1.208.237
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042	0	1042	0
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	961.511	1043	1.044.860
1. Activos titulizados	0044	568.157	1044	620.891
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	529.236	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	37.367	1065	27.515
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	42	1066	25
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	1.406	1067	1.309
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	118	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	314.404	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	314.404	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	
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
<b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b>	0085	697.105	1085	163.377
1. Tesorería	0086	697.105	1086	163.377
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	16.383.130	1088	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: 31/03/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	15.930.135	1089	15.914.518
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0090	60.135	1090	44.518
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	60.135	1092	44.518
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	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
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	0116	0	1116	0

<b>S.01</b>
<b>Denominación Fondo: SOL LION II, FT</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 31/03/2023</b>

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/03/2023		Periodo anterior 31/12/2022
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	14.701	1117	8.933
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0118	0	1118	0
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	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
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	0123	14.548	1123	8.851
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	13.460	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	4.640	1128	3.480
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	8.820	1129	4.964
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	1.088	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	1.088	1136	407
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
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	0148	152	1148	82
1. Comisiones	0149	148	1149	76
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	1	1150	1
1.2 Comisión administrador	0151	148	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	4	1157	6
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158	438.295	1158	438.513
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159	0	1159	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	438.295	1160	438.513
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161	0	1161	0
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	16.383.130	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: 31/03/2023

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2023		Acumulado anterior 31/03/2022
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	108.955	1201	33.821	2201	108.955	3201	33.821
1.1 Activos titulizados	0202	108.955	1202	33.821	2202	108.955	3202	33.821
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-106.249	1204	-3.560	2204	-106.249	3204	-3.560
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-105.568	1205	-3.560	2205	-105.568	3205	-3.560
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-681	1206	0	2206	-681	3206	0
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0208	13.056	1208	-8.517	2208	13.056	3208	-8.517
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	15.762	1209	21.744	2209	15.762	3209	21.744
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	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
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0217	-146	1217	-21.699	2217	-146	3217	-21.699
7.1 Servicios exteriores	0218	-47	1218	-27	2218	-47	3218	-27
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-47	1219	-27	2219	-47	3219	-27
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	-21.672	2224	-99	3224	-21.672
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-21	1225	-20	2225	-21	3225	-20
7.3.2 Comisión administrador	0226	-73	1226	-73	2226	-73	3226	-73
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-5	1227	-5	2227	-5	3227	-5
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	-21.575	2228	0	3228	-21.575
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
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	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
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	0234	-15.616	1234	-44	2234	-15.616	3234	-44
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	-15.616	1236	-44	2236	-15.616	3236	-44
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0238	0	1238	0	2238	0	3238	0
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0239	0	1239	0	2239	0	3239	0
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	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: 31/03/2023

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2023		Acumulado anterior 31/03/2022
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	11.306	1300	97	2300	11.306	3300	97
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	11.332	1301	21.770	2301	11.332	3301	21.770
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	99.046	1302	33.831	2302	99.046	3302	33.831
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-100.552	1303	-3.517	2303	-100.552	3303	-3.517
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	12.838	1304	0	2304	12.838	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	-8.545	2305	0	3305	-8.545
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
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	0309	-26	1309	-21.672	2309	-26	3309	-21.672
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-21	1310	-20	2310	-21	3310	-20
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	-73	2311	0	3311	-73
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	-5	2312	-5	3312	-5
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	-21.575	2313	0	3313	-21.575
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>	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>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>	0322	522.422	1322	-102	2322	522.422	3322	-102
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	0324	-312.319	1324	-419.456	2324	-312.319	3324	-419.456
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b>	0325	834.791	1325	419.381	2325	834.791	3325	419.381
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	171.331	1326	181.531	2326	171.331	3326	181.531
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	662.774	1327	237.731	2327	662.774	3327	237.731
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	686	1328	118	2328	686	3328	118
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
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	0332	-49	1332	-27	2332	-49	3332	-27
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	-49	1336	-27	2336	-49	3336	-27
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	0337	533.728	1337	-5	2337	533.728	3337	-5
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	163.377	1338	120.005	2338	163.377	3338	120.005
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	697.105	1339	120.000	2339	697.105	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: 31/03/2023

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (1. trimestre)		P. corriente anterior (1. trimestre)		Acumulado actual 31/03/2023		Acumulado anterior 31/03/2022
<b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>								
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
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>0356</b>	<b>0</b>	<b>1356</b>	<b>0</b>	<b>2356</b>	<b>0</b>	<b>3356</b>	<b>0</b>
<b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	12.838	1357	-8.545	2357	12.838	3357	-8.545
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	12.838	1358	-8.545	2358	12.838	3358	-8.545
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	-13.056	1360	8.517	2360	-13.056	3360	8.517
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	219	1362	27	2362	219	3362	27
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>0363</b>	<b>0</b>	<b>1363</b>	<b>0</b>	<b>2363</b>	<b>0</b>	<b>3363</b>	<b>0</b>
<b>3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>								
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
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>0369</b>	<b>0</b>	<b>1369</b>	<b>0</b>	<b>2369</b>	<b>0</b>	<b>3369</b>	<b>0</b>
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>0370</b>	<b>0</b>	<b>1370</b>	<b>0</b>	<b>2370</b>	<b>0</b>	<b>3370</b>	<b>0</b>



Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 31/03/2023								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	0,20	0401	0,00	0421	0,00	0441	14,09	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	

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

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	152	0467	22	0474	15	0481	0	0488	37	0495	14.987	0502	0	0509	15.024
De 1 a 3 meses	0461	109	0468	51	0475	27	0482	0	0489	78	0496	11.374	0503	0	0510	11.452
De 3 a 6 meses	0462	86	0469	93	0476	35	0483	10	0490	138	0497	9.439	0504	0	0511	9.577
De 6 a 9 meses	0463	59	0470	130	0477	26	0484	33	0491	189	0498	6.065	0505	0	0512	6.254
De 9 a 12 meses	0464	41	0471	119	0478	16	0485	30	0492	166	0499	4.169	0506	0	0513	4.335
Más de 12 meses	0465	97	0472	449	0479	41	0486	175	0493	666	0500	9.763	0507	0	0514	10.429
<b>Total</b>	0466	<b>544</b>	0473	<b>865</b>	0480	<b>161</b>	0487	<b>248</b>	0494	<b>1.274</b>	0501	<b>55.798</b>	0508	<b>0</b>	1515	<b>57.072</b>

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	152	0522	22	0529	15	0536	0	0543	37	0550	14.987	0557	0	0564	15.024	0571	26.339	0578	26.339	0584	57,04
De 1 a 3 meses	0516	109	0523	51	0530	27	0537	0	0544	78	0551	11.374	0558	0	0565	11.452	0572	18.464	0579	18.464	0585	62,03
De 3 a 6 meses	0517	86	0524	93	0531	35	0538	10	0545	138	0552	9.439	0559	0	0566	9.577	0573	15.259	0580	15.259	0586	62,76
De 6 a 9 meses	0518	59	0525	130	0532	26	0539	33	0546	189	0553	6.065	0560	0	0567	6.254	0574	11.575	0581	11.575	0587	54,03
De 9 a 12 meses	0519	41	0526	119	0533	16	0540	30	0547	166	0554	4.169	0561	0	0568	4.335	0575	7.268	0582	7.268	0588	59,65
Más de 12 meses	0520	97	0527	449	0534	41	0541	175	0548	666	0555	9.763	0562	0	0569	10.429	0576	15.875	0583	15.875	0589	65,69
<b>Total</b>	0521	<b>544</b>	0528	<b>865</b>	0535	<b>161</b>	0542	<b>248</b>	0549	<b>1.274</b>	0556	<b>55.798</b>	0563	<b>0</b>	0570	<b>57.072</b>	0577	<b>94.781</b>			0590	<b>60,21</b>

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: 31/03/2023

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 31/03/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 25/11/2020	
Inferior a 1 año	0600	3.818	1600	4.250	2600	975
Entre 1 y 2 años	0601	13.942	1601	13.896	2601	8.632
Entre 2 y 3 años	0602	29.742	1602	29.363	2602	20.258
Entre 3 y 4 años	0603	40.248	1603	42.207	2603	34.068
Entre 4 y 5 años	0604	53.665	1604	54.754	2604	52.869
Entre 5 y 10 años	0605	609.803	1605	618.110	2605	540.322
Superior a 10 años	0606	14.143.955	1606	14.624.449	2606	13.768.481
<b>Total</b>	0607	<b>14.895.173</b>	1607	<b>15.387.029</b>	2607	<b>14.425.606</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	0608	<b>25,51</b>	1608	<b>25,62</b>	2608	<b>25,94</b>

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 31/03/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 25/11/2020	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	6,11	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: 31/03/2023

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 31/03/2023				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	49.211	0630	2.725.700	1620	49.478	1630	2.745.856	2620	41.763	2630	2.506.123
40% - 60%	0621	41.456	0631	4.144.293	1621	42.319	1631	4.295.227	2621	39.733	2631	4.312.255
60% - 80%	0622	66.590	0632	7.955.851	1622	68.583	1632	8.256.605	2622	63.953	2632	7.971.846
80% - 100%	0623	513	0633	69.329	1623	646	1633	89.341	2623	3.369	2633	418.462
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
<b>Total</b>	0628	<b>157.770</b>	0638	<b>14.895.173</b>	1628	<b>161.026</b>	1638	<b>15.387.029</b>	2628	<b>148.818</b>	2638	<b>15.208.685</b>
<b>Media ponderada (%)</b>	0639	<b>56,93</b>	0649		1639	<b>57,19</b>	1649		2639	<b>58,54</b>	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:** 31/03/2023

**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 31/03/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 25/11/2020	
Tipo de interés medio ponderado	0650	1,81	1650	1,31	2650	1,07
Tipo de interés nominal máximo	0651	7,63	1651	7,61	2651	5,67
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,00	2652	0,00

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

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 31/03/2023				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	27.493	0683	2.165.357	1660	27.920	1683	2.216.510	2660	25.798	2683	2.181.474
Aragón	0661	2.438	0684	188.240	1661	2.473	1684	192.737	2661	2.038	2684	169.227
Asturias	0662	1.311	0685	90.573	1662	1.358	1685	94.116	2662	1.294	2685	98.769
Baleares	0663	4.348	0686	512.227	1663	4.377	1686	522.138	2663	3.691	2686	449.647
Canarias	0664	7.489	0687	633.405	1664	7.556	1687	645.492	2664	6.548	2687	586.488
Cantabria	0665	1.352	0688	106.411	1665	1.375	1688	109.898	2665	1.210	2688	104.191
Castilla-León	0666	4.463	0689	336.352	1666	4.577	1689	348.333	2666	4.058	2689	332.846
Castilla La Mancha	0667	4.364	0690	353.712	1667	4.415	1690	358.719	2667	3.835	2690	326.690
Cataluña	0668	38.868	0691	4.376.597	1668	39.577	1691	4.504.820	2668	33.476	2691	3.975.503
Ceuta	0669	21	0692	1.516	1669	25	1692	1.867	2669	26	2692	1.912
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	0	1693	0	2670	0	2693	0
Galicia	0671	3.040	0694	226.111	1671	3.099	1694	234.326	2671	2.792	2694	223.152
Madrid	0672	42.109	0695	4.286.509	1672	43.572	1695	4.508.208	2672	40.701	2695	4.487.714
Melilla	0673	13	0696	899	1673	14	1696	946	2673	13	2696	911
Murcia	0674	3.161	0697	236.042	1674	3.207	1697	241.709	2674	2.835	2697	226.980
Navarra	0675	336	0698	29.675	1675	343	1698	30.359	2675	306	2698	28.167
La Rioja	0676	326	0699	25.905	1676	331	1699	26.722	2676	245	2699	20.109
Comunidad Valenciana	0677	14.928	0700	1.176.792	1677	15.050	1700	1.194.276	2677	12.721	2700	1.050.115
País Vasco	0678	1.710	0701	148.848	1678	1.757	1701	155.853	2678	1.678	2701	161.712
<b>Total España</b>	0679	<b>157.770</b>	0702	<b>14.895.173</b>	1679	<b>161.026</b>	1702	<b>15.387.029</b>	2679	<b>143.265</b>	2702	<b>14.425.606</b>
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
<b>Total general</b>	0682	<b>157.770</b>	0705	<b>14.895.173</b>	1682	<b>161.026</b>	1705	<b>15.387.029</b>	2682	<b>143.265</b>	2705	<b>14.425.606</b>

SOL LION II, FT

<b>S.05.1</b>
<b>Denominación Fondo:</b> SOL LION II, FT
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b> Titulización de Activos, SGFT, S.A.
<b>Estados agregados:</b> NO
<b>Fecha:</b> 31/03/2023
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados:</b> ING DIRECT

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 31/03/2023				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: 31/03/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

**INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS**

**CUADRO A**

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2023			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			
<b>Total</b>		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: 31/03/2023

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					
													0730	0731	0732	0733	0734
ES0305515001	BONO A1	NS	EURIBOR 3M	0,25	3,28	1.436	0	SI	5.262.300	0	5.263.736	0					
ES0305515019	BONO A2	NS	EURIBOR 3M	0,35	3,38	296	0	SI	1.052.500	0	1.052.796	0					
ES0305515027	BONO A3	NS	EURIBOR 3M	0,45	3,48	1.158	0	SI	3.999.300	0	4.000.458	0					
ES0305515035	BONO A4	NS	EURIBOR 3M	0,55	3,58	313	0	SI	1.052.300	0	1.052.613	0					
ES0305515043	BONO A5	NS	EURIBOR 3M	0,65	3,68	258	0	SI	842.000	0	842.258	0					
ES0305515050	BONO A6	NS	EURIBOR 3M	0,75	3,78	402	0	SI	1.278.600	0	1.279.002	0					
ES0305515068	BONO B	S	EURIBOR 3M	1,00	4,03	618	2.147	SI	1.841.900	0	1.844.664	0					
ES0305515076	BONO C	S	EURIBOR 3M	1,50	4,53	159	6.673	SI	421.100	0	427.932	0					
<b>Total</b>						0740	4.640	0741	8.820	0743	15.750.000	0744	0	0745	15.763.460	0746	0

	Situación actual 31/03/2023		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	1,47	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: 31/03/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/03/2023								Situación periodo comparativo anterior 31/03/2022							
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	31.455	50.748	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0		
ES0305515019	BONO A2	0	0	6.554	10.948	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0		
ES0305515027	BONO A3	0	0	25.905	44.633	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0		
ES0305515035	BONO A4	0	0	7.079	12.892	0	0	0	0	0	0	0	0	170	0		
ES0305515043	BONO A5	0	0	5.875	12.183	0	0	0	0	133	0	0	133	1.149	0		
ES0305515050	BONO A6	0	0	9.241	21.454	0	0	0	0	521	0	0	521	3.403	0		
ES0305515068	BONO B	0	0	14.441	39.396	0	0	0	0	1.902	0	0	1.902	10.870	0		
ES0305515076	BONO C	0	0	0	7.688	0	0	0	0	961	0	0	961	5.214	0		
<b>Total</b>		0754	0755	0756	0757	1754	1755	1756	1757	0	0	0	0	3.517	20.807		

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: 31/03/2023

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 31/03/2023	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: 31/03/2023

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 31/03/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 25/11/2020	
Inferior a 1 año	0765	671.416	1765	0	2765	0
Entre 1 y 2 años	0766	2.438.900	1766	2.120.591	2766	0
Entre 2 y 3 años	0767	2.026.397	1767	1.876.925	2767	0
Entre 3 y 4 años	0768	1.704.818	1768	1.634.041	2768	817.367
Entre 4 y 5 años	0769	1.451.602	1769	1.432.405	2769	749.499
Entre 5 y 10 años	0770	5.103.357	1770	5.260.200	2770	3.622.342
Superior a 10 años	0771	2.353.511	1771	3.425.837	2771	10.560.792
<b>Total</b>	<b>0772</b>	<b>15.750.000</b>	<b>1772</b>	<b>15.750.000</b>	<b>2772</b>	<b>15.750.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>0773</b>	<b>6,65</b>	<b>1773</b>	<b>7,91</b>	<b>2773</b>	<b>17,63</b>

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 31/03/2023		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	85,58	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: 31/03/2023

**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 31/03/2023	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		
<b>Total</b>							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: 31/03/2023

**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 31/03/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 25/11/2020		Situación actual 31/03/2023		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			
<b>Total</b>	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: 31/03/2023

**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 31/03/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación actual 31/03/2023		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	19.840	7006	21.234	7009	0,13	7012	0,14	7015	0,12		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	19.840	7008	21.234	7011	0,13	7014	0,14	7017	0,12	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	13	7020		7021	10.848	7024	8.594	7027	0,07	7030	0,06	7033	0,07		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	10.848	7026	8.594	7029	0,07	7032	0,06	7035	0,07	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 31/03/2023		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: 31/03/2023

**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: 31/03/2023

**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	

<b>S.05.5</b>
<b>Denominación Fondo: SOL LION II, FT</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 31/03/2023</b>

**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												
<b>Ingresos y gastos del periodo de cálculo</b>	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													
<b>Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)</b>	0878													
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879													
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880													
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881													
<b>Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]</b>	0882													
Comisión variable pagada	0883													
<b>Comisión variable impagada en el periodo de cálculo</b>	0884													

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/03/2023

**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	28/03/2023											
Saldo inicial	0886	163.332											
Cobros del periodo	0887	933.837											
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-31											
Pagos por derivados	0889	12.838											
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-120.000											
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-100.552											
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0											
Resto pagos/retenciones	0893	-312.319											
Saldo disponible	0894	577.105											
Liquidación de comisión variable	0895	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: 31/03/2023

**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**