

**I. DATOS IDENTIFICATIVOS**

Denominación del Fondo: SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION  
Número de registro del Fondo: 11140  
NIF Fondo: V02673549  
Denominación del compartimento:  
Número de registro del compartimento:  
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.  
NIF Gestora: A80352750  
Fondo Abierto: SI  
Fondo Privado: NO  
Estados agregados: NO  
Fecha: 30/09/2024

**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: 30/09/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2024		Periodo anterior 31/12/2023
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	16.083.842	1001	16.015.542
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	16.083.842	1002	16.015.542
1. Activos titulizados	0003	15.056.811	1003	14.988.511
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	15.005.100	1005	14.937.123
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	51.723	1025	51.400
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-12	1027	-12
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	1.027.031	1029	1.027.031
2.1 Derivados de cobertura	0030	1.027.031	1030	1.027.031
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
<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0039	0	1039	0
<b>III. Otros activos no corrientes</b>	0040	0	1040	0

S.01

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2024		Periodo anterior 31/12/2023
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	1.076.477	1041	1.116.551
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042	0	1042	0
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	923.404	1043	996.550
1. Activos titulizados	0044	590.734	1044	567.017
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	540.595	1046	516.980
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	44.889	1065	47.388
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	309	1066	89
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	4.186	1067	2.239
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	778	1068	344
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-22	1069	-22
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	136.390	1071	136.390
2.1 Derivados de cobertura	0072	136.390	1072	136.390
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	196.279	1074	293.142
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	196.279	1077	293.142
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	153.074	1085	120.001
1. Tesorería	0086	153.074	1086	120.001
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	17.160.320	1088	17.132.093

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2024		Periodo anterior 31/12/2023
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	15.419.044	1089	15.933.972
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0090	93.825	1090	63.972
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	93.825	1092	63.972
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0094	15.325.219	1094	15.870.000
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	15.205.219	1095	15.750.000
1.1 Series no subordinadas	0096	12.942.219	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

S.01

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2024		Periodo anterior 31/12/2023
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	577.854	1117	36.056
<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	544.781	1123	35.683
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	544.781	1124	31.274
1.1 Series no subordinadas	0125	544.781	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	0	1128	5.830
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	0	1129	25.444
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	0	1131	4.409
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	40
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	4.369
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	33.073	1148	373
1. Comisiones	0149	0	1149	366
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	0	1150	1
1.2 Comisión administrador	0151	0	1151	365
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	33.073	1157	7
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158	1.163.421	1158	1.162.065
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159	0	1159	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	1.163.421	1160	1.162.065
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161	0	1161	0
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	17.160.320	1162	17.132.093

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2024		Acumulado anterior 30/09/2023
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	143.361	1201	142.382	2201	440.739	3201	382.546
1.1 Activos titulizados	0202	143.361	1202	142.382	2202	440.739	3202	382.546
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-171.535	1204	-165.975	2204	-526.347	3204	-414.420
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-170.363	1205	-164.845	2205	-522.740	3205	-411.657
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1.172	1206	-1.130	2206	-3.608	3206	-2.763
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	47.271	1208	23.791	2208	133.701	3208	56.545
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	19.097	1209	198	2209	48.093	3209	24.670
<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	-17.478	1217	-100	2217	-18.225	3217	-346
7.1 Servicios exteriores	0218	-1	1218	-1	2218	-119	3218	-50
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	-1	2219	-119	3219	-50
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	-17.478	1224	-99	2224	-18.107	3224	-296
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-22	1225	-21	2225	-65	3225	-64
7.3.2 Comisión administrador	0226	-71	1226	-73	2226	-216	3226	-217
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-5	1227	-5	2227	-15	3227	-15
7.3.4 Comisión variable	0228	-17.380	1228	0	2228	-17.810	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0231	-7	1231	0	2231	-14	3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-7	1232	0	2232	-14	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	-1.611	1234	-98	2234	-29.853	3234	-24.325
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	-1.611	1236	-98	2236	-29.853	3236	-24.325
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: 30/09/2024

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2024		Acumulado anterior 30/09/2023
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	-3.135	1300	3.762	2300	30.212	3300	22.522
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	14.345	1301	3.788	2301	48.685	3301	22.601
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	143.339	1302	139.172	2302	442.585	3302	363.652
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-174.066	1303	-159.123	2303	-554.014	3303	-397.455
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	48.299	1304	23.739	2304	135.057	3304	56.405
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	-1.198	1307	0	2307	-8.017	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-2.029	1308	0	2308	33.073	3308	0
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	0309	-17.480	1309	-26	2309	-18.472	3309	-79
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-22	1310	-21	2310	-66	3310	-64
2.2 Comisión administrador	0311	-73	1311	0	2311	-581	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	-5	2312	-15	3312	-15
2.4 Comisión variable	0313	-17.380	1313	0	2313	-17.810	3313	0
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	1.104	1322	249.405	2322	2.860	3322	1.111.794
<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	-461.334	1324	-404.444	2324	-1.720.736	3324	-1.114.578
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b>	0325	462.438	1325	653.850	2325	1.723.721	3325	2.226.429
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	129.972	1326	153.614	2326	485.496	3326	479.911
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	330.231	1327	499.721	2327	1.233.924	3327	1.744.852
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	2.235	1328	515	2328	4.302	3328	1.667
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	-1	1332	-1	2332	-126	3332	-56
7.1 Cobros por concesión de deudas con entidades de crédito	0333	0	1333	0	2333	0	3333	0
7.2 Pagos por amortización deudas con entidades de crédito	0334	0	1334	0	2334	0	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-1	1336	-1	2336	-126	3336	-56
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	0337	-2.031	1337	253.167	2337	33.072	3337	1.134.316
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	155.105	1338	1.044.527	2338	120.001	3338	163.377
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	153.074	1339	1.297.694	2339	153.074	3339	1.297.694

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2024		Acumulado anterior 30/09/2023
<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	48.299	1357	23.739	2357	135.057	3357	56.405
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	48.299	1358	23.739	2358	135.057	3358	56.405
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	-47.271	1360	-23.791	2360	-133.701	3360	-56.545
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361	0	3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-1.028	1362	52	2362	-1.356	3362	140
<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: 30/09/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2024								Situación cierre anual anterior 31/12/2023								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	0,36	0401	0,00	0421	0,00	0441	12,95	1381	0,35	1401	0,00	1421	0,00	1441	15,50	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	

<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> 30/09/2024
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados:</b> 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	305	0467	115	0474	115	0481	0	0488	231	0495	31.940	0502	0	0509	32.171
De 1 a 3 meses	0461	152	0468	193	0475	193	0482	0	0489	386	0496	15.612	0503	0	0510	15.998
De 3 a 6 meses	0462	136	0469	354	0476	234	0483	120	0490	708	0497	14.564	0504	0	0511	15.272
De 6 a 9 meses	0463	96	0470	385	0477	133	0484	252	0491	770	0498	10.286	0505	0	0512	11.056
De 9 a 12 meses	0464	66	0471	327	0478	97	0485	230	0492	654	0499	6.322	0506	0	0513	6.976
Más de 12 meses	0465	229	0472	2.222	0479	315	0486	1.752	0493	4.289	0500	21.449	0507	0	0514	25.738
<b>Total</b>	0466	<b>984</b>	0473	<b>3.597</b>	0480	<b>1.086</b>	0487	<b>2.355</b>	0494	<b>7.038</b>	0501	<b>100.173</b>	0508	<b>0</b>	1515	<b>107.212</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	305	0522	115	0529	115	0536	0	0543	231	0550	31.940	0557	0	0564	32.171	0571	52.487	0578	52.487	0584	61,29
De 1 a 3 meses	0516	152	0523	193	0530	193	0537	0	0544	386	0551	15.612	0558	0	0565	15.998	0572	26.528	0579	26.528	0585	60,31
De 3 a 6 meses	0517	136	0524	354	0531	234	0538	120	0545	708	0552	14.564	0559	0	0566	15.272	0573	25.698	0580	25.698	0586	59,43
De 6 a 9 meses	0518	96	0525	385	0532	133	0539	252	0546	770	0553	10.286	0560	0	0567	11.056	0574	17.072	0581	17.072	0587	64,76
De 9 a 12 meses	0519	66	0526	327	0533	97	0540	230	0547	654	0554	6.322	0561	0	0568	6.976	0575	11.680	0582	11.680	0588	59,73
Más de 12 meses	0520	229	0527	2.222	0534	315	0541	1.752	0548	4.289	0555	21.449	0562	0	0569	25.738	0576	37.184	0583	37.184	0589	69,22
<b>Total</b>	0521	<b>984</b>	0528	<b>3.597</b>	0535	<b>1.086</b>	0542	<b>2.355</b>	0549	<b>7.038</b>	0556	<b>100.173</b>	0563	<b>0</b>	0570	<b>107.212</b>	0577	<b>170.649</b>			0590	<b>62,83</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: 30/09/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 25/11/2020	
Inferior a 1 año	0600	5.140	1600	4.778	2600	1.490
Entre 1 y 2 años	0601	17.165	1601	16.706	2601	10.286
Entre 2 y 3 años	0602	28.294	1602	30.122	2602	22.758
Entre 3 y 4 años	0603	40.924	1603	41.758	2603	37.886
Entre 4 y 5 años	0604	60.443	1604	55.096	2604	59.897
Entre 5 y 10 años	0605	674.250	1605	660.560	2605	660.857
Superior a 10 años	0606	14.775.389	1606	14.698.722	2606	23.405.573
<b>Total</b>	0607	<b>15.601.604</b>	1607	<b>15.507.741</b>	2607	<b>24.198.747</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	0608	<b>25,13</b>	1608	<b>25,45</b>	2608	<b>26,18</b>

Antigüedad	Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 25/11/2020	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	6,11	1609	6,29	2609	4,96

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO D**

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/09/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				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	51.999	0630	2.831.750	1620	52.130	1630	2.881.461	2620	49.786	2630	6.070.159
40% - 60%	0621	44.680	0631	4.354.997	1621	43.125	1631	4.253.591	2621	54.755	2631	14.207.271
60% - 80%	0622	69.947	0632	8.385.371	1622	69.237	1632	8.335.887	2622	109.372	2632	796.148
80% - 100%	0623	199	0633	29.487	1623	270	1633	36.803	2623	5.827	2633	0
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>166.825</b>	0638	<b>15.601.604</b>	1628	<b>164.762</b>	1638	<b>15.507.741</b>	2628	<b>219.740</b>	2638	<b>21.073.577</b>
<b>Media ponderada (%)</b>	0639	<b>56,49</b>	0649		1639	<b>56,56</b>	1649		2639	<b>58,75</b>	2649	

<b>S.05.1</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: 30/09/2024</b>
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT</b>

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO E**

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 25/11/2020	
	Tipo de interés medio ponderado	0650	3,71	1650	3,36	2650
Tipo de interés nominal máximo	0651	8,19	1651	8,65	2651	6,34
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,61	2652	0,00

<b>S.05.1</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: 30/09/2024</b>
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT</b>

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO F**

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				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	24.279	0683	1.781.770	1660	26.260	1683	1.995.110	2660	33.116	2683	2.962.852
Aragón	0661	3.119	0684	241.319	1661	2.754	1684	211.643	2661	3.818	2684	338.784
Asturias	0662	1.496	0685	101.791	1662	1.401	1685	95.102	2662	1.984	2685	162.287
Baleares	0663	5.116	0686	609.733	1663	4.831	1686	578.256	2663	6.358	2686	848.087
Canarias	0664	8.997	0687	753.774	1664	8.305	1687	703.466	2664	10.784	2687	1.026.455
Cantabria	0665	1.538	0688	117.526	1665	1.460	1688	112.281	2665	1.971	2688	178.847
Castilla-León	0666	4.840	0689	356.990	1666	4.697	1689	347.714	2666	6.358	2689	548.168
Castilla La Mancha	0667	5.667	0690	469.275	1667	5.178	1690	424.368	2667	6.999	2690	652.454
Cataluña	0668	40.761	0691	4.503.295	1668	41.084	1691	4.629.073	2668	52.472	2691	6.717.359
Ceuta	0669	2	0692	325	1669	2	1692	328	2669	3	2692	446
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	0	1693	0	2670	24	2693	1.438
Galicia	0671	3.408	0694	255.530	1671	3.215	1694	238.828	2671	4.414	2694	389.117
Madrid	0672	46.592	0695	4.821.779	1672	44.028	1695	4.503.378	2672	64.365	2695	7.952.329
Melilla	0673	4	0696	414	1673	3	1696	352	2673	4	2696	448
Murcia	0674	3.767	0697	275.955	1674	3.479	1697	258.231	2674	4.630	2697	393.007
Navarra	0675	430	0698	39.940	1675	388	1698	36.214	2675	558	2698	59.151
La Rioja	0676	502	0699	41.310	1676	398	1699	32.647	2676	590	2699	53.228
Comunidad Valenciana	0677	14.440	0700	1.065.181	1677	15.497	1700	1.181.868	2677	18.780	2700	1.646.445
País Vasco	0678	1.867	0701	165.696	1678	1.782	1701	158.882	2678	2.512	2701	267.845
<b>Total España</b>	0679	<b>166.825</b>	0702	<b>15.601.604</b>	1679	<b>164.762</b>	1702	<b>15.507.741</b>	2679	<b>219.740</b>	2702	<b>24.198.747</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>166.825</b>	0705	<b>15.601.604</b>	1682	<b>164.762</b>	1705	<b>15.507.741</b>	2682	<b>219.740</b>	2705	<b>24.198.747</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> 30/09/2024
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados:</b> ING DIRECT

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 30/09/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 25/11/2020			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,06			1710	0,06			2710	0,08		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2024			Situación cierre anual anterior 31/12/2023			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: 30/09/2024

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		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado	0738	0739					
						0734	0735						0736	0737			
ES0305515001	BONO A1	NS	EURIBOR 3M	0,25	3,60	0	0	SI	5.262.300	0	5.262.300	0					
ES0305515019	BONO A2	NS	EURIBOR 3M	0,35	3,70	0	0	SI	1.052.500	0	1.052.500	0					
ES0305515027	BONO A3	NS	EURIBOR 3M	0,45	3,80	0	0	SI	3.999.300	0	3.999.300	0					
ES0305515035	BONO A4	NS	EURIBOR 3M	0,55	3,90	0	0	SI	1.052.300	0	1.052.300	0					
ES0305515043	BONO A5	NS	EURIBOR 3M	0,65	4,00	0	0	SI	842.000	0	842.000	0					
ES0305515050	BONO A6	NS	EURIBOR 3M	0,75	4,10	0	0	SI	1.278.600	0	1.278.600	0					
ES0305515068	BONO B	S	EURIBOR 3M	1,00	4,35	0	0	SI	1.841.900	0	1.841.900	0					
ES0305515076	BONO C	S	EURIBOR 3M	1,50	4,85	0	0	SI	421.100	0	421.100	0					
<b>Total</b>						0740	0	0741	0	0743	15.750.000	0744	0	0745	15.750.000	0746	0

	Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 25/11/2020	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	3,60	0748	3,83	0749	0,11

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2024								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2023							
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	54.577	368.054	0	0	51.466	146.256								
ES0305515019	BONO A2	0	0	11.191	76.026	0	0	10.563	30.588								
ES0305515027	BONO A3	0	0	43.567	298.049	0	0	41.158	121.307								
ES0305515035	BONO A4	0	0	11.738	81.184	0	0	11.098	33.604								
ES0305515043	BONO A5	0	0	9.612	68.118	0	0	9.096	29.186								
ES0305515050	BONO A6	0	0	14.930	108.354	0	0	14.139	47.927								
ES0305515068	BONO B	0	0	22.710	173.787	0	0	21.605	80.288								
ES0305515076	BONO C	0	0	5.742	47.824	0	0	0	7.688								
<b>Total</b>		0754	0755	0756	174.066	0757	1.221.396	1754	1755	1756	159.123	1757	496.846				

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/09/2024

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

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

**CUADRO D**

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/09/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	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

<b>S.05.2</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>Periodo de la declaración: 30/09/2024</b>
<b>Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF</b>

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

**CUADRO E**

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 25/11/2020	
Inferior a 1 año	0765	0	1765	0	2765	0
Entre 1 y 2 años	0766	0	1766	0	2766	0
Entre 2 y 3 años	0767	1.541.267	1767	0	2767	0
Entre 3 y 4 años	0768	1.709.071	1768	2.114.902	2768	817.367
Entre 4 y 5 años	0769	1.718.480	1769	1.714.329	2769	749.499
Entre 5 y 10 años	0770	7.500.522	1770	8.324.249	2770	3.622.342
Superior a 10 años	0771	3.280.660	1771	3.596.519	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>7,00</b>	<b>1773</b>	<b>7,60</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: 30/09/2024

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		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	85,63	1792	85,49	2792	85,63
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/09/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	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	1.163.422	1.163.422		
<b>Total</b>							0808 1.163.422	0809 1.163.422	0810	

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Naturaleza riesgo cubierto		Situación actual 30/09/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 25/11/2020		Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023	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: 30/09/2024

**INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO**

**CUADRO A**

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	32.503	7006	41.683	7009	0,21	7012	0,27	7015	0,25		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	32.503	7008	41.683	7011	0,21	7014	0,27	7017	0,25	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	13	7020		7021	37.496	7024	22.075	7027	0,24	7030	0,14	7033	0,24		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	37.496	7026	22.075	7029	0,24	7032	0,14	7035	0,24	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/09/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853



Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

**INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO**

**CUADRO B**

TRIGGERS	Límite	% Actual	Última Fecha Pago	Referencia Folleto
Amortización secuencial: series	0854	0858	1858	2858
Diferimiento/postergamiento intereses: series	0855	0859	1859	2859
No Reducción del Fondo de Reserva	0856	0860	1860	2860
OTROS TRIGGERS	0857	0861	1861	2861

Cuadro de texto libre

**CUADRO C**

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene  
  
Información adicional  
en fichero adjunto

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

**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	22	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: 30/09/2024</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>	<b>0878</b>													
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>	<b>0882</b>													
Comisión variable pagada	0883													
<b>Comisión variable impagada en el periodo de cálculo</b>	<b>0884</b>													

<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: 30/09/2024</b>

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo				Total
		02/04/2024	28/06/2024	30/09/2024		
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885					
Saldo inicial	0886	120.001	120.002	120.003		
Cobros del periodo	0887	785.695	774.835	605.778		
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-146	-541	-100		
Pagos por derivados	0889	43.398	43.361	48.299		
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-120.000	-120.000	-120.000		
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-195.201	-184.746	-174.066		
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	-6.819	-1.198		
Resto pagos/retenciones	0893	-633.745	-625.657	-461.334		
Saldo disponible	0894	2	433	17.381		
Liquidación de comisión variable	0895	0	430	17.380		17.810

S.06

Denominación Fondo: SOL LION II, FT


Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2024

**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**