

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: 30/09/2025

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: 30/09/2025

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2025		Periodo anterior 31/12/2024
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	15.811.877	1001	15.824.981
I. Activos financieros a largo plazo	0002	15.811.877	1002	15.824.981
1. Activos titulizados	0003	15.002.377	1003	15.015.481
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	14.934.781	1005	14.961.924
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	67.598	1025	53.558
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-1	1027	-1
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	809.500	1029	809.500
2.1 Derivados de cobertura	0030	809.500	1030	809.500
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

	S.01
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/09/2025	

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2025		Periodo anterior 31/12/2024
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	1.053.699	1041	1.057.399
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	933.699	1043	937.346
1. Activos titulizados	0044	638.241	1044	601.381
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	599.403	1046	556.776
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	33.723	1065	41.635
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	56	1066	77
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	4.196	1067	2.485
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	868	1068	414
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-6	1069	-6
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	114.847	1071	114.847
2.1 Derivados de cobertura	0072	114.847	1072	114.847
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	180.611	1074	221.118
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	180.611	1077	221.118
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	120.000	1085	120.053
1. Tesorería	0086	120.000	1086	120.053
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	16.865.576	1088	16.882.380

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: 30/09/2025

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2025		Periodo anterior 31/12/2024
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	15.336.832	1089	15.397.741
I. Provisiones a largo plazo	0090	70.431	1090	87.002
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	70.431	1092	87.002
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	15.266.401	1094	15.310.740
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	15.146.401	1095	15.190.740
1.1 Series no subordinadas	0096	12.883.401	1096	12.927.740
1.2 Series subordinadas	0097	2.263.000	1097	2.263.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	0	1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	120.000	1101	120.000
2.1 Préstamo subordinado	0102	120.000	1102	120.000
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	0	1105	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108	0	1108	0
3.1 Derivados de cobertura	0109	0	1109	0
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

	S.01
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/09/2025	

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/09/2025		Periodo anterior 31/12/2024
B) PASIVO CORRIENTE	0117	604.697	1117	560.686
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118	0	1118	0
V. Provisiones a corto plazo	0119	0	1119	0
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	0
2. Provisión por margen de intermediación	0121	0	1121	0
3. Otras provisiones	0122	0	1122	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	604.696	1123	560.681
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	604.689	1124	560.672
1.1 Series no subordinadas	0125	603.599	1125	559.260
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	1.090	1128	1.411
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	0	1129	0
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	7	1131	9
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	7	1136	9
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	0	1139	0
3.1 Derivados de cobertura	0140	0	1140	0
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	1	1148	5
1. Comisiones	0149	1	1149	1
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	0	1150	0
1.2 Comisión administrador	0151	1	1151	1
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	0	1157	4
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	924.048	1158	923.953
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	924.048	1160	923.953
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	16.865.576	1162	16.882.380

S.02
Denominación Fondo: SOL LION II, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2025

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2025		Acumulado anterior 30/09/2024
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	108.713	1201	143.361	2201	345.513	3201	440.739
1.1 Activos titulizados	0202	108.713	1202	143.361	2202	345.513	3202	440.739
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-100.885	1204	-171.535	2204	-343.675	3204	-526.347
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-100.247	1205	-170.363	2205	-341.447	3205	-522.740
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-638	1206	-1.172	2206	-2.228	3206	-3.608
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	26.536	1208	47.271	2208	93.522	3208	133.701
A) MARGEN DE INTERESES	0209	34.364	1209	19.097	2209	95.360	3209	48.093
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210	0	3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211	0	3211	0
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212	0	3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213	0	3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214	0	3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-38.278	1217	-17.478	2217	-111.932	3217	-18.225
7.1 Servicios exteriores	0218	-1	1218	-1	2218	-5	3218	-119
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-1	1219	-1	2219	-5	3219	-119
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	-38.277	1224	-17.478	2224	-111.926	3224	-18.107
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-23	1225	-22	2225	-68	3225	-65
7.3.2 Comisión administrador	0226	-73	1226	-71	2226	-218	3226	-216
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-5	1227	-5	2227	-15	3227	-15
7.3.4 Comisión variable	0228	-38.175	1228	-17.380	2228	-111.625	3228	-17.810
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	-1	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	0	1231	-7	2231	0	3231	-14
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	-7	2232	0	3232	-14
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	3.914	1234	-1.611	2234	16.571	3234	-29.853
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	3.914	1236	-1.611	2236	16.571	3236	-29.853
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238	0	3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	0	1239	0	2239	0	3239	0
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

S.03

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2025

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2025		Acumulado anterior 30/09/2024
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-24.280	1300	-3.135	2300	-9.316	3300	30.212
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	13.996	1301	14.345	2301	102.610	3301	48.685
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	110.047	1302	143.339	2302	352.991	3302	442.585
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-99.158	1303	-174.066	2303	-341.768	3303	-554.014
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	26.238	1304	48.299	2304	93.617	3304	135.057
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	-631	1307	-1.198	2307	-2.230	3307	-8.017
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-22.501	1308	-2.029	2308	0	3308	33.073
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-38.276	1309	-17.480	2309	-111.925	3309	-18.472
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-23	1310	-22	2310	-68	3310	-66
2.2 Comisión administrador	0311	-73	1311	-73	2311	-218	3311	-581
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	-5	2312	-15	3312	-15
2.4 Comisión variable	0313	-38.175	1313	-17.380	2313	-111.625	3313	-17.810
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	0	1315	0	2315	0	3315	0
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	1.779	1322	1.104	2322	9.263	3322	2.860
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	0323	0	1323	0	2323	0	3323	0
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	0324	-436.751	1324	-461.334	2324	-1.378.327	3324	-1.720.736
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	438.531	1325	462.438	2325	1.387.599	3325	1.723.721
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	165.944	1326	129.972	2326	469.914	3326	485.496
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	270.214	1327	330.231	2327	911.526	3327	1.233.924
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	2.373	1328	2.235	2328	6.159	3328	4.302
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	0	1331	0	2331	0	3331	0
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	0332	-1	1332	-1	2332	-10	3332	-126
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	-10	3336	-126
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-22.501	1337	-2.031	2337	-53	3337	33.072
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	142.501	1338	155.105	2338	120.053	3338	120.001
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	120.000	1339	153.074	2339	120.000	3339	153.074

S.04

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/09/2025

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (3. trimestre)		P. corriente anterior (3. trimestre)		Acumulado actual 30/09/2025		Acumulado anterior 30/09/2024
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	26.238	1357	48.299	2357	93.617	3357	135.057
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	26.238	1358	48.299	2358	93.617	3358	135.057
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	-26.536	1360	-47.271	2360	-93.522	3360	-133.701
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361	0	3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0362	299	1362	-1.028	2362	-95	3362	-1.356
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el periodo	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 periodo	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

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: 30/09/2025
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/09/2025								Situación cierre anual anterior 31/12/2024								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	0,46	0401	0,00	0421	0,00	0441	8,34	1381	0,36	1401	0,00	1421	0,00	1441	10,53	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	
Prestamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1															
Denominación Fondo: SOL LION II, FT															
Denominación del compartimento:															
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.															
Estados agregados: NO															
Fecha: 30/09/2025															
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	187	0467	28	0474	21	0481	0	0488	48	0495	18.276	0502	0	0509	18.325
De 1 a 3 meses	0461	164	0468	81	0475	35	0482	0	0489	116	0496	16.148	0503	0	0510	16.264
De 3 a 6 meses	0462	120	0469	129	0476	55	0483	16	0490	200	0497	12.533	0504	0	0511	12.733
De 6 a 9 meses	0463	183	0470	965	0477	492	0484	40	0491	1.497	0498	18.282	0505	0	0512	19.779
De 9 a 12 meses	0464	88	0471	199	0478	56	0485	86	0492	342	0499	9.463	0506	0	0513	9.804
Más de 12 meses	0465	293	0472	1.381	0479	265	0486	1.073	0493	2.720	0500	28.840	0507	0	0514	31.560
Total	0466	1.035	0473	2.784	0480	924	0487	1.215	0494	4.923	0501	103.542	0508	0	1515	108.465

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	187	0522	28	0529	21	0536	0	0543	48	0550	18.276	0557	0	0564	18.325	0571	32.542	0578	32.542	0584	56,31
De 1 a 3 meses	0516	164	0523	81	0530	35	0537	0	0544	116	0551	16.148	0558	0	0565	16.264	0572	27.962	0579	27.962	0585	58,16
De 3 a 6 meses	0517	120	0524	129	0531	55	0538	16	0545	200	0552	12.533	0559	0	0566	12.733	0573	21.783	0580	21.783	0586	58,45
De 6 a 9 meses	0518	183	0525	965	0532	492	0539	40	0546	1.497	0553	18.282	0560	0	0567	19.779	0574	31.028	0581	31.028	0587	63,75
De 9 a 12 meses	0519	88	0526	199	0533	56	0540	86	0547	342	0554	9.463	0561	0	0568	9.804	0575	15.530	0582	15.530	0588	63,13
Más de 12 meses	0520	293	0527	1.381	0534	265	0541	1.073	0548	2.720	0555	28.840	0562	0	0569	31.560	0576	48.398	0583	48.398	0589	65,21
Total	0521	1.035	0528	2.784	0535	924	0542	1.215	0549	4.923	0556	103.542	0563	0	0570	108.465	0577	177.244			0590	61,20

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: 30/09/2025
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 30/09/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 25/11/2020	
Inferior a 1 año	0600	5,483	1600	5,747	2600	1,490
Entre 1 y 2 años	0601	16,003	1601	17,233	2601	10,348
Entre 2 y 3 años	0602	29,534	1602	28,140	2602	22,878
Entre 3 y 4 años	0603	44,997	1603	41,973	2603	37,998
Entre 4 y 5 años	0604	66,339	1604	61,331	2604	60,241
Entre 5 y 10 años	0605	710,073	1605	687,198	2605	677,499
Superior a 10 años	0606	14,733,548	1606	14,733,121	2606	25,218,468
Total	0607	15,605,978	1607	15,574,743	2607	26,028,922
Vida residual media ponderada (años)	0608	24,65	1608	24,98	2608	26,23

Antigüedad	Situación actual 30/09/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 25/11/2020	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	6,44	1609	6,20	2609	4,86

	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: 30/09/2025	
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 30/09/2025				Situación cierre anual anterior 31/12/2024				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	52.827	0630	2.813.087	1620	52.375	1630	2.824.785	2620	51.774	2630	3.272.239
40% - 60%	0621	48.864	0631	4.688.818	1621	45.820	1631	4.435.714	2621	59.592	2631	6.569.172
60% - 80%	0622	67.463	0632	8.029.336	1622	69.546	1632	8.287.903	2622	118.066	2632	15.320.906
80% - 100%	0623	494	0633	74.736	1623	176	1633	26.341	2623	6.300	2633	866.605
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	169.648	0638	15.605.978	1628	167.917	1638	15.574.743	2628	235.732	2638	26.028.922
Media ponderada (%)	0639	59,40	0649		1639	56,30	1649		2639	58,75	2649	

SOL LION II, FT

S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION II, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/09/2025
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/09/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 25/11/2020	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,04	1650	3,62	2650	1,20
Tipo de interés nominal máximo	0651	7,61	1651	8,17	2651	6,34
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,61	1652	0,00	2652	0,00

	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: 30/09/2025	
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/09/2025				Situación cierre anual anterior 31/12/2024				Situación inicial 25/11/2020			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	26.367	0683	1.965.456	1660	25.776	1683	1.925.683	2660	37.359	2683	3.383.396
Aragón	0661	3.075	0684	236.239	1661	3.085	1684	237.100	2661	4.005	2684	358.453
Asturias	0662	1.452	0685	95.651	1662	1.481	1685	99.446	2662	2.059	2685	169.512
Baleares	0663	4.923	0686	575.005	1663	5.057	1686	597.400	2663	6.535	2686	878.471
Canarias	0664	8.743	0687	712.565	1664	8.892	1687	738.480	2664	11.022	2687	1.052.636
Cantabria	0665	1.446	0688	106.590	1665	1.511	1688	114.378	2665	2.016	2688	183.721
Castilla-León	0666	4.601	0689	328.481	1666	5.621	1689	461.439	2666	6.488	2689	561.131
Castilla La Mancha	0667	5.532	0690	450.402	1667	4.766	1690	347.542	2667	7.292	2690	685.028
Cataluña	0668	41.792	0691	4.554.440	1668	40.226	1691	4.407.918	2668	56.619	2691	7.269.056
Ceuta	0669	3	0692	193	1669	3	1692	338	2669	6	2692	673
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	0	1693	0	2670	24	2693	1.438
Galicia	0671	3.265	0694	239.108	1671	3.342	1694	248.196	2671	4.526	2694	400.789
Madrid	0672	44.720	0695	4.532.565	1672	45.910	1695	4.707.273	2672	66.280	2695	8.247.301
Melilla	0673	6	0696	598	1673	6	1696	617	2673	6	2696	656
Murcia	0674	3.697	0697	263.692	1674	3.728	1697	269.941	2674	4.800	2697	408.900
Navarra	0675	414	0698	38.373	1675	423	1698	39.300	2675	584	2698	62.342
La Rioja	0676	534	0699	43.593	1676	500	1699	41.202	2676	645	2699	59.005
Comunidad Valenciana	0677	17.308	0700	1.309.740	1677	15.757	1700	1.178.289	2677	22.881	2700	2.029.241
País Vasco	0678	1.770	0701	153.287	1678	1.833	1701	160.200	2678	2.585	2701	277.172
Total España	0679	169.648	0702	15.605.978	1679	167.917	1702	15.574.743	2679	235.732	2702	26.028.922
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	169.648	0705	15.605.978	1682	167.917	1705	15.574.743	2682	235.732	2705	26.028.922

SOL LION II, FT

	S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/09/2025	
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/09/2025				Situación cierre anual anterior 31/12/2024				Situación inicial 25/11/2020			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,05			1710	0,06			2710	0,08		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

S.05.2															
Denominación Fondo: SOL LION II, FT															
Denominación del compartimento:															
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.															
Estados agregados: NO															
Periodo de la declaración: 30/09/2025															
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF															

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2025				Situación cierre anual anterior 31/12/2024				Situación inicial 25/11/2020											
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Principal pendiente		Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Principal pendiente		Nº de pasivos emitidos		Nominal unitario (€)	Principal pendiente						
		0720		0721		0722		1720		1721		1722		2720		2721		2722			
ES0305515001	BONO A1	52.623			100.000	5.262.300			52.623		100.000	5.262.300			52.623		100.000	5.262.300			
ES0305515019	BONO A2	10.525			100.000	1.052.500			10.525		100.000	1.052.500			10.525		100.000	1.052.500			
ES0305515027	BONO A3	39.993			100.000	3.999.300			39.993		100.000	3.999.300			39.993		100.000	3.999.300			
ES0305515035	BONO A4	10.523			100.000	1.052.300			10.523		100.000	1.052.300			10.523		100.000	1.052.300			
ES0305515043	BONO A5	8.420			100.000	842.000			8.420		100.000	842.000			8.420		100.000	842.000			
ES0305515050	BONO A6	12.786			100.000	1.278.600			12.786		100.000	1.278.600			12.786		100.000	1.278.600			
ES0305515068	BONO B	18.419			100.000	1.841.900			18.419		100.000	1.841.900			18.419		100.000	1.841.900			
ES0305515076	BONO C	4.211			100.000	421.100			4.211		100.000	421.100			4.211		100.000	421.100			
Total		0723	157.500			0724	15.750.000		1723	157.500			1724	15.750.000		2723	157.500			2724	15.750.000

SOL LION II, FT

S.05.2											
Denominación Fondo: SOL LION II, FT											
Denominación del compartimento:											
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.											
Estados agregados: NO											
Periodo de la declaración: 30/09/2025											
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					
		0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737	0738	0739						
ES0305515001	BONO A1	NS	EURIBOR 3M	0,25	2,23	326	0	SI	5.262.300	0	5.262.626	0						
ES0305515019	BONO A2	NS	EURIBOR 3M	0,35	2,33	68	0	SI	1.052.500	0	1.052.568	0						
ES0305515027	BONO A3	NS	EURIBOR 3M	0,45	2,43	270	0	SI	3.999.300	0	3.999.570	0						
ES0305515035	BONO A4	NS	EURIBOR 3M	0,55	2,53	74	0	SI	1.052.300	0	1.052.374	0						
ES0305515043	BONO A5	NS	EURIBOR 3M	0,65	2,63	62	0	SI	842.000	0	842.062	0						
ES0305515050	BONO A6	NS	EURIBOR 3M	0,75	2,73	97	0	SI	1.278.600	0	1.278.697	0						
ES0305515068	BONO B	S	EURIBOR 3M	1,00	2,98	152	0	SI	1.841.900	0	1.842.052	0						
ES0305515076	BONO C	S	EURIBOR 3M	1,50	3,48	41	0	SI	421.100	0	421.141	0						
Total						0740	1.090	0741	0		0743	15.750.000	0744	0	0745	15.751.090	0746	0

	Situación actual 30/09/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 25/11/2020	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	3,00	0748	3,40	0749	0,11

SOL LION II, FT

	S.05.2
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Periodo de la declaración: 30/09/2025	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/09/2025								Situación periodo comparativo anterior 30/09/2024							
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		29.663		519.664		0		0		54.577		368.054	
ES0305515019	BONO A2	0		0		6.199		107.413		0		0		11.191		76.026	
ES0305515027	BONO A3	0		0		24.566		421.358		0		0		43.567		298.049	
ES0305515035	BONO A4	0		0		6.730		114.694		0		0		11.738		81.184	
ES0305515043	BONO A5	0		0		5.598		95.782		0		0		9.612		68.118	
ES0305515050	BONO A6	0		0		8.823		151.655		0		0		14.930		108.354	
ES0305515068	BONO B	0		0		13.875		240.821		0		0		22.710		173.787	
ES0305515076	BONO C	0		0		3.704		65.278		0		0		5.742		47.824	
Total		0754	0	0755	0	0756	99.158	0757	1.716.666	1754	0	1755	0	1756	174.066	1757	1.221.396

SOL LION II, FT

	S.05.2
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Periodo de la declaración: 30/09/2025	
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 30/09/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 25/11/2020
		0760	0761	0762	0763	0764
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

SOL LION II, FT

	S.05.2
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Periodo de la declaración: 30/09/2025	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/09/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 25/11/2020	
Inferior a 1 año	0765	0	1765	0	2765	0
Entre 1 y 2 años	0766	1.418.912	1766	0	2766	0
Entre 2 y 3 años	0767	1.704.091	1767	1.915.033	2767	0
Entre 3 y 4 años	0768	1.574.210	1768	1.688.686	2768	817.367
Entre 4 y 5 años	0769	1.670.708	1769	1.661.458	2769	749.499
Entre 5 y 10 años	0770	5.833.389	1770	7.532.853	2770	3.622.342
Superior a 10 años	0771	3.548.690	1771	2.951.970	2771	10.560.792
Total	0772	15.750.000	1772	15.750.000	2772	15.750.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	7,66	1773	6,75	2773	17,63

	S.05.3
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/09/2025	

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo		Situación actual 30/09/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 25/11/2020	
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	85,63	2792	85,63
5	Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1	Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2	Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3	Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

SOL LION II, FT

S.05.3											
Denominación Fondo: SOL LION II, FT											
Denominación del compartimento:											
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.											
Estados agregados: NO											
Fecha: 30/09/2025											

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 30/09/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 25/11/2020		
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806		1806		2806		
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	924.347		924.347				
Total							0808	924.347	0809	924.347	0810		

S.05.3													
Denominación Fondo: SOL LION II, FT													
Denominación del compartimento:													
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.													
Estados agregados: NO													
Fecha: 30/09/2025													

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 30/09/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 25/11/2020		Situación actual 30/09/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024			
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 titulación	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

SOL LION II, FT

S.05.4															
Denominación Fondo: SOL LION II, FT															
Denominación del compartimento:															
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.															
Estados agregados: NO															
Fecha: 30/09/2025															

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

					Importe impagado acumulado				Ratio						Ref. Folleto	
Concepto	Meses impago		Días impago		Situación actual 30/09/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación actual 30/09/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Última Fecha Pago			
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	32.830	7006	44.865	7009	0,21	7012	0,29	7015	0,22		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	32.830	7008	44.865	7011	0,21	7014	0,29	7017	0,22	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	13	7020		7021	54.492	7024	40.820	7027	0,35	7030	0,26	7033	0,35		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	54.492	7026	40.820	7029	0,35	7032	0,26	7035	0,35	7036	Glosario de Términos

	Ratio						Ref. Folleto	
Otras ratios relevantes	Situación actual 30/09/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Última Fecha Pago			
	0850		1850		2850		3850	
	0851		1851		2851		3851	
	0852		1852		2852		3852	
	0853		1853		2853		3853	

SOL LION II, FT

	S.05.4
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/09/2025	

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

SOL LION II, FT

S.05.5																	
Denominación Fondo: SOL LION II, FT																	
Denominación del compartimento:																	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.																	
Estados agregados: NO																	
Fecha: 30/09/2025																	

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Minimo (miles de euros)		Periodidad 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	23	2862		3862		4862		5862		6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	Ing Direct N.V.	1863	73	2863		3863		4863		5863		6863	TRIMESTRAL	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	Ing Direct N.V.	1864	5	2864		3864		4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

	S.05.5
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/09/2025	

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

Derterminada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)		Fecha cálculo												Total
Ingresos y gastos del periodo de cálculo	0872													
Margen de intereses	0873													
Deterioro de activos financieros (neto)	0874													
Dotaciones a provisiones (neto)	0875													
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876													
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877													
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878													
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879													
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880													
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881													
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882													
Comisión variable pagada	0883													
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884													

SOL LION II, FT

	S.05.5
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/09/2025	

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	28/03/2025	30/06/2025	29/09/2025										
Saldo inicial	0886	120.053	120.002	120.000										
Cobros del periodo	0887	603.770	588.242	548.578										
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-102	-107	-101										
Pagos por derivados	0889	34.621	32.759	26.238										
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-120.000	-120.000	-120.000										
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-124.186	-118.424	-99.158										
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-826	-774	-631										
Resto pagos/retenciones	0893	-472.042	-469.534	-436.751										
Saldo disponible	0894	41.287	32.164	38.175										
Liquidación de comisión variable	0895	41.285	32.164	38.175										111.625

	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: 30/09/2025	

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
