

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: 30/06/2023

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:
(sólo se cumplimentará en el supuesto de que se produzca el reenvío con alguna modificación de la información periódica)

S.01

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	14.446.028	1001	15.153.727
I. Activos financieros a largo plazo	0002	14.446.028	1002	15.153.727
1. Activos titulizados	0003	14.086.036	1003	14.793.735
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	14.050.989	1005	14.769.714
1.3 Préstamos hipotecarios	0006	0	1006	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0007	0	1007	0
1.5 Préstamos a promotores	0008	0	1008	0
1.6 Préstamos a PYMES	0009	0	1009	0
1.7 Préstamos a empresas	0010	0	1010	0
1.8 Préstamos corporativos	0011	0	1011	0
1.9 Cédulas territoriales	0012	0	1012	0
1.10 Bonos de tesorería	0013	0	1013	0
1.11 Deuda subordinada	0014	0	1014	0
1.12 Créditos AAPP	0015	0	1015	0
1.13 Préstamos consumo	0016	0	1016	0
1.14 Préstamos automoción	0017	0	1017	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0018	0	1018	0
1.16 Cuentas a cobrar	0019	0	1019	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0020	0	1020	0
1.18 Bonos de titulización	0021	0	1021	0
1.19 Cédulas internacionalización	0022	0	1022	0
1.20 Otros	0023	0	1023	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0024	0	1024	0
1.22 Activos dudosos -principal-	0025	35.056	1025	24.031
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-10	1027	-10
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	359.992	1029	359.992
2.1 Derivados de cobertura	0030	359.992	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	359.992
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	1.950.326	1041	1.208.237
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	905.799	1043	1.044.860
1. Activos titulizados	0044	540.369	1044	620.891
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	495.469	1046	591.975
1.3 Préstamos hipotecarios	0047	0	1047	0
1.4 Cédulas hipotecarias	0048	0	1048	0
1.5 Préstamos a promotores	0049	0	1049	0
1.6 Préstamos a PYMES	0050	0	1050	0
1.7 Préstamos a empresas	0051	0	1051	0
1.8 Préstamos corporativos	0052	0	1052	0
1.9 Cédulas territoriales	0053	0	1053	0
1.10 Bonos de tesorería	0054	0	1054	0
1.11 Deuda subordinada	0055	0	1055	0
1.12 Créditos AAPP	0056	0	1056	0
1.13 Préstamos consumo	0057	0	1057	0
1.14 Préstamos automoción	0058	0	1058	0
1.15 Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0059	0	1059	0
1.16 Cuentas a cobrar	0060	0	1060	0
1.17 Derechos de crédito futuros	0061	0	1061	0
1.18 Bonos de titulización	0062	0	1062	0
1.19 Cédulas internacionalización	0063	0	1063	0
1.20 Otros	0064	0	1064	0
1.21 Intereses y gastos devengados no vencidos	0065	43.070	1065	27.515
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	74	1066	25
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	1.610	1067	1.309
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	159	1068	79
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-13	1069	-13
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	78.949	1071	78.949
2.1 Derivados de cobertura	0072	78.949	1072	78.949
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	286.481	1074	345.020
3.1 Valores representativos de deuda	0075	0	1075	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0076	0	1076	0
3.3 Deudores y otras cuentas a cobrar	0077	286.481	1077	345.020
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	1.044.527	1085	163.377
1. Tesorería	0086	1.044.527	1086	163.377
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	16.396.354	1088	16.361.965

S.01

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	15.938.745	1089	15.914.518
I. Provisiones a largo plazo	0090	68.745	1090	44.518
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	68.745	1092	44.518
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	15.870.000	1094	15.870.000
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	15.750.000	1095	15.750.000
1.1 Series no subordinadas	0096	13.487.000	1096	13.487.000
1.2 Series subordinadas	0097	2.263.000	1097	2.263.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	0	1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	120.000	1101	120.000
2.1 Préstamo subordinado	0102	120.000	1102	120.000
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	0	1105	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108	0	1108	0
3.1 Derivados de cobertura	0109	0	1109	0
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

S.01

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2023		Periodo anterior 31/12/2022
B) PASIVO CORRIENTE	0117	19.184	1117	8.933
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0118	0	1118	0
V. Provisiones a corto plazo	0119	0	1119	0
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	0
2. Provisión por margen de intermediación	0121	0	1121	0
3. Otras provisiones	0122	0	1122	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0123	18.964	1123	8.851
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	16.924	1124	8.444
1.1 Series no subordinadas	0125	0	1125	0
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	3.577	1128	3.480
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	13.348	1129	4.964
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	2.040	1131	407
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133	0	1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134	0	1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	0	1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	25	1136	407
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	2.015	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	220	1148	82
1. Comisiones	0149	220	1149	76
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	0	1150	1
1.2 Comisión administrador	0151	219	1151	75
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	0
1.4 Comisión variable	0153	0	1153	0
1.5 Otras comisiones del cedente	0154	0	1154	0
1.6 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0155	0	1155	0
1.7 Otras comisiones	0156	0	1156	0
2. Otros	0157	0	1157	6
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	438.425	1158	438.513
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	438.425	1160	438.513
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	16.396.354	1162	16.361.965

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2023		Acumulado anterior 30/06/2022
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	131.208	1201	36.358	2201	240.163	3201	70.179
1.1 Activos titulizados	0202	131.208	1202	36.358	2202	240.163	3202	70.179
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-142.196	1204	-5.035	2204	-248.445	3204	-8.595
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-141.245	1205	-5.035	2205	-246.812	3205	-8.595
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-952	1206	0	2206	-1.633	3206	0
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0208	19.697	1208	-7.764	2208	32.754	3208	-16.281
A) MARGEN DE INTERESES	0209	8.710	1209	23.559	2209	24.472	3209	45.303
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0210	0	1210	0	2210	0	3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211	0	3211	0
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212	0	3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213	0	3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214	0	3214	0
5. Diferencias de cambio (neto)	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
6. Otros ingresos de explotación	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
7. Otros gastos de explotación	0217	-100	1217	-21.298	2217	-246	3217	-42.997
7.1 Servicios exteriores	0218	-2	1218	-7	2218	-49	3218	-34
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-2	1219	-7	2219	-49	3219	-34
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	-98	1224	-21.291	2224	-197	3224	-42.963
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-21	1225	-20	2225	-43	3225	-40
7.3.2 Comisión administrador	0226	-72	1226	-72	2226	-144	3226	-144
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-5	1227	-5	2227	-10	3227	-10
7.3.4 Comisión variable	0228	0	1228	-21.194	2228	0	3228	-42.768
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	0	1231	0	2231	0	3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	0	2232	0	3232	0
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	-8.610	1234	-2.261	2234	-24.227	3234	-2.306
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	-8.610	1236	-2.261	2236	-24.227	3236	-2.306
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238	0	3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	0	1239	0	2239	0	3239	0
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2023		Acumulado anterior 30/06/2022
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	7.455	1300	1.676	2300	18.761	3300	1.773
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	7.481	1301	22.967	2301	18.813	3301	44.737
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	125.434	1302	34.864	2302	224.480	3302	68.695
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-137.780	1303	-4.940	2303	-238.332	3303	-8.456
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	19.828	1304	0	2304	32.666	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	0	1305	-7.896	2305	0	3305	-16.440
1.7 Intereses cobrados de otros activos financieros	0306	0	1306	0	2306	0	3306	0
1.8 Intereses pagados por deudas con entidades de crédito	0307	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	939	2308	0	3308	939
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-26	1309	-21.291	2309	-53	3309	-42.964
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-21	1310	-20	2310	-43	3310	-40
2.2 Comisión administrador	0311	0	1311	-73	2311	0	3311	-145
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	-5	2312	-10	3312	-10
2.4 Comisión variable	0313	0	1313	-21.194	2313	0	3313	-42.768
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	339.967	1322	-737	2322	862.389	3322	-839
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	-397.816	1324	-470.760	2324	-710.135	3324	-890.216
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	737.788	1325	470.036	2325	1.572.579	3325	889.417
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	154.966	1326	123.216	2326	326.296	3326	304.748
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	582.356	1327	346.682	2327	1.245.130	3327	584.413
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	466	1328	138	2328	1.152	3328	256
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	-6	1332	-14	2332	-55	3332	-40
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	-6	1336	-14	2336	-55	3336	-40
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	347.421	1337	939	2337	881.149	3337	934
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	697.105	1338	120.000	2338	163.377	3338	120.005
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	1.044.527	1339	120.939	2339	1.044.527	3339	120.939

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2023		Acumulado anterior 30/06/2022
1. Activos financieros disponibles para la venta								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	0356	0	1356	0	2356	0	3356	0
2. Cobertura de los flujos de efectivo								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	19.828	1357	-7.896	2357	32.666	3357	-16.440
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	19.828	1358	-7.896	2358	32.666	3358	-16.440
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	-19.697	1360	7.764	2360	-32.754	3360	16.281
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	-130	1362	132	2362	88	3362	160
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2023								Situación cierre anual anterior 31/12/2022								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	0,25	0401	0,00	0421	0,00	0441	15,66	1381	0,16	1401	0,00	1421	0,00	1441	11,28	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	6,00
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION II, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2023
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO B

Total Impagados (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total							
Hasta 1 mes	0460	160	0467	20	0474	23	0481	0	0488	43	0495	17.526	0502	0	0509	17.569
De 1 a 3 meses	0461	131	0468	63	0475	51	0482	0	0489	115	0496	14.528	0503	0	0510	14.643
De 3 a 6 meses	0462	109	0469	99	0476	59	0483	18	0490	176	0497	12.009	0504	0	0511	12.185
De 6 a 9 meses	0463	64	0470	116	0477	31	0484	34	0491	181	0498	6.949	0505	0	0512	7.130
De 9 a 12 meses	0464	53	0471	160	0478	25	0485	63	0492	248	0499	5.767	0506	0	0513	6.015
Más de 12 meses	0465	112	0472	559	0479	44	0486	201	0493	805	0500	11.007	0507	0	0514	11.811
Total	0466	629	0473	1.018	0480	233	0487	316	0494	1.568	0501	67.786	0508	0	1515	69.354

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	160	0522	20	0529	23	0536	0	0543	43	0550	17.526	0557	0	0564	17.569	0571	29.620	0578	29.620	0584	59,31
De 1 a 3 meses	0516	131	0523	63	0530	51	0537	0	0544	115	0551	14.528	0558	0	0565	14.643	0572	23.293	0579	23.293	0585	62,87
De 3 a 6 meses	0517	109	0524	99	0531	59	0538	18	0545	176	0552	12.009	0559	0	0566	12.185	0573	18.766	0580	18.766	0586	64,93
De 6 a 9 meses	0518	64	0525	116	0532	31	0539	34	0546	181	0553	6.949	0560	0	0567	7.130	0574	11.653	0581	11.653	0587	61,19
De 9 a 12 meses	0519	53	0526	160	0533	25	0540	63	0547	248	0554	5.767	0561	0	0568	6.015	0575	10.765	0582	10.765	0588	55,88
Más de 12 meses	0520	112	0527	559	0534	44	0541	201	0548	805	0555	11.007	0562	0	0569	11.811	0576	18.067	0583	18.067	0589	65,37
Total	0521	629	0528	1.018	0535	233	0542	316	0549	1.568	0556	67.786	0563	0	0570	69.354	0577	112.164			0590	61,83

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: 30/06/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 25/11/2020	
Inferior a 1 año	0600	3.814	1600	4.250	2600	975
Entre 1 y 2 años	0601	14.863	1601	13.896	2601	8.632
Entre 2 y 3 años	0602	29.635	1602	29.363	2602	20.258
Entre 3 y 4 años	0603	40.681	1603	42.207	2603	34.068
Entre 4 y 5 años	0604	52.669	1604	54.754	2604	52.869
Entre 5 y 10 años	0605	611.612	1605	618.110	2605	540.322
Superior a 10 años	0606	13.829.851	1606	14.624.449	2606	13.768.481
Total	0607	14.583.124	1607	15.387.029	2607	14.425.606
Vida residual media ponderada (años)	0608	25,40	1608	25,62	2608	25,94

Antigüedad	Situación					
	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 25/11/2020	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	6,21	1609	5,98	2609	5,22

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 30/06/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 25/11/2020			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	0620	49.576	0630	2.756.001	1620	49.478	1630	2.745.856	2620	41.763	2630	2.506.123
40% - 60%	0621	40.860	0631	4.047.571	1621	42.319	1631	4.295.227	2621	39.733	2631	4.312.255
60% - 80%	0622	65.013	0632	7.728.156	1622	68.583	1632	8.256.605	2622	63.953	2632	7.971.846
80% - 100%	0623	382	0633	51.397	1623	646	1633	89.341	2623	3.369	2633	418.462
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
Total	0628	155.831	0638	14.583.124	1628	161.026	1638	15.387.029	2628	148.818	2638	15.208.685
Media ponderada (%)	0639	56,63	0649		1639	57,19	1649		2639	58,54	2649	

S.05.1

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 25/11/2020	
Tipo de interés medio ponderado	0650	2,44	1650	1,31	2650	1,07
Tipo de interés nominal máximo	0651	8,25	1651	7,61	2651	5,67
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	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: 30/06/2023
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 30/06/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 25/11/2020			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	27.284	0683	2.124.521	1660	27.920	1683	2.216.510	2660	25.798	2683	2.181.474
Aragón	0661	2.385	0684	181.030	1661	2.473	1684	192.737	2661	2.038	2684	169.227
Asturias	0662	1.277	0685	86.774	1662	1.358	1685	94.116	2662	1.294	2685	98.769
Baleares	0663	4.321	0686	508.340	1663	4.377	1686	522.138	2663	3.691	2686	449.647
Canarias	0664	7.459	0687	626.269	1664	7.556	1687	645.492	2664	6.548	2687	586.488
Cantabria	0665	1.345	0688	104.043	1665	1.375	1688	109.898	2665	1.210	2688	104.191
Castilla-León	0666	4.393	0689	326.271	1666	4.577	1689	348.333	2666	4.058	2689	332.846
Castilla La Mancha	0667	4.684	0690	377.571	1667	4.415	1690	358.719	2667	3.835	2690	326.690
Cataluña	0668	37.622	0691	4.239.014	1668	39.577	1691	4.504.820	2668	33.476	2691	3.975.503
Ceuta	0669	2	0692	330	1669	25	1692	1.867	2669	26	2692	1.912
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	0	1693	0	2670	0	2693	0
Galicia	0671	2.988	0694	220.900	1671	3.099	1694	234.326	2671	2.792	2694	223.152
Madrid	0672	40.848	0695	4.130.371	1672	43.572	1695	4.508.208	2672	40.701	2695	4.487.714
Melilla	0673	3	0696	357	1673	14	1696	946	2673	13	2696	911
Murcia	0674	3.116	0697	230.937	1674	3.207	1697	241.709	2674	2.835	2697	226.980
Navarra	0675	328	0698	28.697	1675	343	1698	30.359	2675	306	2698	28.167
La Rioja	0676	315	0699	24.831	1676	331	1699	26.722	2676	245	2699	20.109
Comunidad Valenciana	0677	15.853	0700	1.232.369	1677	15.050	1700	1.194.276	2677	12.721	2700	1.050.115
País Vasco	0678	1.608	0701	140.499	1678	1.757	1701	155.853	2678	1.678	2701	161.712
Total España	0679	155.831	0702	14.583.124	1679	161.026	1702	15.387.029	2679	143.265	2702	14.425.606
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	155.831	0705	14.583.124	1682	161.026	1705	15.387.029	2682	143.265	2705	14.425.606

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: 30/06/2023
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2023				Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Situación inicial 25/11/2020			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,07			1710	0,07			2710	0,10		
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: 30/06/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2023			Situación cierre anual anterior 31/12/2022			Situación inicial 25/11/2020					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente			
		0720	Nominal unitario (€) 0721	0722	1720	Nominal unitario (€) 1721	1722	2720	Nominal unitario (€) 2721	2722			
ES0305515001	BONO A1	52.623	100.000	5.262.300	52.623	100.000	5.262.300	52.623	100.000	5.262.300			
ES0305515019	BONO A2	10.525	100.000	1.052.500	10.525	100.000	1.052.500	10.525	100.000	1.052.500			
ES0305515027	BONO A3	39.993	100.000	3.999.300	39.993	100.000	3.999.300	39.993	100.000	3.999.300			
ES0305515035	BONO A4	10.523	100.000	1.052.300	10.523	100.000	1.052.300	10.523	100.000	1.052.300			
ES0305515043	BONO A5	8.420	100.000	842.000	8.420	100.000	842.000	8.420	100.000	842.000			
ES0305515050	BONO A6	12.786	100.000	1.278.600	12.786	100.000	1.278.600	12.786	100.000	1.278.600			
ES0305515068	BONO B	18.419	100.000	1.841.900	18.419	100.000	1.841.900	18.419	100.000	1.841.900			
ES0305515076	BONO C	4.211	100.000	421.100	4.211	100.000	421.100	4.211	100.000	421.100			
Total		0723	157.500	0724	15.750.000	1723	157.500	1724	15.750.000	2723	157.500	2724	15.750.000

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas						
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados	Intereses impagados	Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado	0738	0739						
													0730	0731	0732	0733	0734	0735
ES0305515001	BONO A1	NS	EURIBOR 3M	0,25	3,83	1.119	0	SI	5.262.300	0	5.263.419	0						
ES0305515019	BONO A2	NS	EURIBOR 3M	0,35	3,93	230	0	SI	1.052.500	0	1.052.730	0						
ES0305515027	BONO A3	NS	EURIBOR 3M	0,45	4,03	895	0	SI	3.999.300	0	4.000.195	0						
ES0305515035	BONO A4	NS	EURIBOR 3M	0,55	4,13	241	0	SI	1.052.300	0	1.052.541	0						
ES0305515043	BONO A5	NS	EURIBOR 3M	0,65	4,23	198	0	SI	842.000	0	842.198	0						
ES0305515050	BONO A6	NS	EURIBOR 3M	0,75	4,33	307	0	SI	1.278.600	0	1.278.907	0						
ES0305515068	BONO B	S	EURIBOR 3M	1,00	4,58	468	1.805	SI	1.841.900	0	1.844.173	0						
ES0305515076	BONO C	S	EURIBOR 3M	1,50	5,08	119	11.543	SI	421.100	0	432.761	0						
Total						0740	3.577	0741	13.348		0743	15.750.000	0744	0	0745	15.766.924	0746	0

	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 25/11/2020	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	2,36	0748	0,76	0749	0,11

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: 30/06/2023
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2023								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2022							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750	0751	0752	0753	1750	1751	1752	1753								
ES0305515001	BONO A1	0	0	44.042	94.790	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0		
ES0305515019	BONO A2	0	0	9.078	20.026	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0		
ES0305515027	BONO A3	0	0	35.516	80.150	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0		
ES0305515035	BONO A4	0	0	9.614	22.506	0	0	0	0	180	350	0	0	0	0		
ES0305515043	BONO A5	0	0	7.908	20.091	0	0	0	0	359	1.509	0	0	0	0		
ES0305515050	BONO A6	0	0	12.335	33.789	0	0	0	0	872	4.275	0	0	0	0		
ES0305515068	BONO B	0	0	19.287	58.683	0	0	0	0	2.434	13.304	0	0	0	0		
ES0305515076	BONO C	0	0	0	7.688	0	0	0	0	1.094	6.309	0	0	0	0		
Total		0754	0755	0756	0757	1754	1755	1756	1757	0	0	0	0	4.940	25.747		

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: 30/06/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación		
				Situación actual 30/06/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 25/11/2020
				0760	0761	0762
ES0305515001	BONO A1	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515001	BONO A1	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515019	BONO A2	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515019	BONO A2	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515027	BONO A3	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515027	BONO A3	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515035	BONO A4	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515035	BONO A4	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515043	BONO A5	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515043	BONO A5	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515050	BONO A6	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515050	BONO A6	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515068	BONO B	04/12/2020	DBRS	NR	NR	NR
ES0305515068	BONO B	04/12/2020	FCH	NR	NR	NR
ES0305515076	BONO C	04/12/2020	DBRS	NR	NR	NR
ES0305515076	BONO C	04/12/2020	FCH	NR	NR	NR

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2023

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 25/11/2020	
Inferior a 1 año	0765	1.512.938	1765	0	2765	0
Entre 1 y 2 años	0766	2.629.102	1766	2.120.591	2766	0
Entre 2 y 3 años	0767	2.092.846	1767	1.876.925	2767	0
Entre 3 y 4 años	0768	1.717.834	1768	1.634.041	2768	817.367
Entre 4 y 5 años	0769	1.438.506	1769	1.432.405	2769	749.499
Entre 5 y 10 años	0770	4.787.791	1770	5.260.200	2770	3.622.342
Superior a 10 años	0771	1.570.983	1771	3.425.837	2771	10.560.792
Total	0772	15.750.000	1772	15.750.000	2772	15.750.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	5,67	1773	7,91	2773	17,63

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 25/11/2020	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	120.000	1775	120.000	2775	120.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	120.000	1776	120.000	2776	120.000
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	0,76	1777	0,76	2777	0,76
1.3 Denominación de la contrapartida	0778	Ing Direct N.V.	1778	Ing Direct N.V.	2778	Ing Direct N.V.
1.4 Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5 Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2 Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781		1781		2781	
2.1 Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782		1782		2782	
2.2 Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	
2.3 Rating de la contrapartida	0784		1784		2784	
2.4 Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3 Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786		1786		2786	
3.1 Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787		1787		2787	
3.2 Denominación de la entidad avalista	0788		1788		2788	
3.3 Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4 Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4 Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1 Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	85,56	1792	85,60	2792	85,63
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS		Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características	
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 30/06/2023	Situación cierre anual anterior 31/12/2022	Situación inicial 25/11/2020	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Permuta Financiera de Intereses	Ing Direct N.V.	TRIMESTRAL	Tipos fijo 0,5%	Ver Nota S.06	Tipo Rerefencia de los Bonos	Ver Nota S.06	438.942	438.942		
Total							0808 438.942	0809 438.942	0810	

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 25/11/2020		Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación inicial 25/11/2020			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
Total	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	24.465	7006	21.234	7009	0,17	7012	0,14	7015	0,20		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	24.465	7008	21.234	7011	0,17	7014	0,14	7017	0,20	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	13	7020		7021	13.743	7024	8.594	7027	0,09	7030	0,06	7033	0,09		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	13.743	7026	8.594	7029	0,09	7032	0,06	7035	0,09	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio			Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2023		Situación cierre anual anterior 31/12/2022		
	0850		1850		3850
	0851		1851		3851
	0852		1852		3852
	0853		1853		3853

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

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

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene

Información adicional
en fichero adjunto

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida		Importe fijo (miles de euros)		Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)		Mínimo (miles de euros)		Periodicidad pago según folleto / escritura		Condiciones iniciales folleto / escritura emisión		Otras consideraciones	
					Base de cálculo		% anual											
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862	21	2862		3862		4862		5862		6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	Ing Direct N.V.	1863	73	2863		3863		4863		5863		6863	TRIMESTRAL	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	Ing Direct N.V.	1864	5	2864		3864		4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

S.05.5
Denominación Fondo: SOL LION II, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

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

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

S.06

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2023

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene



Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

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