

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: TITULACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.

NIF Gestora: A80352750

Fondo Abierto: SI

Fondo Privado: NO

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2025

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: 31/12/2025				

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2025		Periodo anterior 31/12/2024
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	15.648.984	1001	15.824.981
I. Activos financieros a largo plazo	0002	15.648.984	1002	15.824.981
1. Activos titulizados	0003	14.958.532	1003	15.015.481
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	14.889.969	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	68.563	1025	53.558
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	0	1027	-1
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	690.452	1029	809.500
2.1 Derivados de cobertura	0030	690.452	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: 31/12/2025				

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2025		Periodo anterior 31/12/2024
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	1.099.698	1041	1.057.399
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	979.697	1043	937.346
1. Activos titulizados	0044	641.616	1044	601.381
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	603.096	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	33.242	1065	41.635
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	57	1066	77
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	4.409	1067	2.485
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	838	1068	414
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-26	1069	-6
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	118.514	1071	114.847
2.1 Derivados de cobertura	0072	118.514	1072	114.847
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	219.567	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	219.567	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	120.001	1085	120.053
1. Tesorería	0086	120.001	1086	120.053
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	16.748.682	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: 31/12/2025				

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2025		Periodo anterior 31/12/2024
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	15.330.609	1089	15.397.741
I. Provisiones a largo plazo	0090	68.114	1090	87.002
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	68.114	1092	87.002
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	15.262.495	1094	15.310.740
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	15.142.495	1095	15.190.740
1.1 Series no subordinadas	0096	12.879.495	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: 31/12/2025				

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2025		Periodo anterior 31/12/2024
B) PASIVO CORRIENTE	0117	609.740	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	609.732	1123	560.681
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	609.718	1124	560.672
1.1 Series no subordinadas	0125	607.505	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	2.213	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	14	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	14	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	9	1148	5
1. Comisiones	0149	2	1149	1
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	0	1150	0
1.2 Comisión administrador	0151	2	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	6	1157	4
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	808.333	1158	923.953
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	808.333	1160	923.953
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	16.748.682	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: 31/12/2025							

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2025		Acumulado anterior 31/12/2024
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	105.969	1201	135.649	2201	451.481	3201	576.388
1.1 Activos titulizados	0202	105.969	1202	135.649	2202	451.481	3202	576.388
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-100.919	1204	-155.967	2204	-444.593	3204	-682.315
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-100.281	1205	-154.913	2205	-441.727	3205	-677.653
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-638	1206	-1.054	2206	-2.866	3206	-4.662
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	27.520	1208	44.067	2208	121.042	3208	177.768
A) MARGEN DE INTERESES	0209	32.570	1209	23.749	2209	127.930	3209	71.842
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	-34.867	1217	-30.601	2217	-146.799	3217	-48.826
7.1 Servicios exteriores	0218	-30	1218	-66	2218	-35	3218	-185
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-30	1219	-66	2219	-35	3219	-185
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	-34.837	1224	-30.535	2224	-146.763	3224	-48.642
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-23	1225	-22	2225	-91	3225	-88
7.3.2 Comisión administrador	0226	-73	1226	-73	2226	-291	3226	-289
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-5	1227	-5	2227	-20	3227	-20
7.3.4 Comisión variable	0228	-34.729	1228	-30.428	2228	-146.354	3228	-48.238
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-6	1230	-6	2230	-7	3230	-7
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-19	1231	28	2231	-19	3231	14
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-19	1232	28	2232	-19	3232	14
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	2.317	1234	6.824	2234	18.888	3234	-23.030
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	2.317	1236	6.824	2236	18.888	3236	-23.030
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 PERÍODO	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: 31/12/2025							

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2025		Acumulado anterior 31/12/2024
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-954	1300	-35.013	2300	-10.270	3300	-4.801
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	33.876	1301	-4.485	2301	136.486	3301	44.199
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	106.479	1302	139.460	2302	459.470	3302	582.046
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-99.158	1303	-153.502	2303	-440.926	3303	-707.516
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	27.185	1304	43.674	2304	120.802	3304	178.731
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	-1.045	2307	-2.861	3307	-9.062
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	-33.073	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-34.830	1309	-30.527	2309	-146.755	3309	-49.000
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-23	1310	-22	2310	-91	3310	-88
2.2 Comisión administrador	0311	-73	1311	-73	2311	-290	3311	-653
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	-5	2312	-20	3312	-20
2.4 Comisión variable	0313	-34.729	1313	-30.428	2313	-146.354	3313	-48.238
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	955	1322	1.992	2322	10.217	3322	4.852
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	-435.839	1324	-451.848	2324	-1.814.165	3324	-2.172.585
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	436.823	1325	453.909	2325	1.824.422	3325	2.177.631
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	109.933	1326	109.459	2326	579.847	3326	594.955
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	325.191	1327	343.252	2327	1.236.717	3327	1.577.176
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.699	1328	1.198	2328	7.858	3328	5.500
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	-30	1332	-68	2332	-40	3332	-194
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	-30	1336	-68	2336	-40	3336	-194
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	1	1337	-33.021	2337	-52	3337	52
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	120.000	1338	153.074	2338	120.053	3338	120.001
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	120.001	1339	120.053	2339	120.001	3339	120.053

							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: 31/12/2025							

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2025		Acumulado anterior 31/12/2024
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	-88.195	1357	-195.401	2357	5.422	3357	-60.344
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-88.195	1358	-195.401	2358	5.422	3358	-60.344
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	-27.520	1360	-44.067	2360	-121.042	3360	-177.768
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	115.715	1362	239.468	2362	115.620	3362	238.112
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: 31/12/2025	
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2025					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	Tasa de activos dudosos	Tasa de fallido	
Participaciones hipotecarias	0380		0400	0420	0440	1380	1400	1420	1440	2380	2400	2420	2440		
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	0,47	0401	0,00	0421	0,00	0441	8,25	1381	0,36	1401	0,00	1421	0,00	
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: 31/12/2025	
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	168	0467	25	0474	17	0481	0	0488	42	0495	17.366	0502	0	0509	17.409
De 1 a 3 meses	0461	163	0468	83	0475	39	0482	0	0489	123	0496	16.197	0503	0	0510	16.320
De 3 a 6 meses	0462	134	0469	130	0476	53	0483	20	0490	203	0497	13.579	0504	0	0511	13.782
De 6 a 9 meses	0463	97	0470	187	0477	49	0484	35	0491	271	0498	10.493	0505	0	0512	10.764
De 9 a 12 meses	0464	154	0471	1.018	0478	465	0485	61	0492	1.544	0499	15.339	0506	0	0513	16.883
Más de 12 meses	0465	310	0472	1.572	0479	271	0486	1.150	0493	2.993	0500	30.654	0507	0	0514	33.647
Total	0466	1.026	0473	3.014	0480	895	0487	1.266	0494	5.175	0501	103.630	0508	0	1515	108.805

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	168	0522	25	0529	17	0536	0	0543	42	0550	17.366	0557	0	0564	17.409
De 1 a 3 meses	0516	163	0523	83	0530	39	0537	0	0544	123	0551	16.197	0558	0	0565	16.320
De 3 a 6 meses	0517	134	0524	130	0531	53	0538	20	0545	203	0552	13.579	0559	0	0566	13.782
De 6 a 9 meses	0518	97	0525	187	0532	49	0539	35	0546	271	0553	10.493	0560	0	0567	10.764
De 9 a 12 meses	0519	154	0526	1.018	0533	465	0540	61	0547	1.544	0554	15.339	0561	0	0568	16.883
Más de 12 meses	0520	310	0527	1.572	0534	271	0541	1.150	0548	2.993	0555	30.654	0562	0	0569	33.647
Total	0521	1.026	0528	3.014	0535	895	0542	1.266	0549	5.175	0556	103.630	0563	0	0570	108.805

	S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2025	
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 31/12/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 25/11/2020	
Inferior a 1 año	0600	5.533	1600	5.747	2600
Entre 1 y 2 años	0601	16.763	1601	17.233	2601
Entre 2 y 3 años	0602	29.222	1602	28.140	2602
Entre 3 y 4 años	0603	46.817	1603	41.973	2603
Entre 4 y 5 años	0604	69.242	1604	61.331	2604
Entre 5 y 10 años	0605	723.384	1605	687.198	2605
Superior a 10 años	0606	14.675.076	1606	14.733.121	2606
Total	0607	15.566.037	1607	15.574.743	2607
Vida residual media ponderada (años)	0608	24,54	1608	24,98	2608
					26,27

Antigüedad	Situación actual 31/12/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 25/11/2020
Antigüedad media ponderada (años)	0609	6,52	1609
			6,20
			2609
			4,77

	S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2025	
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 31/12/2025				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	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente
0% - 40%	0620	53.047	0630	2.806.110	1620	52.375	1630	2.824.785	2620	52.254	2630	3.312.476
40% - 60%	0621	49.998	0631	4.796.769	1621	45.820	1631	4.435.714	2621	60.738	2631	6.701.264
60% - 80%	0622	66.162	0632	7.884.547	1622	69.546	1632	8.287.903	2622	119.826	2632	15.570.036
80% - 100%	0623	513	0633	78.611	1623	176	1633	26.341	2623	6.389	2633	880.984
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	169.720	0638	15.566.037	1628	167.917	1638	15.574.743	2628	239.207	2638	26.464.761
Media ponderada (%)	0639	59,40	0649		1639	56,30	1649		2639	58,75	2649	

S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION II, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 31/12/2025
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 31/12/2025		Situación cierre anual anterior 31/12/2024		Situación inicial 25/11/2020	
Tipo de interés medio ponderado	0650	2,87	1650	3,62	2650	1,24
Tipo de interés nominal máximo	0651	6,68	1651	8,17	2651	6,34
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: 31/12/2025											
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 31/12/2025				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	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente
Andalucía	0660	25.846	0683	1.907.983	1660	25.776	1683	1.925.683	2660	37.359	2683	3.383.396
Aragón	0661	3.104	0684	237.949	1661	3.085	1684	237.100	2661	4.077	2684	366.283
Asturias	0662	1.430	0685	93.579	1662	1.481	1685	99.446	2662	2.074	2685	171.293
Baleares	0663	4.876	0686	568.554	1663	5.057	1686	597.400	2663	6.589	2686	888.138
Canarias	0664	8.737	0687	707.800	1664	8.892	1687	738.480	2664	11.128	2687	1.064.929
Cantabria	0665	1.428	0688	104.481	1665	1.511	1688	114.378	2665	2.034	2688	185.735
Castilla-León	0666	4.553	0689	323.767	1666	5.621	1689	461.439	2666	6.544	2689	567.211
Castilla La Mancha	0667	5.509	0690	447.677	1667	4.766	1690	347.542	2667	7.397	2690	697.163
Cataluña	0668	42.328	0691	4.593.511	1668	40.226	1691	4.407.918	2668	57.924	2691	7.438.369
Ceuta	0669	3	0692	184	1669	3	1692	338	2669	6	2692	673
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	0	1693	0	2670	24	2693	1.438
Galicia	0671	3.250	0694	235.580	1671	3.342	1694	248.196	2671	4.568	2694	404.634
Madrid	0672	44.443	0695	4.491.949	1672	45.910	1695	4.707.273	2672	67.010	2695	8.359.609
Melilla	0673	6	0696	591	1673	6	1696	617	2673	6	2696	656
Murcia	0674	3.677	0697	260.781	1674	3.728	1697	269.941	2674	4.853	2697	413.865
Navarra	0675	412	0698	38.369	1675	423	1698	39.300	2675	593	2698	63.481
La Rioja	0676	538	0699	43.426	1676	500	1699	41.202	2676	654	2699	59.784
Comunidad Valenciana	0677	17.812	0700	1.357.034	1677	15.757	1700	1.178.289	2677	23.740	2700	2.115.384
País Vasco	0678	1.768	0701	152.821	1678	1.833	1701	160.200	2678	2.627	2701	282.717
Total España	0679	169.720	0702	15.566.037	1679	167.917	1702	15.574.743	2679	239.207	2702	26.464.761
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680	0	1703	0	2680		2703	
Resto	0681		0704		1681	0	1704	0	2681		2704	
Total general	0682	169.720	0705	15.566.037	1682	167.917	1705	15.574.743	2682	239.207	2705	26.464.761

	S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2025	
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2025			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	0,07	
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: 31/12/2025	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2025			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

	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: 31/12/2025	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Intereses						Principal pendiente		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas				
			0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737					
ES0305515001	BONO A1	NS	EURIBOR 3M	0,25	2,27	663	0	SI	5.262.300	0	5.262.963	0				
ES0305515019	BONO A2	NS	EURIBOR 3M	0,35	2,37	138	0	SI	1.052.500	0	1.052.638	0				
ES0305515027	BONO A3	NS	EURIBOR 3M	0,45	2,47	548	0	SI	3.999.300	0	3.999.848	0				
ES0305515035	BONO A4	NS	EURIBOR 3M	0,55	2,57	150	0	SI	1.052.300	0	1.052.450	0				
ES0305515043	BONO A5	NS	EURIBOR 3M	0,65	2,67	125	0	SI	842.000	0	842.125	0				
ES0305515050	BONO A6	NS	EURIBOR 3M	0,75	2,77	197	0	SI	1.278.600	0	1.278.797	0				
ES0305515068	BONO B	S	EURIBOR 3M	1,00	3,02	309	0	SI	1.841.900	0	1.842.209	0				
ES0305515076	BONO C	S	EURIBOR 3M	1,50	3,52	82	0	SI	421.100	0	421.182	0				
Total				0740	2.213	0741	0		0743	15.750.000	0744	0	0745	15.752.213	0746	0

	Situación actual 31/12/2025	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	2,71	3,40

	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: 31/12/2025	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

Serie	Denominación serie	Situación actual 31/12/2025				Situación periodo comparativo anterior 31/12/2024			
		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	549.328	0	0	47.821	415.875
ES0305515019	BONO A2	0	0	6.199	113.612	0	0	9.830	85.856
ES0305515027	BONO A3	0	0	24.566	445.924	0	0	38.365	336.414
ES0305515035	BONO A4	0	0	6.730	121.423	0	0	10.361	91.545
ES0305515043	BONO A5	0	0	5.598	101.380	0	0	8.503	76.621
ES0305515050	BONO A6	0	0	8.823	160.478	0	0	13.235	121.589
ES0305515068	BONO B	0	0	13.875	254.696	0	0	20.230	194.017
ES0305515076	BONO C	0	0	3.704	68.983	0	0	5.157	52.981
Total		0754	0 0755	0 0756	99.158 0757	1.815.824 1754	0 0 1755	0 0 1756	153.502 1757 1.374.898

	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: 31/12/2025	
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				
				0760	0761	0762	0763	0764
ES0305515001	BONO A1	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515001	BONO A1	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515019	BONO A2	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515019	BONO A2	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515027	BONO A3	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515027	BONO A3	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515035	BONO A4	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515035	BONO A4	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515043	BONO A5	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515043	BONO A5	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515050	BONO A6	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515050	BONO A6	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515068	BONO B	04/12/2020	DBRS	NR	NR	NR	NR	NR
ES0305515068	BONO B	04/12/2020	FCH	NR	NR	NR	NR	NR
ES0305515076	BONO C	04/12/2020	DBRS	NR	NR	NR	NR	NR
ES0305515076	BONO C	04/12/2020	FCH	NR	NR	NR	NR	NR

	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: 31/12/2025	
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 31/12/2025		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	1.862.055	1766	0	2766	0
Entre 2 y 3 años	0767	1.685.552	1767	1.915.033	2767	0
Entre 3 y 4 años	0768	1.576.890	1768	1.688.686	2768	817.367
Entre 4 y 5 años	0769	1.618.518	1769	1.661.458	2769	749.499
Entre 5 y 10 años	0770	5.364.385	1770	7.532.853	2770	3.622.342
Superior a 10 años	0771	3.642.599	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	7,16	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: 31/12/2025	

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo		Situación actual 31/12/2025		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		

	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: 31/12/2025	

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 31/12/2025	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	808.966	924.347		
Total							0808	808.966	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: 31/12/2025	

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	
	Situación actual 31/12/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación inicial 25/11/2020	Situación actual 31/12/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	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	

	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: 31/12/2025	

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago	Días impago	Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto					
			Situación actual 31/12/2025	Situación cierre anual anterior 31/12/2024	Situación actual 31/12/2025	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	31.920	7006	44.865	7009	0,21	7012	0,29	7015	0,18		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	31.920	7008	44.865	7011	0,21	7014	0,29	7017	0,18	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	13	7020		7021	58.343	7024	40.820	7027	0,37	7030	0,26	7033	0,37		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	58.343	7026	40.820	7029	0,37	7032	0,26	7035	0,37	7036	Glosario de Términos

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

	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: 31/12/2025	

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



	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: 31/12/2025	

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)	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: 31/12/2025	

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	
Contrapartida	0870	
Capítulo folleto emisión (sólo Fondos con folleto de emisión)	0871	

Determinada por diferencia entre ingresos y gastos (miles de euros)	0872	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													

	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: 31/12/2025	

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Determinada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)	0885	Fecha cálculo						Total
		28/03/2025	30/06/2025	29/09/2025	29/12/2025			
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885							
Saldo inicial	0886	120.053	120.002	120.000	0			
Cobros del periodo	0887	603.770	588.242	548.578	543.302			
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-102	-107	-101	0			
Pagos por derivados	0889	34.621	32.759	26.238	27.185			
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-120.000	-120.000	-120.000	-120.000			
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-124.186	-118.424	-99.158	-99.158			
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-826	-774	-631	-631			
Resto pagos/retenciones	0893	-472.042	-469.534	-436.751	-435.839			
Saldo disponible	0894	41.287	32.164	38.175	-85.140			
Liquidación de comisión variable	0895	41.285	32.164	38.175	34.729			146.354

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2025

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