

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: 30/06/2026

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: 30/06/2026

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2026		Periodo anterior 31/12/2025
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	15.667.844	1001	15.648.984
I. Activos financieros a largo plazo	0002	15.667.844	1002	15.648.984
1. Activos titulizados	0003	14.977.391	1003	14.958.532
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	14.924.183	1005	14.889.969
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	53.209	1025	68.563
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	0	1027	0
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	690.452	1029	690.452
2.1 Derivados de cobertura	0030	690.452	1030	690.452
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

	S.01
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2026		Periodo anterior 31/12/2025
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	1.083.044	1041	1.099.698
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	963.044	1043	979.697
1. Activos titulizados	0044	639.691	1044	641.616
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	601.555	1046	603.096
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	34.713	1065	33.242
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	68	1066	57
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	3.044	1067	4.409
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	337	1068	838
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-26	1069	-26
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	118.514	1071	118.514
2.1 Derivados de cobertura	0072	118.514	1072	118.514
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	204.839	1074	219.567
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	204.839	1077	219.567
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
VI. Ajustes por periodificaciones	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes	0085	120.000	1085	120.001
1. Tesorería	0086	120.000	1086	120.001
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	16.750.888	1088	16.748.682

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: 30/06/2026

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2026		Periodo anterior 31/12/2025
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	15.336.489	1089	15.330.609
I. Provisiones a largo plazo	0090	71.087	1090	68.114
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	71.087	1092	68.114
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	15.265.401	1094	15.262.495
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	15.145.401	1095	15.142.495
1.1 Series no subordinadas	0096	12.882.401	1096	12.879.495
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: 30/06/2026	

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2026		Periodo anterior 31/12/2025
B) PASIVO CORRIENTE	0117	605.834	1117	609.740
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	605.833	1123	609.732
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	605.825	1124	609.718
1.1 Series no subordinadas	0125	604.599	1125	607.505
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	1.227	1128	2.213
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	8	1131	14
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	8	1136	14
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	0	1139	0
3.1 Derivados de cobertura	0140	0	1140	0
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
VII. Ajustes por periodificaciones	0148	1	1148	9
1. Comisiones	0149	1	1149	2
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	0	1150	0
1.2 Comisión administrador	0151	1	1151	2
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	808.565	1158	808.333
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	808.565	1160	808.333
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	16.750.888	1162	16.748.682

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2026

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2026		Acumulado anterior 30/06/2025
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	109.016	1201	113.776	2201	215.680	3201	236.800
1.1 Activos titulizados	0202	109.016	1202	113.776	2202	215.680	3202	236.800
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-106.076	1204	-115.394	2204	-206.327	3204	-242.789
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-105.398	1205	-114.645	2205	-205.013	3205	-241.199
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-678	1206	-749	2206	-1.314	3206	-1.590
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	32.211	1208	31.713	2208	60.740	3208	66.986
A) MARGEN DE INTERESES	0209	35.151	1209	30.095	2209	70.093	3209	60.996
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	-27.952	1217	-32.264	2217	-61.301	3217	-73.654
7.1 Servicios exteriores	0218	-2	1218	-2	2218	-42	3218	-4
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-2	1219	-2	2219	-42	3219	-4
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	-27.950	1224	-32.262	2224	-61.259	3224	-73.649
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-23	1225	-22	2225	-46	3225	-45
7.3.2 Comisión administrador	0226	-73	1226	-70	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	-27.848	1228	-32.164	2228	-61.057	3228	-73.449
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-1	1230	-1	2230	-1	3230	-1
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	-5.819	1231	0	2231	-5.819	3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	-5.819	1232	0	2232	-5.819	3232	0
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	-1.380	1234	2.169	2234	-2.974	3234	12.657
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	-1.380	1236	2.169	2236	-2.974	3236	12.657
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238	0	3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	0	1239	0	2239	0	3239	0
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERIODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

S.03

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2026

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2026		Acumulado anterior 30/06/2025
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	6.514	1300	19.827	2300	7.093	3300	14.964
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	34.463	1301	52.091	2301	68.352	3301	88.614
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	108.306	1302	116.030	2302	214.699	3302	242.944
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-105.329	1303	-118.424	2303	-205.999	3303	-242.611
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	32.164	1304	32.759	2304	60.972	3304	67.379
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	-678	1307	-774	2307	-1.320	3307	-1.599
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	22.501	2308	0	3308	22.501
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-27.949	1309	-32.264	2309	-61.259	3309	-73.650
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-23	1310	-23	2310	-47	3310	-45
2.2 Comisión administrador	0311	-73	1311	-73	2311	-145	3311	-145
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	-5	2312	-10	3312	-10
2.4 Comisión variable	0313	-27.848	1313	-32.164	2313	-61.057	3313	-73.449
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	-6.514	1322	2.672	2322	-7.094	3322	7.484
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	-479.160	1324	-469.534	2324	-977.963	3324	-941.576
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	472.653	1325	472.212	2325	970.919	3325	949.068
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	142.363	1326	149.671	2326	313.087	3326	303.970
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	317.909	1327	320.505	2327	643.139	3327	641.312
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	12.381	1328	2.036	2328	14.694	3328	3.786
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	-7	1332	-6	2332	-49	3332	-9
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	-7	1336	-6	2336	-49	3336	-9
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	0	1337	22.499	2337	-1	3337	22.448
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	120.000	1338	120.002	2338	120.001	3338	120.053
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	120.000	1339	142.501	2339	120.000	3339	142.501

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2026

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2026		Acumulado anterior 30/06/2025
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	32.164	1357	32.759	2357	60.972	3357	67.379
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	32.164	1358	32.759	2358	60.972	3358	67.379
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	-32.211	1360	-31.713	2360	-60.740	3360	-66.986
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	48	1362	-1.045	2362	-232	3362	-393
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el periodo	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION II, FT
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.
Estados agregados: NO
Fecha: 30/06/2026
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2026								Situación cierre anual anterior 31/12/2025								Hipótesis iniciales folleto/escritura							
	Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada		Tasa de activos dudosos		Tasa de fallido		Tasa de recuperación fallidos		Tasa de amortización anticipada	
Participaciones hipotecarias	0380		0400		0420		0440		1380		1400		1420		1440		2380		2400		2420		2440	
Certificados de transmisión de hipoteca	0381	0,36	0401	0,04	0421	0,00	0441	8,26	1381	0,47	1401	0,00	1421	0,00	1441	8,25	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	6,00
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Prestamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1															
Denominación Fondo: SOL LION II, FT															
Denominación del compartimento:															
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.															
Estados agregados: NO															
Fecha: 30/06/2026															
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	193	0467	32	0474	26	0481	0	0488	59	0495	20.589	0502	0	0509	20.648
De 1 a 3 meses	0461	157	0468	82	0475	41	0482	0	0489	124	0496	17.640	0503	0	0510	17.764
De 3 a 6 meses	0462	135	0469	144	0476	47	0483	16	0490	207	0497	13.332	0504	0	0511	13.539
De 6 a 9 meses	0463	90	0470	168	0477	39	0484	35	0491	243	0498	9.092	0505	0	0512	9.335
De 9 a 12 meses	0464	73	0471	169	0478	34	0485	69	0492	272	0499	7.531	0506	0	0513	7.803
Más de 12 meses	0465	256	0472	1.268	0479	217	0486	888	0493	2.372	0500	24.549	0507	0	0514	26.921
Total	0466	904	0473	1.863	0480	405	0487	1.008	0494	3.276	0501	92.733	0508	0	1515	96.010

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	193	0522	32	0529	26	0536	0	0543	59	0550	20.589	0557	0	0564	20.648	0571	35.427	0578	35.427	0584	58,28
De 1 a 3 meses	0516	157	0523	82	0530	41	0537	0	0544	124	0551	17.640	0558	0	0565	17.764	0572	29.294	0579	29.294	0585	60,64
De 3 a 6 meses	0517	135	0524	144	0531	47	0538	16	0545	207	0552	13.332	0559	0	0566	13.539	0573	23.025	0580	23.025	0586	58,80
De 6 a 9 meses	0518	90	0525	168	0532	39	0539	35	0546	243	0553	9.092	0560	0	0567	9.335	0574	15.768	0581	15.768	0587	59,20
De 9 a 12 meses	0519	73	0526	169	0533	34	0540	69	0547	272	0554	7.531	0561	0	0568	7.803	0575	12.990	0582	12.990	0588	60,07
Más de 12 meses	0520	256	0527	1.268	0534	217	0541	888	0548	2.372	0555	24.549	0562	0	0569	26.921	0576	43.427	0583	43.427	0589	61,99
Total	0521	904	0528	1.863	0535	405	0542	1.008	0549	3.276	0556	92.733	0563	0	0570	96.010	0577	159.930			0590	60,03

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: 30/06/2026
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 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 25/11/2020	
Inferior a 1 año	0600	4.882	1600	5.533	2600	1.505
Entre 1 y 2 años	0601	16.484	1601	16.763	2601	10.359
Entre 2 y 3 años	0602	31.049	1602	29.222	2602	23.033
Entre 3 y 4 años	0603	47.527	1603	46.817	2603	38.066
Entre 4 y 5 años	0604	72.825	1604	69.242	2604	60.435
Entre 5 y 10 años	0605	753.043	1605	723.384	2605	690.461
Superior a 10 años	0606	14.656.181	1606	14.675.076	2606	26.618.866
Total	0607	15.581.990	1607	15.566.037	2607	27.442.724
Vida residual media ponderada (años)	0608	24,33	1608	24,54	2608	26,31

Antigüedad	Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 25/11/2020	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	6,65	1609	6,52	2609	4,68

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: 30/06/2026	
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 30/06/2026				Situación cierre anual anterior 31/12/2025				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	53.375	0630	2.814.577	1620	53.047	1630	2.806.110	2620	53.433	2630	3.412.515
40% - 60%	0621	52.692	0631	5.073.272	1621	49.998	1631	4.796.769	2621	63.639	2631	7.047.052
60% - 80%	0622	63.483	0632	7.591.432	1622	66.162	1632	7.884.547	2622	123.197	2632	16.059.493
80% - 100%	0623	635	0633	102.709	1623	513	1633	78.611	2623	6.632	2633	923.664
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	170.185	0638	15.581.990	1628	169.720	1638	15.566.037	2628	246.901	2638	27.442.724
Media ponderada (%)	0639	60,51	0649		1639	59,40	1649		2639	58,75	2649	

SOL LION II, FT

	S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	
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 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 25/11/2020	
Tipo de interés medio ponderado	0650	2,76	1650	2,87	2650	1,29
Tipo de interés nominal máximo	0651	7,24	1651	6,68	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: 30/06/2026	
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 30/06/2026				Situación cierre anual anterior 31/12/2025				Situación inicial 25/11/2020			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	24.805	0683	1.796.406	1660	25.846	1683	1.907.983	2660	37.359	2683	3.383.396
Aragón	0661	3.140	0684	240.396	1661	3.104	1684	237.949	2661	4.233	2684	382.095
Asturias	0662	1.405	0685	91.480	1662	1.430	1685	93.579	2662	2.119	2685	175.828
Baleares	0663	4.847	0686	564.306	1663	4.876	1686	568.554	2663	6.748	2686	916.505
Canarias	0664	8.836	0687	714.392	1664	8.737	1687	707.800	2664	11.497	2687	1.106.628
Cantabria	0665	1.397	0688	101.780	1665	1.428	1688	104.481	2665	2.070	2688	189.999
Castilla-León	0666	4.492	0689	315.907	1666	4.553	1689	323.767	2666	6.690	2689	579.899
Castilla La Mancha	0667	5.537	0690	451.257	1667	5.509	1690	447.677	2667	7.676	2690	727.697
Cataluña	0668	43.176	0691	4.671.237	1668	42.328	1691	4.593.511	2668	60.507	2691	7.791.878
Ceuta	0669	2	0692	158	1669	3	1692	184	2669	6	2692	673
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	0	1693	0	2670	24	2693	1.438
Galicia	0671	3.196	0694	228.570	1671	3.250	1694	235.580	2671	4.648	2694	413.509
Madrid	0672	44.142	0695	4.463.737	1672	44.443	1695	4.491.949	2672	68.867	2695	8.635.378
Melilla	0673	6	0696	579	1673	6	1696	591	2673	6	2696	656
Murcia	0674	3.713	0697	262.540	1674	3.677	1697	260.781	2674	5.036	2697	430.907
Navarra	0675	416	0698	39.046	1675	412	1698	38.369	2675	612	2698	66.135
La Rioja	0676	544	0699	43.915	1676	538	1699	43.426	2676	677	2699	62.202
Comunidad Valenciana	0677	18.755	0700	1.441.025	1677	17.812	1700	1.357.034	2677	25.389	2700	2.280.747
País Vasco	0678	1.776	0701	155.259	1678	1.768	1701	152.821	2678	2.737	2701	297.155
Total España	0679	170.185	0702	15.581.990	1679	169.720	1702	15.566.037	2679	246.901	2702	27.442.724
Otros países Unión Europea	0680		0703		1680		1703		2680		2703	
Resto	0681		0704		1681		1704		2681		2704	
Total general	0682	170.185	0705	15.581.990	1682	169.720	1705	15.566.037	2682	246.901	2705	27.442.724

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: 30/06/2026	
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 30/06/2026				Situación cierre anual anterior 31/12/2025				Situación inicial 25/11/2020			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,05			1710	0,05			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: 30/06/2026															
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF															

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2026					Situación cierre anual anterior 31/12/2025					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
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: 30/06/2026											
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF											

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente				Total Pendiente		Correcciones de valor por repercusión de pérdidas									
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados		Intereses impagados		Serie devenga intereses en el periodo		Principal no vencido					Principal impagado							
		0730												0731	0732	0733			0734	0735	0742	0736	0737	0738
ES0305515001	BONO A1	NS	EURIBOR 3M	0,25	2,54	372		0		SI		5.262.300		0		5.262.672		0						
ES0305515019	BONO A2	NS	EURIBOR 3M	0,35	2,64	77		0		SI		1.052.500		0		1.052.577		0						
ES0305515027	BONO A3	NS	EURIBOR 3M	0,45	2,74	305		0		SI		3.999.300		0		3.999.605		0						
ES0305515035	BONO A4	NS	EURIBOR 3M	0,55	2,84	83		0		SI		1.052.300		0		1.052.383		0						
ES0305515043	BONO A5	NS	EURIBOR 3M	0,65	2,94	69		0		SI		842.000		0		842.069		0						
ES0305515050	BONO A6	NS	EURIBOR 3M	0,75	3,04	108		0		SI		1.278.600		0		1.278.708		0						
ES0305515068	BONO B	S	EURIBOR 3M	1,00	3,29	168		0		SI		1.841.900		0		1.842.068		0						
ES0305515076	BONO C	S	EURIBOR 3M	1,50	3,79	44		0		SI		421.100		0		421.144		0						
Total							0740	1.227		0741	0		0743		15.750.000	0744	0		0745		15.751.227	0746	0	

	Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 25/11/2020	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	2,56	0748	2,71	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: 30/06/2026		
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF		

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2026								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2025							
Serie	Denominación serie	Amortización principal				Intereses				Amortización principal				Intereses			
		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados		Pagos del periodo		Pagos acumulados	
		0750		0751		0752		0753		1750		1751		1752		1753	
ES0305515001	BONO A1	0		0		31.725		611.222		0		0		35.986		490.001	
ES0305515019	BONO A2	0		0		6.611		126.523		0		0		7.472		101.214	
ES0305515027	BONO A3	0		0		26.133		497.007		0		0		29.438		396.793	
ES0305515035	BONO A4	0		0		7.142		135.396		0		0		8.020		107.964	
ES0305515043	BONO A5	0		0		5.928		112.986		0		0		6.637		90.184	
ES0305515050	BONO A6	0		0		9.324		178.749		0		0		10.413		142.831	
ES0305515068	BONO B	0		0		14.596		283.344		0		0		16.203		226.947	
ES0305515076	BONO C	0		0		3.869		76.597		0		0		4.254		61.574	
Total		0754	0	0755	0	0756	105.329	0757	2.021.823	1754	0	1755	0	1756	118.424	1757	1.617.508

SOL LION II, FT

	S.05.2
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Periodo de la declaración: 30/06/2026	
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 30/06/2026	Situación cierre anual anterior 31/12/2025	Situación inicial 25/11/2020
		0760	0761	0762	0763	0764
ES0305515001	BONO A1	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515001	BONO A1	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515019	BONO A2	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515019	BONO A2	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515027	BONO A3	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515027	BONO A3	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515035	BONO A4	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515035	BONO A4	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515043	BONO A5	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515043	BONO A5	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515050	BONO A6	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515050	BONO A6	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515068	BONO B	04/12/2020	DBRS	NR	NR	NR
ES0305515068	BONO B	04/12/2020	FCH	NR	NR	NR
ES0305515076	BONO C	04/12/2020	DBRS	NR	NR	NR
ES0305515076	BONO C	04/12/2020	FCH	NR	NR	NR

SOL LION II, FT

	S.05.2
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Periodo de la declaración: 30/06/2026	
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 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 25/11/2020	
Inferior a 1 año	0765	1.005.662	1765	0	2765	0
Entre 1 y 2 años	0766	1.802.526	1766	1.862.055	2766	0
Entre 2 y 3 años	0767	1.618.834	1767	1.685.552	2767	0
Entre 3 y 4 años	0768	1.619.273	1768	1.576.890	2768	817.367
Entre 4 y 5 años	0769	1.378.559	1769	1.618.518	2769	749.499
Entre 5 y 10 años	0770	4.814.583	1770	5.364.385	2770	3.622.342
Superior a 10 años	0771	3.510.564	1771	3.642.599	2771	10.560.792
Total	0772	15.750.000	1772	15.750.000	2772	15.750.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	6,66	1773	7,16	2773	17,63

	S.05.3
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo		Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 25/11/2020	
1	Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	120.000	1775	120.000	2775	120.000
1.1	Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	120.000	1776	120.000	2776	120.000
1.2	Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	0,76	1777	0,76	2777	0,76
1.3	Denominación de la contrapartida	0778	Ing Direct N.V.	1778	Ing Direct N.V.	2778	Ing Direct N.V.
1.4	Rating de la contrapartida	0779		1779		2779	
1.5	Rating requerido de la contrapartida	0780		1780		2780	
2	Importe disponible de la línea/s de liquidez (miles de euros)	0781		1781		2781	
2.1	Porcentaje que representa el importe disponible de la línea de liquidez sobre el total de pasivos emitidos (%)	0782		1782		2782	
2.2	Denominación de la contrapartida	0783		1783		2783	
2.3	Rating de la contrapartida	0784		1784		2784	
2.4	Rating requerido de la contrapartida	0785		1785		2785	
3	Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales (miles de euros)	0786		1786		2786	
3.1	Porcentaje que representan los avales sobre el total de los pasivos emitidos (%)	0787		1787		2787	
3.2	Denominación de la entidad avalista	0788		1788		2788	
3.3	Rating del avalista	0789		1789		2789	
3.4	Rating requerido del avalista	0790		1790		2790	
4	Subordinación de series (S/N)	0791	S	1791	S	2791	S
4.1	Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total bonos (%)	0792	85,63	1792	85,63	2792	85,63
5	Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793	
5.1	Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794	
5.2	Rating de la contrapartida	0795		1795		2795	
5.3	Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796	

SOL LION II, FT

S.05.3										
Denominación Fondo: SOL LION II, FT										
Denominación del compartimento:										
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.										
Estados agregados: NO										
Fecha: 30/06/2026										

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 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		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		808.966			
Total							0808	808.966	0809	808.966	0810	

S.05.3													
Denominación Fondo: SOL LION II, FT													
Denominación del compartimento:													
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.													
Estados agregados: NO													
Fecha: 30/06/2026													

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
Naturaleza riesgo cubierto	Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación inicial 25/11/2020		Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		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: 30/06/2026															

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

					Importe impagado acumulado				Ratio						Ref. Folleto	
Concepto	Meses impago		Días impago		Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Última Fecha Pago			
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	26.129	7006	31.920	7009	0,17	7012	0,21	7015	0,22		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	26.129	7008	31.920	7011	0,17	7014	0,21	7017	0,22	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	13	7020		7021	48.088	7024	58.343	7027	0,31	7030	0,37	7033	0,31		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	48.088	7026	58.343	7029	0,31	7032	0,37	7035	0,31	7036	Glosario de Términos

	Ratio						Ref. Folleto	
Otras ratios relevantes	Situación actual 30/06/2026		Situación cierre anual anterior 31/12/2025		Última Fecha Pago			
	0850		1850		2850		3850	
	0851		1851		2851		3851	
	0852		1852		2852		3852	
	0853		1853		2853		3853	

SOL LION II, FT

	S.05.4
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

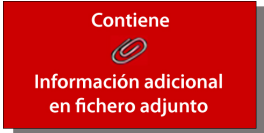
CUADRO B

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

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



Contiene
Información adicional
en fichero adjunto

SOL LION II, FT

S.05.5																
Denominación Fondo: SOL LION II, FT																
Denominación del compartimento:																
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.																
Estados agregados: NO																
Fecha: 30/06/2026																

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	23	2862		3862		4862		5862		6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	Ing Direct N.V.	1863	73	2863		3863		4863		5863		6863	TRIMESTRAL	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	Ing Direct N.V.	1864	5	2864		3864		4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

	S.05.5
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

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

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

SOL LION II, FT

	S.05.5
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 30/06/2026	

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo													Total
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885	28/03/2026	29/06/2026	16/03/2026	15/04/2026	18/05/2026	15/06/2026								
Saldo inicial	0886	120.001	120.000	0	0	0	0								
Cobros del periodo	0887	604.659	580.959	3.030	5.650	3.439	3.294								
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-144	-108	-478	-444	-363	-459								
Pagos por derivados	0889	28.809	32.164	0	0	0	0								
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-120.000	-120.000	0	0	0	0								
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-100.671	-105.329	-2.552	-5.206	-3.076	-2.835								
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-642	-678	0	0	0	0								
Resto pagos/retenciones	0893	-498.803	-479.160	0	0	0	0								
Saldo disponible	0894	33.209	27.848	0	0	0	0								
Liquidación de comisión variable	0895	33.209	27.848	0	0	0	0								61.057

	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: 30/06/2026	

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	