

**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: 30/06/2021

**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)

<b>S.01</b>
<b>Denominación Fondo: SOL LION II, FT</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/06/2021</b>

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
<b>ACTIVO</b>				
<b>A) ACTIVO NO CORRIENTE</b>	0001	15.085.142	1001	13.259.943
<b>I. Activos financieros a largo plazo</b>	0002	15.085.142	1002	13.259.943
1. Activos titulizados	0003	15.085.142	1003	13.259.943
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	15.082.454	1005	13.259.943
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	2.688	1025	0
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	0	1029	0
2.1 Derivados de cobertura	0030	0	1030	0
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
<b>II. Activos por impuesto diferido</b>	0039	0	1039	0
<b>III. Otros activos no corrientes</b>	0040	0	1040	0

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
<b>B) ACTIVO CORRIENTE</b>	0041	806.692	1041	939.742
<b>IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0042	0	1042	0
<b>V. Activos financieros a corto plazo</b>	0043	686.692	1043	715.260
1. Activos titulizados	0044	538.286	1044	550.564
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	527.770	1046	539.633
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	10.397	1065	10.928
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	9	1066	3
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	104	1067	0
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	6	1068	0
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	0	1069	0
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	0	1071	0
2.1 Derivados de cobertura	0072	0	1072	0
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	148.406	1074	164.696
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	148.406	1077	164.696
3.4 Garantías financieras	0078	0	1078	0
3.5 Otros	0079	0	1079	0
3.6 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0080	0	1080	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0081		1081	
<b>VI. Ajustes por periodificaciones</b>	0082	0	1082	0
1. Comisiones	0083	0	1083	0
2. Otros	0084	0	1084	0
<b>VII. Efectivo y otros activos líquidos equivalentes</b>	0085	120.000	1085	224.482
1. Tesorería	0086	120.000	1086	224.482
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
<b>TOTAL ACTIVO</b>	0088	15.891.834	1088	14.199.685

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
<b>PASIVO</b>				
<b>A) PASIVO NO CORRIENTE</b>	0089	15.500.461	1089	13.793.843
<b>I. Provisiones a largo plazo</b>	0090	21.475	1090	19.916
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	21.475	1092	19.916
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
<b>II. Pasivos financieros a largo plazo</b>	0094	15.478.986	1094	13.773.927
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	15.222.126	1095	13.516.867
1.1 Series no subordinadas	0096	12.959.126	1096	11.497.267
1.2 Series subordinadas	0097	2.263.000	1097	2.019.600
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	120.200
2.1 Préstamo subordinado	0102	120.000	1102	120.200
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	136.860	1108	136.860
3.1 Derivados de cobertura	0109	136.860	1109	136.860
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
<b>III. Pasivos por impuesto diferido</b>	0116	0	1116	0

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 30/06/2021		Periodo anterior 31/12/2020
<b>B) PASIVO CORRIENTE</b>	0117	555.608	1117	568.358
<b>IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta</b>	0118	0	1118	0
<b>V. Provisiones a corto plazo</b>	0119	0	1119	0
1. Provisión garantías financieras	0120	0	1120	0
2. Provisión por margen de intermediación	0121	0	1121	0
3. Otras provisiones	0122	0	1122	0
<b>VI. Pasivos financieros a corto plazo</b>	0123	555.521	1123	568.345
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	527.965	1124	540.788
1.1 Series no subordinadas	0125	527.874	1125	539.633
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	91	1128	1.156
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	0	1131	0
2.1 Préstamo subordinado	0132	0	1132	0
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0133	0	1133	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0134	0	1134	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0135	0	1135	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0136	0	1136	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	0
2.7 Ajustes por operaciones de cobertura	0138	0	1138	0
3. Derivados	0139	27.556	1139	27.556
3.1 Derivados de cobertura	0140	27.556	1140	27.556
3.2 Derivados de negociación	0141	0	1141	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0142	0	1142	0
4. Otros pasivos financieros	0143	0	1143	0
4.1 Acreedores y otras cuentas a pagar	0144	0	1144	0
4.2 Garantías financieras	0145	0	1145	0
4.3 Otros	0146	0	1146	0
4.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0147	0	1147	0
<b>VII. Ajustes por periodificaciones</b>	0148	87	1148	13
1. Comisiones	0149	87	1149	8
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	0	1150	6
1.2 Comisión administrador	0151	86	1151	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0152	0	1152	1
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	5
<b>C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS</b>	0158	-164.235	1158	-162.516
<b>VIII. Activos financieros disponibles para la venta</b>	0159	0	1159	0
<b>IX. Coberturas de flujos de efectivo</b>	0160	-164.235	1160	-162.516
<b>X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>	0161	0	1161	0
<b>TOTAL PASIVO</b>	0162	15.891.834	1162	14.199.685

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2021		Acumulado anterior 30/06/2020
<b>1. Intereses y rendimientos asimilados</b>	0201	34.895	1201	0	2201	67.395	3201	0
1.1 Activos titulizados	0202	34.895	1202	0	2202	67.395	3202	0
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
<b>2. Intereses y cargas asimilados</b>	0204	-4.130	1204	0	2204	-7.987	3204	0
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-4.130	1205	0	2205	-7.987	3205	0
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	0	1206	0	2206	0	3206	0
2.3 Otros pasivos financieros	0207	0	1207	0	2207	0	3207	0
<b>3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)</b>	0208	-8.003	1208	0	2208	-14.372	3208	0
<b>A) MARGEN DE INTERESES</b>	0209	22.762	1209	0	2209	45.036	3209	0
<b>4. Resultado de operaciones financieras (neto)</b>	0210	0	1210	0	2210	0	3210	0
4.1 Resultados de derivados de negociación	0211	0	1211	0	2211	0	3211	0
4.2 Otros ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0212	0	1212	0	2212	0	3212	0
4.3 Activos financieros disponibles para la venta	0213	0	1213	0	2213	0	3213	0
4.4 Otros	0214	0	1214	0	2214	0	3214	0
<b>5. Diferencias de cambio (neto)</b>	0215	0	1215	0	2215	0	3215	0
<b>6. Otros ingresos de explotación</b>	0216	0	1216	0	2216	0	3216	0
<b>7. Otros gastos de explotación</b>	0217	-22.438	1217	0	2217	-43.477	3217	0
7.1 Servicios exteriores	0218	-197	1218	0	2218	-479	3218	0
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-197	1219	0	2219	-479	3219	0
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	-22.241	1224	0	2224	-42.998	3224	0
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-19	1225	0	2225	-38	3225	0
7.3.2 Comisión administrador	0226	-3.975	1226	0	2226	-8.537	3226	0
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-5	1227	0	2227	-10	3227	0
7.3.4 Comisión variable	0228	-18.243	1228	0	2228	-34.413	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	0	1230	0	2230	0	3230	0
<b>8. Deterioro de activos financieros (neto)</b>	0231	0	1231	0	2231	0	3231	0
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	0	1232	0	2232	0	3232	0
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
<b>9. Dotaciones a provisiones (neto)</b>	0234	-324	1234	0	2234	-1.559	3234	0
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	-324	1236	0	2236	-1.559	3236	0
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
<b>10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta</b>	0238	0	1238	0	2238	0	3238	0
<b>11. Repercusión de pérdidas (ganancias)</b>	0239	0	1239	0	2239	0	3239	0
<b>B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS</b>	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
<b>12. Impuesto sobre beneficios</b>	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
<b>C) RESULTADO DEL PERIODO</b>	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2021		Acumulado anterior 30/06/2020
<b>A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION</b>	0300	-353	1300	0	2300	-147	3300	0
<b>1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones</b>	0301	21.888	1301	0	2301	42.772	3301	0
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	34.015	1302	0	2302	67.914	3302	0
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-4.130	1303	0	2303	-9.052	3303	0
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	0	1304	0	2304	0	3304	0
1.6 Pagos por operaciones de derivados de cobertura	0305	-7.997	1305	0	2305	-16.091	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	0	1307	0	2307	0	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	0	1308	0	2308	0	3308	0
<b>2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados</b>	0309	-22.242	1309	0	2309	-42.918	3309	0
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-19	1310	0	2310	-44	3310	0
2.2 Comisión administrador	0311	-3.975	1311	0	2311	-8.451	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	0	2312	-11	3312	0
2.4 Comisión variable	0313	-18.243	1313	0	2313	-34.413	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
<b>3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación</b>	0315	0	1315	0	2315	0	3315	0
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
<b>B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION</b>	0322	332	1322	0	2322	-104.335	3322	0
<b>4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización</b>	0323	0	1323	0	2323	1.693.500	3323	0
<b>5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros</b>	0324	-416.487	1324	0	2324	-2.583.533	3324	0
<b>6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos</b>	0325	417.021	1325	0	2325	786.383	3325	0
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	169.395	1326	0	2326	334.318	3326	0
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	247.586	1327	0	2327	452.001	3327	0
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	40	1328	0	2328	64	3328	0
6.4 Cobros por amortización de activos previamente clasificados como fallidos	0329	0	1329	0	2329	0	3329	0
6.5 Cobros netos procedentes de activos recibidos por ejecución de garantías	0330	0	1330	0	2330	0	3330	0
6.6 Pagos por amortización de obligaciones y otros valores emitidos	0331	0	1331	0	2331	0	3331	0
<b>7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo</b>	0332	-202	1332	0	2332	-685	3332	0
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	-200	3334	0
7.3 Pagos a Administraciones públicas	0335	0	1335	0	2335	0	3335	0
7.4 Otros cobros y pagos	0336	-202	1336	0	2336	-485	3336	0
<b>C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES</b>	0337	-21	1337	0	2337	-104.482	3337	0
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	120.022	1338	0	2338	224.482	3338	0
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	120.000	1339	0	2339	120.000	3339	0

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (2. trimestre)		P. corriente anterior (2. trimestre)		Acumulado actual 30/06/2021		Acumulado anterior 30/06/2020
<b>1. Activos financieros disponibles para la venta</b>								
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0350	0	1350	0	2350	0	3350	0
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0351	0	1351	0	2351	0	3351	0
1.1.2 Efecto fiscal	0352	0	1352	0	2352	0	3352	0
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0353	0	1353	0	2353	0	3353	0
1.3 Otras reclasificaciones	0354	0	1354	0	2354	0	3354	0
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0355	0	1355	0	2355	0	3355	0
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta</b>	<b>0356</b>	<b>0</b>	<b>1356</b>	<b>0</b>	<b>2356</b>	<b>0</b>	<b>3356</b>	<b>0</b>
<b>2. Cobertura de los flujos de efectivo</b>								
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	0357	-7.997	1357	0	2357	-16.091	3357	0
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-7.997	1358	0	2358	-16.091	3358	0
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	8.003	1360	0	2360	14.372	3360	0
2.3 Otras reclasificaciones	0361	0	1361	0	2361	0	3361	0
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0362	-6	1362	0	2362	1.719	3362	0
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables</b>	<b>0363</b>	<b>0</b>	<b>1363</b>	<b>0</b>	<b>2363</b>	<b>0</b>	<b>3363</b>	<b>0</b>
<b>3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos</b>								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el período	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el período	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
<b>Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias</b>	<b>0369</b>	<b>0</b>	<b>1369</b>	<b>0</b>	<b>2369</b>	<b>0</b>	<b>3369</b>	<b>0</b>
<b>TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)</b>	<b>0370</b>	<b>0</b>	<b>1370</b>	<b>0</b>	<b>2370</b>	<b>0</b>	<b>3370</b>	<b>0</b>

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO A**

Ratios (%)	Situación actual 30/06/2021								Situación cierre anual anterior 31/12/2020								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	0,02	0401	0,00	0421	0,00	0441	4,14	1381	0,00	1401	0,00	1421	0,00	1441	0,76	2381	0,00	2401	0,00	2421	0,00	2441	6,00
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442		2382		2402		2422		2442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443		2383		2403		2423		2443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444		2384		2404		2424		2444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445		2385		2405		2425		2445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446		2386		2406		2426		2446	
Préstamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447		2387		2407		2427		2447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448		2388		2408		2428		2448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449		2389		2409		2429		2449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450		2390		2410		2430		2450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451		2391		2411		2431		2451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452		2392		2412		2432		2452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453		2393		2413		2433		2453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454		2394		2414		2434		2454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455		2395		2415		2435		2455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456		2396		2416		2436		2456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457		2397		2417		2437		2457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458		2398		2418		2438		2458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459		2399		2419		2439		2459	

S.05.1

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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	53	0467	12	0474	4	0481	0	0488	16	0495	5.666	0502	0	0509	5.682
De 1 a 3 meses	0461	43	0468	29	0475	5	0482	0	0489	34	0496	4.461	0503	0	0510	4.495
De 3 a 6 meses	0462	19	0469	23	0476	3	0483	1	0490	28	0497	1.909	0504	0	0511	1.937
De 6 a 9 meses	0463	8	0470	13	0477	3	0484	3	0491	19	0498	846	0505	0	0512	865
De 9 a 12 meses	0464	0	0471	0	0478	0	0485	0	0492	0	0499	0	0506	0	0513	0
Más de 12 meses	0465	0	0472	0	0479	0	0486	0	0493	0	0500	0	0507	0	0514	0
<b>Total</b>	<b>0466</b>	<b>123</b>	<b>0473</b>	<b>77</b>	<b>0480</b>	<b>15</b>	<b>0487</b>	<b>4</b>	<b>0494</b>	<b>97</b>	<b>0501</b>	<b>12.882</b>	<b>0508</b>	<b>0</b>	<b>1515</b>	<b>12.979</b>

Impagados con garantía real (miles de euros)	Nº de activos		Importe impagado								Principal pendiente no vencido		Otros importes		Deuda Total		Valor garantía		Valor Garantía con Tasación > 2 años		% Deuda / v. Tasación	
			Principal pendiente vencido		Intereses devengados en contabilidad		Intereses interrumpidos en contabilidad		Total													
Hasta 1 mes	0515	53	0522	12	0529	4	0536	0	0543	16	0550	5.666	0557	0	0564	5.682	0571	9.840	0578	9.840	0584	57,74
De 1 a 3 meses	0516	43	0523	29	0530	5	0537	0	0544	34	0551	4.461	0558	0	0565	4.495	0572	7.989	0579	7.989	0585	56,27
De 3 a 6 meses	0517	19	0524	23	0531	3	0538	1	0545	28	0552	1.909	0559	0	0566	1.937	0573	3.235	0580	3.235	0586	59,87
De 6 a 9 meses	0518	8	0525	13	0532	3	0539	3	0546	19	0553	846	0560	0	0567	865	0574	1.550	0581	1.550	0587	55,83
De 9 a 12 meses	0519	0	0526	0	0533	0	0540	0	0547	0	0554	0	0561	0	0568	0	0575	0	0582	0	0588	0,00
Más de 12 meses	0520	0	0527	0	0534	0	0541	0	0548	0	0555	0	0562	0	0569	0	0576	0	0583	0	0589	0,00
<b>Total</b>	<b>0521</b>	<b>123</b>	<b>0528</b>	<b>77</b>	<b>0535</b>	<b>15</b>	<b>0542</b>	<b>4</b>	<b>0549</b>	<b>97</b>	<b>0556</b>	<b>12.882</b>	<b>0563</b>	<b>0</b>	<b>0570</b>	<b>12.979</b>	<b>0577</b>	<b>22.613</b>			<b>0590</b>	<b>57,39</b>

S.05.1

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 25/11/2020	
Inferior a 1 año	0600	2.488	1600	1.292	2600	975
Entre 1 y 2 años	0601	11.164	1601	8.347	2601	8.632
Entre 2 y 3 años	0602	22.176	1602	18.883	2602	20.258
Entre 3 y 4 años	0603	37.310	1603	31.181	2603	34.068
Entre 4 y 5 años	0604	58.096	1604	47.164	2604	52.869
Entre 5 y 10 años	0605	574.858	1605	485.450	2605	540.322
Superior a 10 años	0606	14.906.924	1606	13.207.258	2606	13.768.481
<b>Total</b>	0607	<b>15.613.016</b>	1607	<b>13.799.575</b>	2607	<b>14.425.606</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	0608	<b>25,93</b>	1608	<b>26,01</b>	2608	<b>25,79</b>

Antigüedad	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 25/11/2020	
Antigüedad media ponderada (años)	0609	5,47	1609	5,27	2609	5,44

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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 30/06/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				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	44.114	0630	2.516.372	1620	37.592	1630	2.207.081	2620	40.853	2630	2.401.942
40% - 60%	0621	41.547	0631	4.417.477	1621	36.942	1631	3.987.973	2621	38.805	2631	4.197.863
60% - 80%	0622	68.184	0632	8.325.668	1622	59.145	1632	7.261.501	2622	60.324	2632	7.420.206
80% - 100%	0623	2.612	0633	353.500	1623	2.797	1633	343.021	2623	3.283	2633	405.595
100% - 120%	0624	0	0634	0	1624	0	1634	0	2624	0	2634	0
120% - 140%	0625	0	0635	0	1625	0	1635	0	2625	0	2635	0
140% - 160%	0626	0	0636	0	1626	0	1636	0	2626	0	2636	0
superior al 160%	0627	0	0637	0	1627	0	1637	0	2627	0	2637	0
<b>Total</b>	0628	<b>156.457</b>	0638	<b>15.613.016</b>	1628	<b>136.476</b>	1638	<b>13.799.575</b>	2628	<b>143.265</b>	2638	<b>14.425.606</b>
<b>Media ponderada (%)</b>	0639	<b>58,59</b>	0649		1639	<b>58,54</b>	1649		2639	<b>58,25</b>	2649	

S.05.1

**Denominación Fondo:** SOL LION II, FT

**Denominación del compartimento:**

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

**Estados agregados:** NO

**Fecha:** 30/06/2021

**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 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 25/11/2020	
Tipo de interés medio ponderado	0650	0,95	1650	1,03	2650	1,02
Tipo de interés nominal máximo	0651	4,67	1651	4,41	2651	4,41
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,00	2652	0,00

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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 30/06/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 25/11/2020			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Andalucía	0660	27.018	0683	2.244.645	1660	24.446	1683	2.074.321	2660	25.798	2683	2.181.474
Aragón	0661	2.320	0684	188.273	1661	1.986	1684	164.164	2661	2.038	2684	169.227
Asturias	0662	1.386	0685	102.644	1662	1.257	1685	94.967	2662	1.294	2685	98.769
Baleares	0663	4.154	0686	506.471	1663	3.613	1686	439.255	2663	3.691	2686	449.647
Canarias	0664	7.281	0687	648.068	1664	6.320	1687	568.716	2664	6.548	2687	586.488
Cantabria	0665	1.294	0688	109.490	1665	1.169	1688	100.925	2665	1.210	2688	104.191
Castilla-León	0666	4.424	0689	356.303	1666	3.874	1689	316.666	2666	4.058	2689	332.846
Castilla La Mancha	0667	4.256	0690	360.944	1667	3.578	1690	305.431	2667	3.835	2690	326.690
Cataluña	0668	37.925	0691	4.473.410	1668	32.546	1691	3.860.612	2668	33.476	2691	3.975.503
Ceuta	0669	25	0692	1.803	1669	25	1692	1.793	2669	26	2692	1.912
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	0	1693	0	2670	0	2693	0
Galicia	0671	2.999	0694	238.039	1671	2.533	1694	204.472	2671	2.792	2694	223.152
Madrid	0672	44.000	0695	4.786.818	1672	38.338	1695	4.257.260	2672	40.701	2695	4.487.714
Melilla	0673	14	0696	980	1673	12	1696	807	2673	13	2696	911
Murcia	0674	3.076	0697	243.967	1674	2.455	1697	202.163	2674	2.835	2697	226.980
Navarra	0675	336	0698	30.722	1675	291	1698	26.560	2675	306	2698	28.167
La Rioja	0676	298	0699	24.229	1676	216	1699	18.304	2676	245	2699	20.109
Comunidad Valenciana	0677	13.854	0700	1.127.162	1677	12.282	1700	1.014.220	2677	12.721	2700	1.050.115
País Vasco	0678	1.797	0701	169.048	1678	1.535	1701	148.938	2678	1.678	2701	161.712
<b>Total España</b>	0679	<b>156.457</b>	0702	<b>15.613.016</b>	1679	<b>136.476</b>	1702	<b>13.799.575</b>	2679	<b>143.265</b>	2702	<b>14.425.606</b>
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
<b>Total general</b>	0682	<b>156.457</b>	0705	<b>15.613.016</b>	1682	<b>136.476</b>	1705	<b>13.799.575</b>	2682	<b>143.265</b>	2705	<b>14.425.606</b>

<b>S.05.1</b>
<b>Denominación Fondo:</b> SOL LION II, FT
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora:</b> Titulización de Activos, SGFT, S.A.
<b>Estados agregados:</b> NO
<b>Fecha:</b> 30/06/2021
<b>Entidades cedentes de los activos titulizados:</b> ING DIRECT

**INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS**

**CUADRO G**

Concentración	Situación actual 30/06/2021				Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Situación inicial 25/11/2020			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,07			1710	0,08			2710	0,07		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

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

**CUADRO A**

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2021			Situación cierre anual anterior 31/12/2020			Situación inicial 25/11/2020					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente			
		0720	Nominal unitario (€) 0721	0722	1720	Nominal unitario (€) 1721	1722	2720	Nominal unitario (€) 2721	2722			
ES0305515001	BONO A1	52.623	100.000	5.262.300	46.965	100.000	4.696.500	52.623	100.000	5.262.300			
ES0305515019	BONO A2	10.525	100.000	1.052.500	9.393	100.000	939.300	10.525	100.000	1.052.500			
ES0305515027	BONO A3	39.993	100.000	3.999.300	35.693	100.000	3.569.300	39.993	100.000	3.999.300			
ES0305515035	BONO A4	10.523	100.000	1.052.300	9.392	100.000	939.200	10.523	100.000	1.052.300			
ES0305515043	BONO A5	8.420	100.000	842.000	7.514	100.000	751.400	8.420	100.000	842.000			
ES0305515050	BONO A6	12.786	100.000	1.278.600	11.412	100.000	1.141.200	12.786	100.000	1.278.600			
ES0305515068	BONO B	18.419	100.000	1.841.900	16.438	100.000	1.643.800	18.419	100.000	1.841.900			
ES0305515076	BONO C	4.211	100.000	421.100	3.758	100.000	375.800	4.211	100.000	421.100			
<b>Total</b>		0723	157.500	0724	15.750.000	1723	140.565	1724	14.056.500	2723	157.500	2724	15.750.000

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

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

**CUADRO B**

(miles de euros)			Intereses						Principal pendiente		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas					
Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Índice de referencia	Margen	Tipo aplicado	Intereses Acumulados		Serie devenga Intereses en el periodo	Principal no vencido	Principal impagado	0738	0739					
						0734	0735						0736	0737			
ES0305515001	BONO A1	NS	EURIBOR 3M	0,25	0,00	0	0	SI	5.262.300	0	5.262.300	0					
ES0305515019	BONO A2	NS	EURIBOR 3M	0,35	0,00	0	0	SI	1.052.500	0	1.052.500	0					
ES0305515027	BONO A3	NS	EURIBOR 3M	0,45	0,00	0	0	SI	3.999.300	0	3.999.300	0					
ES0305515035	BONO A4	NS	EURIBOR 3M	0,55	0,01	1	0	SI	1.052.300	0	1.052.301	0					
ES0305515043	BONO A5	NS	EURIBOR 3M	0,65	0,11	5	0	SI	842.000	0	842.005	0					
ES0305515050	BONO A6	NS	EURIBOR 3M	0,75	0,21	15	0	SI	1.278.600	0	1.278.615	0					
ES0305515068	BONO B	S	EURIBOR 3M	1,00	0,46	47	0	SI	1.841.900	0	1.841.947	0					
ES0305515076	BONO C	S	EURIBOR 3M	1,50	0,96	23	0	SI	421.100	0	421.123	0					
<b>Total</b>						0740	91	0741	0	0743	15.750.000	0744	0	0745	15.750.091	0746	0

	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 25/11/2020	
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	0,09	0748	0,11	0749	0,11

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2021

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 30/06/2021								Situación periodo comparativo anterior 30/06/2020							
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	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
ES0305515019	BONO A2	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
ES0305515027	BONO A3	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
ES0305515035	BONO A4	0	0	32	119	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
ES0305515043	BONO A5	0	0	238	548	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
ES0305515050	BONO A6	0	0	685	1.520	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
ES0305515068	BONO B	0	0	2.151	4.666	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
ES0305515076	BONO C	0	0	1.024	2.199	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
<b>Total</b>		0754	0	0755	0	0756	4.130	0757	9.052	1754	0	1755	0	1756	0	1757	0

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: 30/06/2021

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 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 25/11/2020
				0760	0761	0762
ES0305515001	BONO A1	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515001	BONO A1	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515019	BONO A2	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515019	BONO A2	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515027	BONO A3	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515027	BONO A3	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515035	BONO A4	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515035	BONO A4	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515043	BONO A5	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515043	BONO A5	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515050	BONO A6	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA
ES0305515050	BONO A6	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA
ES0305515068	BONO B	04/12/2020	DBRS	NR	NR	NR
ES0305515068	BONO B	04/12/2020	FCH	NR	NR	NR
ES0305515076	BONO C	04/12/2020	DBRS	NR	NR	NR
ES0305515076	BONO C	04/12/2020	FCH	NR	NR	NR

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Periodo de la declaración: 30/06/2021

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 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 25/11/2020	
Inferior a 1 año	0765	0	1765	0	2765	0
Entre 1 y 2 años	0766	0	1766	0	2766	0
Entre 2 y 3 años	0767	210.989	1767	0	2767	0
Entre 3 y 4 años	0768	823.182	1768	729.481	2768	817.367
Entre 4 y 5 años	0769	809.484	1769	668.910	2769	749.499
Entre 5 y 10 años	0770	3.755.396	1770	3.232.854	2770	3.622.342
Superior a 10 años	0771	10.150.949	1771	9.425.256	2771	10.560.792
<b>Total</b>	<b>0772</b>	<b>15.750.000</b>	<b>1772</b>	<b>14.056.500</b>	<b>2772</b>	<b>15.750.000</b>
<b>Vida residual media ponderada (años)</b>	<b>0773</b>	<b>14,95</b>	<b>1773</b>	<b>17,63</b>	<b>2773</b>	<b>17,63</b>

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO A**

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 25/11/2020	
	Código	Valor	Código	Valor	Código	Valor
1 Importe del Fondo de Reserva constituido (miles de euros)	0775	120.000	1775	120.000	2775	120.000
1.1 Importe mínimo del Fondo de Reserva (miles de euros)	0776	120.000	1776	120.000	2776	120.000
1.2 Porcentaje que representa el Fondo de Reserva constituido sobre el total de pasivos emitidos (%)	0777	0,76	1777	0,85	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	

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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 30/06/2021	Situación cierre anual anterior 31/12/2020	Situación inicial 25/11/2020	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	3806
Permuta Financiera de Intereses	Ing Direct N.V.	TRIMESTRAL	Tipos fijo 0,5%	Ver Nota S.06	Tipo Rerefencia de los Bonos	Ver Nota S.06	-164.417	-164.417		
<b>Total</b>							0808 - 164.417	0809 - 164.417	0810	

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

**OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO**

**CUADRO B**

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS Naturaleza riesgo cubierto	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)						Valor en libros (miles de euros)						Otras características	
	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 25/11/2020		Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación inicial 25/11/2020			
Préstamos hipotecarios	0811		1811		2811		0829		1829		2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812		1812		2812		0830		1830		2830		3830	
Préstamos a promotores	0813		1813		2813		0831		1831		2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814		1814		2814		0832		1832		2832		3832	
Préstamos a empresas	0815		1815		2815		0833		1833		2833		3833	
Préstamos corporativos	0816		1816		2816		0834		1834		2834		3834	
Cédulas territoriales	0817		1817		2817		0835		1835		2835		3835	
Bonos de tesorería	0818		1818		2818		0836		1836		2836		3836	
Deuda subordinada	0819		1819		2819		0837		1837		2837		3837	
Créditos AAPP	0820		1820		2820		0838		1838		2838		3838	
Préstamos consumo	0821		1821		2821		0839		1839		2839		3839	
Préstamos automoción	0822		1822		2822		0840		1840		2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823		1823		2823		0841		1841		2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824		1824		2824		0842		1842		2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825		1825		2825		0843		1843		2843		3843	
Bonos de titulización	0826		1826		2826		0844		1844		2844			
<b>Total</b>	0827		1827		2827		0845		1845		2845		3845	

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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

**CUADRO A**

Concepto	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio				Ref. Folleto			
					Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020		Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020				Última Fecha Pago	
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	2.791	7006	0	7009	0,02	7012	0,00	7015	0,02		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	2.791	7008	0	7011	0,02	7014	0,00	7017	0,02	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	13	7020		7021	0	7024	0	7027	0,00	7030	0,00	7033	0,00		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	0	7026	0	7029	0,00	7032	0,00	7035	0,00	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 30/06/2021		Situación cierre anual anterior 31/12/2020			
	0850		1850		2850	3850
	0851		1851		2851	3851
	0852		1852		2852	3852
	0853		1853		2853	3853

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

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

**CUADRO B**

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

Cuadro de texto libre

**CUADRO C**

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento

Contiene  
  
Información adicional  
en fichero adjunto

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

**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	19	2862		3862		4862		5862		6862	TRIMESTRAL	7862	S	8862	
Comisión administrador	0863	Ing Direct N.V.	1863	150	2863		3863		4863		5863		6863	TRIMESTRAL	7863	S	8863	
Comisión del agente financiero/pagos	0864	Ing Direct N.V.	1864	5	2864		3864		4864		5864		6864	TRIMESTRAL	7864	S	8864	
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865		6865		7865		8865	

<b>S.05.5</b>
<b>Denominación Fondo: SOL LION II, FT</b>
<b>Denominación del compartimento:</b>
<b>Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.</b>
<b>Estados agregados: NO</b>
<b>Fecha: 30/06/2021</b>

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

Forma de cálculo		
1 Diferencia ingresos y gastos (S/N)	0866	N
2 Diferencia cobros y pagos (S/N)	0867	S
3 Otros (S/N)	0868	N
3.1 Descripción	0869	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		
<b>Ingresos y gastos del periodo de cálculo</b>	0872															
Margen de intereses	0873															
Deterioro de activos financieros (neto)	0874															
Dotaciones a provisiones (neto)	0875															
Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0876															
Otros ingresos y gastos excepto comisión variable y repercusión de pérdidas (ganancias)	0877															
Total ingresos y gastos excepto comisión variable, impuesto sobre beneficios y repercusión de pérdidas (ganancias) (A)	0878															
Impuesto sobre beneficios (-) (B)	0879															
Repercusión de ganancias (-) (C)	0880															
Comisión variable devengada en cuenta de pérdidas y ganancias (-) (D)	0881															
Repercusión de pérdidas (+) (-)[(A)+(B)+(C)+(D)]	0882															
Comisión variable pagada	0883															
Comisión variable impagada en el periodo de cálculo	0884															

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

**INFORMACION RELATIVA A COMISIONES**

**CUADRO B**

Derterminada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)		Fecha cálculo										Total	
		29/03/2021	28/06/2021										
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885												
Saldo inicial	0886	120.045	120.022										
Cobros del periodo	0887	507.566	451.037										
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-4.657	-4.201										
Pagos por derivados	0889	-8.094	-7.997										
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-120.000	-120.000										
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-4.922	-4.130										
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	-200	0										
Resto pagos/retenciones	0893	-473.546	-416.487										
Saldo disponible	0894	16.192	18.243										
Liquidación de comisión variable	0895	16.170	18.243										34.413

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 30/06/2021

**NOTAS EXPLICATIVAS**



**INFORME DE AUDITOR**

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