

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: SOL LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION

Número de registro del Fondo: 11140

NIF Fondo: V02673549

Denominación del compartimento:

Número de registro del compartimento:

Denominación de la gestora: TITULACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.

NIF Gestora: A80352750

Fondo Abierto: SI

Fondo Privado: NO

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2024

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA

Explicación de las principales modificaciones respecto a la información periódica previamente publicada:

(sólo se cumplimentará en el supuesto de que se produzca el reenvío con alguna modificación de la información periódica)

				S.01
Denominación Fondo: SOL LION II, FT				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.				
Estados agregados: NO				
Fecha: 31/12/2024				

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2024		Periodo anterior 31/12/2023
ACTIVO				
A) ACTIVO NO CORRIENTE	0001	15.824.981	1001	16.015.542
I. Activos financieros a largo plazo	0002	15.824.981	1002	16.015.542
1. Activos titulizados	0003	15.015.481	1003	14.988.511
1.1 Participaciones hipotecarias	0004	0	1004	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0005	14.961.924	1005	14.937.123
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	53.558	1025	51.400
1.23 Activos dudosos -intereses y otros-	0026	0	1026	0
1.24 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0027	-1	1027	-12
1.25 Ajustes por operaciones de cobertura	0028	0	1028	0
2. Derivados	0029	809.500	1029	1.027.031
2.1 Derivados de cobertura	0030	809.500	1030	1.027.031
2.2 Derivados de negociación	0031	0	1031	0
3. Otros activos financieros	0032	0	1032	0
3.1 Valores representativos de deuda	0033	0	1033	0
3.2 Instrumentos de patrimonio	0034	0	1034	0
3.3 Garantías financieras	0035	0	1035	0
3.4 Otros	0036	0	1036	0
3.5 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0037	0	1037	0
Pro-memoria: cedidos, pignorados o gravados en garantía	0038	0	1038	0
II. Activos por impuesto diferido	0039	0	1039	0
III. Otros activos no corrientes	0040	0	1040	0

				S.01
Denominación Fondo: SOL LION II, FT				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.				
Estados agregados: NO				
Fecha: 31/12/2024				

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) ACTIVO CORRIENTE	0041	1.057.399	1041	1.116.551
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0042	0	1042	0
V. Activos financieros a corto plazo	0043	937.346	1043	996.550
1. Activos titulizados	0044	601.381	1044	567.017
1.1 Participaciones hipotecarias	0045	0	1045	0
1.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0046	556.776	1046	516.980
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	41.635	1065	47.388
1.22 Intereses vencidos e impagados	0066	77	1066	89
1.23 Activos dudosos -principal-	0067	2.485	1067	2.239
1.24 Activos dudosos -intereses-	0068	414	1068	344
1.25 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0069	-6	1069	-22
1.26 Ajustes por operaciones de cobertura	0070	0	1070	0
2. Derivados	0071	114.847	1071	136.390
2.1 Derivados de cobertura	0072	114.847	1072	136.390
2.2 Derivados de negociación	0073	0	1073	0
3. Otros activos financieros	0074	221.118	1074	293.142
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	221.118	1077	293.142
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	120.053	1085	120.001
1. Tesorería	0086	120.053	1086	120.001
2. Otros activos líquidos equivalentes	0087	0	1087	0
TOTAL ACTIVO	0088	16.882.380	1088	17.132.093

				S.01
Denominación Fondo: SOL LION II, FT				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.				
Estados agregados: NO				
Fecha: 31/12/2024				

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2024		Periodo anterior 31/12/2023
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0089	15.397.741	1089	15.933.972
I. Provisiones a largo plazo	0090	87.002	1090	63.972
1. Provisión garantías financieras	0091	0	1091	0
2. Provisión por margen de intermediación	0092	87.002	1092	63.972
3. Otras provisiones	0093	0	1093	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0094	15.310.740	1094	15.870.000
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0095	15.190.740	1095	15.750.000
1.1 Series no subordinadas	0096	12.927.740	1096	13.487.000
1.2 Series subordinadas	0097	2.263.000	1097	2.263.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0098	0	1098	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0099	0	1099	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0100	0	1100	0
2. Deudas con entidades de crédito	0101	120.000	1101	120.000
2.1 Préstamo subordinado	0102	120.000	1102	120.000
2.2 Crédito línea de liquidez dispuesta	0103	0	1103	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0104	0	1104	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0105	0	1105	0
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0106	0	1106	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0107	0	1107	0
3. Derivados	0108	0	1108	0
3.1 Derivados de cobertura	0109	0	1109	0
3.2 Derivados de negociación	0110	0	1110	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0111	0	1111	0
4. Otros pasivos financieros	0112	0	1112	0
4.1 Garantías financieras	0113	0	1113	0
4.1 Otros	0114	0	1114	0
4.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0115	0	1115	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0116	0	1116	0

				S.01
Denominación Fondo: SOL LION II, FT				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.				
Estados agregados: NO				
Fecha: 31/12/2024				

BALANCE (miles de euros)		Periodo actual 31/12/2024		Periodo anterior 31/12/2023
B) PASIVO CORRIENTE	0117	560.686	1117	36.056
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	560.681	1123	35.683
1. Obligaciones y otros valores emitidos	0124	560.672	1124	31.274
1.1 Series no subordinadas	0125	559.260	1125	0
1.2 Series subordinadas	0126	0	1126	0
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0127	0	1127	0
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0128	1.411	1128	5.830
1.5 Intereses vencidos e impagados	0129	0	1129	25.444
1.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0130	0	1130	0
2. Deudas con entidades de crédito	0131	9	1131	4.409
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	9	1136	40
2.6 Intereses vencidos e impagados	0137	0	1137	4.369
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	5	1148	373
1. Comisiones	0149	1	1149	366
1.1 Comisión sociedad gestora	0150	0	1150	1
1.2 Comisión administrador	0151	1	1151	365
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	4	1157	7
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0158	923.953	1158	1.162.065
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0159	0	1159	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0160	923.953	1160	1.162.065
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0161	0	1161	0
TOTAL PASIVO	0162	16.882.380	1162	17.132.093

							S.02
Denominación Fondo: SOL LION II, FT							
Denominación del compartimento:							
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.							
Estados agregados: NO							
Fecha: 31/12/2024							

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2024		Acumulado anterior 31/12/2023
1. Intereses y rendimientos asimilados	0201	135.649	1201	149.081	2201	576.388	3201	531.627
1.1 Activos titulizados	0202	135.649	1202	149.081	2202	576.388	3202	531.627
1.2 Otros activos financieros	0203	0	1203	0	2203	0	3203	0
2. Intereses y cargas asimilados	0204	-155.967	1204	-180.404	2204	-682.315	3204	-594.824
2.1 Obligaciones y otros valores emitidos	0205	-154.913	1205	-179.165	2205	-677.653	3205	-590.822
2.2 Deudas con entidades de crédito	0206	-1.054	1206	-1.239	2206	-4.662	3206	-4.002
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	44.067	1208	26.628	2208	177.768	3208	83.173
A) MARGEN DE INTERESES	0209	23.749	1209	-4.695	2209	71.842	3209	19.976
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	-30.601	1217	-164	2217	-48.826	3217	-510
7.1 Servicios exteriores	0218	-66	1218	-58	2218	-185	3218	-108
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0219	-66	1219	-58	2219	-185	3219	-108
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	-30.535	1224	-106	2224	-48.642	3224	-403
7.3.1 Comisión sociedad gestora	0225	-22	1225	-22	2225	-88	3225	-86
7.3.2 Comisión administrador	0226	-73	1226	-73	2226	-289	3226	-290
7.3.3 Comisión agente financiero/pagos	0227	-5	1227	-5	2227	-20	3227	-20
7.3.4 Comisión variable	0228	-30.428	1228	0	2228	-48.238	3228	0
7.3.5 Otras comisiones del cedente	0229	0	1229	0	2229	0	3229	0
7.3.6 Otros gastos	0230	-6	1230	-7	2230	-7	3230	-7
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0231	28	1231	-12	2231	14	3231	-12
8.1 Deterioro neto de activos titulizados	0232	28	1232	-12	2232	14	3232	-12
8.2 Deterioro neto de otros activos financieros	0233	0	1233	0	2233	0	3233	0
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0234	6.824	1234	4.871	2234	-23.030	3234	-19.454
9.1 Dotación provisión por garantías financieras	0235	0	1235	0	2235	0	3235	0
9.2 Dotación provisión por margen de intermediación	0236	6.824	1236	4.871	2236	-23.030	3236	-19.454
9.3 Dotación otras provisiones	0237	0	1237	0	2237	0	3237	0
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0238	0	1238	0	2238	0	3238	0
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0239	0	1239	0	2239	0	3239	0
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0240	0	1240	0	2240	0	3240	0
12. Impuesto sobre beneficios	0241	0	1241	0	2241	0	3241	0
C) RESULTADO DEL PERÍODO	0242	0	1242	0	2242	0	3242	0

							S.03
Denominación Fondo: SOL LION II, FT							
Denominación del compartimento:							
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.							
Estados agregados: NO							
Fecha: 31/12/2024							

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2024		Acumulado anterior 31/12/2023
A) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES DE EXPLOTACION	0300	-35.013	1300	3.043	2300	-4.801	3300	25.566
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	0301	-4.485	1301	3.076	2301	44.199	3301	25.677
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	0302	139.460	1302	147.773	2302	582.046	3302	511.425
1.2 Intereses pagados por las obligaciones y otros valores emitidos	0303	-153.502	1303	-170.536	2303	-707.516	3303	-567.992
1.3 Cobros por operaciones de derivados de cobertura	0304	43.674	1304	25.839	2304	178.731	3304	82.244
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	-1.045	1307	0	2307	-9.062	3307	0
1.9 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	0308	-33.073	1308	0	2308	0	3308	0
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados	0309	-30.527	1309	-32	2309	-49.000	3309	-112
2.1 Comisión sociedad gestora	0310	-22	1310	-27	2310	-88	3310	-92
2.2 Comisión administrador	0311	-73	1311	0	2311	-653	3311	0
2.3 Comisión agente financiero/pagos	0312	-5	1312	-5	2312	-20	3312	-20
2.4 Comisión variable	0313	-30.428	1313	0	2313	-48.238	3313	0
2.5 Otras comisiones	0314	0	1314	0	2314	0	3314	0
3. Otros flujos de caja provenientes de actividades de explotación	0315	0	1315	0	2315	0	3315	0
3.1 Pagos por garantías financieras	0316	0	1316	0	2316	0	3316	0
3.2 Cobros por garantías financieras	0317	0	1317	0	2317	0	3317	0
3.3 Pagos por operaciones de derivados de negociación	0318	0	1318	0	2318	0	3318	0
3.4 Cobros por operaciones de derivados de negociación	0319	0	1319	0	2319	0	3319	0
3.5 Otros pagos de explotación	0320	0	1320	0	2320	0	3320	0
3.6 Otros cobros de explotación	0321	0	1321	0	2321	0	3321	0
B) FLUJOS DE EFECTIVO ACTIVIDADES INVERSION/ FINANCIACION	0322	1.992	1322	-1.180.736	2322	4.852	3322	-68.942
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	-451.848	1324	-1.822.880	2324	-2.172.585	3324	-2.937.458
6. Flujos de caja netos por amortizaciones y procedentes de otros activos	0325	453.909	1325	642.196	2325	2.177.631	3325	2.868.624
6.1 Cobros por amortización ordinaria de activos titulizados	0326	109.459	1326	80.709	2326	594.955	3326	560.619
6.2 Cobros por amortización anticipada de activos titulizados	0327	343.252	1327	560.872	2327	1.577.176	3327	2.305.724
6.3 Cobros por amortización previamente impagada de activos titulizados	0328	1.198	1328	615	2328	5.500	3328	2.281
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	-68	1332	-52	2332	-194	3332	-108
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	-68	1336	-52	2336	-194	3336	-108
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	0337	-33.021	1337	-1.177.692	2337	52	3337	-43.376
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	0338	153.074	1338	1.297.694	2338	120.001	3338	163.377
Efectivo o equivalentes al final del periodo	0339	120.053	1339	120.001	2339	120.053	3339	120.001

							S.04
Denominación Fondo: SOL LION II, FT							
Denominación del compartimento:							
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.							
Estados agregados: NO							
Fecha: 31/12/2024							

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (miles de euros)		P. corriente actual (4. trimestre)		P. corriente anterior (4. trimestre)		Acumulado actual 31/12/2024		Acumulado anterior 31/12/2023
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	-195.401	1357	750.320	2357	-60.344	3357	806.725
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0358	-195.401	1358	750.320	2358	-60.344	3358	806.725
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	-44.067	1360	-26.628	2360	-177.768	3360	-83.173
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	239.468	1362	-723.692	2362	238.112	3362	-723.552
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	0363	0	1363	0	2363	0	3363	0
3. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos								
3.1 Importe de otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos directamente en el balance en el periodo	0364	0	1364	0	2364	0	3364	0
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	0365	0	1365	0	2365	0	3365	0
3.1.2 Efecto fiscal	0366	0	1366	0	2366	0	3366	0
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	0367	0	1367	0	2367	0	3367	0
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	0368	0	1368	0	2368	0	3368	0
Total ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	0369	0	1369	0	2369	0	3369	0
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	0370	0	1370	0	2370	0	3370	0

	S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2024	
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO A

Ratios (%)	Situación actual 31/12/2024					Situación cierre anual anterior 31/12/2023					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	0,00	0421	0,00	0441	10,53	1381	0,35	1401	0,00	1421	0,00	1441	15,50
Préstamos hipotecarios	0382		0402		0422		0442		1382		1402		1422		1442	
Cédulas hipotecarias	0383		0403		0423		0443		1383		1403		1423		1443	
Préstamos a promotores	0384		0404		0424		0444		1384		1404		1424		1444	
Préstamos a PYMES	0385		0405		0425		0445		1385		1405		1425		1445	
Préstamos a empresas	0386		0406		0426		0446		1386		1406		1426		1446	
Prestamos corporativos	0387		0407		0427		0447		1387		1407		1427		1447	
Cédulas territoriales	0388		0408		0428		0448		1388		1408		1428		1448	
Bonos de tesorería	0389		0409		0429		0449		1389		1409		1429		1449	
Deuda subordinada	0390		0410		0430		0450		1390		1410		1430		1450	
Créditos AAPP	0391		0411		0431		0451		1391		1411		1431		1451	
Préstamos consumo	0392		0412		0432		0452		1392		1412		1432		1452	
Préstamos automoción	0393		0413		0433		0453		1393		1413		1433		1453	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0394		0414		0434		0454		1394		1414		1434		1454	
Cuentas a cobrar	0395		0415		0435		0455		1395		1415		1435		1455	
Derechos de crédito futuros	0396		0416		0436		0456		1396		1416		1436		1456	
Bonos de titulización	0397		0417		0437		0457		1397		1417		1437		1457	
Cédulas internacionalización	0398		0418		0438		0458		1398		1418		1438		1458	
Otros	0399		0419		0439		0459		1399		1419		1439		1459	

	S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2024	
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	150	0467	28	0474	30	0481	0	0488	58	0495	15.691	0502	0	0509	15.749
De 1 a 3 meses	0461	149	0468	63	0475	47	0482	0	0489	110	0496	15.284	0503	0	0510	15.394
De 3 a 6 meses	0462	193	0469	184	0476	116	0483	41	0490	341	0497	20.293	0504	0	0511	20.634
De 6 a 9 meses	0463	107	0470	191	0477	94	0484	101	0491	387	0498	11.867	0505	0	0512	12.254
De 9 a 12 meses	0464	80	0471	181	0478	82	0485	151	0492	414	0499	8.685	0506	0	0513	9.099
Más de 12 meses	0465	157	0472	684	0479	121	0486	603	0493	1.409	0500	13.958	0507	0	0514	15.367
Total	0466	836	0473	1.331	0480	491	0487	896	0494	2.718	0501	85.779	0508	0	1515	88.497

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	150	0522	28	0529	30	0536	0	0543	58	0550	15.691	0557	0	0564	15.749	
De 1 a 3 meses	0516	149	0523	63	0530	47	0537	0	0544	110	0551	15.284	0558	0	0565	15.394	
De 3 a 6 meses	0517	193	0524	184	0531	116	0538	41	0545	341	0552	20.293	0559	0	0566	20.634	
De 6 a 9 meses	0518	107	0525	191	0532	94	0539	101	0546	387	0553	11.867	0560	0	0567	12.254	
De 9 a 12 meses	0519	80	0526	181	0533	82	0540	151	0547	414	0554	8.685	0561	0	0568	9.099	
Más de 12 meses	0520	157	0527	684	0534	121	0541	603	0548	1.409	0555	13.958	0562	0	0569	15.367	
Total	0521	836	0528	1.331	0535	491	0542	896	0549	2.718	0556	85.779	0563	0	0570	88.497	
																0577	145.772
																0590	60,71

	S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2024	
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO C

Vida residual de los activos titulizados (miles de euros)	Principal pendiente				
	Situación actual 31/12/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 25/11/2020	
Inferior a 1 año	0600	5.747	1600	4.778	2600
Entre 1 y 2 años	0601	17.233	1601	16.706	2601
Entre 2 y 3 años	0602	28.140	1602	30.122	2602
Entre 3 y 4 años	0603	41.973	1603	41.758	2603
Entre 4 y 5 años	0604	61.331	1604	55.096	2604
Entre 5 y 10 años	0605	687.198	1605	660.560	2605
Superior a 10 años	0606	14.733.121	1606	14.698.722	2606
Total	0607	15.574.743	1607	15.507.741	2607
Vida residual media ponderada (años)	0608	24,98	1608	25,45	2608
					26,18

Antigüedad	Situación actual 31/12/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 25/11/2020
Antigüedad media ponderada (años)	0609	6,20	1609
			6,29
			2609
			4,96

	S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2024	
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO D

Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (miles de euros)	Situación actual 31/12/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 25/11/2020			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente
0% - 40%	0620	52.375	0630	2.824.785	1620	52.130	1630	2.881.461	2620	50.375	2630	6.210.145
40% - 60%	0621	45.820	0631	4.435.714	1621	43.125	1631	4.253.591	2621	56.190	2631	14.473.624
60% - 80%	0622	69.546	0632	8.287.903	1622	69.237	1632	8.335.887	2622	111.701	2632	799.896
80% - 100%	0623	176	0633	26.341	1623	270	1633	36.803	2623	5.854	2633	0
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	167.917	0638	15.574.743	1628	164.762	1638	15.507.741	2628	224.120	2638	21.483.665
Media ponderada (%)	0639	56,30	0649		1639	56,56	1649		2639	58,75	2649	

	S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2024	
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO E

Tipos de interés de los activos titulizados (%)	Situación actual 31/12/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		Situación inicial 25/11/2020	
Tipo de interés medio ponderado	0650	3,62	1650	3,36	2650	1,16
Tipo de interés nominal máximo	0651	8,17	1651	8,65	2651	6,34
Tipo de interés nominal mínimo	0652	0,00	1652	0,61	2652	0,00

	S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2024	
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO F

Distribución geográfica activos titulizados (miles de euros)	Situación actual 31/12/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 25/11/2020			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente	Nº de activos vivos	Principal pendiente
Andalucía	0660	25.776	0683	1.925.683	1660	26.260	1683	1.995.110	2660	35.161	2683	3.166.990
Aragón	0661	3.085	0684	237.100	1661	2.754	1684	211.643	2661	3.841	2684	341.084
Asturias	0662	1.481	0685	99.446	1662	1.401	1685	95.102	2662	1.990	2685	162.715
Baleares	0663	5.057	0686	597.400	1663	4.831	1686	578.256	2663	6.383	2686	852.051
Canarias	0664	8.892	0687	738.480	1664	8.305	1687	703.466	2664	10.814	2687	1.029.762
Cantabria	0665	1.511	0688	114.378	1665	1.460	1688	112.281	2665	1.977	2688	179.482
Castilla-León	0666	5.621	0689	461.439	1666	4.697	1689	347.714	2666	6.380	2689	550.594
Castilla La Mancha	0667	4.766	0690	347.542	1667	5.178	1690	424.368	2667	7.045	2690	657.306
Cataluña	0668	40.226	0691	4.407.918	1668	41.084	1691	4.629.073	2668	52.725	2691	6.753.132
Ceuta	0669	3	0692	338	1669	2	1692	328	2669	5	2692	559
Extremadura	0670	0	0693	0	1670	0	1693	0	2670	24	2693	1.438
Galicia	0671	3.342	0694	248.196	1671	3.215	1694	238.828	2671	4.419	2694	389.981
Madrid	0672	45.910	0695	4.707.273	1672	44.028	1695	4.503.378	2672	64.636	2695	7.993.332
Melilla	0673	6	0696	617	1673	3	1696	352	2673	6	2696	656
Murcia	0674	3.728	0697	269.941	1674	3.479	1697	258.231	2674	4.647	2697	394.922
Navarra	0675	423	0698	39.300	1675	388	1698	36.214	2675	561	2698	59.530
La Rioja	0676	500	0699	41.202	1676	398	1699	32.647	2676	595	2699	53.935
Comunidad Valenciana	0677	15.757	0700	1.178.289	1677	15.497	1700	1.181.868	2677	20.394	2700	1.794.669
País Vasco	0678	1.833	0701	160.200	1678	1.782	1701	158.882	2678	2.517	2701	268.459
Total España	0679	167.917	0702	15.574.743	1679	164.762	1702	15.507.741	2679	224.120	2702	24.650.596
Otros países Unión Europea	0680	0	0703	0	1680	0	1703	0	2680	0	2703	0
Resto	0681	0	0704	0	1681	0	1704	0	2681	0	2704	0
Total general	0682	167.917	0705	15.574.743	1682	164.762	1705	15.507.741	2682	224.120	2705	24.650.596

	S.05.1
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2024	
Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT	

INFORMACION RELATIVA A LOS ACTIVOS TITULIZADOS

CUADRO G

Concentración	Situación actual 31/12/2024				Situación cierre anual anterior 31/12/2023				Situación inicial 25/11/2020			
	Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE		Porcentaje		CNAE	
	0710	0,06	0712		1710	0,06	1712		2710	0,08	2712	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	0710	0,06			1710	0,06			2710	0,08		
Sector	0711		0712		1711		1712		2711		2712	

	S.05.2
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Periodo de la declaración: 31/12/2024	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO A

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2024			Situación cierre anual anterior 31/12/2023			Situación inicial 25/11/2020					
Serie	Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario (€)	Principal pendiente			
		0720	0721	0722	1720	1721	1722	2720	2721	2722			
ES0305515001	BONO A1	52.623	100.000	5.262.300	52.623	100.000	5.262.300	52.623	100.000	5.262.300			
ES0305515019	BONO A2	10.525	100.000	1.052.500	10.525	100.000	1.052.500	10.525	100.000	1.052.500			
ES0305515027	BONO A3	39.993	100.000	3.999.300	39.993	100.000	3.999.300	39.993	100.000	3.999.300			
ES0305515035	BONO A4	10.523	100.000	1.052.300	10.523	100.000	1.052.300	10.523	100.000	1.052.300			
ES0305515043	BONO A5	8.420	100.000	842.000	8.420	100.000	842.000	8.420	100.000	842.000			
ES0305515050	BONO A6	12.786	100.000	1.278.600	12.786	100.000	1.278.600	12.786	100.000	1.278.600			
ES0305515068	BONO B	18.419	100.000	1.841.900	18.419	100.000	1.841.900	18.419	100.000	1.841.900			
ES0305515076	BONO C	4.211	100.000	421.100	4.211	100.000	421.100	4.211	100.000	421.100			
Total		0723	157.500	0724	15.750.000	1723	157.500	1724	15.750.000	2723	157.500	2724	15.750.000

	S.05.2
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Periodo de la declaración: 31/12/2024	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO B

Serie	Denominación serie	Grado de subordinación	Intereses						Principal pendiente		Total Pendiente	Correcciones de valor por repercusión de pérdidas	
			0730	0731	0732	0733	0734	0735	0742	0736	0737		
ES0305515001	BONO A1	NS	EURIBOR 3M	0,25	2,97		433		0	SI	5.262.300	0	5.262.733 0
ES0305515019	BONO A2	NS	EURIBOR 3M	0,35	3,07		90		0	SI	1.052.500	0	1.052.590 0
ES0305515027	BONO A3	NS	EURIBOR 3M	0,45	3,17		352		0	SI	3.999.300	0	3.999.652 0
ES0305515035	BONO A4	NS	EURIBOR 3M	0,55	3,27		95		0	SI	1.052.300	0	1.052.395 0
ES0305515043	BONO A5	NS	EURIBOR 3M	0,65	3,37		79		0	SI	842.000	0	842.079 0
ES0305515050	BONO A6	NS	EURIBOR 3M	0,75	3,47		123		0	SI	1.278.600	0	1.278.723 0
ES0305515068	BONO B	S	EURIBOR 3M	1,00	3,72		190		0	SI	1.841.900	0	1.842.090 0
ES0305515076	BONO C	S	EURIBOR 3M	1,50	4,22		49		0	SI	421.100	0	421.149 0
Total					0740	1.411	0741	0		0743	15.750.000	0744	0 0745 15.751.411 0746 0

	Situación actual 31/12/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 25/11/2020
Tipo de interés medio ponderado de las obligaciones y otros valores emitidos (%)	0747	3,40	0748 3,83 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: 31/12/2024	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO C

(miles de euros)		Situación actual 31/12/2024				Situación periodo comparativo anterior 31/12/2023			
		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	47.821	415.875	0	0	55.748	202.004
ES0305515019	BONO A2	0	0	9.830	85.856	0	0	11.416	42.005
ES0305515027	BONO A3	0	0	38.365	336.414	0	0	44.390	165.697
ES0305515035	BONO A4	0	0	10.361	91.545	0	0	11.946	45.550
ES0305515043	BONO A5	0	0	8.503	76.621	0	0	9.771	38.958
ES0305515050	BONO A6	0	0	13.235	121.589	0	0	15.161	63.089
ES0305515068	BONO B	0	0	20.230	194.017	0	0	22.103	102.391
ES0305515076	BONO C	0	0	5.157	52.981	0	0	0	7.688
Total		0754	0 0755	0 0756	153.502 0757	1.374.898 1754	0 0 1755	0 0 1756	170.536 1757 667.382

	S.05.2
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Periodo de la declaración: 31/12/2024	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO D

Serie	Denominación Serie	Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Calificación				
				0760	0761	0762	0763	0764
ES0305515001	BONO A1	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515001	BONO A1	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515019	BONO A2	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515019	BONO A2	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515027	BONO A3	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515027	BONO A3	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515035	BONO A4	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515035	BONO A4	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515043	BONO A5	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515043	BONO A5	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515050	BONO A6	04/12/2020	DBRS	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515050	BONO A6	04/12/2020	FCH	AAA	AAA	AAA	AAA	AAA
ES0305515068	BONO B	04/12/2020	DBRS	NR	NR	NR	NR	NR
ES0305515068	BONO B	04/12/2020	FCH	NR	NR	NR	NR	NR
ES0305515076	BONO C	04/12/2020	DBRS	NR	NR	NR	NR	NR
ES0305515076	BONO C	04/12/2020	FCH	NR	NR	NR	NR	NR

	S.05.2
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Periodo de la declaración: 31/12/2024	
Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF	

INFORMACION RELATIVA A LAS OBLIGACIONES Y OTROS VALORES EMITIDOS

CUADRO E

Vida residual de las obligaciones y otros valores emitidos por el Fondo (miles de euros)	Principal pendiente					
	Situación actual 31/12/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		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	1.915.033	1767	0	2767	0
Entre 3 y 4 años	0768	1.688.686	1768	2.114.902	2768	817.367
Entre 4 y 5 años	0769	1.661.458	1769	1.714.329	2769	749.499
Entre 5 y 10 años	0770	7.532.853	1770	8.324.249	2770	3.622.342
Superior a 10 años	0771	2.951.970	1771	3.596.519	2771	10.560.792
Total	0772	15.750.000	1772	15.750.000	2772	15.750.000
Vida residual media ponderada (años)	0773	6,75	1773	7,60	2773	17,63

	S.05.3
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2024	

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO A

Información sobre las mejoras crediticias del Fondo		Situación actual 31/12/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023		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	85,49	2792	85,63	
5 Importe máximo de riesgo cubierto por garantías financieras adquiridas (miles de euros)	0793		1793		2793		
5.1 Denominación de la contrapartida	0794		1794		2794		
5.2 Rating de la contrapartida	0795		1795		2795		
5.3 Rating requerido de la contrapartida	0796		1796		2796		

	S.05.3
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2024	

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

PERMUTAS FINANCIERAS			Importe a pagar por el fondo		Importe a pagar por la contrapartida		Valor razonable (miles de euros)			Otras características
	Contrapartida	Periodicidad liquidación	Tipo de interés anual	Nocional	Tipo de interés anual	Nocional	Situación actual 31/12/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 25/11/2020	
	0800	0801	0802	0803	0804	0805	0806	1806	2806	
Permuta Financiera de Intereses	Ing Direct N.V.	TRIMESTRAL	Tipos fijo 0,5%	Ver Nota S.06	Tipo Rerefencia de los Bonos	Ver Nota S.06	924.347	1.163.422		
Total							0808	924.347	0809	1.163.422

	S.05.3
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2024	

OTRA INFORMACIÓN SOBRE EL FONDO

CUADRO B

GARANTÍAS FINANCIERAS EMITIDAS	Importe máximo del riesgo cubierto (miles de euros)				Valor en libros (miles de euros)			Otras características	
	Situación actual 31/12/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 25/11/2020	Situación actual 31/12/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación inicial 25/11/2020			
Préstamos hipotecarios	0811	1811	2811	0829	1829	2829		3829	
Cédulas hipotecarias	0812	1812	2812	0830	1830	2830		3830	
Préstamos a promotores	0813	1813	2813	0831	1831	2831		3831	
Préstamos a PYMES	0814	1814	2814	0832	1832	2832		3832	
Préstamos a empresas	0815	1815	2815	0833	1833	2833		3833	
Préstamos corporativos	0816	1816	2816	0834	1834	2834		3834	
Cédulas territoriales	0817	1817	2817	0835	1835	2835		3835	
Bonos de tesorería	0818	1818	2818	0836	1836	2836		3836	
Deuda subordinada	0819	1819	2819	0837	1837	2837		3837	
Créditos AAPP	0820	1820	2820	0838	1838	2838		3838	
Préstamos consumo	0821	1821	2821	0839	1839	2839		3839	
Préstamos automoción	0822	1822	2822	0840	1840	2840		3840	
Cuotas de arrendamiento financiero (leasing)	0823	1823	2823	0841	1841	2841		3841	
Cuentas a cobrar	0824	1824	2824	0842	1842	2842		3842	
Derechos de crédito futuros	0825	1825	2825	0843	1843	2843		3843	
Bonos de titulización	0826	1826	2826	0844	1844	2844			
Total	0827	1827	2827	0845	1845	2845		3845	

	S.05.4
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2024	

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO A

Concepto	Meses impago	Días impago	Importe impagado acumulado		Ratio		Ref. Folleto									
			Situación actual 31/12/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023	Situación actual 31/12/2024	Situación cierre anual anterior 31/12/2023										
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	7000		7002	90	7003	44.865	7006	41.683	7009	0,29	7012	0,27	7015	0,21		
2. Activos Morosos por otras razones					7004		7007		7010		7013		7016			
Total Morosos					7005	44.865	7008	41.683	7011	0,29	7014	0,27	7017	0,21	7018	
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	7019	13	7020		7021	40.820	7024	22.075	7027	0,26	7030	0,14	7033	0,26		
4. Activos Fallidos por otras razones					7022	0	7025	0	7028	0,00	7031	0,00	7034	0,00		
Total Fallidos					7023	40.820	7026	22.075	7029	0,26	7032	0,14	7035	0,26	7036	Glosario de Términos

Otras ratios relevantes	Ratio				Ref. Folleto	
	Situación actual 31/12/2024		Situación cierre anual anterior 31/12/2023			
0850		1850		2850		3850
0851		1851		2851		3851
0852		1852		2852		3852
0853		1853		2853		3853

	S.05.4
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2024	

INFORME DE CUMPLIMIENTO DE LAS REGLAS DE FUNCIONAMIENTO DEL FONDO

CUADRO B

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

Cuadro de texto libre

CUADRO C

Informe cumplimiento reglas de funcionamiento



	S.05.5
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2024	

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO A

Comisión	Contrapartida	Importe fijo (miles de euros)	Criterios determinación de la comisión				Máximo (miles de euros)	Mínimo (miles de euros)	Periodidad pago según folleto / escritura	Condiciones iniciales folleto / escritura emisión	Otras consideraciones	
			Base de cálculo		% anual							
Comisión sociedad gestora	0862	Titulización de Activos, SGFT, S.A.	1862	22	2862		3862		4862		5862	6862 TRIMESTRAL 7862 S 8862
Comisión administrador	0863	Ing Direct N.V.	1863	73	2863		3863		4863		5863	6863 TRIMESTRAL 7863 S 8863
Comisión del agente financiero/pagos	0864	Ing Direct N.V.	1864	5	2864		3864		4864		5864	6864 TRIMESTRAL 7864 S 8864
Otras	0865		1865		2865		3865		4865		5865	6865 7865 8865

	S.05.5
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2024	

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	

	S.05.5
Denominación Fondo: SOL LION II, FT	
Denominación del compartimento:	
Denominación de la gestora: Titulización de Activos, SGFT, S.A.	
Estados agregados: NO	
Fecha: 31/12/2024	

INFORMACION RELATIVA A COMISIONES

CUADRO B

Determinada diferencia entre cobros y pagos (miles de euros)	0885	Fecha cálculo						Total
		02/04/2024	28/06/2024	30/09/2024	30/12/2024			
Cobros y pagos del periodo de cálculo, según folleto	0885	02/04/2024	28/06/2024	30/09/2024	30/12/2024			
Saldo inicial	0886	120.001	120.002	120.003	120.001			
Cobros del periodo	0887	785.695	774.835	605.778	593.369			
Pagos por gastos y comisiones, distintas de la comisión variable	0888	-146	-541	-100	-168			
Pagos por derivados	0889	43.398	43.361	48.299	43.674			
Retención importe Fondo de Reserva	0890	-120.000	-120.000	-120.000	-120.000			
Pagos por las obligaciones y otros valores emitidos	0891	-195.201	-184.746	-174.066	-153.502			
Pagos por deudas con entidades de crédito	0892	0	-6.819	-1.198	-1.045			
Resto pagos/retenciones	0893	-633.745	-625.657	-461.334	-451.848			
Saldo disponible	0894	2	433	17.381	30.481			
Liquidación de comisión variable	0895	0	430	17.380	30.428			48.238

Denominación Fondo: SOL LION II, FT

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: NO

Fecha: 31/12/2024

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