

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.00

I. DATOS IDENTIFICATIVOS

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Número de registro del Fondo: **9395**

NIF Fondo: **V-85683431**

Denominación del compartimento:

Número de registro del compartimento:

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

NIF gestora: **A-80352750**

Estados agregados: **No**

Periodo: **3er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

II. INFORMACIÓN COMPLEMENTARIA A LA INFORMACIÓN PERIÓDICA PREVIAMENTE PUBLICADA



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

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
Estados agregados: No
Periodo: 3er Trimestre
Ejercicio: 2016

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/09/2016		Periodo Anterior 31/12/2015
--------------------------	--	------------------------------	--	--------------------------------

ACTIVO				
---------------	--	--	--	--

A) ACTIVO NO CORRIENTE	0008	2.150.467	1008	2.321.904
-------------------------------	------	-----------	------	-----------

I. Activos financieros a largo plazo	0010	2.150.467	1010	2.321.904
1. Valores representativos de deuda	0100	0	1100	0
1.1 Bancos centrales	0101	0	1101	0
1.2 Administraciones Públicas españolas	0102	0	1102	0
1.3 Entidades de crédito	0103	0	1103	0
1.4 Otros sectores residentes	0104	0	1104	0
1.5 Administraciones Públicas no residentes	0105	0	1105	0
1.6 Otros sectores no residentes	0106	0	1106	0
1.7 Activos dudosos	0107	0	1107	0
1.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0108		1108	
1.9 Intereses y gastos devengados no vencidos	0109	0	1109	0
1.10 Ajustes por operaciones de cobertura	0110	0	1110	0
2. Derechos de crédito	0200	2.100.353	1200	2.271.790
2.1 Participaciones hipotecarias	0201	0	1201	0
2.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0202	2.082.288	1202	2.253.620
2.3 Préstamos hipotecarios	0203	0	1203	0
2.4 Cédulas Hipotecarias	0204	0	1204	0
2.5 Préstamos a promotores	0205	0	1205	0
2.6 Préstamos a PYMES	0206	0	1206	0
2.7 Préstamos a empresas	0207	0	1207	0
2.8 Préstamos Corporativos	0208	0	1208	0
2.9 Cédulas territoriales	0209	0	1209	0
2.10 Bonos de Tesorería	0210	0	1210	0
2.11 Deuda Subordinada	0211	0	1211	0
2.12 Créditos AAPP	0212	0	1212	0
2.13 Préstamos Consumo	0213	0	1213	0
2.14 Préstamos automoción	0214	0	1214	0
2.15 Cuotas de Arrendamiento financiero (leasing)	0215	0	1215	0
2.16 Cuentas a cobrar	0216	0	1216	0
2.17 Derechos de crédito futuros	0217	0	1217	0
2.18 Bonos de titulación	0218	0	1218	0
2.19 Otros	0219	0	1219	0
2.20 Activos dudosos	0220	18.151	1220	18.256
2.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0221	-86	1221	-86
2.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0222	0	1222	0
2.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0223	0	1223	0
3. Derivados	0230	50.114	1230	50.114
3.1 Derivados de cobertura	0231	50.114	1231	50.114
3.2 Derivados de negociación	0232	0	1232	0
4. Otros activos financieros	0240	0	1240	0
4.1 Garantías financieras	0241	0	1241	0
4.2 Otros	0242	0	1242	0

II. Activos por impuesto diferido	0250	0	1250	0
--	------	---	------	---

III. Otros activos no corrientes	0260	0	1260	0
---	------	---	------	---

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Periodo: **3er Trimestre**
 Ejercicio: **2016**

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/09/2016		Periodo Anterior 31/12/2015
B) ACTIVO CORRIENTE	0270	284.450	1270	306.751
IV. Activos no corrientes mantenidos para la venta	0280	0	1280	0
V. Activos financieros a corto plazo	0290	183.435	1290	203.086
1. Deudores y otras cuentas a cobrar	0300	19.157	1300	34.465
2. Valores representativos de deuda	0310	0	1310	0
2.1 Bancos centrales	0311	0	1311	0
2.2 Administraciones Públicas españolas	0312	0	1312	0
2.3 Entidades de crédito	0313	0	1313	0
2.4 Otros sectores residentes	0314	0	1314	0
2.5 Administraciones Públicas no residentes	0315	0	1315	0
2.6 Otros sectores no residentes	0316	0	1316	0
2.7 Activos dudosos	0317	0	1317	0
2.8 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0318		1318	
2.9 Intereses y gastos devengados no vencidos	0319	0	1319	0
2.10 Ajustes por operaciones de cobertura	0320	0	1320	0
2.11 Intereses vencidos e impagados	0330	0	1330	0
3. Derechos de crédito	0400	158.277	1400	162.620
3.1 Participaciones hipotecarias	0401	0	1401	0
3.2 Certificados de transmisión hipotecaria	0402	155.168	1402	159.204
3.3 Préstamos hipotecarios	0403	0	1403	0
3.4 Cédulas Hipotecarias	0404	0	1404	0
3.5 Préstamos a promotores	0405	0	1405	0
3.6 Préstamos a PYMES	0406	0	1406	0
3.7 Préstamos a empresas	0407	0	1407	0
3.8 Préstamos Corporativos	0408	0	1408	0
3.9 Cédulas territoriales	0409	0	1409	0
3.10 Bonos de Tesorería	0410	0	1410	0
3.11 Deuda Subordinada	0411	0	1411	0
3.12 Créditos AAPP	0412	0	1412	0
3.13 Préstamos Consumo	0413	0	1413	0
3.14 Préstamos automoción	0414	0	1414	0
3.15 Arrendamiento financiero	0415	0	1415	0
3.16 Cuentas a cobrar	0416	0	1416	0
3.17 Derechos de crédito futuros	0417	0	1417	0
3.18 Bonos de titulización	0418	0	1418	0
3.19 Otros	0419	0	1419	0
3.20 Activos dudosos	0420	2.409	1420	2.308
3.21 Correcciones de valor por deterioro de activos (-)	0421	-22	1421	-22
3.22 Intereses y gastos devengados no vencidos	0422	677	1422	1.076
3.23 Ajustes por operaciones de cobertura	0423	0	1423	0
3.24 Intereses vencidos e impagados	0424	45	1424	54
4. Derivados	0430	6.001	1430	6.001
4.1 Derivados de cobertura	0431	6.001	1431	6.001
4.2 Derivados de negociación	0432	0	1432	0
5. Otros activos financieros	0440	0	1440	0
5.1 Garantías financieras	0441	0	1441	0
5.2 Otros	0442	0	1442	0
VI. Ajustes por periodificaciones	0450	0	1450	1
1. Comisiones	0451	0	1451	0
2. Otros	0452	0	1452	1
VII. Efectivos y otros activos líquidos equivalentes	0460	101.015	1460	103.664
1. Tesorería	0461	101.015	1461	103.664
2. Otros activos líquidos equivalentes	0462	0	1462	0

TOTAL ACTIVO	0500	2.434.917	1500	2.628.655
--------------	------	-----------	------	-----------

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.01

Denominación del Fondo: SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS				
Denominación del compartimento:				
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.				
Estados agregados: No				
Periodo: 3er Trimestre				
Ejercicio: 2016				

BALANCE (miles de euros)		Periodo Actual 30/09/2016		Periodo Anterior 31/12/2015
PASIVO				
A) PASIVO NO CORRIENTE	0650	2.203.588	1650	2.395.585
I. Provisiones a largo plazo	0660	0	1660	0
II. Pasivos financieros a largo plazo	0700	2.203.588	1700	2.395.585
1. Obligaciones y otros valores negociables	0710	2.121.452	1710	2.313.449
1.1 Series no subordinadas	0711	1.941.452	1711	2.133.449
1.2 Series subordinadas	0712	180.000	1712	180.000
1.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0713		1713	
1.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0714	0	1714	0
1.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0715	0	1715	0
2. Deudas con entidades de crédito	0720	82.136	1720	82.136
2.1 Préstamo subordinado	0721	82.136	1721	82.136
2.2 Crédito línea de liquidez	0722	0	1722	0
2.3 Otras deudas con entidades de crédito	0723	0	1723	0
2.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0724		1724	
2.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0725	0	1725	0
2.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0726	0	1726	0
3. Derivados	0730	0	1730	0
3.1 Derivados de cobertura	0731	0	1731	0
3.2 Derivados de negociación	0732	0	1732	0
3.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0733		1733	
4. Otros pasivos financieros	0740	0	1740	0
4.1 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0741		1741	
4.2 Otros	0742	0	1742	0
III. Pasivos por impuesto diferido	0750	0	1750	0
B) PASIVO CORRIENTE	0760	175.227	1760	176.832
IV. Pasivos vinculados con activos no corrientes mantenidos para la venta	0770	0	1770	0
V. Provisiones a corto plazo	0780	0	1780	0
VI. Pasivos financieros a corto plazo	0800	157.830	1800	162.325
1. Acreedores y otras cuentas a pagar	0810	0	1810	0
2. Obligaciones y otros valores negociables	0820	157.830	1820	162.314
2.1 Series no subordinadas	0821	157.577	1821	161.512
2.2 Series subordinadas	0822	0	1822	0
2.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0823		1823	
2.4 Intereses y gastos devengados no vencidos	0824	253	1824	802
2.5 Ajustes por operaciones de cobertura	0825	0	1825	0
2.6 Intereses vencidos e impagados	0826	0	1826	0
3. Deudas con entidades de crédito	0830	0	1830	5
3.1 Préstamo subordinado	0831	0	1831	0
3.2 Crédito línea de liquidez	0832	0	1832	0
3.3 Otras deudas con entidades de crédito	0833	0	1833	0
3.4 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0834		1834	
3.5 Intereses y gastos devengados no vencidos	0835	0	1835	5
3.6 Ajustes por operaciones de cobertura	0836	0	1836	0
3.7 Intereses vencidos e impagados	0837	0	1837	0
4. Derivados	0840	0	1840	0
4.1 Derivados de cobertura	0841	0	1841	0
4.2 Derivados de negociación	0842	0	1842	0
4.3 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0843		1843	
5. Otros pasivos financieros	0850	0	1850	6
5.1 Importe bruto	0851	0	1851	6
5.2 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0852		1852	

VII. Ajustes por periodificación	0900	17.397	1900	14.507
1. Comisiones	0910	17.394	1910	14.499
1.1 Comisión sociedad gestora	0911	11	1911	11
1.2 Comisión administrador	0912	0	1912	0
1.3 Comisión agente financiero/pagos	0913	2	1913	2
1.4 Comisión variable - resultados realizados	0914	17.381	1914	14.486
1.5 Comisión variable - resultados no realizados	0915	0	1915	0
1.6 Otras comisiones del cedente	0916	0	1916	0
1.7 Correcciones de valor por repercusión de pérdidas (-)	0917		1917	
1.8 Otras comisiones	0918	0	1918	0
2. Otros	0920	3	1920	8
C) AJUSTES REPERCUTIDOS EN BALANCE DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS	0930	56.102	1930	56.238
VIII. Activos financieros disponibles para la venta	0940	0	1940	0
IX. Coberturas de flujos de efectivo	0950	56.102	1950	56.238
X. Otros ingresos/ganancias y gastos/pérdidas reconocidos	0960	0	1960	0
XI. Gastos de constitución en transición	0970		1970	
TOTAL PASIVO	1000	2.434.917	2000	2.628.655

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.02

Denominación del Fondo: SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS							
Denominación del compartimento:							
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.							
Estados agregados: No							
Periodo: 3er Trimestre							
Ejercicio: 2016							

CUENTA DE PÉRDIDAS Y GANANCIAS (miles de euros)		P. Corriente Actual 3er trimestre		P. Corriente Anterior 3er trimestre		Acumulado Actual 30/09/2016		Acumulado Anterior 31/12/2015
1. Intereses y rendimientos asimilados	0100	2.256	1100		2100	8.025	3100	
1.1 Valores representativos de deuda	0110	0	1110		2110	0	3110	
1.2 Derechos de crédito	0120	2.256	1120		2120	8.002	3120	
1.3 Otros activos financieros	0130	0	1130		2130	23	3130	
2. Intereses y cargas asimiladas	0200	-759	1200		2200	-3.477	3200	
2.1 Obligaciones y otros valores negociables	0210	-759	1210		2210	-3.470	3210	
2.2 Deudas con entidades de crédito	0220		1220		2220	-7	3220	
2.3 Otros pasivos financieros	0230		1230		2230		3230	
3. Resultado de operaciones de cobertura de flujos de efectivo (neto)	0240	1.350	1240		2240	4.089	3240	
A) MARGEN DE INTERESES	0250	2.847	1250		2250	8.637	3250	
4. Resultado de operaciones financieras (neto)	0300	1	1300		2300	-1	3300	
4.1 Ajustes de valoración en carteras a VR con cambios en PyG	0310	0	1310		2310	0	3310	
4.2 Activos financieros disponibles para la venta	0320	0	1320		2320	0	3320	
4.3 Otros	0330	1	1330		2330	-1	3330	
5. Diferencias de cambio (neto)	0400	0	1400		2400	0	3400	
6. Otros ingresos de explotación	0500	0	1500		2500	0	3500	
7. Otros gastos de explotación	0600	-2.848	1600		2600	-8.636	3600	
7.1 Servicios exteriores	0610	-1	1610		2610	-9	3610	
7.1.1 Servicios de profesionales independientes	0611	-1	1611		2611	-9	3611	
7.1.2 Servicios bancarios y similares	0612		1612		2612		3612	
7.1.3 Publicidad y propaganda	0613		1613		2613		3613	
7.1.4 Otros servicios	0614		1614		2614		3614	
7.2 Tributos	0620	0	1620		2620	0	3620	
7.3 Otros gastos de gestión corrientes	0630	-2.847	1630		2630	-8.627	3630	
7.3.1 Comisión de sociedad gestora	0631	-29	1631		2631	-86	3631	
7.3.2 Comisión administrador	0632		1632		2632		3632	
7.3.3 Comisión del agente financiero/pagos	0633	-5	1633		2633	-15	3633	
7.3.4 Comisión variable - resultados realizados (neto)	0634	-2.813	1634		2634	-8.526	3634	
7.3.5 Comisión variables - resultados no realizados (neto)	0635	0	1635		2635	0	3635	
7.3.6 Otras comisiones del cedente	0636		1636		2636		3636	
7.3.7 Otros gastos	0637	0	1637		2637	0	3637	
8. Deterioro de activos financieros (neto)	0700	0	1700		2700	0	3700	
8.1 Deterioro neto de valores representativos de deuda	0710	0	1710		2710	0	3710	
8.2 Deterioro neto de derechos de crédito	0720	0	1720		2720	0	3720	
8.3 Deterioro neto de derivados	0730	0	1730		2730	0	3730	
8.4 Deterioro neto de otros activos financieros	0740	0	1740		2740	0	3740	
9. Dotaciones a provisiones (neto)	0750	0	1750		2750	0	3750	
10. Ganancias (pérdidas) de activos no corrientes en venta	0800	0	1800		2800	0	3800	
11. Repercusión de pérdidas (ganancias)	0850	0	1850		2850	0	3850	
B) RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS	0900	0	1900		2900	0	3900	
12. Impuesto sobre beneficios	0950	0	1950		2950	0	3950	
C) RESULTADO DEL PERIODO	3000	0	4000		5000	0	6000	

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.03

Denominación del Fondo: SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.
Estados agregados: No
Periodo: 3er Trimestre
Ejercicio: 2016

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO (miles de euros)		Periodo Actual		Mismo Periodo año Anterior
A) FLUJOS DE EFECTIVO PROVENIENTES DE ACTIVIDADES DE EXPLOTACIÓN	8000	2.618	9000	
1. Flujo de caja neto por intereses de las operaciones	8100	8.350	9100	
1.1 Intereses cobrados de los activos titulizados	8110	8.411	9110	
1.2 Intereses pagados por valores de titulización	8120	-4.019	9120	
1.3 Cobros/pagos netos por operaciones de derivados	8130	3.953	9130	
1.4 Intereses cobrados de inversiones financieras	8140	17	9140	
1.5 Intereses pagados por préstamos y créditos en entidades de crédito	8150	-12	9150	
1.6 Otros intereses cobrados/pagados (neto)	8160	0	9160	
2. Comisiones y gastos por servicios financieros pagados por el Fondo	8200	-5.732	9200	
2.1 Comisiones pagadas a la sociedad gestora	8210	-86	9210	
2.2 Comisiones pagadas por administración de activos titulizados	8220		9220	
2.3 Comisiones pagadas al agente financiero	8230	-15	9230	
2.4 Comisiones variables pagadas	8240	-5.631	9240	
2.5 Otras comisiones	8250		9250	
3. Otros flujos de caja provenientes de operaciones del Fondo	8300	0	9300	
3.1 Recuperaciones de fallidos y otros activos adquiridos	8310	0	9310	
3.2 Pagos de provisiones	8320		9320	
3.3 Cobros procedentes de la enajenación de activos no corrientes mantenidos para la venta	8325		9325	
3.4 Otros	8330	0	9330	
B) FLUJOS DE EFECTIVO PROCEDENTES DE ACTIVIDADES INVERSION/FINANCIACION	8350	-5.267	9350	
4. Flujos de caja netos por emisión de valores de titulización	8400	0	9400	
4.1 Cobros por emisión de valores de titulización	8410	0	9410	
4.2 Pagos por emisión de valores de titulización (aseguramiento colocación)	8420		9420	
5. Flujos de caja por adquisición de activos financieros	8500		9500	
5.1 Pagos por adquisición de derechos de crédito	8510		9510	
5.2 Pagos por adquisición de otras inversiones financieras	8520		9520	
6. Flujos de caja netos por amortizaciones	8600	-5.252	9600	
6.1 Cobros por amortización de derechos de crédito	8610	190.680	9610	
6.2 Cobros por amortización de otros activos titulizados	8620	0	9620	
6.3 Pagos por amortización de valores de titulización	8630	-195.932	9630	
7. Otros flujos provenientes de operaciones del Fondo	8700	-15	9700	
7.1 Cobros por concesiones de préstamos o disposiciones de créditos	8710	0	9710	
7.2 Pagos por amortización de préstamos o créditos	8720		9720	
7.3 Cobros derechos de crédito pendientes ingreso	8730	0	9730	
7.4 Administraciones públicas - Pasivo	8740	0	9740	
7.5 Otros deudores y acreedores	8750	-15	9750	
7.6 Cobros por amortización o venta de inversiones financieras	8770	0	9770	
7.7 Cobros de Subvenciones	8780	0	9780	
C) INCREMENTO (+) DISMINUCIÓN (-) DE EFECTIVO O EQUIVALENTES	8800	-2.649	9800	
Efectivo o equivalentes al comienzo del periodo	8900	103.664	9900	
Efectivo o equivalentes al final del periodo	8990	101.015	9990	

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.04

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Periodo: **3er Trimestre**
 Ejercicio: **2016**

INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS <i>(miles de euros)</i>		Periodo Actual 30/09/2016	Mismo Periodo año Anterior 31/12/2015
1 Activos financieros disponibles para la venta			
1.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6010	0	7010
1.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6020	0	7020
1.1.2 Efecto fiscal	6021	0	7021
1.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6022	0	7022
1.3 Otras reclasificaciones	6030	0	7030
1.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6040	0	7040
Total ingresos y gastos reconocidos por activos financieros disponibles para la venta	6100	0	7100
2 Cobertura de los flujos de efectivo			
2.1 Ganancias (pérdidas) por valoración	6110	3.953	7110
2.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6120	3.953	7120
2.1.2 Efecto fiscal	6121	0	7121
2.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6122	-4.089	7122
2.3 Otras reclasificaciones	6130	0	7130
2.4 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6140	136	7140
Total ingresos y gastos reconocidos por coberturas contables	6200	0	7200
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	6310	0	7310
3.1.1 Importe bruto de las ganancias (pérdidas) por valoración	6320	0	7320
3.1.2 Efecto fiscal	6321	0	7321
3.2 Importes transferidos a la cuenta de pérdidas y ganancias	6322	0	7322
3.3 Importes repercutidos a la cuenta de pasivo en el periodo	6330	0	7330
Total Ingresos y gastos reconocidos por otros ingresos/ganancias	6400	0	7400
TOTAL DE INGRESOS Y GASTOS RECONOCIDOS (1+2+3)	6500	0	7500

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Periodo: **3er Trimestre**
 Ejercicio: **2016**
 Entidades cedentes de los activos titulizados: **ING DIRECT N.V. S.E.**

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

Tipología de activos titulizados	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 18/05/2009			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)		
Participaciones hipotecarias	0001		0030		0060		0090		0120		0150	
Certificados de transmisión hipotecaria	0002	28.668	0031	2.258.016	0061	29.751	0091	2.433.388	0121	38.700	0151	4.500.000
Préstamos hipotecarios	0003		0032		0062		0092		0122		0152	
Cédulas hipotecarias	0004		0033		0063		0093		0123		0153	
Préstamos a promotores	0005		0034		0064		0094		0124		0154	
Préstamos a PYMES	0007		0036		0066		0096		0126		0156	
Préstamos a empresas	0008		0037		0067		0097		0127		0157	
Préstamos Corporativos	0009		0038		0068		0098		0128		0158	
Cédulas territoriales	0010		0039		0069		0099		0129		0159	
Bonos de tesorería	0011		0040		0070		0100		0130		0160	
Deuda subordinada	0012		0041		0071		0101		0131		0161	
Créditos AAPP	0013		0042		0072		0102		0132		0162	
Préstamos consumo	0014		0043		0073		0103		0133		0163	
Préstamos automoción	0015		0044		0074		0104		0134		0164	
Arrendamiento financiero	0016		0045		0075		0105		0135		0165	
Cuentas a cobrar	0017		0046		0076		0106		0136		0166	
Derechos de crédito futuros	0018		0047		0077		0107		0137		0167	
Bonos de titulización	0019		0048		0078		0108		0138		0168	
Otros	0020		0049		0079		0109		0139		0169	
Total	0021	28.668	0050	2.258.016	0080	29.751	0110	2.433.388	0140	38.700	0170	4.500.000

(1) Entendido como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Periodo: **3er Trimestre**
 Ejercicio: **2016**
 Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT N.V. S.E.

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO B

Movimiento de la cartera de activos titulizados/Tasa de amortización anticipada	Situación actual 30/09/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015	
Importe de Principal Fallido desde el cierre anual anterior	0196		0206	
Derechos de crédito dados de baja por dación/adjudicación de bienes desde el cierre anual anterior	0197		0207	
Amortización ordinaria desde el cierre anual anterior	0200	-120.339	0210	-165.460
Amortización anticipada desde el cierre anual anterior	0201	-55.033	0211	-83.717
Total importe amortizado acumulado, incluyendo adjudicaciones y otros pagos en especie, desde el origen del Fondo	0202	-2.241.984	0212	-2.066.612
Importe de principal pendiente de amortización de los nuevos activos incorporados en el periodo (1)	0203	0	0213	0
Principal pendiente cierre del periodo (2)	0204	2.258.016	0214	2.433.388
Tasa amortización anticipada efectiva del periodo (%)	0205	3,50	0215	3,12

(1) En fondos abiertos, importe de principal pendiente de reembolso en la fecha de presentación de la información de los nuevos activos incorporados en el periodo

(2) Importe del principal pendiente de reembolso de la totalidad de los activos (incluidas las nuevas incorporaciones del periodo) a fecha del informe

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Periodo: **3er Trimestre**
 Ejercicio: **2016**
 Entidades cedentes de los activos titulizados: **ING DIRECT N.V. S.E.**

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO C

Total Impagados (1)	Nº de activos	Importe impagado							Deuda Total			
		Principal pendiente vencido		Intereses ordinarios (2)		Total		Principal pendiente no vencido				
Hasta 1 mes	0700	35	0710	8	0720	0	0730	8	0740	2.950	0750	2.958
De 1 a 3 meses	0701	46	0711	39	0721	1	0731	40	0741	4.049	0751	4.089
De 3 a 6 meses	0703	33	0713	56	0723	2	0733	58	0743	2.735	0753	2.793
De 6 a 9 meses	0704	13	0714	40	0724	2	0734	42	0744	1.017	0754	1.059
De 9 a 12 meses	0705	9	0715	26	0725	2	0735	28	0745	909	0755	937
De 12 meses a 2 años	0706	41	0716	145	0726	16	0736	161	0746	4.414	0756	4.575
Más de 2 años	0708	93	0718	952	0728	214	0738	1.166	0748	10.267	0758	11.433
Total	0709	270	0719	1.266	0729	237	0739	1.503	0749	26.341	0759	27.844

(1) La distribución de los activos vencidos impagados entre los distintos tramos señalados se realizará en función de la antigüedad de la primera cuota vencida y no cobrada. Los intervalos se entenderán excluido el de inicio e incluido el final (p.e. De 1 a 3 meses, esto es: superior a 1 mes y menor o igual a 3 meses)

(2) Importe de intereses cuyo devengo, en su caso, se ha interrumpido conforme lo establecido en el apartado 12 de la norma 13ª de la Circular(p.e. De 1 a 3 meses, esto es: superior a 1 mes y menor o igual a 3 meses)

Impagados con garantía real (2)	Nº de activos	Importe impagado							Deuda Total	Valor garantía (3)	Valor Garantía con Tasación > 2 años (4)	% Deuda/v. Tasación				
		Principal pendiente vencido		Intereses ordinarios		Total		Principal pendiente no vencido								
Hasta 1 mes	0772	35	0782	8	0792	0	0802	8	0812	2.950	0822	2.958	0832	7.682	0842	38,52
De 1 a 3 meses	0773	46	0783	39	0793	1	0803	40	0813	4.049	0823	4.089	0833	9.849	0843	41,52
De 3 a 6 meses	0774	33	0784	56	0794	2	0804	58	0814	2.735	0824	2.793	0834	6.940	0844	40,24
De 6 a 9 meses	0775	13	0785	40	0795	2	0805	42	0815	1.017	0825	1.059	0835	2.988	0845	35,42
De 9 a 12 meses	0776	9	0786	26	0796	2	0806	28	0816	909	0826	937	0836	2.037	0846	45,98
De 12 meses a 2 años	0777	41	0787	145	0797	16	0807	161	0817	4.414	0827	4.575	0837	9.453	0847	48,38
Más de 2 años	0778	93	0788	952	0798	214	0808	1.166	0818	10.267	0828	11.433	0838	22.831	0848	50,08
Total	0779	270	0789	1.266	0799	237	0809	1.503	0819	26.341	0829	27.844	0839	61.780	0849	45,07

(2) La distribución de los activos vencidos impagados entre los distintos tramos señalados se realizará en función de la antigüedad de la primera cuota vencida y no cobrada. Los intervalos se entenderán excluido el de inicio e incluido el final (p.e. De 1 a 2 meses, estos es: superior a 1 mes y menor o igual a 2 meses)

(3) Cumplimentar con la última valoración disponible de tasación del inmueble o valor razonable de la garantía real (acciones o deuda pignoralas, etc.) si el valor de las mismas se ha considerado en el momento inicial del Fondo

(4) Se incluirá el valor de las garantías que tengan una tasación superior a dos años

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **3er Trimestre**
 Ejercicio: **2016**
 Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT N.V. S.E.

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

CUADRO D	Situación actual 30/09/2016						Situación cierre anual anterior 31/12/2015						Escenario inicial					
	Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)		Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)		Tasa de activos dudosos (A)		Tasa de fallido (contable) (B)		Tasa de recuperación fallidos (D)	
Participaciones hipotecarias	0850		0868		0886		0904		0922		0940		0958		0976		0994	
Certificados de transmisión de hipoteca	0851	0,91	0869	0,00	0887	0,00	0905	0,85	0923	0,00	0941	0,00	0959	0,00	0977	0,00	0995	0,00
Préstamos hipotecarios	0852		0870		0888		0906		0924		0942		0960		0978		0996	
Cédulas Hipotecarias	0853		0871		0889		0907		0925		0943		0961		0979		0997	
Préstamos a promotores	0854		0872		0890		0908		0926		0944		0962		0980		0998	
Préstamos a PYMES	0855		0873		0891		0909		0927		0945		0963		0981		0999	
Préstamos a empresas	0856		0874		0892		0910		0928		0946		0964		0982		1000	
Préstamos Corporativos	0857		0875		0893		0911		0929		0947		0965		0983		1001	
Cédulas Territoriales	1066		1084		1102		1120		1138		1156		1174		1192		1210	
Bonos de Tesorería	0858		0876		0894		0912		0930		0948		0966		0984		1002	
Deuda subordinada	0859		0877		0895		0913		0931		0949		0967		0985		1003	
Créditos AAPP	0860		0878		0896		0914		0932		0950		0968		0986		1004	
Préstamos Consumo	0861		0879		0897		0915		0933		0951		0969		0987		1005	
Préstamos automoción	0862		0880		0898		0916		0934		0952		0970		0988		1006	
Cuotas arrendamiento financiero	0863		0881		0899		0917		0935		0953		0971		0989		1007	
Cuentas a cobrar	0864		0882		0900		0918		0936		0954		0972		0990		1008	
Derechos de crédito futuros	0865		0883		0901		0919		0937		0955		0973		0991		1009	
Bonos de titulización	0866		0884		0902		0920		0938		0956		0974		0992		1010	
Otros	0867		0885		0903		0921		0939		0957		0975		0993		1011	

(1) Estos ratios se referirán exclusivamente a la cartera de activos cedidos al Fondo (presentados en el balance en la partida de "derechos de crédito") y se expresarán en términos porcentuales

(A) Determinada por el cociente entre el principal de los activos clasificados como dudosos a la fecha de presentación de la información, y el principal pendiente (sin incluir intereses, e incluyendo principales impagados) del total activos dados de alta en el balance a la fecha de presentación de la información. La clasificación como dudosos se realizará con arreglo a lo previsto en las Normas 13ª y 23ª

(B) Determinada por el cociente entre el principal de los activos clasificados como fallidos a la fecha de presentación de la información, y el principal pendiente del total de los activos dados de alta en el balance a la fecha de presentación de la información más el principal de los activos clasificados como fallidos. Se considerará la definición de fallidos recogida en la Circular (no necesariamente coincidentes con la definición de la escritura o folleto, recogidas en el estado 5.4)

(D) Determinada por el cociente entre el importe total de recuperaciones de principal de activos clasificados como fallidos que se hayan producido en los últimos 12 meses desde el cierre del mismo período del año anterior y el importe de principal de activos clasificados como fallidos al cierre del mismo período del año anterior

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.1

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Periodo: **3er Trimestre**
 Ejercicio: **2016**
 Entidades cedentes de los activos titulizados: ING DIRECT N.V. S.E.

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS AL FONDO DE TITULIZACIÓN

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO E Vida residual de los activos cedidos al Fondo (1)	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 18/05/2009			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior a 1 año	1300	485	1310	1.751	1320	509	1330	1.802	1340	29	1350	147
Entre 1 y 2 años	1301	477	1311	4.678	1321	541	1331	5.409	1341	70	1351	759
Entre 2 y 3 años	1302	634	1312	9.957	1322	503	1332	8.253	1342	109	1352	1.992
Entre 3 y 5 años	1303	1.752	1313	40.918	1323	1.689	1333	40.642	1343	489	1353	13.914
Entre 5 y 10 años	1304	4.982	1314	222.535	1324	4.718	1334	209.686	1344	2.884	1354	139.111
Superior a 10 años	1305	20.338	1315	1.978.177	1325	21.791	1335	2.167.595	1345	35.119	1355	4.344.077
Total	1306	28.668	1316	2.258.016	1326	29.751	1336	2.433.387	1346	38.700	1356	4.500.000
Vida residual media ponderada (años)	1307	17,02			1327	17,60			1347	23,30		

(1) Los intervalos se entenderán excluido el inicio del mismo e incluido el final (p.e. Entre 1 y 2 años: superior a 1 año y menor o igual a 2 años)

Antigüedad	Situación actual 30/09/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015		Situación inicial 18/05/2009	
	Años		Años		Años	
Antigüedad media ponderada	0630	10,11	0632	9,37	0634	2,83

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **3er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)

CUADRO A		Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Escenario inicial 18/05/2009			
		Denominación serie	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)	Nº de pasivos emitidos	Nominal unitario	Vida media de los pasivos (1)		
Serie (2)		0001	0002	0003	0004	0005	0006	0007	0008	0009	0070	0080	0090
ES0317104000	SERIE A	43.200	49	2.099.029	3,15	43.200	53	2.294.961	3,64	43.200	100	4.320.000	6,37
ES0317104018	SERIE B	900	100	90.000	6,65	900	100	90.000	7,56	900	100	90.000	10,78
ES0317104026	SERIE C	900	100	90.000	6,65	900	100	90.000	7,56	900	100	90.000	10,78
Total		8006	45.000	8025	2.279.029	8045	45.000	8065	2.474.961	8085	45.000	8105	4.500.000

(1) Importes en años. En caso de ser estimado se indicará en las notas explicativas las hipótesis de estimación

(2) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Período: **3er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)

Serie (1)		Denominación serie	Grado de subordinación (2)	Índice de referencia (3)	Margen (4)	Tipo aplicado	Intereses				Principal pendiente		Corrección de valor por repercusión de pérdidas						
							Base de cálculo de intereses	Días Acumulados (5)	Intereses Acumulados (6)	Intereses impagados	Principal no vencido	Principal impagado			Total pendiente				
			9950	9960	9970	9980	9990	9991	9993	9997	9994	9995	9998	9995					
ES0317104000	SERIE A	NS		EURIBOR 3 m	0,35	0,05	360	38	115	0	2.099.029	0	2.099.144						
ES0317104018	SERIE B	S		EURIBOR 3 m	0,80	0,50	360	38	48	0	90.000	0	90.048						
ES0317104026	SERIE C	S		EURIBOR 3 m	1,25	0,95	360	38	90	0	90.000	0	90.090						
Total									9228	253	9105	0	9085	2.279.029	9095	0	9115	2.279.282	9227

(1) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

(2) La gestora deberá indicar si la serie es subordinada o no subordinada (S=Subordinada; NS=No subordinada)

(3) La gestora deberá cumplimentar el índice de referencia que corresponda en cada caso (EURIBOR un año, EURIBOR a tres meses...). En el caso de tipos fijos esta columna se cumplimentará con el término "fijo"

(4) En el caso de tipos fijos esta columna no se cumplimentará

(5) Días acumulados desde la última fecha de pago

(6) Intereses acumulados desde la última fecha de pago

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**

Denominación del compartimento:

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

Estados agregados: **No**

Periodo: **3er Trimestre**

Ejercicio: **2016**

Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros y se referirán al total de la serie salvo que expresamente se solicite el valor unitario)

CUADRO C			Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015											
			Amortización principal		Intereses		Amortización principal		Intereses									
Serie (1)	Denominación serie	Fecha final (2)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)	Pagos del periodo (3)	Pagos acumulados (4)								
		7290	7300	7310	7320	7330	7340	7350	7360	7370								
ES0317104000	SERIE A	23-05-2047	195.932	2.220.972	2.865	220.078	256.239	2.025.040	9.228	217.213								
ES0317104018	SERIE B	23-05-2047	0	0	423	8.743	0	0	748	8.320								
ES0317104026	SERIE C	23-05-2047	0	0	731	11.723	0	0	1.157	10.992								
Total			7305	195.932	7315	2.220.972	7325	4.019	7335	240.544	7345	256.239	7355	2.025.040	7365	11.133	7375	236.525

(1) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

(2) Entendiendo como fecha final aquella que de acuerdo con la documentación contractual determine la extinción del Fondo, siempre que no se haya producido previamente una causa de liquidación anticipada

(3) Total de pagos realizados desde el último cierre anual

(4) Total de pagos realizados desde la fecha de constitución del Fondo

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.2

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **3er Trimestre**
 Ejercicio: **2016**
 Mercados de cotización de los valores emitidos: AIAF

INFORMACIÓN RELATIVA A LOS PASIVOS EMITIDOS POR EL FONDO

CUADRO D

Serie (1)	Denominación serie	Calificación				
		Fecha último cambio de calificación crediticia	Agencia de calificación crediticia (2)	Situación actual	Situación anual cierre anterior	Situación inicial
		3310	3330	3350	3360	3370
ES0317104000	SERIE A	07-08-2014	FCH	AA+	AA+	N/A
ES0317104000	SERIE A	22-01-2016	SYP	AA+	AA	AAA
ES0317104018	SERIE B	29-04-2015	FCH	A+	A+	N/A
ES0317104018	SERIE B	22-01-2016	SYP	AA-	A+	A
ES0317104026	SERIE C	13-05-2014	FCH	BBB	BBB	N/A
ES0317104026	SERIE C	22-01-2016	SYP	BBB+	BBB	BBB

(1) La gestora deberá cumplimentar la denominación de la serie (ISIN) y su denominación. Cuando los títulos emitidos no tengan ISIN se rellenará exclusivamente la columna de denominación

(2) La gestora deberá cumplimentar la calificación crediticia otorgada por cada agencia de rating, cuya denominación también deberá ser cumplimentada, para serie - MDY para Moody's; SYP para Standard & Poors; FCH para Fitch; DBRS para Dominion Bond Rating Service -

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.3

Denominación del Fondo: SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS Denominación del compartimento: Denominación de la gestora: TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T. Estados agregados: No Periodo: 3er Trimestre Ejercicio: 2016

INFORMACIÓN SOBRE MEJORAS CREDITICIAS <i>(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)</i>		Situación actual 30/09/2016		Situación cierre anual anterior 31/12/2015
1. Importe del Fondo de Reserva	0010	82.136	1010	82.136
2. Porcentaje que representa el Fondo de Reserva, u otras mejoras equivalentes, sobre el total de activos titulizados	0020	3,64	1020	3,38
3. Exceso de spread (%) (1)	0040	0,27	1040	0,27
4. Permuta financiera de intereses (S/N)	0050	Si	1050	Si
5. Permuta financiera de tipos de cambio (S/N)	0070	No	1070	No
6. Otras permutas financieras (S/N)	0080	No	1080	No
7. Importe disponible de la línea/s de liquidez (2)	0090	0	1090	0
8. Subordinación de series (S/N)	0110	Si	1110	Si
9. Porcentaje del importe pendiente de las series no subordinadas sobre el importe pendiente del total de bonos (3)	0120	92,10	1120	92,73
10. Importe de los pasivos emitidos garantizados por avales	0150		1150	
11. Porcentaje que representa el aval sobre el total de los pasivos emitidos	0160		1160	
12. Importe máximo de riesgo cubierto por derivados de crédito u otras garantías financieras adquiridas	0170	0	1170	0
13. Otros (S/N) (4)	0180	No	1180	No
(1) Diferencial existente entre los tipos de interés medios ponderados percibidos de la cartera de activos titulizados conforme se establece en el Cuadro 5.5.E y el tipo de interés medio de los pasivos emitidos cuya finalidad ha sido la adquisición de los activos (2) Se incluirá el importe total disponible de las distintas líneas de liquidez en caso de que haya más de una (3) Entendiendo como no subordinadas aquellas series que en la fecha se encuentren, respecto a las demás, en una posición anterior para el cobro de capital conforme al orden de prelación de pagos (4) La gestora deberá incluir una descripción de dichas mejoras crediticias en las notas explicativas en caso de que las consideren relevantes				

Información sobre contrapartes de las mejoras crediticias		NIF		Denominación
Contraparte del Fondo de Reserva u otras mejores equivalentes (5)	0200		1210	ING Direct N.V., sucursal España
Permutas financieras de tipos de interés	0210		1220	ING Direct N.V., sucursal España
Permutas financieras de tipos de cambio	0220		1230	N/A
Otras permutas financieras	0230		1240	N/A
Contraparte de la Línea de Liquidez	0240		1250	N/A
Entidad Avalista	0250		1260	N/A
Contraparte del derivado de crédito	0260		1270	N/A

(5) Si el Fondo de Reserva se ha constituido a través de títulos emitidos y se desconoce el titular de esos títulos no se cumplimentará

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.4

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **3er Trimestre**
 Ejercicio: **2016**

CIRCUNSTANCIAS ESPECÍFICAS ESTABLECIDAS CONTRACTUALMENTE EN EL FONDO

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

Concepto (1)	Meses impago		Días impago		Importe impagado acumulado				Ratio (2)				Ref. Folleto		
					Situación actual	Periodo anterior	Situación actual	Periodo anterior	Situación actual	Periodo anterior	Última Fecha Pago				
1. Activos Morosos por impagos con antigüedad igual o superior a	0010		0030	90	0100	7.776	0200	8.535	0300	0,00	0400	0,00	1120	0,00	
2. Activos Morosos por otras razones					0110		0210		0310		0410		1130		
Total Morosos					0120	7.776	0220	8.535	0320	0,00	0420	0,00	1140	0,00	1280
3. Activos Fallidos por impagos con antigüedad igual o superior a	0050	18	0060		0130	15.262	0230	14.000	0330	0,01	0430	0,01	1050	0,01	
4. Activos Fallidos por otras razones					0140	0	0240	0	0340	0,00	0440	0,00	1160	0,00	
Total Fallidos					0150	15.262	0250	14.000	0350	0,01	0450	0,01	1200	0,01	1290

(1) En caso de existir definiciones adicionales a las recogidas en la presente tabla (moros cualificadas, fallidos subjetivos, etc) respecto a las que se establezca algún trigger se indicarán en la tabla de Otros ratios relevantes, indicando el nombre del ratio

(2) Los ratios se corresponden al importe total de activos fallidos o morosos entre el saldo vivo de los activos cedidos al fondo según se defina en la documentación contractual. En la columna Ref. Folleto se indicará el epígrafe o capítulo del folleto en el que el concepto esté definido

Otros ratios relevantes	Ratio (2)				Ref. Folleto	
	Situación actual	periodo anterior	Última Fecha Pago			
N/A			0160	0260	0360	0460

TRIGGERS (3)	Límite	% Actual	Última Fecha Pago		Ref. Folleto
Amortización secuencial: series (4)	0500	0520	0540	0560	
SERIE B ES0317104018	4,00	3,95	3,85		4.9.2.2 Nota de Valores
SERIE B ES0317104018	2,50	0,28	0,29		4.9.2.2 Nota de Valores
SERIE B ES0317104018	10,00	49,84	50,65		4.9.2.2 Nota de Valores
SERIE C ES0317104026	4,40	3,95	3,85		4.9.2.2 Nota de Valores
SERIE C ES0317104026	1,00	0,28	0,29		4.9.2.2 Nota de Valores
SERIE C ES0317104026	10,00	49,84	50,65		4.9.2.2 Nota de Valores
Diferimiento/postergamiento intereses: series (5)	0506	0526	0546	0566	
SERIE C ES0317104026	7,50	0,54	0,53		3.4.5.2.2. Modulo Adicional
SERIE B ES0317104018	10,00	0,54	0,53		3.4.5.2.2. Modulo Adicional
No Reducción del Fondo de Reserva (6)	0512	0532	0552	0572	3.4.2.2. Modulo Adicional
OTROS TRIGGERS (3)	0513	0523	0553	0573	

N/A								
-----	--	--	--	--	--	--	--	--

(3) En caso de existir triggers adicionales a los recogidos en la presente tabla se indicarán su nombre o concepto debajo de OTROS TRIGGERS. Si los triggers recogidos expresamente en la tabla no están previstos en el Fondo, no se cumplimentarán

(4) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto al modo de amortización (prorrata/secuencial) de algunas de las series se indicarán las series afectadas indicando su ISIN, y en su defecto el nombre, el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

(5) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto al diferimiento o postergamiento de intereses de algunas de las series se indicarán las series afectadas indicando su ISIN o nombre, el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

(6) Si en el folleto y escritura de constitución del Fondo se establecen triggers respecto a la no reducción del fondo de reserva se indicará el límite contractual establecido, la situación actual del ratio, la situación en la última fecha de pago y la referencia al epígrafe del folleto donde está definido

--

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **3er Trimestre**
 Ejercicio: **2016**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO A Distribución geográfica de activos titulizados	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 18/05/2009			
	Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)			Nº de activos vivos	Principal pendiente (1)		
Andalucía	0400	5.702	0426	390.869	0452	5.892	0478	419.506	0504	7.635	0530	757.747
Aragón	0401	303	0427	20.026	0453	310	0479	21.574	0505	408	0531	42.201
Asturias	0402	340	0428	20.778	0454	357	0480	22.272	0506	478	0532	44.264
Baleares	0403	548	0429	48.376	0455	570	0481	52.300	0507	728	0533	92.532
Canarias	0404	796	0430	60.424	0456	824	0482	64.913	0508	1.005	0534	109.066
Cantabria	0405	241	0431	15.968	0457	256	0483	17.407	0509	341	0535	34.409
Castilla-León	0406	680	0432	42.979	0458	718	0484	46.372	0510	942	0536	93.273
Castilla La Mancha	0407	1.099	0433	83.030	0459	1.136	0485	89.183	0511	1.430	0537	159.270
Cataluña	0408	5.177	0434	480.348	0460	5.372	0486	518.018	0512	6.856	0538	924.455
Ceuta	0409	0	0435	0	0461	0	0487	0	0513	0	0539	0
Extremadura	0410	289	0436	15.953	0462	298	0488	17.139	0514	409	0540	34.214
Galicia	0411	565	0437	33.737	0463	599	0489	36.522	0515	780	0541	70.205
Madrid	0412	8.418	0438	726.827	0464	8.766	0490	785.819	0516	11.794	0542	1.522.156
Meilla	0413	0	0439	0	0465	0	0491	0	0517	0	0543	0
Murcia	0414	691	0440	51.645	0466	706	0492	54.744	0518	858	0544	91.710
Navarra	0415	63	0441	4.619	0467	64	0493	5.104	0519	95	0545	11.033
La Rioja	0416	53	0442	3.632	0468	57	0494	3.964	0520	68	0546	7.288
Comunidad Valenciana	0417	3.320	0443	230.312	0469	3.428	0495	247.695	0521	4.323	0547	441.977
País Vasco	0418	383	0444	28.492	0470	398	0496	30.855	0522	550	0548	64.199
Total España	0419	28.668	0445	2.258.015	0471	29.751	0497	2.433.387	0523	38.700	0549	4.499.999
Otros países Unión europea	0420	0	0446	0	0472	0	0498	0	0524	0	0550	0
Resto	0422	0	0448	0	0474	0	0500	0	0526	0	0552	0
Total general	0425	28.668	0450	2.258.015	0475	29.751	0501	2.433.387	0527	38.700	0553	4.499.999

(1) Entendiendo como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **3er Trimestre**
 Ejercicio: **2016**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

Divisa/Activos titulizados	Situación actual 30/09/2016						Situación cierre anual anterior 31/12/2015						Situación inicial 18/05/2009					
	Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)		Nº de activos vivos		Principal pendiente en Divisa (1)		Principal pendiente en euros (1)	
Euro - EUR	0571	28.668	0577	2.258.016	0583	2.258.016	0600	29.751	0606	2.433.388	0611	2.433.388	0620	38.700	0626	4.500.000	0631	4.500.000
EEUU Dólar - USD	0572	0	0578	0	0584	0	0601	0	0607	0	0612	0	0621	0	0627	0	0632	0
Japón Yen - JPY	0573	0	0579	0	0585	0	0602	0	0608	0	0613	0	0622	0	0628	0	0633	0
Reino Unido Libra - GBP	0574	0	0580	0	0586	0	0603	0	0609	0	0614	0	0623	0	0629	0	0634	0
Otras	0575	0			0587	0	0604	0			0615	0	0624	0			0635	0
Total	0576	28.668			0588	2.258.016	0605	29.751			0616	2.433.388	0625	38.700			0636	4.500.000

(1) Entendiendo como principal pendiente el importe de principal pendiente de reembolso

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **3er Trimestre**
 Ejercicio: **2016**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO C Importe pendiente activos titulizados / Valor garantía (1)	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 18/05/2009			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
0% - 40%	1100	19.136	1110	1.118.269	1120	19.025	1130	1.128.907	1140	15.343	1150	1.170.291
40% - 60%	1101	8.266	1111	949.091	1121	8.863	1131	1.022.116	1141	12.155	1151	1.533.714
60% - 80%	1102	1.264	1112	190.271	1122	1.854	1132	280.989	1142	10.010	1152	1.556.842
80% - 100%	1103	2	1113	384	1123	9	1133	1.376	1143	1.192	1153	239.153
100% - 120%	1104	0	1114	0	1124	0	1134	0	1144	0	1154	0
120% - 140%	1105	0	1115	0	1125	0	1135	0	1145	0	1155	0
140% - 160%	1106	0	1116	0	1126	0	1136	0	1146	0	1156	0
superior al 160%	1107	0	1117	0	1127	0	1137	0	1147	0	1157	0
Total	1108	28.668	1118	2.258.015	1128	29.751	1138	2.433.388	1148	38.700	1158	4.500.000
Media ponderada (%)			1119	39,54			1139	40,88			1159	53,21

(1) Distribución según el valor de la razón entre el importe pendiente de amortizar de los préstamos con garantía real y la última valoración disponible de tasación de los inmuebles hipotecados, o valor razonable de otras garantías reales, siempre que el valor de las mismas se haya considerado en el momento inicial del Fondo, expresada en porcentaje

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **3er Trimestre**
 Ejercicio: **2016**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO D

Rendimiento índice del periodo	Número de activos		Principal Pendiente		Margen ponderado s/ índice de referencia		Tipo de interés medio ponderado (2)	
	vivos							
Índice de referencia (1)	1400		1410		1420		1430	
EURIBOR	28.666		2.257.943		0,40		0,48	
TIPO FIJO	2		73				3,20	
Total	1405	28.668	1415	2.258.016	1425	0,40	1435	0,48

(1) La gestora deberá cumplimentar el índice de referencia que corresponda en cada caso (EURIBOR un año, LIBRO, etc.)

(2) En el caso de tipos fijos no se cumplimentará la columna de margen ponderado y se indicará el tipo de interés medio ponderado de los activos a tipo fijo en la columna "tipo de interés medio ponderado"

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **3er Trimestre**
 Ejercicio: **2016**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO E Tipo de interés nominal	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 18/05/2009			
	Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente		Nº de activos vivos		Principal pendiente	
Inferior al 1%	1500	28.650	1521	2.256.552	1542	29.632	1563	2.426.445	1584	0	1605	0
1% - 1,49%	1501	16	1522	1.365	1543	70	1564	2.431	1585	0	1606	0
1,5% - 1,99%	1502	1	1523	62	1544	42	1565	4.090	1586	0	1607	0
2% - 2,49%	1503	0	1524	0	1545	5	1566	315	1587	7.765	1608	983.476
2,5% - 2,99%	1504	0	1525	0	1546	0	1567	0	1588	5.502	1609	625.109
3% - 3,49%	1505	0	1526	0	1547	1	1568	69	1589	2.407	1610	225.491
3,5% - 3,99%	1506	0	1527	0	1548	0	1569	0	1590	7.777	1611	913.308
4% - 4,49%	1507	0	1528	0	1549	0	1570	0	1591	1.031	1612	112.071
4,5% - 4,99%	1508	0	1529	0	1550	0	1571	0	1592	7.017	1613	822.668
5% - 5,49%	1509	1	1530	38	1551	1	1572	38	1593	790	1614	88.133
5,5% - 5,99%	1510	0	1531	0	1552	0	1573	0	1594	6.411	1615	729.746
6% - 6,49%	1511	0	1532	0	1553	0	1574	0	1595	0	1616	0
6,5% - 6,99%	1512	0	1533	0	1554	0	1575	0	1596	0	1617	0
7% - 7,49%	1513	0	1534	0	1555	0	1576	0	1597	0	1618	0
7,5% - 7,99%	1514	0	1535	0	1556	0	1577	0	1598	0	1619	0
8% - 8,49%	1515	0	1536	0	1557	0	1578	0	1599	0	1620	0
8,5% - 8,99%	1516	0	1537	0	1558	0	1579	0	1600	0	1621	0
9% - 9,49%	1517	0	1538	0	1559	0	1580	0	1601	0	1622	0
9,5% - 9,99%	1518	0	1539	0	1560	0	1581	0	1602	0	1623	0
Superior al 10%	1519	0	1540	0	1561	0	1582	0	1603	0	1624	0
Total	1520	28.668	1541	2.258.017	1562	29.751	1583	2.433.388	1604	38.700	1625	4.500.002
Tipo de interés medio ponderado de los activos(%)			9542	0,48			9584	0,66			1626	3,83
Tipo de interés medio ponderado de los pasivos(%)			9543	0,21			9585	0,39			1627	1,62

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **3er Trimestre**
 Ejercicio: **2016**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

Concentración	Situación actual 30/09/2016				Situación cierre anual anterior 31/12/2015				Situación inicial 18/05/2009			
	Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)		Porcentaje		CNAE (2)	
Diez primeros deudores/emisores con más concentración	2000	0,32			2030	0,31			2060	0,26		
Sector: (1)	2010		2020		2040		2050		2070		2080	

(1) Indíquese denominación del sector con mayor concentración

(2) Incluir código CNAE con dos niveles de agregación

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.05.5

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
 Denominación del compartimento:
 Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
 Estados agregados: **No**
 Período: **3er Trimestre**
 Ejercicio: **2016**

OTRA INFORMACIÓN RELATIVA A LOS ACTIVOS CEDIDOS Y PASIVOS

(Las cifras relativas a importes se consignarán en miles de euros)

CUADRO G

Divisa/Pasivos emitidos por el fondo	Situación actual 30/09/2016						Situación inicial 18/05/2009					
	Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros		Nº de pasivos emitidos		Principal pendiente en Divisa		Principal pendiente en euros	
Euro - EUR	3000	45.000	3060	2.279.029	3110	2.279.029	3170	45.000	3230	4.500.000	3250	4.500.000
EEUU Dólar - USDR	3010	0	3070	0	3120	0	3180	0	3240	0	3260	0
Japón Yen - JPY	3020	0	3080	0	3130	0	3190	0	3250	0	3270	0
Reino Unido Libra - GBP	3030	0	3090	0	3140	0	3200	0	3260	0	3280	0
Otras	3040	0			3150	0	3210	0			3290	0
Total	3050	45.000			3160	2.279.029	3220	45.000			3300	4.500.000

ESTADOS FINANCIEROS PÚBLICOS DE FONDOS DE TITULIZACIÓN DE ACTIVOS



S.06

Denominación del Fondo: **SOL-LION, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS**
Denominación del compartimento:
Denominación de la gestora: **TITULIZACION DE ACTIVOS, S.A., S.G.F.T.**
Estados agregados: **No**
Periodo: **3er Trimestre**
Ejercicio: **2016**

NOTAS EXPLICATIVAS

Contiene
Información adicional
en fichero adjunto

INFORME DE AUDITOR

N/A