

SOL-LION II RMBS - Fondo de Titulización

LIQUIDACION DEL PERIODO 28/06/24 - 30/09/24

	Euros
I. Situación al inicio del período:	120.002.779,27
Fondo de Reserva	120.000.000,00
Importe reservado para la compra de derechos de crédito	2.779,27
II. Fondos recibidos del emisor	605.777.534,24
Principal:	
Según calendario hasta 31/07/24:	133.161.846,59
Amort. Anticipada hasta 31/07/24:	328.162.700,46
Intereses:	144.452.987,19
III. Recursos disponibles (I + II):	725.780.313,51
IV. Gastos:	100.223,32
V. Liquidación SWAP:	48.298.757,72
Cantidad a Pagar por el Fondo:	7.495.151,72
Cantidad a Pagar por la Contraparte (ING Direct N.V.):	55.793.909,44
VI. Compra de Derechos de Crédito Adicionales	
Importe objetivo	461.334.539,73
Importe recomprado	461.333.596,85
Importe reservado para la siguiente fecha de compra	942,88
VII. Pago a los Bonos:	174.066.403,37
Bonos A1:	
Intereses correspondientes al 30/09/24:	54.576.891,99
Retenciones practicadas a los bonos:	10.369.609,48
Amortización correspondiente al 30/09/24:	0,00
Bonos A2:	
Intereses correspondientes al 30/09/24:	11.190.601,00
Retenciones practicadas a los bonos:	2.126.214,19
Amortización correspondiente al 30/09/24:	0,00
Bonos A3:	
Intereses correspondientes al 30/09/24:	43.566.774,48
Retenciones practicadas a los bonos:	8.277.687,15
Amortización correspondiente al 30/09/24:	0,00
Bonos A4:	
Intereses correspondientes al 30/09/24:	11.738.090,81
Retenciones practicadas a los bonos:	2.230.237,25
Amortización correspondiente al 30/09/24:	0,00
Bonos A5:	
Intereses correspondientes al 30/09/24:	9.612.103,60
Retenciones practicadas a los bonos:	1.826.299,68
Amortización correspondiente al 30/09/24:	0,00
Bonos A6:	
Intereses correspondientes al 30/09/24:	14.930.084,34
Retenciones practicadas a los bonos:	2.836.716,02
Amortización correspondiente al 30/09/24:	0,00
Bonos B:	
Intereses correspondientes al 30/09/24:	22.710.074,43
Retenciones practicadas a los bonos:	4.314.914,14
Amortización correspondiente al 30/09/24:	0,00
Bonos C:	
Intereses correspondientes al 30/09/24:	5.741.782,72
Retenciones practicadas a los bonos:	1.090.938,72
Amortización correspondiente al 30/09/24:	0,00
Reinversión o devolución de las retenciones:	-33.072.616,63
VIII. Saldo disponible (III - IV + V - VI - VII):	138.578.847,69
Distribución del saldo disponible:	
Fondo de Reserva previo (28/06/24):	120.000.000,00
Aportación al Fondo de Reserva	0,00
Remuneración Fija del Prestamo Participativo	1.197.560,00
Amortización del Prestamo Participativo	0,00
Otros recursos	0,00
Pago de intermediación financiera	17.380.344,81
Importe reservado para la siguiente fecha de compra	942,88
Fondo de Reserva (30/09/24):	120.000.000,00



Nº: 3548/24

Titulización de Activos, SGFT, S.A.

Ortense, 58

28020 Madrid

Tel: 917020808

http://www.tda-sgft.com

SOL LION 2liq trm Sep24

SOL-LION II RMBS, FT**INFORMACION A LOS INVERSORES****FECHA DE PAGO: 30 de Septiembre de 2024**

Importes en euros		
I. BONO A1 ES0305515001	Sobre 52623 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (04/12/20):	4.696.500.000,00 €	100.000,00 €
2. Saldo tras la emisión de bonos de 29/03/2021	5.262.300.000,00 €	100.000,00 €
3. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	5.262.300.000,00 €	100.000,00 €
4. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	54.576.891,99 €	1.037,13 €
5. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
6. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	5.262.300.000,00 €	100.000,00 €
7. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
II. BONO A2 ES0305515019	Sobre 10525 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (04/12/20):	939.300.000,00 €	100.000,00 €
2. Saldo tras la emisión de bonos de 29/03/2021	1.052.500.000,00 €	100.000,00 €
3. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	1.052.500.000,00 €	100.000,00 €
4. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	11.190.601,01 €	1.063,24 €
5. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
6. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	1.052.500.000,00 €	100.000,00 €
7. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
III. BONO A3 ES0305515027	Sobre 39993 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (04/12/20):	3.569.300.000,00 €	100.000,00 €
2. Saldo tras la emisión de bonos de 29/03/2021	3.999.300.000,00 €	100.000,00 €
3. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	3.999.300.000,00 €	100.000,00 €
4. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	43.566.774,48 €	1.089,36 €
5. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
6. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	3.999.300.000,00 €	100.000,00 €
7. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
IV. BONO A4 ES0305515035	Sobre 10523 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (04/12/20):	939.200.000,00 €	100.000,00 €
2. Saldo tras la emisión de bonos de 29/03/2021	1.052.300.000,00 €	100.000,00 €
3. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	1.052.300.000,00 €	100.000,00 €
4. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	11.738.090,81 €	1.115,47 €
5. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
6. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	1.052.300.000,00 €	100.000,00 €
7. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
V. BONO A5 ES0305515043	Sobre 8420 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (04/12/20):	751.400.000,00 €	100.000,00 €
2. Saldo tras la emisión de bonos de 29/03/2021	842.000.000,00 €	100.000,00 €
3. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	842.000.000,00 €	100.000,00 €
4. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	9.612.103,60 €	1.141,58 €
5. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
6. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	842.000.000,00 €	100.000,00 €
7. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
VI. BONO A6 ES0305515050	Sobre 12786 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (04/12/20):	1.141.200.000,00 €	100.000,00 €
2. Saldo tras la emisión de bonos de 29/03/2021	1.278.600.000,00 €	100.000,00 €
3. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	1.278.600.000,00 €	100.000,00 €
4. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	14.930.084,34 €	1.167,69 €
5. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
6. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	1.278.600.000,00 €	100.000,00 €
7. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
VII. BONO B ES0305515068	Sobre 18419 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (04/12/20):	1.643.800.000,00 €	100.000,00 €
2. Saldo tras la emisión de bonos de 29/03/2021	1.841.900.000,00 €	100.000,00 €
3. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	1.841.900.000,00 €	100.000,00 €
4. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	22.710.074,43 €	1.232,97 €
5. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
6. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	1.841.900.000,00 €	100.000,00 €
7. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
VIII. BONO C ES0305515076	Sobre 4211 bonos	Por Bono
1. Saldo inicial (04/12/20):	375.800.000,00 €	100.000,00 €
2. Saldo tras la emisión de bonos de 29/03/2021	421.100.000,00 €	100.000,00 €
3. Pendiente de vencimiento en la anterior Fecha de Pago:	421.100.000,00 €	100.000,00 €
4. Intereses devengados y pagados en esta Fecha de Pago:	5.741.782,72 €	1.363,52 €
5. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:	0,00 €	0,00 €
6. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:	421.100.000,00 €	100.000,00 €
7. Porcentaje pendiente de vencimiento:	100,000000%	100,000000%
IX. EL FONDO	Importes en euros	
1. Saldo de participaciones hipotecarias a 31/08/24:		
a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:		15.251.105.136,69 €
b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:		35.779.735,33 €
c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:		15.251.581.172,49 €
d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:		37.098.408,36 €
2. Amortización del periodo 30/04/24 a 31/08/24:		461.324.547,05 €
a) Según calendario:		133.161.846,59 €
b) Amortización anticipada hasta 31/08/24:		328.162.700,46 €
3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):		
b) Ultimo año:		12,76%
c) Ultimo semestre:		10,20%
d) Ultimo trimestre:		8,09%
4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:		0,13%
5. Porcentaje de impago entre 7 y 12 meses:		0,12%
6. Porcentaje de fallidos (1):		0,24%
7. Nivel de impago(2):		0,22%

(1) Saldo pendiente de las participaciones hipotecarias fallidas según definición del Folleto de Emisión (retraso de 13 meses y otras causas), sobre el saldo pendiente total.

(2) Importe de principal de las Participaciones Hipotecarias con morosidad superior a 90 días en la Fecha de Cobro inmediata anterior a la Fecha de Pago en curso, sobre el Saldo Vivo de las Participaciones Hipotecarias.

Destinatarios: Cedente; CNMV; AIAF.



Nº: 3542/24

Titulización de Activos, (SGFT), S.A.

Orense, 88

28020 Madrid

Tel.: 917020000

http://www.tta-egft.com

SOL LION 2Inforver.trim3Sep24 (Español)

SOL-LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL PERÍODO: 28/06/24 - 30/09/24

I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO	
Fecha de Constitución del Fondo	1 de diciembre de 2020
Fecha Emisión Bonos	4 de diciembre de 2020
Fecha Final Amortización CTH: (12,76% TAA)	28 de marzo de 2042
Sociedad Gestora	Titulización de Activos, SGFT,S.A.
Emisores Certificados de Transmisión de Hipoteca	ING Direct, N.V.
Agente de Pagos	ING Direct, N.V.
Negociación Mercado	Mercado AIAF
Agencia de Calificación	Fitch Ratings España / DBRS Ratings GMBH
Calificación	Bonos A1: (F) AAA (sf) / (D) AAA (sf) Bonos A2: (F) AAA (sf) / (D) AAA (sf) Bonos A3: (F) AAA (sf) / (D) AAA (sf) Bonos A4: (F) AAA (sf) / (D) AAA (sf) Bonos A5: (F) AAA (sf) / (D) AAA (sf) Bonos A6: (F) AAA (sf) / (D) AAA (sf) Bonos B: (F) - (sf) / (D) - (sf) Bonos C: (F) - (sf) / (D) - (sf)

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO	
Nombre	Bonos de Titulización SOL-LION II
Serie A1:	
Código ISIN	ES0305515001
Nominal en circulación total (inicial)	4.696.500.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	5.262.300.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie A2:	
Código ISIN	ES0305515019
Nominal en circulación total (inicial)	939.300.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	1.052.500.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie A3:	
Código ISIN	ES0305515027
Nominal en circulación total (inicial)	3.569.300.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	3.999.300.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros

II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)	
Nombre	Bonos de Titulización SOL-LION II
Serie A4:	
Código ISIN	ES0305515035
Nominal en circulación total (inicial)	939.200.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	1.052.300.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie A5:	
Código ISIN	ES0305515043
Nominal en circulación total (inicial)	751.400.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	842.000.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie A6:	
Código ISIN	ES0305515050
Nominal en circulación total (inicial)	1.141.200.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	1.278.600.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie B:	
Código ISIN	ES0305515068
Nominal en circulación total (inicial)	1.643.800.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	1.841.900.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros
Serie C:	
Código ISIN	ES0305515076
Nominal en circulación total (inicial)	375.800.000,00 Euros
Nominal en circulación total (actual)	421.100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (inicial)	100.000,00 Euros
Nominal en circulación unitario (actual)	100.000,00 Euros

III. INFORMACION INCLUIDA
* Liquidación del Período: 28/06/24 - 30/09/24
* Flujos de Caja del Período: 28/06/24 - 30/09/24
* Información a los inversores. Fecha de Pago: 30 de Septiembre de 2024

SOL-LION II RMBS, FT**Fondo de Titulización de Activos****FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 28/06/24 - 30/09/24**

	Euros	
	Ingresos	Pagos
I. INVERSIONES/FINANCIACIONES		
Amortización Bonos Titulización Hip.		0,00
Amortización Participaciones Hip.	461.324.547,05	
Compra de derechos de crédito		461.333.596,85
II. INTERESES		
Intereses pagados a los BTH		174.066.403,37
Intereses recibidos de las CTHs	144.452.987,19	
Intereses Ptmos. Subordinados		1.197.560,00
III. GASTOS		
Comisiones y Gastos		100.223,32
Neto SWAP	48.298.757,72	
IV. REMUNERACIÓN POR INTERMEDIACIÓN FINANCIERA		17.380.344,81
Total Ingresos/Pagos	654.076.291,96	654.078.128,35
Saldo inicial 28/06/24	120.002.779,27	
A Inversiones Temporales		120.000.942,88
Total	774.079.071,23	774.079.071,23
Retenciones practicadas el 30/09/24	33.072.616,63	
A Inversiones Temporales		33.072.616,63

Destinatarios: CNMV; AIAF.



TdA
Titulización
de Activos

Nº: 3546/24

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

<http://www.tda-sgft.com>

SOL LION 2|fluj.trim|Sep24