

**SOL-LION II RMBS - Fondo de Titulización****LIQUIDACION DEL PERIODO 28/12/22 - 28/03/23**

|  | Euros                   |
|--|-------------------------|
| <b>I. Situación al Inicio del periodo:</b>                 | <b>163.332.131,92</b>   |
| Fondo de Reserva   | 120.000.000,00          |
| Importe reservado para la compra de derechos de crédito    | 43.322.911,25           |
| Otros recursos   | 9.220,67                |
| <b>II. Fondos recibidos del emisor</b>                     | <b>933.836.770,83</b>   |
| <b>Principal:</b>  |                         |
| Según calendario hasta 28/02/23:                           | 147.232.538,56          |
| Amort. Anticipada hasta 28/02/23:                          | 698.868.732,84          |
| <b>Intereses:</b>  | <b>87.735.499,43</b>    |
| <b>III. Recursos disponibles ( I + II ):</b>               | <b>1.097.168.902,75</b> |
| <b>IV. Gastos:</b>   | <b>30.533,41</b>        |
| <b>V. Liquidación SWAP:</b>                                | <b>12.837.648,28</b>    |
| Cantidad a Pagar por el Fondo:                             | 3.911.532,08            |
| Cantidad a Pagar por la Contraparte (ING Direct N.V.):     | 16.749.180,36           |
| <b>VI. Compra de Derechos de Crédito Adicionales</b>       |                         |
| Importe objetivo   | 889.424.182,65          |
| Importe recomprado   | 312.319.073,15          |
| Importe reservado para la siguiente fecha de compra        | 577.105.109,50          |
| <b>VII. Pago a los Bonos:</b>                              | <b>100.551.656,88</b>   |
| <b>Bonos A1:</b>   |                         |
| Intereses correspondientes al 28/03/23:                    | 31.455.398,25           |
| Retenciones practicadas a los bonos:                       | 5.976.525,67            |
| Amortización correspondiente al 28/03/23:                  | 0,00                    |
| <b>Bonos A2:</b>   |                         |
| Intereses correspondientes al 28/03/23:                    | 6.554.443,75            |
| Retenciones practicadas a los bonos:                       | 1.245.344,31            |
| Amortización correspondiente al 28/03/23:                  | 0,00                    |
| <b>Bonos A3:</b>   |                         |
| Intereses correspondientes al 28/03/23:                    | 25.905.465,75           |
| Retenciones practicadas a los bonos:                       | 4.922.038,49            |
| Amortización correspondiente al 28/03/23:                  | 0,00                    |
| <b>Bonos A4:</b>   |                         |
| Intereses correspondientes al 28/03/23:                    | 7.079.348,25            |
| Retenciones practicadas a los bonos:                       | 1.345.076,17            |
| Amortización correspondiente al 28/03/23:                  | 0,00                    |
| <b>Bonos A5:</b>   |                         |
| Intereses correspondientes al 28/03/23:                    | 5.875.055,00            |
| Retenciones practicadas a los bonos:                       | 1.116.260,45            |
| Amortización correspondiente al 28/03/23:                  | 0,00                    |
| <b>Bonos A6:</b>   |                         |
| Intereses correspondientes al 28/03/23:                    | 9.241.081,50            |
| Retenciones practicadas a los bonos:                       | 1.755.805,49            |
| Amortización correspondiente al 28/03/23:                  | 0,00                    |
| <b>Bonos B:</b>  |                         |
| Intereses debidos en la anterior fecha de pago:            | 2.123.894,89            |
| Intereses correspondientes al 28/03/23:                    | 14.463.519,75           |
| Intereses pagados al 28/03/23:                             | 14.440.864,38           |
| Intereses impagados actuales                               | 2.146.550,26            |
| Retenciones practicadas a los bonos:                       | 2.743.764,23            |
| Amortización correspondiente al 28/03/23:                  | 0,00                    |
| <b>Bonos C:</b>  |                         |
| Intereses debidos en la anterior fecha de pago:            | 2.839.940,51            |
| Intereses correspondientes al 28/03/23:                    | 3.833.062,75            |
| Intereses pagados al 28/03/23:                             | 0,00                    |
| Intereses impagados actuales                               | 6.673.003,26            |
| Retenciones practicadas a los bonos:                       | 0,00                    |
| Amortización correspondiente al 28/03/23:                  | 0,00                    |
| <b>Reinversión o devolución de las retenciones:</b>        | <b>-19.104.814,81</b>   |
| <b>VIII. Saldo disponible ( III - IV + V - VI - VII ):</b> | <b>697.105.287,59</b>   |
| <b>Distribución del saldo disponible:</b>                  |                         |
| Fondo de Reserva previo (28/12/22):                        | 120.000.000,00          |
| Aportación al Fondo de Reserva                             | 0,00                    |
| Remuneración Fija del Prestamo Participativo               | 0,00                    |
| Amortización del Prestamo Participativo                    | 0,00                    |
| Otros recursos   | 178,09                  |
| <b>Pago de intermediación financiera</b>                   | <b>0,00</b>             |
| <b>Importe reservado para la siguiente fecha de compra</b> | <b>577.105.109,50</b>   |
| <b>Fondo de Reserva (28/03/23):</b>                        | <b>120.000.000,00</b>   |



Nº 1287/23

Titulización de Activos, SGFT,S.A.  
 Orense, 58  
 28020 Madrid  
 Tel.:917020808  
<http://www.tia-sgft.com>  
 SOL LION 2/liqu/trim/Mar23

**SOL-LION II RMBS, FT**

**INFORMACION A LOS INVERSORES**

**FECHA DE PAGO: 28 de Marzo de 2023**

| Importes en euros   |                          |                     |
|---|--------------------------|---------------------|
| <b>I. BONO A1 ES0305515001</b>                              | <b>Sobre 52623 bonos</b> | <b>Por Bono</b>     |
| 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:    | 31.455.398,25 €          | 597,75 €            |
| 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%         |
| <b>II. BONO A2 ES0305515019</b>                             | <b>Sobre 10525 bonos</b> | <b>Por Bono</b>     |
| 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:    | 6.554.443,75 €           | 622,75 €            |
| 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%         |
| <b>III. BONO A3 ES0305515027</b>                            | <b>Sobre 39993 bonos</b> | <b>Por Bono</b>     |
| 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:    | 25.905.465,75 €          | 647,75 €            |
| 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%         |
| <b>IV. BONO A4 ES0305515035</b>                             | <b>Sobre 10523 bonos</b> | <b>Por Bono</b>     |
| 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:    | 7.079.348,25 €           | 672,75 €            |
| 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%         |
| <b>V. BONO A5 ES0305515043</b>                              | <b>Sobre 8420 bonos</b>  | <b>Por Bono</b>     |
| 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:    | 5.875.055,00 €           | 697,75 €            |
| 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%         |
| <b>VI. BONO A6 ES0305515050</b>                             | <b>Sobre 12786 bonos</b> | <b>Por Bono</b>     |
| 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:    | 9.241.081,50 €           | 722,75 €            |
| 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%         |
| <b>VII. BONO B ES0305515068</b>                             | <b>Sobre 18419 bonos</b> | <b>Por Bono</b>     |
| 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 en esta Fecha de Pago:              | 14.463.519,75 €          | 785,25 €            |
| 5. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:                 | 14.440.864,38 €          | 784,02 €            |
| 6. Intereses impagados en esta Fecha de Pago:               | 2.146.550,25 €           | 116,54 €            |
| 7. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:     | 0,00 €                   | 0,00 €              |
| 8. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:        | 1.841.900.000,00 €       | 100.000,00 €        |
| 9. Porcentaje pendiente de vencimiento:                     | 100,000000%              | 100,000000%         |
| <b>VIII. BONO C ES0305515076</b>                            | <b>Sobre 4211 bonos</b>  | <b>Por Bono</b>     |
| 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 en esta Fecha de Pago:              | 3.833.062,75 €           | 910,25 €            |
| 5. Intereses pagados en esta Fecha de Pago:                 | 0,00 €                   | 0,00 €              |
| 6. Intereses impagados en esta Fecha de Pago:               | 6.673.003,26 €           | 1.584,66 €          |
| 7. Vencido y amortizado (pagado) en esta Fecha de Pago:     | 0,00 €                   | 0,00 €              |
| 8. Pendiente de vencimiento tras esta Fecha de Pago:        | 421.100.000,00 €         | 100.000,00 €        |
| 9. Porcentaje pendiente de vencimiento:                     | 100,000000%              | 100,000000%         |
| <b>IX. EL FONDO</b>   | <b>Importes en euros</b> |                     |
| <b>1. Saldo de participaciones hipotecarias a 28/02/23:</b> |                          |                     |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas:              |                          | 14.849.771.656,67 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas:                 |                          | 9.982.792,73 €      |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas:                    |                          | 14.850.161.628,82 € |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidas:                       |                          | 10.414.188,53 €     |
| <b>2. Amortización del periodo 30/11/22 a 28/02/23:</b>     |                          |                     |
| a) Según calendario:  |                          | 147.232.538,56 €    |
| b) Amortización anticipada hasta 28/02/23:                  |                          | 698.868.732,84 €    |
| <b>3. Tasa de amortización anticipada (anualizada):</b>     |                          |                     |
| b) Ultimo año:  |                          | 12,50%              |
| c) Ultimo semestre:   |                          | 15,34%              |
| d) Ultimo trimestre:  |                          | 16,65%              |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses:                  |                          | 0,09%               |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 12 meses:                 |                          | 0,06%               |
| 6. Porcentaje de fallidos (1):                              |                          | 0,07%               |
| 7. Nivel de Impago(2):                                      |                          | 0,12%               |

(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: 1126/23

Titulización de Activos (SGFT), S.A.

Orense, 55

28020 Madrid

Tel.: 917020508

http://www.tda-sgft.com

SOL LION 21nfoinver.trimMar23 (Español)

**SOL-LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION**
**INFORMACION CORRESPONDIENTE AL PERÍODO: 28/12/22 - 28/03/23**

| <b>I. DATOS GENERALES SOBRE EL FONDO</b>         |  |
|--|--|
| Fecha de Constitución del Fondo                  | 1 de diciembre de 2020   |
| Fecha Emisión Bonos                              | 4 de diciembre de 2020   |
| Fecha Final Amortización CTH:<br>(12,50% 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)<br>Bonos A2: (F) AAA (sf) / (D) AAA (sf)<br>Bonos A3: (F) AAA (sf) / (D) AAA (sf)<br>Bonos A4: (F) AAA (sf) / (D) AAA (sf)<br>Bonos A5: (F) AAA (sf) / (D) AAA (sf)<br>Bonos A6: (F) AAA (sf) / (D) AAA (sf)<br>Bonos B: (F) - (sf) / (D) - (sf)<br>Bonos C: (F) - (sf) / (D) - (sf) |

| <b>II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO</b>  |  |
|---|--|
| <b>Nombre</b>                             | <b>Bonos de Titulización SOL-LION II</b> |
| 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                         |

| <b>II. VALORES EMITIDOS POR EL FONDO (cont.)</b> |  |
|--|--|
| <b>Nombre</b>                                    | <b>Bonos de Titulización SOL-LION II</b> |
| <b>Serie A4:</b>                                 |  |
| 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                         |
| <b>Serie A5:</b>                                 |  |
| 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                         |
| <b>Serie A6:</b>                                 |  |
| 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                         |
| <b>Serie B:</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                         |
| <b>Serie C:</b>                                  |  |
| 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                         |

| <b>III. INFORMACION INCLUIDA</b>                                   |
|--|
| * Liquidación del Período: 28/12/22 - 28/03/23                     |
| * Flujos de Caja del Período: 28/12/22 - 28/03/23                  |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 28 de Marzo de 2023 |

**SOL-LION II RMBS, FT**  
**Fondo de Titulización de Activos**  
**FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 28/12/22 - 28/03/23**

|   | Euros                   |                         |
|---|-------------------------|-------------------------|
|   | <u>Ingresos</u>         | <u>Pagos</u>            |
| <b>I. INVERSIONES/FINANCIACIONES</b>                  |                         |                         |
| Amortización Bonos Titulización Hip.                  |                         | 0,00                    |
| Amortización Participaciones Hip.                     | 846.101.271,40          |                         |
| Compra de derechos de crédito                         |                         | 312.319.073,15          |
| <b>II. INTERESES</b>                                  |                         |                         |
| Intereses pagados a los BTH                           |                         | 100.551.656,88          |
| Intereses recibidos de las CTHs                       | 87.735.499,43           |                         |
| Intereses Ptmos. Subordinados                         |                         | 0,00                    |
| <b>III. GASTOS</b>                                    |                         |                         |
| Comisiones y Gastos                                   |                         | 30.533,41               |
| Neto SWAP   | 12.837.648,28           |                         |
| <b>IV. REMUNERACIÓN POR INTERMEDIACIÓN FINANCIERA</b> |                         |                         |
|   |                         | 0,00                    |
| <b>Total Ingresos/Pagos</b>                           | <b>946.674.419,11</b>   | <b>412.901.263,44</b>   |
| Saldo inicial 28/12/22                                | 163.332.131,92          |                         |
| A Inversiones Temporales                              |                         | 697.105.287,59          |
| <b>Total</b>  | <b>1.110.006.551,03</b> | <b>1.110.006.551,03</b> |
| Retenciones practicadas el 28/03/23                   | 19.104.814,81           |                         |
| A Inversiones Temporales                              |                         | 19.104.814,81           |

Destinatarios: CNMV; AIAF.



**Nº: 1130/23**

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

SOL LION 2Ifuj.trimMar23