

SOL-LION II RMBS - Fondo de Titulización
LIQUIDACION DEL PERIODO 28/12/23 - 02/04/24

| | Euros |
|--|-----------------------|
| I. Situación al inicio del periodo: | 120.001.467,79 |
| Fondo de Reserva | 120.000.000,00 |
| Importe reservado para la compra de derechos de crédito | 1.414,57 |
| Otros recursos | 53,22 |
| II. Fondos recibidos del emisor | 785.694.549,13 |
| Principal: | |
| Según calendario hasta 29/02/24: | 127.739.946,62 |
| Amort. Anticipada hasta 29/02/24: | 505.998.564,24 |
| Intereses: | 151.956.038,27 |
| III. Recursos disponibles (I + II): | 905.696.016,92 |
| IV. Gastos: | 145.927,85 |
| V. Liquidación SWAP: | 43.397.757,74 |
| Cantidad a Pagar por el Fondo: | 6.324.359,92 |
| Cantidad a Pagar por la Contraparte (ING Direct N.V.): | 49.722.117,66 |
| VI. Compra de Derechos de Crédito Adicionales | |
| Importe objetivo | 633.746.832,60 |
| Importe recomprado | 633.745.150,90 |
| Importe reservado para la siguiente fecha de compra | 1.681,70 |
| VII. Pago a los Bonos: | 195.200.981,26 |
| Bonos A1: | |
| Intereses correspondientes al 02/04/24: | 58.670.961,39 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 11.147.482,66 |
| Amortización correspondiente al 02/04/24: | 0,00 |
| Bonos A2: | |
| Intereses correspondientes al 02/04/24: | 12.015.340,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 2.282.914,60 |
| Amortización correspondiente al 02/04/24: | 0,00 |
| Bonos A3: | |
| Intereses correspondientes al 02/04/24: | 46.722.622,11 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 8.877.298,20 |
| Amortización correspondiente al 02/04/24: | 0,00 |
| Bonos A4: | |
| Intereses correspondientes al 02/04/24: | 12.574.248,39 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 2.389.107,19 |
| Amortización correspondiente al 02/04/24: | 0,00 |
| Bonos A5: | |
| Intereses correspondientes al 02/04/24: | 10.285.872,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 1.954.315,68 |
| Amortización correspondiente al 02/04/24: | 0,00 |
| Bonos A6: | |
| Intereses correspondientes al 02/04/24: | 15.960.380,22 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 3.032.472,24 |
| Amortización correspondiente al 02/04/24: | 0,00 |
| Bonos B: | |
| Intereses debidos en la anterior fecha de pago: | 2.646.626,11 |
| Intereses correspondientes al 02/04/24: | 24.219.695,67 |
| Intereses pagados al 02/04/24: | 26.866.321,78 |
| Intereses impagados actuales | 0,00 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 5.104.601,14 |
| Amortización correspondiente al 02/04/24: | 0,00 |
| Bonos C: | |
| Intereses debidos en la anterior fecha de pago: | 22.797.806,57 |
| Intereses correspondientes al 02/04/24: | 6.098.664,97 |
| Intereses pagados al 02/04/24: | 12.105.235,37 |
| Intereses impagados actuales | 16.791.236,17 |
| Retenciones practicadas a los bonos: | 2.299.994,72 |
| Amortización correspondiente al 02/04/24: | 0,00 |
| Reinversión o devolución de las retenciones: | -37.088.186,43 |
| VIII. Saldo disponible (III - IV + V - VI - VII): | 120.001.714,65 |
| Distribución del saldo disponible: | |
| Fondo de Reserva previo (28/12/23): | 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 | 32,95 |
| Pago de intermediación financiera | 0,00 |
| Importe reservado para la siguiente fecha de compra | 1.681,70 |
| Fondo de Reserva (02/04/24): | 120.000.000,00 |



Nº: 1186/24

Titulización de Activos, SGFT,S.A.
 Orense, 58
 28020 Madrid
 Tel.: 917020808
<http://www.tda-sgt.com>
 SOL LION 2liq.trim/Abr24

SOL-LION II RMBS, FT

INFORMACION A LOS INVERSORES

FECHA DE PAGO: 02 de Abril 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: | 58.670.961,39 € | 1.114,93 € |
| 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 10526 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: | 12.015.340,00 € | 1.141,60 € |
| 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: | 46.722.622,11 € | 1.168,27 € |
| 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: | 12.574.248,39 € | 1.194,93 € |
| 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: | 10.285.872,00 € | 1.221,60 € |
| 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: | 15.960.380,22 € | 1.248,27 € |
| 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 en esta Fecha de Pago: | 24.219.695,67 € | 1.314,93 € |
| 5. Intereses pagados en esta Fecha de Pago: | 26.866.321,78 € | 1.458,62 € |
| 6. Intereses impagados en esta Fecha de Pago: | 0,00 € | 0,00 € |
| 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% |
| 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 en esta Fecha de Pago: | 6.098.664,97 € | 1.448,27 € |
| 5. Intereses pagados en esta Fecha de Pago: | 12.105.235,37 € | 2.874,67 € |
| 6. Intereses impagados en esta Fecha de Pago: | 16.791.236,17 € | 3.987,47 € |
| 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% |
| IX. EL FONDO | | |
| Importes en euros | | |
| 1. Saldo de participaciones hipotecarias a 29/02/24: | | |
| a) Saldo pendiente de vencimiento No Fallidas: | | 15.090.537.708,95 € |
| b) Saldo pendiente de vencimiento Fallidas: | | 24.129.887,42 € |
| c) Saldo pendiente de cobro No Fallidas: | | 15.091.067.376,76 € |
| d) Saldo pendiente de cobro Fallidas: | | 25.192.697,81 € |
| 2. Amortización del periodo 30/11/23 a 29/02/24: | | |
| a) Según calendario: | | 633.738.510,86 € |
| b) Amortización anticipada hasta 29/02/24: | | 127.739.946,62 € |
| 3. Tasa de amortización anticipada (anualizada): | | |
| b) Ultimo año: | | 14,39% |
| c) Ultimo semestre: | | 13,69% |
| d) Ultimo trimestre: | | 12,26% |
| 4. Porcentaje de impago entre 3 y 6 meses: | | 0,14% |
| 5. Porcentaje de impago entre 7 y 12 meses: | | 0,14% |
| 6. Porcentaje de fallidos (1): | | 0,17% |
| 7. Nivel de impago(2): | | 0,25% |

(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: 1180/24

Titulización de Activos, (SGFF), S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.: 917020808

http://www.tria-sgf.com

SOL LION 2InfoInver.triimAbr24 (Español)

SOL-LION II RMBS, FONDO DE TITULIZACION
INFORMACION CORRESPONDIENTE AL PERÍODO: 28/12/23 - 02/04/24

| 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: (14,39% 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: 28/12/23 - 02/04/24 |
| * Flujos de Caja del Período: 28/12/23 - 02/04/24 |
| * Información a los inversores. Fecha de Pago: 02 de Abril de 2024 |

SOL-LION II RMBS, FT
Fondo de Titulización de Activos
FLUJOS DE CAJA DEL PERÍODO: 28/12/23 - 02/04/24

| | Euros | |
|---|-----------------------|-----------------------|
| | <u>Ingresos</u> | <u>Pagos</u> |
| I. INVERSIONES/FINANCIACIONES | | |
| Amortización Bonos Titulización Hip. | | 0,00 |
| Amortización Participaciones Hip. | 633.738.510,86 | |
| Compra de derechos de crédito | | 633.745.150,90 |
| II. INTERESES | | |
| Intereses pagados a los BTH | | 195.200.981,26 |
| Intereses recibidos de las CTHs | 151.956.038,27 | |
| Intereses Ptmos. Subordinados | | 0,00 |
| III. GASTOS | | |
| Comisiones y Gastos | | 145.927,85 |
| Neto SWAP | 43.397.757,74 | |
| IV. REMUNERACIÓN POR INTERMEDIACIÓN FINANCIERA | | |
| | | 0,00 |
| Total Ingresos/Pagos | 829.092.306,87 | 829.092.060,01 |
| Saldo inicial 28/12/23 | 120.001.467,79 | |
| A Inversiones Temporales | | 120.001.714,65 |
| Total | 949.093.774,66 | 949.093.774,66 |
| Retenciones practicadas el 02/04/24 | 37.088.186,43 | |
| A Inversiones Temporales | | 37.088.186,43 |

Destinatarios: CNMV; AIAF.



Nº: 1184/24

Titulización de Activos, SGFT,S.A.

Orense, 58

28020 Madrid

Tel.:917020808

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

SOL LION 2fluj.trim1Abr24