

华菁证券有限公司关于华菁-中集 1 号资产支持专项计划

2018 年第 1 期资产管理报告

(报告期间：2018 年 6 月 22 日至 2018 年 9 月 12 日)

一、重要提示

本报告依据中国证监会《证券公司及基金管理公司子公司资产证券化业务管理规定》、《证券公司及基金管理公司子公司资产证券化业务信息披露指引》、深圳证券交易所出具的《关于华菁证券“华菁-中集 1 号资产支持专项计划”的无异议函》、《深圳证券交易所资产证券化业务指引》(2014 年修订)以及其他相关规定制作。“华菁-中集 1 号资产支持专项计划”已于 2018 年 7 月 12 日完成备案,获得中国证券投资基金业协会出具的《资产支持专项计划备案确认函》(备案编码:130180629001)。

本报告由管理人华菁证券有限公司负责编制,管理人声明保证本报告信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本报告关于基础资产运行情况及原始权益人经营情况的数据由中集融资租赁有限公司提供,专项计划托管账户的数据由托管行招商银行股份有限公司深圳分行提供。

二、资产支持专项计划基本情况

产品简称	预期期限 (年)	预期 收益率	发行规模 (亿元)	面值 (元)	还本付息方式
资产支持证券概况					
18 中集 1A	0.5	6.20	2.23	100	每年按季付息,过手摊还本金。
18 中集 1B	0.75	6.50	0.26	100	
18 中集 1C	0.75	6.80	0.10	100	
18 中集 1D	1.00	8.50	0.32	100	
18 中集次	2.25	-	0.513662	100	期间不分配收益,到期还本并获得所有剩余收益。



信用评级	大公国际资信评估有限公司给予优先 A 级资产支持证券评级为 AAA 级，优先 B 级资产支持证券评级为 AA+级，优先 C 级资产支持证券评级为 AA 及，优先 D 级资产支持证券评级为 A 级。
销售对象	由合格机构投资者认购，优先级认购金额为 100 万元的整数倍
管理人	华菁证券有限公司
托管银行	招商银行股份有限公司深圳分行
登记机构	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司
流动性安排	资产支持证券可以在深圳证券交易所综合协议交易平台进行转让、交易

三、基础资产运行情况

本专项计划于 2018 年 6 月 22 日设立，基础资产封包的初始基准日为 2017 年 9 月 30 日。根据资产服务机构及原始权益人中集融资租赁有限公司提供的资产服务机构报告，下述基础资产运行情况的统计期间是 2017 年 9 月 30 日至 2018 年 8 月 31 日。

(一) 基础资产回收统计

1、基础资产按合同数：

期初应收租赁款余额（元）	366,654,842.23
当期应收租赁款（元）	199,009,222.76
期末应收租赁款余额（元）	167,645,041.64
期初尚未到期的债权数（笔）	42
当期终止的债权数（笔）	4
期末尚未终止的债权数（笔）	38

2、基础资产按实际发生数：

当期收到的回收款（即本金回收款与收入回收款之和）（元）	219,477,743.12
当期收到本金回收款（元）	202,460,975.07
当期应收并正常收取的租赁款的本金部分（元）	173,846,846.64

	用有 限公 司							产 买 卖 协 议 》 已 经 完 成 赎 回。
LA0 16F Sa0 022	东 莞 市 东 宝 物 流 有 限 公 司	不 适 用	不 适 用	不 适 用	不 适 用	不 适 用	不 适 用	不 合 格 基 础 资 产 ， 根 据 《 资 产 买 卖 协 议 》 已 经 完 成 赎 回。

(四) 提前退租明细

债 权 编 号	债 权 名 称	应 收 租 金 日	应 收 租 金 金 额 (元)	实 际 回 收 日	实 际 回 收 租 金 金 额 (元)
LA016F Sa0018	四川中亿新 威能源有限 公司	2019年4 月15日	19,044,696.80	2018年 8月31 日	19,044,696.80
LA0160 143	广州志鸿物 流有限公司	2019年1 月15日	5,232,124.02	2018年 6月27	5,207,294.95

				日	
LA0160 044	阳江市源强 运输有限公 司	2018年9 月5日	1,306,220.14	2018年 4月5 日	1,298,847.85

(五) 合同变更明细

债权编号	债权名称	合同变更日期	变更内容	变更原因	其他说明
无。					

(六) 违约基础资产情况

	前一报告期间截止 日累计		本报告期间		本报告期间截止日 累计	
	基础资产 笔数 =A1	未偿本金 余额 =B1	基础资 产笔数 =A2	未偿本金 余额=B2	基础资产 笔数= A1+A2	未偿本金 余 额 =B1+B2
新增违约基础资产 =a+b	0	0	0	0	0	0
1.本报告期内新增 拖欠超过 90 天的基 础资产 (a)	0	0	0	0	0	0
2.本报告期内,在无 “计划管理人”和 “资产服务机构”书 面确认的情况下,被 重组、重新确定还款 计划或展期的风险 类基础资产 (b)	0	0	0	0	0	0
违约基础资产的回	0		0		0	

收金额			
违约基础资产的未偿本金余额占基准日本金余额的比例 (%)	0	0	0

(七) 诉讼/仲裁进展情况

项目编号	项目名称	应收租金余额	诉讼/仲裁进展情况
无			

(八) 不合格基础资产的赎回

被赎回基础资产的承租人名称	赎回时间	被赎回基础资产的未偿本金余额 (元)	赎回价格 (可计入本金回收款的金额) (元)	赎回价格 (可计入收入回收款的金额) (元)	赎回原因
天津市塘沽危险品运输有限公司	2018年6月29日	9,556,860.00	9,556,860.00	404,366.86	不合格基础资产, 根基《资产买卖协议》已经完成赎回。
东莞市东宝物流有限公司	2018年6月29日	8,264,356.60	8,264,356.60	346,359.43	不合格基础资产, 根基《资产买卖协议》已经完成赎回。

合计		17,821,216.60	17,821,216.60	750,726.29	
----	--	---------------	---------------	------------	--

四、业务参与人履约情况

在本专项计划存续期间，管理人华菁证券有限公司、托管人招商银行股份有限公司深圳分行、资产服务机构及原始权益人中集融资租赁有限公司等业务参与人严格履行了计划说明书约定的职责和义务，不存在未依约履行的情况，不存在任何损害资产支持证券持有人利益的行为。

五、原始权益人的经营情况

报告期内，原始权益人中集融资租赁有限公司主营业务未发生变化，经营持续稳定。截至 2018 年 6 月 30 日，中集融资租赁有限公司总资产 3,561,159 万元，净资产 732,843 万元；2018 年上半年度营业收入 102,042 万元，净利润 26,427 万元。

六、专项计划账户资金收支情况

根据托管银行提供的托管报告（报告期间：2018 年 6 月 22 日-2018 年 9 月 10 日），专项计划账户期初余额为 0.00 元。

根据托管银行提供的托管报告（报告期间：2018 年 6 月 22 日-2018 年 9 月 10 日），专项计划账户共收到资金 757,222,859.29 元。其中 2018 年 6 月 22 日收到专项计划募集资金 342,366,200.00 元；2018 年 6 月 29 日收到赎回价款 18,571,942.89 元；2018 年 6 月 29 日、2018 年 7 月 3 日、2018 年 8 月 2 日和 2018 年 9 月 4 日收到基础资产回收款分别为 140,144,062.35 元、19,550,379.69 元、16,513,321.02 元和 24,698,037.17 元；2018 年 7 月 5 日和 2018 年 8 月 7 日收到结息款分别为 19,827.94 元和 348,013.90 元；2018 年 9 月 7 日收到货币基金赎回款 5,005,652.17 元、20,025,915.06 元、30,044,963.09 元、60,072,382.91 元、20,027,554.04 元、19,776,634.46 元、20,029,364.02 元、20,028,608.58 元。

根据托管银行提供的托管报告（报告期间：2018 年 6 月 22 日-2018 年 9 月 10 日），专项计划账户共支出资金 537,120,162.32 元。其中 2018 年 6 月 22 日

支付基础资产购买价款 342,366,200.00 元；2018 年 7 月 23 日支付专项计划登记费分别为 2,230.00 元、1,027.32 元、320.00 元、100.00 元、260.00 元；2018 年 8 月 7 日批量扣费 25.00 元；2018 年 8 月 22 日支付货币基金购买价款 30,000,000.00 元、10,000,000.00 元、60,000,000.00 元、10,000,000.00 元、10,000,000.00 元、10,000,000.00 元、10,000,000.00 元；2018 年 8 月 23 日支付货币基金购买价款 10,000,000.00 元、10,000,000.00 元、10,000,000.00 元、10,000,000.00 元、9,750,000.00 元、5,000,000.00 元。

截至 2018 年 9 月 10 日，专项计划账户资金余额为 220,102,696.97 元。

七、各档次资产支持证券的本息兑付情况

本专项计划 2018 年第 1 期收益分配，将于 2018 年 9 月 13 日公告、2018 年 9 月 20 日完成兑付。18 中集 1A、18 中集 1B、18 中集 1C、18 中集 1D 本期将分别分配收益 3,409,134.80 元、416,712.32 元、167,671.23 元和 670,684.93 元，18 中集次不分配收益；18 中集 1A 本期将兑付本金 215,150,400.00 元。详细情况请参考《华菁证券有限公司关于华菁-中集 1 号资产支持专项计划 2018 年第 1 期（总第 1 期）收益分配报告》。

八、需要对投资者报告的其他事项

本报告期内，管理人没有以自有资金或其管理的资产管理计划、其他客户资产、证券投资基金等在一二级市场认购本资产支持证券情况。

本报告期内原始权益人持续经营，未发生违反合同约定、损害基础资产及其收益的情况。中集租赁未转让其所持有任何部分或全部次级资产支持证券。

本报告期内专项计划基础资产归集正常，未发生现金流混同和挪用风险。

本报告期内专项计划未触发权利完善事件，管理人、托管人、评级机构未发生变更。

九、备查文件目录、查阅地点及联系方式

（一）备查文件

（1）、《华菁-中集 1 号资产支持专项计划说明书》

- (2)、《华菁-中集 1 号资产支持专项计划标准条款》
- (3)、《华菁-中集 1 号资产支持专项计划资产买卖协议》
- (4)、《华菁-中集 1 号资产支持专项计划服务协议》
- (5)、《华菁-中集 1 号资产支持专项计划托管协议》
- (6)、《华菁-中集 1 号资产支持专项计划监管协议》
- (7)、《华菁-中集 1 号资产支持专项计划资产支持证券认购协议与风险揭示书》
- (8)、《关于华菁证券有限公司申请设立华菁-中集 1 号资产支持专项计划之法律意见书》
- (9)、《华菁-中集 1 号资产支持专项计划优先级资产支持证券信用评级报告》
- (10)、《华菁证券有限公司拟设立华菁-中集 1 号资产支持专项计划普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)针对基础资产池未来现金流预测信息执行商定程序的报告》
- (11)、《关于华菁证券有限公司设立华菁-中集 1 号资产支持专项计划发行资产支持证券, 中集融资租赁有限公司会计处理原则的会计评论意见书》
- (12)、《华菁-中集 1 号资产支持专项计划尽职调查报告》
- (13)、管理人的业务资质批件、营业执照和公司章程
- (14)、原始权益人的营业执照和公司章程
- (15)、托管人的业务资格批件和营业执照

(二) 备查文件查阅地点

华菁证券有限公司

联系地址: 上海市虹口区吴淞路 575 号虹口 SOHO25 楼

联系电话: 021-60156816

传真: 021-60156733

联系人: 王倩

网址: www.huajingsec.com

