

华融·共赢一期信托受益权资产支持专项计划

2018 年三季度资产管理报告

一、重要提示

本报告依据中国证券监督管理委员会《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《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》、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》及其他有关规定制作。

本报告中关于华融·共赢一期信托受益权资产支持专项计划的数据由华融国际信托有限责任公司提供，专项计划账户的资金数据由宁波银行股份有限公司提供并确认。

华融·共赢一期信托受益权资产支持专项计划于 2017 年 2 月 23 日成立。

报告期间：2018 年 7 月 17 日至 2018 年 10 月 16 日。

当期权益登记日：2018 年 10 月 23 日

当期兑付日：2018 年 10 月 24 日

二、本专项计划基本情况

产品序列	产品代码	预期到期期限 (年)	预期收益率 (%)	发行规模 (亿元)	面值 (元)	信用评级	还本付息方式
华融 1A	SQ7099	1.41	5.38	28.27	100	AAA	按季/半年付息，过手还本；兑付日为 2017 年 7 月 24 日、2018 年 1 月 24 日、2018 年 7 月 24 日、2018 年 10 月 24 日以及 2019 年 1 月 24 日，若该日为非工作日则为该日后的第一个工作日。
华融 1B	SQ7100	1.67	6.00	5.11	100	AA+	
华融 1C	SQ7101	1.92	6.45	3.84	100	AA	
华融 1 次	SQ7041	1.92	无	2.81	100	N.R.	
销售对象	华融 1A、华融 1B、华融 1C 由合格投资者认购，华融 1 次由华融国际信托有限责任公司（代“华融·融升 4 号集合资金信托计划”）认购						
托管人	宁波银行股份有限公司						
登记机构	中证机构间报价系统股份有限公司						

三、基础资产运行情况

(一) 基础资产回收统计

(1) 按信托合同：

期初应分配标的信托利益余额（元）	22,944,138.88
当期应分配标的信托利益（元）	15,567,633.33
期末应分配标的信托利益余额（元）	7,376,505.55
期初尚未终止的信托受益权（笔）	3
当期终止的信托受益权（笔）	1
期末尚未终止的信托受益权（笔）	2

(2) 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）	695,283,512.17
当期收到本金回收款（元）	680,000,000.00
当期正常回收的基础资产本金（元）	680,000,000.00
当期回收以前期应收基础资产本金（元）	0
当期回收下期应收基础资产本金（元）	0
当期回收的提前还款中的相应本金（元）	0
当期核销的坏账中的相应本金（元）	0
可列入本金回收款的其他款项（元）	0
当期收到的收入回收款（元）	15,283,512.17
期初尚未终止的信托受益权（笔）	3
当期终止的信托受益权（笔）	1
期末尚未终止的信托受益权（笔）	2

(二) 期末标的债权项下回收款逾期情况

	期初标的债权项 下回收款余额 (元)	期末标的债权项 下回收款余额 (元)	占 比	合 同 数	占 比

逾期 7-15 天 (含)	0	0	0	0	0
逾期 15 天-1 个月(含)	0	0	0	0	0
逾期 1-3 个月 (含)	0	0	0	0	0
逾期 3-6 个月 (含)	0	0	0	0	0
逾期 6 个月以上	0	0	0	0	0
合计	0	0	0	0	0

(三) 提前还款明细

信托合同 合同编号	债务人名称	信托收益权 预期到期日	应收信托本金和 收益金额	实际回收日	实收信托收益和 本金金额
无					

(四) 合同变更明细

信托贷款合同/委 托贷款合同编号	债务人名称	合同变更日	变更内容	变更原因	其他说明
无					

四、参与方的履约情况

本报告期内，管理人严格遵守《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《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》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照《标准条款》、《计划说明书》等文件的约定进行，不存在任何损害资产支持证券持有人利益的行为。

本报告期内，托管人在专项计划托管活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，妥善保管专项计划账户内资金，确保专项计划账户内资金的独立和安全，依法保护资产支持证券持有人的财产权益。在各重要方面的运作严格按照《标准条款》、《计划说明书》及《托管协议》的约定，管理专项计划账户，不存

在任何损害资产支持证券持有人利益的行为。

本报告期内，原始权益人按照《标准条款》、《计划说明书》及《服务协议》的约定，参与基础资产管理服务等相关工作。本报告期内，实际基础资产回收情况与计划基础资产回收情况基本一致。

五、原始收益人的经营情况

原始权益人整体运营平稳，主营业务并未发生重大变化。

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7月17日-2018年10月15日），专项计划账户共收到资金695,660,722.99元。其中，报告期间，专项计划账户共收到基础资产回收款共695,283,512.17元，其中归属于本金科目的金额为680,000,000.00元，归属于收入科目的金额为15,283,512.17元；报告期间，专项计划账户收到账户结息款共377,210.82元。

根据托管银行提供的托管报告（报告期间：2018年7月17日-2018年10月15日），专项计划账户共支付资金957,187,616.76元。其中，2018年7月19日，专项计划账户支付兑付兑息款952,266,498.95元；2018年7月24日，支付资产服务机构服务费4,921,117.81元。

截至2018年10月15日，专项计划账户的余额为695,866,432.39元。

七、各档次资产支持证券的本息兑付情况

本专项计划第4期收益分配，将于2018年10月17日公告、2018年10月24日完成兑付。本期华融1B、华融1C和华融1次分别分配收益4,706,367.12元、6,242,893.15元和3,541,369.86元，此外华融1B将分配本金311,200,000.00元，华融1C将分配本金368,500,000.00元。详细情况请参考《华菁证券有限公司关于华融·共赢一期信托受益权资产支持专项计划第4期收益分配的公告》。

八、管理人以自有资金或其管理的资产管理计划、其他客户资产、证券投资基金等认购资产支持证券情况

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级市场认购资产支持证券情况。

九、备查文件

（一）备查文件目录



- 1、《华融·共赢一期信托受益权资产支持专项计划标准条款》
- 2、《华融·共赢一期信托受益权资产支持专项计划说明书》
- 3、《华融·共赢一期信托受益权资产支持专项计划资产支持证券认购协议与风险揭示书》
- 4、《华融·共赢一期信托受益权资产支持专项计划信托受益权转让协议》
- 5、《华融·共赢一期信托受益权资产支持专项计划托管协议》
- 6、《华融·共赢一期信托受益权资产支持专项计划服务协议》
- 7、《关于华菁证券有限公司拟设立的华融·共赢一期信托受益权资产支持专项计划的法律意见书》
- 8、《华融·共赢一期信托受益权资产支持专项计划优先级资产支持证券信用评级报告》
- 9、《华融·共赢一期信托受益权资产支持专项计划项目现金流预测分析咨询报告书》
- 10、《华融·共赢一期信托受益权资产支持专项计划会计处理意见书》
- 11、《华融·共赢一期信托受益权资产支持专项计划尽职调查报告》
- 12、管理人的业务资格批件、营业执照和公司章程
- 13、原始权益人的营业执照和公司章程
- 14、托管人的业务资格批件和营业执照

(二) 查阅方式

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

特此公告。

