

三一重工-中泰光大 2016 年 1 期应收账款资产支持专项计划 第 4 期资产管理报告

重要提示

本报告依据《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》、上海证券交易所《上海证券交易所资产证券化业务指南》、中国证券投资基金业协会出具的《三一重工-中泰光大 2016 年 1 期应收账款资产支持专项计划备案确认函》及其他有关规定制作。

本报告中关于专项计划账户的资金数据由中国银行股份有限公司湖南省分行提供并确认。

计划成立日：2016 年 11 月 10 日。

报告期间：2017 年 6 月 21 日至 2017 年 9 月 20 日。

一、专项计划产品概况

系列	简称	证券代码	起息日	预期到期日	还本付息方式	评级	预期年化收益率	剩余规模 (亿元)
优先级 A 资产支持证券	三一 1A	142414	2016/11/10	2017/6/26	按季付息, 过手摊还	AAA	3.6%	0
优先级 B 资产支持证券	三一 1B	142415	2016/11/10	2018/3/26	按季付息, 过手摊还	AA+	4.5%	1.927464
次级资产支持证券	三一 1 次	142416	2016/11/10	2018/3/26	按季获得优先级本息足额兑付完毕后的剩余部分	—	—	1.31
总计								3.237464

注：本专项计划为过手摊还型资产支持证券，如果分配期基础资产回收款项大于预期金额，或者回款日期早于预期日期，则本专项计划的实际到期日可能早于预期到期日。

专项计划的交易相关方	
原始权益人	三一重工股份有限公司
管理人	上海光大证券资产管理有限公司

上海光大
骑

托管人	中国银行股份有限公司湖南省分行
监管人	中国银行股份有限公司长沙市芙蓉支行
资产服务机构	三一重工股份有限公司
证券登记托管机构	中国证券登记结算有限公司上海分公司

二、基础资产的运行情况

本期专项计划的基础资产系指基础资产清单所列的由原始权益人在专项计划设立日转让给管理人的原始权益人对买受人享有的应收账款债权。

报告期内，专项计划收到基础现金流回款情况如下：

(单位：元)

基础资产现金流回款	到账时间	到账金额
现金流回款	2017年9月12日	129,829,736.90

三、参与方的履约情况

本报告期内，原始权益人、管理人、监管银行和托管人等资产证券化业务参与人均按《计划说明书》、《标准条款》、《基础资产买卖协议》、《托管协议》、《监管协议》以及《服务协议》等专项计划文件履行相关约定，未发生违约事件。

四、原始权益人的经营情况

根据原始权益人提供的2017年半年报，截至2017年6月30日原始权益人主要财务指标如下：

(单位：千元)

总资产	净资产	2017年前两季度 营业收入	2017年前两季度 净利润
59,516,406	25,038,820	19,207,820	1,270,185

五、专项计划账户资金的收支情况

本报告期内，专项计划的主要资金收支情况如下：

(单位：元)

序号	交易时间	交易对象	交易金额	备注
1	2017年6月21日	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）	-125,135,456.46	兑付兑息
2	2017年6月21日	中国证券登记结算有限责任	-74,219,390.78	兑付兑息

		公司上海分公司（备付金）		
3	2017年9月12日	三一重工股份有限公司	+129,829,736.90	基础资产 回收款

六、各档次资产支持证券的本息兑付情况

专项计划于2017年6月26日进行了第3期收益分配。

该期优先级资产支持证券的分配资金为199,344,880.00元，其中：

三一1A分配资金合计为125,129,200.00元。

三一1B分配资金合计为74,215,680.00元。

注：详细情况请参考《三一重工-中泰光大2016年1期应收账款资产支持专项计划第3期收益分配报告》。

七、管理人认购资产支持证券的情况

无

八、专项计划资金运作情况

根据《三一重工-中泰光大2016年1期应收账款资产支持专项计划说明书》的约定，专项计划存续期内，专项计划账户中资金在分配之前可进行合格投资。本报告期间，专项计划账户内的资金投资于银行活期存款。

九、其他情况

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。

本报告期内专项计划的计划管理人、托管人、评级机构未发生变更。

本报告期内专项计划优先级资产支持证券的信用评级未发生变化。

十、备查文件

- 1、《三一重工-中泰光大2016年1期应收账款资产支持专项计划标准条款》
- 2、《三一重工-中泰光大2016年1期应收账款资产支持专项计划资产支持证券认购协议及风险

揭示书》

- 3、《三一重工-中泰光大2016年1期应收账款资产支持专项计划资产买卖协议》
- 4、《三一重工-中泰光大2016年1期应收账款资产支持专项计划托管协议》
- 5、《三一重工-中泰光大2016年1期应收账款资产支持专项计划差额支付承诺函》
- 6、《三一重工-中泰光大2016年1期应收账款资产支持专项计划服务协议》
- 7、《三一重工-中泰光大2016年1期应收账款资产支持专项计划监管协议》
- 8、《三一重工-中泰光大2016年1期应收账款资产支持专项计划承销协议》
- 9、《应收账款转让协议》
- 10、《关于上海光大证券资产管理有限公司申请设立三一重工-中泰光大2016年1期应收账款资产支持专项计划之法律意见书》
- 11、《三一重工-中泰光大2016年1期应收账款资产支持专项计划优先级资产支持证券信用评级报告》
- 12、《三一重工-中泰光大2016年1期应收账款资产支持专项计划基础资产现金流预测审核报告》
- 13、《三一重工-中泰光大2016年1期应收账款资产支持专项计划会计处理意见书》
- 14、《三一重工-中泰光大2016年1期应收账款资产支持专项计划尽职调查报告》
- 15、管理人的业务资格批件、营业执照和公司章程
- 16、原始权益人的营业执照和公司章程
- 17、托管人的业务资格批件和营业执照

备查文件查阅点：上海光大证券资产管理有限公司

联系地址：上海市静安区新闻路 1508 号 17 层

联系人：王哲、孙叶晶、黄未晞

电话：021-22169676

传真：021-22169634

网址：<http://www.ebscn-am.com>

上海光大证券资产管理有限公司

2017年9月20日

