

华科租赁三期资产支持专项计划

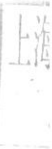
第 9 期季度资产管理报告

(报告期间：2018 年 10 月 8 日-2019 年 1 月 7 日)

专项计划管理人：上海光大证券资产管理有限公司

专项计划成立日：2016年11月11日

报 告 日 期：2019年1月8日



第一节 重要提示

本报告依据《证券期货经营机构私募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》、《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》、《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《华科租赁三期资产支持专项计划备案确认函》及其他有关规定制作。

第二节 专项计划基本情况及业务参与人履约情况

1、专项计划基本情况

华科租赁三期资产支持专项计划(以下简称“本专项计划”)自2016年11月11日由上海光大证券资产管理有限公司(以下简称“管理人”)设立并开始运作,发行规模466,450,000.00元。

专项计划设置优先级资产支持证券和次级资产支持证券两类资产支持证券。其中优先级资产支持证券共分为两个类别:优先A级资产支持证券和优先B级资产支持证券。优先A级资产支持证券包括优先A-1级资产支持证券(简称华科3A1)、优先A-2级资产支持证券(简称华科3A2)、优先B级资产支持证券(简称华科3B)。

截至报告期末,专项计划资产支持证券各类别情况如下表所示:

系列	PR后简称	证券代码	起息日	预期到期日	还本付息方式	评级	预期年收益率	剩余规模(亿元)
优先A-1级资产支持证券	华科3A1	142460	2016/11/11	2018/1/15	利息:按季付息;本金:固定转付	AAA	4.1%	0
优先A-2级资产支持证券	华科3A2	142461	2016/11/11	2018/7/15	利息:按季付息;本金:过手摊还	AAA	4.5%	0
优先B级资产支持证券	华科3B	142462	2016/11/11	2019/4/15	利息:按季付息;本金:过手摊还	AA+	6.8%	0.16705
次级资产支持证券	华科3次	142463	2016/11/11	2021/10/15	到期支付剩余金额	-	-	0.4745

注:本专项计划的华科3B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。

本报告期内,专项计划资产支持证券本息分配情况如下:

专项计划于2018年10月15日完成第8期收益分配,该期资产支持证券的分配资金为35,582,300.00元,其中华科3B分配资金合计35,582,300.00元。

2、主要业务参与者及其履约情况

专项计划的主要参与机构	
管理人	上海光大证券资产管理有限公司
托管人	浙商银行股份有限公司
监管银行	浙商银行股份有限公司重庆分行
原始权益人	华科融资租赁股份有限公司
资产服务机构	华科融资租赁股份有限公司
差额支付承诺人	华科融资租赁股份有限公司
法律顾问	北京大成律师事务所
会计师事务所	北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）
信用评级机构	中诚信证券评估有限责任公司
挂牌转让场所	上海证券交易所
登记结算机构	中国证券登记结算有限公司上海分公司

本报告期内，管理人严格遵守《证券期货经营机构私募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》、《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》、《上海证券交易所上海证券交易所资产证券化业务指南》等有关法律、法规规定、以及《计划说明书》等协议的约定，勤勉尽责地履行专项计划资产管理职责和义务，积极督促原始权益人、资产服务机构、增信机构、托管人等资产证券化业务参与机构按照规定或约定履行职责和义务，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，托管人根据国家有关法律法规、《计划说明书》、《托管协议》等文件的约定，对计划管理人在本专项资产管理计划各方面的运作、管理进行了必要的监督、复核等托管相关工作，不存在任何损害资产支持证券持有人利益的行为；监管银行根据国家有关法律法规、《计划说明书》、《监管协议》等文件的约定，完成资金监管服务，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。资产服务机构根据所适用的法律法规、《计划说明书》及《服务协议》等文件的约定，进行与基础资产管理服务、回收有关的事项等服务相关工作，不存在任何损害资产支持证券持有人利益的行为。增信机构等其他专项计划户主要参与机构按照规定及合同约定履行职责和义务，不存在任何损害资产支持证券持有人利益的行为。

第三节 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、原始权益人依据租赁合同对承租人享有的租金请求权和其他权利及其附属担

保权益。

本报告期内，基础资产现金流按照合同约定如期回款，且实际回款金额与基础资产现金流预测回款金额无明显差异。专项计划收到基础现金流回款情况如下：

基础资产现金流回款	回款时间	回款金额（元）
现金流回款	2018/12/21	36,260,181.2

注：以上数据于原始权益人提供的《华科租赁三期资产支持专项计划第9期季度资产服务机构报告》。

第四节 专项计划账户资金收支及运作情况

1. 专项计划账户资金收付情况

专项计划账户收款情况	到账时间	总金额（元）	记入收入科目	摘要
1	2018/12/21	6,635.49	利息收入	结息
2	2018/12/21	36,260,181.20	基础资产还本付息	基础资产现金收入
专项计划账户付款情况	交易日期	本期支出（元）	摘要	
1	2018/10/10	4,929.71	托管费	
2	2018/10/10	35,584,079.12	142462 兑付兑息款	
3	2018/10/10	172,539.74	服务费	
4	2018/11/14	15,000.00	审计费	
5	2018/12/21	50,000.00	评级费	

注：以上专项账户资金收付数据由浙商银行股份有限公司提供。

2. 专项计划资金运作情况

根据《华科租赁三期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。

第五节 原始权益人的经营情况

根据原始权益人提供的华科融资租赁股份有限公司截至2018年11月30日的主要财务指标如下：

主要财务指标	华科租赁截止到2018年11月30日的数据（元）
总资产	3,265,266,963.78

净资产	1,028,362,705.21
总负债	2,236,904,258.57
短期借款	75,876,000.00
长期借款	749,136,885.00
期间营业总收入	220,093,378.44
期间净利润	49,008,159.43
期间经营活动产生现金流净额	77,625,908.99

第六节 信用措施及其执行情况

本报告期内，专项计划内外部增信措施未发生变化，增信机构为华科融资租赁股份有限公司，其主要财务情况参考原始权益人主要财务数据。

第七节 管理人认购资产支持证券的情况

认购份额	认购人名称	认购金额（元）
华科 3A1	上海光大证券资产管理有限公司（代“光大阳光北斗星 2 号集合资产管理计划”）	17,000,000.00
华科 3A1	上海光大证券资产管理有限公司（代“光大阳光北极星 2 号集合资产管理计划”）	35,000,000.00
华科 3A1	上海光大证券资产管理有限公司（代“光大证券金阳光 6 号集合资产管理计划”）	10,000,000.00
华科 3A1	上海光大证券资产管理有限公司（代“光大全球全天候 1 号（QDII）集合资产管理计划”）	17,000,000.00
华科 3B	上海光大证券资产管理有限公司（代“光大阳光北极星 2 号集合资产管理计划”）	55,000,000.00
华科 3B	上海光大证券资产管理有限公司（代“光大阳光稳健添利集合资产管理计划”）	10,000,000.00

第八节 其他情况

1. 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。
2. 本报告期内，中诚信评级机构调升本专项计划项下优先 B 级资产支持证券的信用等级为 AA+级，详情参考《华科租赁三期资产支持专项计划优先级资产支持证券跟踪评级报告（2018）》。

第九节 备查文件

- 1、《华科租赁三期资产支持专项计划标准条款》
- 2、《华科租赁三期资产支持专项计划资产支持证券认购协议》
- 3、《华科租赁三期资产支持专项计划资产买卖协议》
- 4、《华科租赁三期资产支持专项计划托管协议》

- 5、《华科租赁三期资产支持专项计划差额支付承诺函》
 - 6、《华科租赁三期资产支持专项计划服务协议》
 - 7、《关于上海光大证券资产管理有限公司申请设立华科租赁三期资产支持专项计划之法律意见书》
 - 8、《华科租赁三期资产支持专项计划优先级资产支持证券信用评级报告》
 - 9、《华科租赁三期资产支持专项计划尽职调查报告》
 - 10、管理人的业务资格批件、营业执照和公司章程
 - 11、原始权益人的营业执照和公司章程
 - 12、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：尹莉、黄未晞
电话：021-22169676
传真：021-22169634
网址：<http://www.ebscn-am.com>

