

光证资管-光大租赁一期资产支持专项计划

第7期季度资产管理报告

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《光证资管-光大租赁一期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光大银行股份有限公司上海分行提供并确认。

计划成立日：2017年12月13日。

报告期间：2018年4月23日至2019年7月22日。

一、专项计划基本情况

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：

证券代码	简称	起息日	到期日	还本付息方式	评级	预期年化收益率	剩余规模(亿)
149044	光租 1A1	2017/12/13	2018/10/30	按季付息, 过手摊还	AAA	5.90%	0
149045	光租 1A2	2017/12/13	2019/10/30	按季付息, 过手摊还	AAA	6.10%	1.6399768
149046	光租 1A3	2017/12/13	2020/4/30	按季付息, 过手摊还	AAA	6.20%	1.348
149047	光租 1B	2017/12/13	2022/1/30	按季付息, 过手摊还	AA	6.50%	2.9656
149048	光租次级	2017/12/13	2022/1/30	到期一次性分配	-	-	0.674

注：光租 1A1、光租 1A2、光租 1A3、光租 1B 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	光大幸福国际租赁有限公司
管理人	上海光大证券资产管理有限公司
托管人	中国光大银行股份有限公司上海分行
监管人	中国光大银行股份有限公司上海分行
差额支付承诺人	光大幸福国际租赁有限公司
资产服务机构	光大幸福国际租赁有限公司



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计划管理人的、原始权益人依据租赁合同自基准日（含该日）起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，基础资产实际现金流回款金额与基础资产预测现金流回款金额无显著差异，专项计划基础资产现金流回款情况如下表所示：

（单位：元）

基础资产现金流回款	回款时间	回款金额
现金流回款	2019年7月17日	155,640,587.22

注：以上数据源自原始权益人提供季度基础资产回收清单以及《光证资管-光大租赁一期资产支持专项计划第7期季度资产服务报告》。

三、参与方的履约情况

本报告期内，管理人、原始权益人、资产服务机构、托管人等资产证券化业务参与人均按监管有关规定及《计划说明书》、《标准条款》、《托管协议》、《监管协议》和《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2019年上半年财务报表（未审计），截至2019年6月30日原始权益人主要财务指标（合并口径）如下：

（单位：元）

总资产	净资产	营业总收入 (截至2019年6月30日)	净利润 (截至2019年6月30日)
6,100,271,421.16	1,215,233,551.14	191,771,920.31	20,772,375.92

五、专项计划账户资金的收支情况

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	摘要
1	2019/6/21	16,489.82	结息
2	2019/7/17	155,640,587.22	其他费用

专项计划账户付款情况	交易日期	本期支出	摘要
1	2019/4/25	4,754,094.49	147047 光租 1B 兑息兑付款
2	2019/4/25	2,061,195.05	149046 光租 1A3 兑息兑付款
3	2019/4/25	51,009,791.96	149045PR1A2 兑息兑付款

		2019/6/11	10,000.00	光大租赁一期 ABS2018 年审计费 ICN40300064041
--	--	-----------	-----------	---------------------------------------

2、专项计划账户资金余额情况

报告项目				
专项计划账户资金 余额	本期收入	本期支出	期末余额	摘要
60,658,431.59	155,657,077.04	57,835,081.50	158,480,427.13	

注：以上数据源自中国光大银行股份有限公司上海分行出具的《光证资管-光大租赁一期资产支持专项计划季度托管报告（第7期）》以及本期专项计划账户对账单。

六、各档次资产支持证券的本息兑付情况

2018年1月30日进行第1期兑付兑息，该期分配资金为216,640,584.80元，其中：

光租 1A1 分配资金合计 209,979,308.00 元；

光租 1A2 分配资金合计 3,027,068.80 元；

光租 1A3 分配资金合计 1,098,620.00 元；

光租 1B 分配资金合计 2,535,588.00 元；

2018年5月2日进行第2期兑付兑息，该期分配资金为91,781,950.00元，其中：

光租 1A1 分配资金合计 79,012,346.00 元；

光租 1A2 分配资金合计 5,805,027.20 元；

光租 1A3 分配资金合计 2,106,924.00 元；

光租 1B 分配资金合计 4,857,652.80 元；

2018年7月30日进行第3期兑付兑息，该期分配资金为170,408,902.80元，其中：

光租 1A1 分配资金合计 158,057,718.00 元；

光租 1A2 分配资金合计 5,612,532.80 元；

光租 1A3 分配资金合计 2,038,176.00 元；

光租 1B 分配资金合计 4,700,476.00 元；

2018年10月30日进行第4期兑付兑息，该期分配资金为65,380,022.00元，其中：

光租 1A1 分配资金合计 35,625,618.00 元，该期光租 1A1 分配完毕；

光租 1A2 分配资金合计 22,789,827.20 元；

光租 1A3 分配资金合计 2,106,924.00 元；

光租 1B 分配资金合计 4,857,652.80 元；

2019年1月30日进行第5期兑付兑息，该期分配资金为161,141,268.00元，其中：

光租 1A2 分配资金合计 154,176,691.20 元；

光租 1A3 分配资金合计 2,106,924.00 元；

光租 1B 分配资金合计 4,857,652.80 元；

2019年4月30日进行第6期兑付兑息，该期分配资金为57,822,190.40元，其中：

证券资产管理
缝

光租 1A2 分配资金合计 51,007,241.60 元；
 光租 1A3 分配资金合计 2,061,092.00 元；
 光租 1B 分配资金合计 4,753,856.80 元。

2019 年 7 月 30 日进行第 7 期兑付兑息，该期分配资金为 155,153,452.00 元，其中：
 光租 1A2 分配资金合计 148,262,206.40 元；
 光租 1A3 分配资金合计 2,084,008.00 元；
 光租 1B 分配资金合计 4,807,237.60 元。

七、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）
光租 1A1	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）	131,800,000.00
光租 1A1	上海光大证券资产管理有限公司（代“光大证券资管-建设银行-光大阳光债享收益 4 期集合资产管理计划”）	90,000,000.00
光租 1A1	上海光大证券资产管理有限公司（代“光大证券资管-建设银行-光大阳光债享收益 3 期集合资产管理计划”）	100,000,000.00
光租 1A2	上海光大证券资产管理有限公司（代“光证资管光大银行沈阳分行汇利宝 257 号定向资产管理计划”）	52,200,000.00
光租 1A3	上海光大证券资产管理有限公司（代“光证资管光大银行沈阳分行汇利宝 257 号定向资产管理计划”）	134,800,000.00
光租 1B	上海光大证券资产管理有限公司（代“光证资管光大银行沈阳分行汇利宝 257 号定向资产管理计划”）	150,000,000.00

八、专项计划资金运作情况

根据《光证资管-光大租赁一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。

九、其他情况

（一）光大租赁股权变更

2019 年 1 月，光大租赁内部完成了股权变更流程，原股东荆门市城市建设投资有限公司收购原股东幸福航空控股有限公司所持发起机构 5% 的股权。2019 年 6 月 19 日，光大租赁于工商局完成了股权变更备案程序。

变更前：

序号	出资方	出资金额（万元）	出资比例
1	光大金融投资有限公司	50,000.00	50%

2	光大资本投资有限公司	35,000.00	35%
3	荆门市城市建设投资公司	10,000.00	10%
4	幸福航空控股有限公司	5,000.00	5%
合计		100,000.00	100%

变更后:

序号	出资方	出资金额(万元)	出资比例
1	光大金融投资有限公司	50,000.00	50%
2	光大资本投资有限公司	35,000.00	35%
3	荆门市城市建设投资公司	15,000.00	15%
合计		100,000.00	100%

光大租赁的实际控制人不发生变化,为光大证券股份有限公司。

(二) 重要债务人

截至2019年4月30日,基础资产中有三笔的剩余本金占比超过15%。

① 第一大债务人

最大单一债务人为西安市浐灞河发展有限公司(以下简称“浐灞河发展”),截至4月30日的剩余本金为12,558.32万元,占比为19.66%。

截至2018年末,浐灞河发展的股权结构为:西安浐灞生态区管理委员会、国投瑞银资本管理有限公司及西安世园园林有限责任公司持股比例分别为47.89%、37.22%和14.89%。

浐灞河发展是西安市浐灞生态区重要的基础设施建设主体,主要从事浐灞生态区内的基础设施和保障房建设、房地产开发、公园运营及园区维护等业务。

截至2018年末的财务数据(单位:亿元)

总资产	总负债	资产负债率	营业总收入	净利润
271.06	189.53	69.92%	17.02	0.84

② 第二大债务人

大连顺兴投资有限公司(以下简称“大连顺兴”)截至4月30日的剩余本金为12,000.00万元,占比为18.79%。

旅顺口区国资局持为大连顺兴控股股东及实际控制人。

大连顺兴主营业务包括旅顺口区土地整理、建筑工程施工、项目投资等。

截至2018年末的财务数据(单位:亿元)

总资产	总负债	资产负债率	营业总收入	净利润
211.64	62.24	29.41%	4.78	0.97

③ 第三大债务人

醴陵市渌江新城投资开发建设有限公司(以下简称“渌江新城投资”),担保方为醴陵市渌江投资控股集团有限公司,截至4月30日剩余本金为11,734.39万元,占比为18.37%。

醴陵市国有资产投资经营中心为其实际控制人。

渌江新城投资作为渌江投控的重要子公司,主要经营醴陵市土地一级开发、基础设施建

设等工作。

截至2018年末的财务数据（单位：亿元）

总资产	总负债	资产负债率	营业总收入	净利润
39.11	18.98	48.53%	3.44	0.78

（三）其他

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、《光证资管-光大租赁一期资产支持专项计划标准条款》
- 1、《光证资管-光大租赁一期资产支持专项计划标准条款》
- 2、《光证资管-光大租赁一期资产支持专项计划资产支持证券认购协议与风险揭示书》
- 3、《光证资管-光大租赁一期资产支持专项计划基础资产买卖协议》
- 4、《光证资管-光大租赁一期资产支持专项计划监管协议》
- 5、《光证资管-光大租赁一期资产支持专项计划托管协议》
- 6、《光证资管-光大租赁一期资产支持专项计划差额支付承诺函》
- 7、《光证资管-光大租赁一期资产支持专项计划服务协议》
- 8、《北京大成律师事务所关于上海光大证券资产管理有限公司申请设立光证资管-光大租赁一期资产支持专项计划之法律意见书》
- 9、《光证资管-光大租赁一期资产支持专项计划优先级资产支持证券信用评级报告》
- 10、《关于拟设立的光证资管-光大租赁一期资产支持专项计划的基础资产池信息及现金流预测数据执行商定程序的报告》
- 11、《光证资管-光大租赁一期资产支持专项计划尽职调查报告》
- 12、计划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、托管银行的业务资格批件和营业执照
- 15、《光证资管-光大租赁一期资产支持专项计划说明书》

备查文件查阅地点：

上海光大证券资产管理有限公司

联系地址：上海市静安区1508号17楼

联系电话：021-22169999

传真：021-22169634

联系人：尹莉、潘钧天

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

2019年7月23日