

光大-银川通联-银川公交收费收益权丝路资产支持专项计划

第3期季度资产管理报告

重要提示

本报告依据《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》、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银川分行提供并确认。

计划成立日：2020年3月31日。

报告期间：2020年9月18日至2020年12月17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	证券简称	起息日	到期日	收益分配方式	信用评级	年化收益率	发行金额(亿元)	未偿本金余额(亿元)
168104	银公交 A1	2020/3/31	2020/12/24	季度付息、分期摊还	AAA	4.50%	0.77	0.19
168105	银公交 A2	2020/3/31	2021/12/24	季度付息、分期摊还	AAA	4.90%	0.75	0.75
168106	银公交 A3	2020/3/31	2022/12/26	季度付息、分期摊还	AAA	5.00%	0.75	0.75
168107	银公交 A4	2020/3/31	2029/12/24	季度付息、分期摊还	AAA	5.40%	6.33	6.33
168108	银公交次	2020/3/31	2029/12/24	分配剩余收益	无	无	0.50	0.50

专项计划的交易相关方	
原始权益人/资产服务机构	银川市公共交通有限公司
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银川分行
监管人	中国光大银行股份有限公司银川分行
差额支付承诺人/回购义务人/流动性支持机构	银川通联资本投资运营有限公司
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

本专项计划基础资产系指原始权益人根据政府及相关法律文件，基于公交经营收费权自2019年10月1日至2029年11月30日止的特定期间内收取乘客支付的公交票款收入的权利。其中，公交票款收入包括零售票款收入和IC卡票款收入。专项计划设立后，若原始权益人调增公交票价、增加公交线路或增加公交票款结算方式的，则调增公交票价、新增加的

公交线路以及公交票款结算方式形成的票款收入亦在公交票款收入范围内，属于基础资产。

本报告期内，专项计划基础资产现金流回款情况如下表所示：

(单位：元)

序号	到账时间	总金额	摘要
1	2020-12-14	33,924,480.44	ABS 归集资金

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 2020 年 9 月末财务报表（未经审计），原始权益人主要财务指标如下：

(单位：万元)

总资产	净资产	营业总收入	净利润
222,965.97	-15,202.97	16,837.44	-23,011.53

五、专项计划账户资金的收支情况

专项计划账户资金信息如下（单位：元）：

1、专项计划账户收款情况

序号	到账时间	总金额	摘要
1	2020/9/21	16,724.36	结息
2	2020/12/14	33,924,480.44	归集资金

2、专项计划账户付款情况

序号	交易日期	本期支出	摘要
1	2020/9/22	926,296.31	168105 银公交 A2 兑付兑息款
2	2020/9/22	945,047.25	168106 银公交 A3 兑付兑息款
3	2020/9/22	8,615,560.76	168107 银公交 A4 兑付兑息款
6	2020/9/22	19,435,771.74	168104 PR 交 A1 兑付兑息款

3、专项计划账户资金余额情况

专项计划账户资金余额	本期收入	本期支出	期末余额	摘要
36,685,628.75	33,941,204.80	29,922,676.06	40,704,157.49	

注：以上数据来自于中国光大银行股份有限公司银川分行出具的《光大-银川通联-银川公交收费收益权丝路资产支持专项计划当期托管报告》

六、各档次资产支持证券的本息兑付情况

报告期间，专项计划于2020年9月24日进行2020年第2期（总第2期）收益分配，分配情况如下：

证券代码	证券简称	收益分配类型	分配本金（元/份）	分配收益（元/份）	持有人份额（份）	分配资金合计（元）	剩余本金面值（元）	剩余本金余额（万元）
168104	银公交A1	付息，按面值分期偿还	24.68	0.560	770,000	19,434,800.00	24.67	1,899.59
168105	银公交A2	付息	0	1.235	750,000	926,250.00	100	7,500.00
168106	银公交A3	付息	0	1.260	750,000	945,000.00	100	7,500.00
168107	银公交A4	付息	0	1.361	6,330,000	8,615,130.00	100	63,300.00
168108	银公交次	付息	0	0	500,000	0	100	5,000.00

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《光大-银川通联-银川公交收费收益权丝路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. 《光大-银川通联-银川公交收费收益权丝路资产支持专项计划说明书》
2. 《光大-银川通联-银川公交收费收益权丝路资产支持专项计划标准条款》
3. 《光大-银川通联-银川公交收费收益权丝路资产支持专项计划资产支持证券认购协议》
4. 《光大-银川通联-银川公交收费收益权丝路资产支持专项计划托管协议》
5. 《光大-银川通联-银川公交收费收益权丝路资产支持专项计划监管协议》
6. 《光大-银川通联-银川公交收费收益权丝路资产支持专项计划服务协议》
7. 《光大-银川通联-银川公交收费收益权丝路资产支持专项计划资产买卖协议》
8. 《光大-银川通联-银川公交收费收益权丝路资产支持专项计划之法律意见书》
9. 《光大-银川通联-银川公交收费收益权丝路资产支持专项计划优先级资产支持证券信用评级报告》
10. 《光大-银川通联-银川公交收费收益权丝路资产支持专项计划项目现金流预测报告书》
11. 计划管理人的业务资格批件、营业执照和公司章程
12. 原始权益人的营业执照和公司章程
13. 托管银行的业务资格批件和营业执照

备查文件查阅地点：上海光大证券资产管理有限公司

地址：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

电话：021-32068526

传真：021-32068585

联系人：赵颖

