

# 光大招商-中远海运租赁 2018 年第二期资产支持专项计划

## 2021 年第 1 期（总第 8 期）资产管理报告

（报告期间：2020 年 11 月 14 日至 2021 年 2 月 8 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：2019年1月29日

报 告 日 期：2021年2月8日

## 第一节 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》、《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《光大招商-中远海运租赁 2018 年第二期资产支持专项计划备案确认函》及其他有关规定制作。

本报告由上海光大证券资产管理有限公司负责编制,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。

## 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

光大招商-中远海运租赁 2018 年第二期资产支持专项计划(以下简称“本专项计划”)自 2019 年 1 月 29 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 2,455,000,000.00 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。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“远海租 01”)、优先 A-2 级资产支持证券(简称“远海租 02”)、优先 A-3 级资产支持证券(简称“远海租 03”)。截至目前,本次发行的资产支持证券各类别情况如下表所示:

截至目前,本次发行的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)
156747	远海租 01	2019/1/29	2020/5/20	按季付息、过手摊还	AAA	4.50%	13	0
156748	远海租 02	2019/1/29	2021/2/20	按季付息、过手摊还	AAA	5.10%	5.6	0.57344
156749	远海租 03	2019/1/29	2022/8/20	按季付息、过手摊还	AAA	5.65%	4.58	4.58
156750	远海租 C	2019/1/29	2023/2/20	到期一次性分配	-	-	1.37	1.37

专项计划资产支持证券本息分配情况如下:

专项计划已于 2020 年 11 月 20 日进行第 7 期收益分配:

该期资产支持证券的分配资金为 219,786,720.00 元。

远海租 02 分配资金合计 213,264,800.00 元。

远海租 03 分配资金合计 6,521,920.00 元。

专项计划将于 2021 年 2 月 22 日进行第 8 期收益分配:

该期资产支持证券的分配资金为 187,135,900.00 元。

远海租 02 分配资金合计 58,094,400.00 元。

远海租 03 分配资金合计 129,041,500.00 元。

分配后：

远海租 02 剩余本金面值为 0 元，已兑付完毕；

远海租 03 剩余本金面值为 73.28 元；

远海租 C 剩余本金面值为 100.00 元。

注：详细情况请参考《光大招商-中远海运租赁 2018 年第二期资产支持专项计划 2021 年第 1 期（总第 8 期）收益分配报告》。

## 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	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
原始权益人	中远海运租赁有限公司
资产服务机构	中远海运租赁有限公司
流动性支持机构	中远海运发展股份有限公司
法律顾问	上海市锦天城律师事务所
评级机构	上海新世纪资信评估投资服务有限公司
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责任公司上海分公司

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》、《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、监管人等主要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、复核和审查等托管相关工作，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

本报告期内，专项计划基础资产现金流回款情况如下表所示：

基础资产现金流回款	回款时间	实际回款金额（元）
现金流回款	2021/2/3	187,525,045.56

注：以上数据源自原始权益人提供的《光大招商-中远海运租赁 2018 年第二期资产支持专项计划第 8 期季度资产服务报告》及基础资产现金流清单。

### 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	摘要
1	2020-12-21	57,654.81	结息
2	2021-02-03	187,525,045.56	2018-2ABS

专项计划账户付款情况	交易日期	本期支出	摘要
1	2020-11-17	213,275,463.24	156748PR 租 02 兑付兑息款
2	2020-11-17	6,522,246.10	156749 远海租 03 兑付兑息款
3	2020-12-09	559,199.07	支付 11 月份增值税及附加

#### 2、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
220,391,372.71	187,582,700.37	220,356,908.41	187,617,164.67	/

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《光大招商-中远海运租赁 2018 年第二期资产支持专项计划第 8 期季度托管报告》。

#### 2. 专项计划资金运作情况

根据《光大招商-中远海运租赁 2018 年第二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

原始权益人为中远海运租赁有限公司，本报告期内，原始权益人持续经营，截至 2020 年 9 月 30 日的主要财务指标（合并口径）如下：

中远海运租赁有限公司	2020 年 9 月 30 日（元）
总资产	35,536,841,073.82
总负债	30,185,550,905.19
短期借款	852,110,000.00
长期借款	9,339,924,486.17
所有者权益	5,351,290,168.63
今年累计营业总收入	1,899,153,199.66
今年累计净利润	316,404,019.37

注：以上数据源自原始权益人提供的 2020 年三季度财务报表。

## 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，流动性支持机构为中远海运发展股份有限公司，其 2020 年三季度主要财务指标如下：

中远海运发展股份有限公司	2020 年 9 月 30 日（元）
总资产	146,623,833,850.27
净资产	25,110,987,519.90
总负债	121,512,846,330.37
短期借款	14,910,740,891.75
长期借款	53,398,512,342.96
今年累计营业总收入	12,746,602,135.73
今年累计净利润	1,672,036,317.11

注：以上数据源自 wind。

## 第七节 管理人认购资产支持证券的情况

无。

## 第八节 其他情况

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。

## 第九节 备查文件

- 1、《光大招商-中远海运租赁 2018 年第二期资产支持专项计划标准条款》
- 2、《光大招商-中远海运租赁 2018 年第二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、《光大招商-中远海运租赁 2018 年第二期资产支持专项计划基础资产买卖协议》
- 4、《光大招商-中远海运租赁 2018 年第二期资产支持专项计划监管协议》
- 5、《光大招商-中远海运租赁 2018 年第二期资产支持专项计划托管协议》
- 6、《光大招商-中远海运租赁 2018 年第二期资产支持专项计划差额支付承诺函》
- 7、《光大招商-中远海运租赁 2018 年第二期资产支持专项计划流动性支持合同》
- 8、《光大招商-中远海运租赁 2018 年第二期资产支持专项计划服务协议》
- 9、《上海市锦天城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大招商-中远海运租赁 2018 年第二期资产支持专项计划之法律意见书》
- 10、《光大招商-中远海运租赁 2018 年第二期资产支持专项计划优先级资产支持证券信用评级报告》
- 11、《关于拟设立的光大招商-中远海运租赁 2018 年第二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》
- 12、《光大招商-中远海运租赁 2018 年第二期资产支持专项计划尽职调查报告》
- 13、计划管理人的业务资格批件、营业执照和公司章程
- 14、原始权益人的营业执照和公司章程
- 15、托管银行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：上海市静安区新闸路 1508 号 17 层

联系人：尹莉、潘钧天

电话：021-22169676

传真：021-22169634

网址：<http://www.ebscn-am.com>



