

浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权 3 号资产支持专项计划服务报告

报告期间：【2018】年【2】月【1】日至【2018】年【12】月【31】日

本报告中关于浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权 3 号资产支持专项计划的数据由资产服务机构与上海浦银安盛资产管理有限公司（作为计划管理人）签订的《申万宏源融出资金 3 号资产支持专项计划服务协议》提供并确认。

专项计划成立日：【2018】年【2】月【1】日

报告日期：【2018】年【12】月【31】日

第一节、专项计划基本情况

份额类别	期限（月）	预期收益率	发行规模（亿元）	面值（元）
优先级	18	5.6%	28.5	100
次级	18	—	1.5	100

第二节 报告期内是否发生加速清偿事件、权利完善事件、资产服务机构解任事件

加速清偿事件说明

编号	内容	是	否
a	“原始权益人”或“流动性支持方”发生任何丧失清偿能力事件；		√
b	发生任何“资产服务机构解任事件”，且在九十个自然日内仍无法找到合格的继任资产服务机构；		√
c	根据“专项计划文件”的约定，需要更换“计划管理人”或“托管人”，且在九十个自然日内仍无法找到合格的继任或后备机构；		√
d	“在流动性支持启动事件”发生后的任何一个“流动性支持支付日”，“流动性支持方”未按照《流动性支持承诺函》的条款与条件承担补足义务，导致“专项计划托管账户”内可供分配的资金不足以支付相应的“收益兑付日”应付的税费、费用以及“优先级资产支持证券”的预期收益之总和的；		√
e	其他（或有）		√

权利完善事件说明

编号	内容	是	否
a	发生任何一起“资产服务机构解任事件”；		√
b	“借款人”未履行其在“《融资融券合同》”项下的全部或部分义务，以致须针对其提起法律诉讼或仲裁。		√

资产服务机构解任事件说明

编号	内容	是	否
a	“资产服务机构”未能根据《服务协议》”按时进行资金划付（除非由于“资产服务机构”不能控制的技术故障、计算机故障或电汇支付系统故障导致未能及时付款，而使该付款到期日顺延），且经“计划管理人”书面通知要求付款后超过三个工作日仍未付款；		√
b	“资产服务机构”停止经营或计划停止经营其全部或主要的业务；		√
c	发生与“资产服务机构”有关的丧失清偿能力事件；		√

d	“资产服务机构”未能保持履行《服务协议》”项下实质性义务所需的资格（特别是从事与“基础资产”有关的融资融券业务的资格）、许可、批准、授权和/或同意，或上述资格、许可、批准、授权和/或同意被中止、收回或撤销；		√
e	“资产服务机构”未能根据《服务协议》的规定按时交付相关报告期间的《资产服务机构报告》（除非由于“资产服务机构”不能控制的技术故障、计算机故障或电汇支付系统故障导致未能及时提供，而使“资产服务机构”提供《资产服务机构报告》的日期延后），且经“计划管理人”书面通知要求提交报告后超过三个工作日内仍未提交；		√
f	“资产服务机构”严重违反：(1)除资金划付义务和提供报告义务以外的其它义务；(2)“资产服务机构”在“专项计划文件”中所做的任何陈述和保证，且在“资产服务机构”实际得知（不管是否收到“计划管理人”的通知）该等违约行为后，该行为仍持续超过十五个工作日，以致对“基础资产”的回收产生“重大不利影响”；		√
g	“资产支持证券持有人大会”合理认为已经发生与“资产服务机构”有关的“重大不利变化”；		√
h	“资产服务机构”未能落实“《服务协议》”的规定，在“专项计划设立日”后九十个工作日内，未能按照“计划管理人”的要求，对“《服务协议》”指明的所有账户记录原件以及与上述账户记录相关的所有文件按“《服务协议》”的约定进行保管。		√

### 第三节 专项计划各期基础资产的运作情况

#### 基础资产统计

期初未偿本金余额	3000000000
期初融资仓单笔数	29451
期初借款人数量	4925
当期循环购买本金金额	10456368706.81
当期循环购买仓单笔数	263176
当期循环购买借款人数量	10963
当期本金回收款	10383619348.76
当期利息及费用回收款	72749358.05
当期了结仓单笔数	581
当期仓单回购笔数	52352
当期仓单回购金额	2192530634.00
期末未偿本金余额	2923060269.17
期末仓单笔数	64588
期末借款人数量	4625

#### 1、当期税收和费用情况

项目	金额
当期支付营业税及其附加	0
当前支付应付账款（如有）	0
机构服务报酬（仅指资产服务机构费用，未偿本金 余额*费率）	0
其他由服务机构垫付并提取的费用	0
合计	0

2、当期资金流情况

金额单位：元

项目	金额
期初两融账户余额	0
期初仓单余额(+)	3000000000
当期实际回收利息及费用 (+)	72749358.05
当期税收支出 (-)	0
当期分红支出 (-)	0
当期费用支出 (-)	149689088.88
期末仓单余额 (-)	2923060269.17
期末两融账户余额	0

3、期末仓单分类情况

金额单位：元

分类	期末本金余额	借款人数	笔数
担保比例大于 150%	2923060269.17	4625	64588
担保比例小于等于 150%	无	无	无
担保比例小于等于 140%	无	无	无
担保比例小于等于 130%	无	无	无
担保比例小于等于 120%	无	无	无
担保比例小于等于 115%	无	无	无
合计	—		

4、基础资产回购统计

金额单位：元

项目	金额/笔数
当期应回购本金	2192530634.00
当期应回购利息	72749358.05
当期实际回购本金	2192530634.00
当期实际回购利息	72749358.05
当期仓单回购笔数合计	52352
不合格基础资产	48477
风险基础资产	3141
不良基础资产	153
期末到期基础资产	581
当期仓单回购金额合计	2192530634.00
不合格基础资产	2160196832.96
风险基础资产	2014576.61
不良基础资产	5705354.57

源证券  
缝章

期末到期基础资产	24613869.86
----------	-------------

5、 不合格基础资产的回购

金额单位：元

期间不合格基础资产回购发生额	人数	笔数	静态占比=当期不合格基础资产回购发生额/产品募集规模	动态占比=当期不合格基础资产回购发生额/当期循环购买本金金额
2160196832.96	1763	48477	0.7200656109866667	0.2067536926136319
截至本期末不合格基础资产回购总额	人数	笔数	静态占比=截至期末不合格基础资产回购总额/产品募集规模	动态占比=截至期末不合格基础资产回购总额/截至期末累计购买本金金额
2160196832.96	1763	48477	0.7200656109866667	0.2067536926136319

6、 期间风险基础资产回购情况

金额单位：元

期间风险基础资产回购发生额	人数	笔数	静态占比=期间风险基础资产回购发生额/产品募集规模	动态占比=期间风险基础资产回购发生额/当期循环购买本金金额
2014576.61	810	3141	0.00067152553667	0.000192816296559
截至本期末风险基础资产回购总额	人数	笔数	静态占比=截至期末风险基础资产回购总额/产品募集规模	动态占比=截至期末风险基础资产回购总额/截至期末累计购买本金金额
2014576.61	810	3141	0.00067152553667	0.000192816296559

7、 期间不良基础资产回购情况

金额单位：元

期间不良基础资产回购发生额	人数	笔数	静态占比=期间不良基础资产回购发生额/产品募集规模	动态占比=期间不良基础资产回购发生额/当期循环购买本金金额
5705354.57	9	153	0.00190178	0.0005460627971578
截至本期末不良基础资产回购总额	人数	笔数	静态占比=截至期末不良基础资产回购总额/产品募集规模	动态占比=截至期末不良基础资产回购总额/截至期末累计购买本金金额
5705354.57	9	153	0.00190178	0.0005460627971578

8、 期末到期基础资产回购情况

金额单位：元

期末到期基础资产回购发生额	人数	笔数	静态占比=期末到期基础资产回购发生额/产品募集规模	动态占比=期末到期基础资产回购发生额/当期循环购买本金金额
24613869.86	61	581	0.008204623286667	0.0023558077696527
截至本期末到期基础资产回购总额	人数	笔数	静态占比=截至期末到期基础资产回购总额/产品募集规模	动态占比=截至期末到期基础资产回购总额/截至期末累计购买本金金额
24613869.86	61	581	0.008204623286667	0.0023558077696527

9、 期间违约基础资产平仓情况

金额单位：元

期间违约基础资产平仓发	人数	了结仓单笔数	静态占比=期间	动态占比=期间违
-------------	----	--------	---------	----------

生额			违约基础资产平 仓发生额/产品 募集规模	约基础资产平仓发 生额/当期循环购 买本金金额
无				
截至本期末违约基础资产 平仓总额	人数	了结仓单笔数	静态占比=截至 期末违约基础资 产平仓总额/产 品募集规模	动态占比=截至期 末违约基础资产平 仓总额/截至期末 累计购买本金金额
无				

第四节 《融资融券合同》变更情况

协议编号	合同变更日期	变更内容	变更原因	其他说明
无				

第五节 诉讼或仲裁情况

1、融资融券业务方面诉讼或仲裁情况

(1) 专项计划资产涉诉或仲裁情况

协议编号	融出资金债权余额	诉讼/仲裁进展情况
无		

(2) 其他融出资金债权涉诉或仲裁情况

无

2、资产服务机构重大诉讼或仲裁情况

无

公司  
(2)

资产服务机构：申万宏源证券有限公司

【 2019 】年【 3 】月【 19 】日

