

浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权1号资产支持 专项计划2017年度资产管理报告

(报告期间:2017年8月24日至2017年12月31日)

一、重要提示

本报告依据中国证监会《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子公司资产证券化业务信息披露指引》、《深圳证券交易所资产证券化业务指引》(2014年修订)以及其他相关规定制作。

浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权1号资产支持专项计划于2017年8月24日设立,并于2017年9月12日取得中国证券投资基金业协会发放的《资产支持专项计划备案确认函》(备案编码:486170829001)。

本报告由计划管理人上海浦银安盛资产管理有限公司负责编制,计划管理人声明保证本报告信息披露的内容真实、准确、完整、没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本报告关于基础资产运营的数据由资产服务机构申万宏源证券提供,已经由上海浦银安盛资管有限公司复核确认。

报告期间:2017年8月24日至2017年12月31日。



二、资产支持专项计划基本情况

产品名称	浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权1号资产支持专项计划		
产品设立日	2017年8月24日		
产品到期日	2019年2月25日		
挂牌起始日	2017年10月12日		
计划管理人	上海浦银安盛资产管理有限公司		
托管人	上海浦东发展银行股份有限公司北京分行		
资产服务机构	申万宏源证券有限公司		
评级机构	上海新世纪资信评估投资服务有限公司		
登记机构	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司		
交易场所	深圳证券交易所的综合协议交易平台		
增信安排	本专项计划采用优先级/次级分层产品结构安排,并设置超额利差增信方式。原始权益人申万证券宏源证券有限公司提供流动性支持,并承担对专项计划存续期间不合格基础资产、风险基础资产或不良基础资产回购义务,以及到期的期末回购。		
证券资料	证券简称	中证1A01	中证1次
	证券类型	优先级	次级
	证券代码	116643	116644
	规模(亿元)	19.00	1.00
	每份资产支持证券面值(元)	100	100
	预期年收益率	4.99%	无
	信用评级	AAA	无
	期限(月)	18个月	18个月
	资产支持证券份数	19000000.00	1000000.00
	还本付息期限	每半年付息	到期还本付息
	还本付息方式	定期付息、到期一次还本	到期一次还本付息
	利率形式	固定利率	无
	分配日期	2017年12月26日、2018年6月26日、2019年2月26日	2019年2月26日

三、基础资产运行情况

根据浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权1号资产支持专项计划资产服务机构年度报告(报告期2017年8月24日至2017年12月31日),本专项计划基础资产运行情况如下:

1、专项计划投资者情况

序号	证券账户名称	证件号码	持股数量	性质
1	青岛银行股份有限公司	91370200264609602K	1,000,000.00	优先级
2	江苏银行股份有限公司 上海分行	913100006822451438	3,000,000.00	优先级
3	中欧基金-浦发银行-上海浦银安盛资产管理有 限公司	310000400578800	200,000.00	优先级
4	中欧基金-浦发银行-上海浦东发展银行股份有 限公司上海分行	91310000717866389C	200,000.00	优先级
5	中国银行股份有限公司- 中证兴业中高等级信用 债指数证券投资基金	中证证基(2016)1067	1,500,000.00	优先级
6	兴业银行股份有限公司- 兴银长乐半年定期开放 债券型证券投资基金	华福证基(2015)609	1,500,000.00	优先级
7	平安银行股份有限公司	91440300192185379H	2,000,000.00	优先级
8	招商银行股份有限公司	9144030010001686XA	9,500,000.00	优先级
9	易方达基金-农业银行- 易方达资产管理有限公司	91440000727878666D	100,000.00	优先级
10	申万宏源证券有限公司	310000000136970	1,000,000	次级
		共计	20,000,000.00	

截止本报告出具之日，本专项计划存续期内的投资者无变化。

2、专项计划基础资产数据统计

期初未偿本金余额	2000000000
期初融资仓单笔数	29010
期初借款人数量	4823
当期循环购买本金金额	7040986463.7
当期循环购买仓单笔数	171203
当期循环购买借款人数量	19916
当期本金回收款	7035562907.54
当期利息及费用回收款	5423556.16
当期了结仓单笔数	931

当期仓单回购笔数	8614
当期仓单回购金额	39446462.04
期末未偿本金余额	1932856261.46
期末仓单笔数	28624
期末借款人数量	3504

3、专项计划基础资产回购统计

金额单位：元

项目	金额/笔数
当期应回购本金	39551417.49
当期应回购利息	683531.12
当期实际回购本金	39551417.49
当期实际回购利息	562768.05
当期仓单回购笔数合计	9491
不合格基础资产	467
风险基础资产	8093
不良基础资产	0
期末到期基础资产	931
当期仓单回购金额合计	39551417.49
不合格基础资产	34614576.58
风险基础资产	2870299.28
不良基础资产	0
期末到期基础资产	2066541.63

4、专项计划不合格基础资产的回购统计

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
34614576.58	89	467	0.01730728829	0.0049161543992424
截至本期末不合格基础资产回购	人数	笔数	静态占比=截至期末不合格基础资产	动态占比=截至期末不合格基础资产回购总额

总额			回购总额/产品募集规模	/截至期末累计购买本金金额
34614576.58	89	467	0.01730728829	0.0049161543992424

5、专项计划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
2870299.28	2638	8093	0.00143514964	0.00040765584406
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
2870299.28	2638	8093	0.00143514964	0.00040765584406

6、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
2066541.63	301	931	0.001033270815	0.0002935017189
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

资产
簿

				买本金金额
2066541.63	301	931	0.001033270815	0.0002935017189

7、期间不良基础资产回购情况

截止本报告出具之日，本专项计划存续期内的基础资产不涉及不良基础资产回购。

8、期间违约基础资产平仓情况

截止本报告出具之日，本专项计划存续期内的基础资产不涉及强制平仓。

9、诉讼、仲裁情况

截止本报告出具之日，本专项计划存续期内的基础资产不涉及诉讼、仲裁。

四、业务参与者履约情况

1、原始权益人履约情况

原始权益人持续经营，不存在影响资产支持证券发行的诉讼、仲裁和纠纷，未发生违反合同约定、损害基础资产及其收益的情况，履约情况良好。

2、计划管理人履约情况

本报告期间，计划管理人未发生变更，不存在违反合同约定的损害基础资产及其收益的情况，履约情况良好。

3、计划托管人履约情况

本报告期间，计划托管人未发生变更，不存在违反合同约定的损害基础资产及其收益的情况，履约情况良好。

4、服务机构履约情况

本报告期间，专项计划的服务机构均未发生变更，不存在违反合同约定的损害基础资产及其收益的情况，履约情况良好。

五、原始权益人经营情况

根据原始权益人2017年第三季度财务报表披露，截止2017年9月，申万宏源证券有限公司(原始权益人)合并实现营业收入91.44亿元，净利润34.87亿元，资产总规模为2,715.87亿元，公司融出资金净值达到534.53亿元。截至2017年上半年，公司主要资产管理规模和营业规模排名均稳居证券公司第一梯队，具有领先的市场地位。根据中国证券监督管理委员会公布的2017年证券公司分类评价结果，申万宏源证券有限公司获A类AA级评价结果。

申万宏源集团股份有限公司于2018年2月23日发布公告，对所属全资子公司申万宏源证券有限公司(原始权益人)增加注册资本100亿人民币，经中国证券监督管理委员会核准，增资事项已经完成。

总体而言，原始权益人在报告期间主营业务未发生变化，未发生异常事件，经营情况良好。

六、专项计划资金收支情况

本专项计划于 2017 年 8 月 24 日成立，专项计划账户收到募集资金：2,000,000,000.00 元（人民币贰拾亿元）。计划管理人根据《资产买卖协议》、《标准条款》等专项计划文件约定，将该笔资金用于购买原始权益人基础资产。

2017 年 12 月 18 日，专项计划账户收到当期必备金额：33,820,000.00 元。截止至 2017 年 12 月 21 日，专项计划账户内余额（含结息）33,822,029.20 元。

专项计划账户于 2017 年 12 月 22 日向中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司划拨资产支持证券兑付息所需资金 32,211,033.67 元，并按照《计划说明书》等专项计划文件的约定支付管理费、托管费、中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司手续费、项目安排费等相关费用。

截止至 2017 年 12 月 25 日，专项计划托管账户内资金余额 8,045.81 元。

七、专项计划资金管理情况

根据《计划说明书》约定，专项计划存续期间，计划管理人可以将托管资金以定期存款、通知存款或协定存款方式存放于托管人处或计划管理人以产品名义开立的指定存款账户进行合格投资，或者投资于货币基金。

本报告期内，专项计划未进行合格投资。

八、资产支持证券的本息兑付情况

本报告期内，专项计划发生过收益分配，已正常付息，收益分配如下：

中证 1A01 本次兑付兑息金额合计 32,209,423.20 元人民币，其中兑付本金为 0.00 元人民币，分配利息 32,209,423.20 元人民币。权益登记日为 2017 年 12 月 25 日，兑付资金到帐日为 2017 年 12 月 26 日。

九、评级情况（如有）及内外部信用增级情况说明

上海新世纪资信评估投资服务有限公司综合专项计划的基础资产情况、交易结构安排、增信安排等因素，评估了有关风险，给予优先级资产支持证券的评级为 AAA 级。

本报告期内，专项计划的信用评级未发生变化。

十、会计师事务所对专项计划年度运行情况的审计情况

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对计划管理人为“浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权 1 号资产支持专项计划”编制的财务报表（包括资产负债表、利润表、净值变动表及财务报表附注）进行了审计，并于 2017 年 4 月 11 日出具了《“浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权 1 号资产支持专项计划”审计报告》（毕马威华振审字第 1801108 号）。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的审计意见如下：“我

们认为，该专项计划的上述财务报表在所有重大方面按照附注2所述的编制基础编制。”

十一、需要对投资者报告的其他事项

无

十二、备查文件目录、查阅地点及联系方式

1、备查文件目录

- 1) 《关于浦银安盛资管“浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权1-7号资产支持专项计划”符合深交所挂牌条件的无异议函》
- 2) 《浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权1号资产支持专项计划之计划说明书》
- 3) 《浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权1号资产支持专项计划标准条款》
- 4) 《浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权1号资产支持专项计划之基础资产买卖协议》
- 5) 《浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权1号资产支持专项计划资产服务协议》
- 6) 《申万宏源证券有限公司关于浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权1号资产支持专项计划流动性支持承诺函》
- 7) 《浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权1号资产支持专项计划托管协议》
- 8) 《浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权1号资产支持专项计划项目安排协议》
- 9) 《浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权1号资产支持专项计划认购协议与风险揭示书》
- 10) 《浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权1号资产支持专项计划优先级资产支持证券信用评级报告》
- 11) 《浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权1号资产支持专项计划尽职调查报告》

- 12) 《关于上海浦银安盛资产管理有限公司通过设立浦银安盛资管-申万宏源证券融出资金债权1号发售资产支持证券之法律意见书》
- 13) 计划管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 14) 特定原始权益人的营业执照和公司章程
- 15) 托管人业务资格批件和营业执照

2、查阅地点及联系方式

上海浦银安盛资产管理有限公司

地址：上海市淮海中路381号中环广场33楼

联系人：龙明昌

电话：021-23212956

传真：021-23212998

计划管理人：上海浦银安盛资产管理有限公司



2018年4月15日

限公司