

专项计划名称：鲁能集团-长城证券-三亚山海天 JW 万豪酒店及  
傲途格精选酒店资产支持专项计划

证券代码：168490

证券简称：PR 山海优

证券代码：168491

证券简称：山海 01 次

## 关于鲁能集团-长城证券-三亚山海天 JW 万豪酒店及傲途格 精选酒店资产支持专项计划基础资产现金流变动的公告

本公司保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担相应的法律责任。

### 一、专项计划与资产支持证券的基本信息

#### (一) 专项计划基本情况

- 1、专项计划全称：鲁能集团-长城证券-三亚山海天 JW 万豪酒店及傲途格精选酒店资产支持专项计划
- 2、发行规模：30.30 亿元
- 3、设立日：2020 年 6 月 4 日
- 4、预期到期日：2032 年 4 月 19 日
- 5、原始权益人：鲁能集团有限公司
- 6、资产服务机构：海南三亚湾新城开发有限公司
- 7、托管人：中国民生银行股份有限公司
- 8、计划管理人：长城证券股份有限公司

#### (二) 各档资产支持证券基本情况



| 证券简称    | 证券代码   | 发行日      | 预期到期日     | 发行金额<br>(亿元) | 发行利率 | 存续金额<br>(亿元) |
|---------|--------|----------|-----------|--------------|------|--------------|
| PR 山海优  | 168490 | 2020/6/4 | 2032/4/19 | 30           | 3.5% | 29.274       |
| 山海 01 次 | 168491 | 2020/6/4 | 2032/4/19 | 0.3          | /    | 0.30         |

## 二、基础资产现金流下降的基本情况

### (一) 基础资产的基本情况

本专项计划的基础资产为金谷·三亚酒店信托的信托受益权，金谷·三亚酒店信托根据《信托合同》及《债权转让与还款安排协议》的约定享有对三亚湾新城公司的标的债权。在金谷·三亚酒店信托存续期间，三亚湾新城公司应当根据《债权转让与还款安排协议》的约定向金谷信托偿还标的债权的本息。

根据本专项计划的交易安排，三亚湾新城公司将其在标的债权存续期间运营、管理目标物业所收取的目标物业经营收入作为其清偿标的债权本息的主要资金来源，并提供目标物业抵押与目标物业经营收入质押担保，同时由鲁能集团就三亚湾新城公司的标的债权本息差额进行差额支付。本专项计划中，三亚湾新城公司用于偿还标的债权的主要现金流来源为三亚湾新城公司享有的目标物业经营收入。本专项计划的目标物业包括三亚山海天 JW 万豪酒店及三亚山海天大酒店·傲途格精选(简称“JW 万豪酒店”和“傲途格酒店”)。

### (二) 基础资产现金流变化的具体情况

2022 年二季度，标的物业实际产生净现金流 1,699.90 万元，预测净现金流 4,504.68 万元，实际较预测下降 62%。

### (三) 实际现金流减少的具体原因

专项计划标的物业酒店位于海南省三亚市，报告期受三亚疫情爆发以及主要客源地上海、北京等地区疫情影响，酒店客流量下降较多，营业收入相应减少，导致本期实际运营收入较预期下降超 20%。

### 三、影响分析及应对措施

截至 2022 年 6 月 30 日，实际归集至监管账户的金额为 4,504.68 万元，已覆盖当期应偿付信托债权本息金额 3,206.90 万元。本次收款期间标的物业运营收入较预期下降不会对资产支持证券于下一次兑付日 2022 年 7 月 19 日的收益分配产生重大不利影响。

### 四、其他

长城证券提请投资者关注专项计划潜在投资风险。专项计划存续期内，长城证券将持续关注可能对资产支持证券持有人权益产生重大影响的事项，并根据《上海证券交易所资产支持证券临时报告信息披露指引》及专项计划相关交易文件的规定履行信息披露义务，积极践行计划管理人职责，维护资产支持证券持有人利益。

特此公告。

长城证券股份有限公司

2022 年 7 月 5 日

