

长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划

半年度资产管理报告（2020 年度第 2 期）

（报告期间：2020 年 2 月 13 日-2020 年 8 月 12 日）

一、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》、《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》等有关规定制作。

本报告中，关于专项计划基础资产的运行数据由株洲市云龙发展投资控股集团有限公司提供，关于专项计划账户的资金的数据由兴业银行股份有限公司提供并确认。

长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划于 2017 年 11 月 23 日正式成立。

报告期间：自 2020 年 2 月 13 日起至 2020 年 8 月 12 日。

二、资产支持专项计划产品概况

证券分层	优先级					次级
	17 云龙 01	17 云龙 02	17 云龙 03	17 云龙 04	17 云龙 05	17 云龙次
规模（万元）	6,000 (已兑付)	8,000 (已兑付)	14,000 (已兑付)	8,000	14,000	5,000
规模占比	10.91%	14.55%	25.45%	14.55%	25.45%	9.09%
发行利率	6.0%	6.2%	6.6%	6.7%	6.8%	无
信用评级	AA	AA	AA	AA	AA	无
存续期	84 天	1 年零 84 天	2 年零 84 天	3 年零 84 天	4 年零 84 天	4 年零 84 天
起息日	2017/11/23	2017/11/23	2017/11/23	2017/11/23	2017/11/23	2017/11/23
到期日	2018/2/15	2019/2/15	2020/2/15	2021/2/15	2022/2/15	2022/2/15
利率类型	固定利率	固定利率	固定利率	固定利率	固定利率	无票面利率
付息方式	定期付息	定期付息	定期付息	定期付息	定期付息	每个预期到期日对应的 兑付日分配 剩余专项计 划资产

本金偿还方式	到期一次还本	到期一次还本	到期一次还本	到期一次还本	到期一次还本	到期分配全部剩余专项计划资产
--------	--------	--------	--------	--------	--------	----------------

三、基础资产运行情况

本专项计划的基础资产系指由原始权益人在专项计划设立日转让给计划管理人的原始权益人根据《信托合同》对万向信托-云龙 1 号事务管理类单一资金信托享有的信托受益权。

根据对应的《信托贷款合同》、《信托合同》，借款人株洲云龙新农村建设投资发展有限公司以其合法拥有的云龙示范区安置房建设项目未来销售收入作为基础资产的还款来源。根据北京盈科（长沙）律师事务所核查，云龙示范区安置房建设项目由 11 个子项目组成，包括响塘-三塔桥安置区（一期一批）、龙头安置区（一期）、龙升安置区（一期一批）、兴隆山安置区（一期）、太平桥安置区（一期）、大丰湖湘文化城安置区（一期）、大丰安置区（一期）、葛塘安置区（一期一批）、云田华强配套安置区（一批）、莲花安置区（一期）、五星榕树花园安置区。

本报告期内，云龙示范区安置房建设项目安置进度总体符合《关于建设株洲云龙示范区新农村安置房建设项目及其安置计划的说明》。2020 年 2 月至 2020 年 7 月，标的项目共完成安置面积约 2.27 万平方米，产生现金流 62,259,200.00 元，现金实际流入与现金流预测基本一致。

本报告期内，株洲云龙新农村建设投资发展有限公司收款账户实际归集至监管账户总额：人民币 62,259,200.00 元；监管账户实际划转至信托账户总额：人民币 9,087,534.25 元；信托账户实际划转至专项计划账户总额：人民币 8,789,688.44 元。

四、专项计划资产投资运作情况

根据《长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划说明书》的约定，在专项计划存续期内，管理人有权指示托管人将专项计划账户中待分配的资金根据《标准条款》的规定进行合格投资。本报告期内，专项计划账户内所有资金皆

用于投资于银行存款。

五、原始权益人经营情况

本报告期内,原始权益人株洲市云龙发展投资控股集团有限公司经营持续稳定,未发生不利变化。

六、原始权益人、管理人、托管人及相关服务机构履约情况

本报告期内,原始权益人株洲市云龙发展投资控股集团有限公司、计划管理人长城证券股份有限公司、托管人兴业银行股份有限公司、受托人万向信托有限公司均严格履行计划说明书及相关专项计划文件约定的职责和义务,不存在未依约履行的情况。

七、专项计划资金收支情况

1、专项计划账户资金流入情况

专项计划账户收款情况		到账时间	总金额	摘要
1		20200321	68,626.63	利息
2		20200621	211.38	利息
3	对手方户名:万向信托股份公司、 账号:368100100100923179	20200729	8,789,688.44	云龙1号事务 管理类收益分 配

2、专项计划账户资金支付情况

专项计划账户付款情况		交易日期	本期支出	摘要
1	对手方户名:中国证券登记结算有 限责任公司深圳分公司、账号: 4000023009027331643	20200213	144,715,827.43	GFPX116731
2	对手方户名:中国证券登记结算有 限责任公司深圳分公司、账号: 4000023009027331643	20200213	2,731,533.77	GFPX116732

3	对手方户名：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司、账号：4000023009027331643	20200213	4,851,530.12	GFPX116733
4	对手方户名：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司、账号：4000023009027331643	20200213	1,496,607.73	GFPX116734
5	对手方户名：天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）深圳分所、账号：4000053619100052770	20200417	20,000.00	支付 2019 年审 费
6	对手方户名：联合信用评级有限公司、账号：122903631810101	20200701	50,000.00	跟踪评级费

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
截至 2020 年 8 月 11 日余额 8,858,526.47 元	8,858,526.45	153,865,499.05	8,858,526.47	

八、资产支持证券本息兑付情况

本报告期内，按约定正常兑付资产支持证券本息，于 2020 年 2 月 17 日兑付“17 云龙 03”本金及收益 144,708,592.00 元，分配“17 云龙 04”收益 2,731,397.20 元，分配“17 云龙 05”收益 4,851,287.56 元，分配“17 云龙次”收益 1,496,532.90 元。

九、管理人以自有资金或者其管理的资产管理计划、其他客户资产、证券投资基金等认购资产支持证券的情况

本专项计划中，管理人未以自有资金或者其管理的资产管理计划、其他客户资产、证券投资基金等认购资产支持证券。

十、其他事项

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。

十一、备查文件

(一) 备查文件目录

- 1、《长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划标准条款》
- 2、《长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划资产支持证券认购协议》
- 3、《长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划信托受益权转让协议》
- 4、《长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划托管协议》
- 5、万向信托-云龙1号事务管理类单一资金信托信托文件
- 6、《北京盈科（长沙）律师事务所关于长城证券股份有限公司设立长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划之法律意见书》
- 7、《长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划资产支持证券信用评级报告》
- 8、《长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划现金流预测分析咨询报告书》
- 9、《长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划说明书》
- 10、管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 11、借款人的营业执照和公司章程
- 12、托管银行业务资格批件和营业执照

(二) 备查文件查阅地点：

深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 11 层

(三) 联系方式

管理人：长城证券股份有限公司

网站：www.cgws.com

电话：0755-83689472

传真：0755-83531612

地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 11 层

特此公告。

