

长城证券-天元保障房信托受益权资产支持专项计划 2020 年度托管报告

报告期：2020 年 01 月 01 日-2020 年 12 月 31 日

北京银行股份有限公司长沙分行
2021 年 04 月



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》《深圳证券交易所资产支持证券定期报告内容与格式指引》以及其他相关规定制作。本报告由托管人北京银行股份有限公司长沙分行负责编制，托管人保证本报告的内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并承担相应的法律责任。

托管人未发现报告期内管理人有严重违反相关规定或约定、损害资产支持证券投资者利益的情形。

年度托管报告中披露的相关信息不会对资产支持证券收益分配、证券投资价值判断和投资者权益产生重大不利影响。

年度托管报告中来源于托管人外的资产证券化业务其他参与机构的信息已经信息来源方复核，信息来源方包括潍坊银行股份有限公司、株洲市天元区保障住房开发建设有限公司，托管人已通过合理方式进行复核确认。

托管人已对年度资产管理报告有关数据的真实性、准确性、完整性进行复核，未发现其他需重要提示、风险提示的事项。

目录

重要提示.....	2
释义.....	4
第一节 报告期内履行职责和义务的情况.....	6
一、在报告期内专项计划资产托管过程中是否严格遵守了法律、法规规定和计划说明书、托管协议约定.....	6
二、在报告期内专项计划资产托管过程中是否勤勉尽责地履行托管职责和义务.....	6
三、在报告期内专项计划资产托管过程中是否安全保管专项计划相关资产.....	6
四、在报告期内专项计划资产托管过程中是否积极监督管理人对专项计划资产的运作.....	6
五、在报告期内专项计划资产托管过程中是否有损害资产支持证券投资者利益的行为.....	6
第二节 专项计划资产隔离情况.....	7
一、托管的专项计划资产是否独立于其自身固有财产和所托管的其他资产.....	7
二、托管的专项计划资产所产生的债权是否与其自身固有财产和所托管的其他资产产生的债务相抵销.....	7
第三节 监督管理人情况.....	8
一、报告期内是否认真复核管理人的每项管理指令.....	8
二、管理指令是否存在违反相关规定或计划说明书及托管协议约定的情形.....	8
三、管理指令是否存在损害资产支持证券投资者利益的情形.....	8
四、相关规定或约定的其他监督事项的执行情况.....	8
第四节 专项计划资金运用、处分情况.....	9
一、专项计划账户资金收支情况.....	9
二、专项计划投资管理情况.....	9
三、向金融机构等借款情况.....	9
四、专项计划账户资金运用、处分的其他情况.....	9

释义

释义项	指	释义内容
原始权益人/潍坊银行	指	潍坊银行股份有限公司
计划管理人/管理人/推广机构	指	根据《标准条款》担任计划管理人的长城证券股份有限公司，或根据《标准条款》任命的作为计划管理人的继任机构
受托人/贷款人/长安信托/信托公司	指	长安国际信托股份有限公司
借款人/出质人/差额补足人/保障房公司/天元保障房公司	指	株洲市天元区保障住房开发建设有限公司
连带责任保证人/保证人	指	湖南天易集团有限公司（以下简称“天易集团”）及/或株洲高科集团有限公司（以下简称“高科集团”）
账户资金监管银行/监管银行	指	根据《账户资金监管协议》担任监管银行的北京银行股份有限公司长沙分行，或根据该协议任命的作为监管银行的继任机构
托管银行/托管人/保管银行/保管人	指	根据《托管协议》担任托管银行，以及同时根据《资金保管合同》担任保管银行的北京银行股份有限公司长沙分行，或根据该协议任命的作为托管银行及保管银行的继任机构
登记托管机构/中证登深圳公司	指	中国证券登记结算有限公司深圳分公司
法律顾问	指	北京盈科（长沙）律师事务所
评级机构	指	联合信用评级有限公司
资产支持证券持有人	指	任何持有“资产支持证券”的投资者，包括“优先级资产支持证券持有人”和“次级资产支持证券持有人”
专项计划	指	根据《管理规定》及其他“法律”，由“计划管理人”设立的“长城证券-天元保障房信托受益权资产支持专项计划”
基础资产	指	由“原始权益人”在“专项计划成立日”转让给“计划管理人”的“原始权益人”根据《信托合同》享有的信托受益权
资产管理合同	指	“《标准条款》”、“《认购协议》”和“《计划说明书》”一同构成“计划管理人”与认购人之间的“资产管理合同”
《标准条款》	指	“计划管理人”为规范专项计划的设立和运作而制定的《长城证券-天元保障房信托受益权资产支持专项计划标准条款》及对其任何有效的修订和补充
《计划说明书》	指	《长城证券-天元保障房信托受益权资产支持专项计划计划说明书》
《信托受益权买卖协议》	指	“原始权益人”与“计划管理人”签署的“《长城证券-天元保障房信托受益权资产支持专项计划信托受益权转让协议》”及对该协议的任何修改或补充
《托管协议》	指	“计划管理人”与“托管银行”签署的“《长城证券-天元保障房信托受益权资产支持专项计划托管协议》”及对该协议的任何修改或补充

长城证券-天元保障房信托受益权资产支持专项计划 2020 年度托管报告

《差额补足承诺函》	指	“差额补足人”向“计划管理人”出具的“《长城证券-天元保障房信托受益权资产支持专项计划差额补足承诺函》”及对该承诺函的任何修改或补充
《保证合同》	指	“连带责任保证人”与“计划管理人”签订的“《长城证券-天元保障房信托受益权资产支持专项计划保证合同》”及对该合同的任何修改或补充

第一节 报告期内履行职责和义务的情况

一、在报告期内专项计划资产托管过程中是否严格遵守了法律、法规规定和计划说明书、托管协议约定

☒是 ☐否

二、在报告期内专项计划资产托管过程中是否勤勉尽责地履行托管职责和义务

☒是 ☐否

三、在报告期内专项计划资产托管过程中是否安全保管专项计划相关资产

☒是 ☐否

四、在报告期内专项计划资产托管过程中是否积极监督管理人对专项计划资产的运作

☒是 ☐否

五、在报告期内专项计划资产托管过程中是否有损害资产支持证券投资者利益的行为

☐是 ☒否

第二节 专项计划资产隔离情况

一、托管的专项计划资产是否独立于其自身固有财产和所托管的其他资产

☒是 ☐否

二、托管的专项计划资产所产生的债权是否与其自身固有财产和所托管的其他资产产生的债务相抵销

☐是 ☒否



第三节 监督管理人情况

一、报告期内是否认真复核管理人的每项管理指令

☒是 ☐否

二、管理指令是否存在违反相关规定或计划说明书及托管协议约定的情形

☐是 ☒否

三、管理指令是否存在损害资产支持证券投资者利益的情形

☐是 ☒否

四、相关规定或约定的其他监督事项的执行情况

☐适用 ☒不适用

第四节 专项计划资金运用、处分情况

一、专项计划账户资金收支情况

单位：万元 币种：人民币

收支日期	收支金额	收入来源	支出用途	支出用于分配的 证券代码	备注
报告期初余额	2.73				
2020 年 04 月 03 日	524.18	信托收益分配			
2020 年 04 月 16 日	183.39		18 天元 03 利息	116836	
2020 年 04 月 16 日	123.64		18 天元 04 利息	116837	
2020 年 04 月 16 日	104.54		18 天元 05 利息	116838	
2020 年 04 月 30 日	17.1		专项计划增值税		
2020 年 05 月 06 日	1.5		专项计划审计费用		
2020 年 06 月 21 日	0.27	结息			
2020 年 07 月 16 日	5		专项计划跟踪评级费用		
2020 年 09 月 28 日	5,993.67	信托收益分配			
2020 年 10 月 15 日	5,683.66		18 天元 03 本息	116836	
2020 年 10 月 15 日	123.64		18 天元 04 利息	116837	
2020 年 10 月 15 日	173.99		18 天元次利息	116839	
2020 年 10 月 15 日	104.54		18 天元 05 利息	116838	
2020 年 12 月 21 日	2.08	结息			
报告期末余额	2.09				

二、专项计划投资管理情况

☐ 适用 ☒ 不适用

三、向金融机构等借款情况

☐ 适用 ☒ 不适用

四、专项计划账户资金运用、处分的其他情况

专项计划资金用于购买信托受益权，无其他运用、处分情况。

(本页无正文，为《长城证券-天元保障房信托受益权资产支持专项计划 2020 年度托管报告》盖章页)

