长城证券-天元保障房信托受益权资产支持专项计划 2021 年第二期托管报告

报告期间： 2021 年 4 月 7 日- 2021 年 10 月 12 日

长城证券股份有限公司：

鉴于贵公司作为管理人，我行作为托管人，据双方签订的《长城证券-天元保障房信托受益权资产支持专项计划托管协议》的要求，本着诚信、尽职、规范的原则，我行切实履行托管人的权利和义务，并对长城证券-天元保障房信托受益权资产支持专项计划（以下简称"专项计划"）的专项计划资金进行托管，现将报告期间的托管情况说明如下：

一、 专项计划资金托管情况

1、本专项计划于 2018 年 2 月 9 日成立，共募集 3.5 亿元人民币。

2、管理人当日根据《基础资产买卖协议》、《标准条款》等专项计划文件的约定，于专项计划设立日向原始权益人支付初始基础资产的购买价款，专项计划设立日的初始基础资产购买价款为专项计划募集资金金额，即人民币 3.5 亿元。

3、本报告期内，基础资产现金流回流金额为 44,279,100.0 元，监管账户支付信托借款本金及利息金额为 39,647,780.82 元，信托账户向专项计划账户分配本金及收益金额为 39,515,134.25 元，截至 2021 年 9 月 30 日，专项计划账户资金余额为 40,597,049.46 元。

二、 对管理人的监督情况

1、本期，我行依据《托管协议》的规定，监督并记录了贵司关于"专项计划"账户的资金划拨情况，账户内的资金划付流程均与《计划说明书》、《托管协议》等专项计划文件的规定相符，我行认为贵司无违反协议规定的资金拨付指令。

2、我行与贵司进行了托管账户余额和相关科目的核对。

3、我行对资产管理报告有关数据的真实性、准确性、完整性已进行复核。

三、 其他情况说明（如有）

无。

（以下无正文，接签章页）

（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 2021 年第二期托管报告》之签章页）

北京银行股份有限公司长沙分行（签章）

2021 年 10 月 12 日