

长城证券-天元保障房信托受益权资产支持专项计划

2021 年度第二期资产管理报告

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

一、 重要提示

本报告依据《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《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的数据由北京银行股份有限公司提供并确认。

长城证券-天元保障房信托受益权资产支持专项计划于 2018 年 2 月 9 日正式成立。

报告期间：自 2021 年 4 月 7 日起至 2021 年 10 月 12 日。

二、 专项资产管理计划产品概况

证券分层	优先级					次级
	18 天元 01	18 天元 02	18 天元 03	18 天元 04	18 天元 05	18 天元次
规模 (万元)	9,900	6,000	5,500	3,600	3,000	7,000
规模占比	28.29%	17.14%	15.71%	10.29%	8.57%	20.00%
发行利率	6.20%	6.40%	6.65%	6.85%	6.95%	无
信用评级	AA+	AA+	AA+	AA+	AA+	无
存续期	0.69 年	1.69 年	2.69 年	3.69 年	4.69 年	4.69 年
起息日	2018/2/9	2018/2/9	2018/2/9	2018/2/9	2018/2/9	2018/2/9
到期日	2018/10/18	2019/10/18	2020/10/18	2021/10/18	2022/10/18	2022/10/18
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
付息方式	半年付息	半年付息	半年付息	半年付息	半年付息	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	每个预期到期日对应的兑付日分配剩余专项计划资产
--------	--------	--------	--------	--------	--------	-------------------------

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》对长安宁-天元基建贷款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》，借款人株洲市天元区保障住房开发建设有限公司以其合法拥有的天元区保障房建设项目未来销售收入作为基础资产的还款来源。该项目由3个子项目组成，包括安泰安置小区二期、泉源安置小区一期、兴湖家园二期安置区。

本报告期内，株洲市天元区保障住房开发建设有限公司实际归集至监管账户总额：人民币 44,279,100.00 元；监管账户实际划转至信托账户人民币 39,647,780.82 元；信托账户实际划转至专项计划账户总额 39,515,134.25 元。

四、 专项计划资产投资运作情况

根据《长城证券-天元保障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，原始权益人潍坊银行股份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，原始权益人潍坊银行股份有限公司、计划管理人长城证券股份有限公司、托管人北京银行股份有限公司、受托人长安国际信托股份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、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44,279,100.00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。

八、 资产支持证券本息兑付情况

2018年4月18日，本期资产支持专项计划完成第一次付息，无本金兑付；2018年10月18日，本期资产支持专项计划完成第二次付息，并兑付18天元01本金；2019年4月18日，本期资产支持专项计划完成第三次付息，无本金兑付；2019年10月18日，本期资产支持专项计划完成第四次付息，并兑付18天元02本金；2020年4月18日，本期资产支持专项计划完成第五次付息，无本金兑付；2020年10月18日，本期资产支持专项计划完成第六次付息，并兑付18天元03本金；2021年4月18日，本期资产支持专项计划完成第七次付息，无本金兑付。

公告链接地址：

http://www.cgws.com/cczq/ccyw/zcgl/cplb/zxlc/kxwy_6063/cpgg/。

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，借款人进行资金归集时，由于经办人员操作失误，将归集资金直接由一般账户归集到监管账户，未通过收款账户进行归集。本次归集过程中账

户误用，未造成归集资金的减少、截留、挪用或占用，未对专项计划投资人权益产生重大不利影响。

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-天元保障房信托受益权资产支持专项计划标准条款》
- 2、《长城证券-天元保障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-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》
- 4、《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》
- 5、长安宁-天元基建贷款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-天元保障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-天元保障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、《关于株洲市天元区保障住房开发建设有限公司长城证券-天元保障房信托受益权资产支持专项计划现金流量预测专项意见》
- 9、《长城证券-天元保障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:

北京市西城区西直门外大街 112 号阳光大厦 8 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：010-88366062

传真：010-88366650

地址：北京市西城区西直门外大街 112 号阳光大厦 8 层

特此公告。

(以下无正文，接盖章页)

(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 年度第二期资产管理报告之盖章页》)

