

平安汇通-平安金融大厦资产管理费 资产支持专项计划 2018 年下半年度管理报告

(报告期间: 2018 年 6 月 29 日至 2018 年 12 月 28 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》、《上海证券交易所资产证券化业务指引》(2014 年修订)及其他相关规定制作。

本报告托管账户数据由平安汇通-平安金融大厦资产管理费资产支持专项计划托管银行提供并确认。专项计划基础资产运营情况数据由原始权益人平安不动产有限公司(以下简称“不动产”)提供并确认。

本报告期起止时间: 2018 年 6 月 29 日至 2018 年 12 月 28 日。

二、专项计划概况

(一) 基本情况

本专项计划已于 2017 年 6 月 9 日成立,自成立日起,管理人深圳平安大华汇通财富管理有限公司正式开始管理本专项计划。

优先级资产支持证券	发行规模(万元)	信用评级	期限(月)	预期到期日	还本付息安排
不动产 01	7,100	AAA	7	2017-12-31	按半年付息,到期还本。
不动产 02	8,100	AAA	19	2018-12-31	
不动产 03	8,300	AAA	31	2019-12-31	
不动产 04	6,500	AAA	43	2020-12-31	
合计	30,000				

(二) 增信安排

1、基础资产超额现金流覆盖

专项计划采用了基础资产超额现金流覆盖的信用增级方式。根据会计师的测算,基础资产每期产生的现金流入均大于当期资产支持证券预期应付本息的 1.06-1.44 倍,5 倍压力测试结果显示当期资产支持证券预期支付额的覆盖倍数

仍大于1，能够为资产支持证券提供信用支持。

2、原始权益人差额支付承诺

根据原始权益人出具的《差额支付承诺函》，原始权益人对专项计划资金根据《标准条款》不足以支付资产支持证券的各期预期收益和全部未偿本金余额的差额部分承担补足义务。

(三) 管理人

深圳平安大华汇通财富管理有限公司

(四) 托管人

招商银行深圳分行

(五) 资产支持证券的登记及转让

1、专项计划存续期内，资产支持证券将在中国证券登记结算有限公司上海分公司登记。

2、专项计划存续期内，优先级资产支持证券将在上海证券交易所综合协议交易平台进行转让。

三、原始权益人、管理人和托管人等资产证券化业务参与人的履约情况

本报告期内，原始权益人、管理人和托管人等资产证券化业务参与人均按《计划说明书》、《标准条款》、《托管协议》、等履行相关约定，未发生违约事件。

四、特定原始权益人的经营情况

根据原始权益人提供的财务报表，平安不动产有限公司生产经营正常，2018年第三季度原始权益人主要经营指标如下：

单位：万元

	2018.9.30	2017	2016
总资产	7,665,493.56	6,007,357.82	5,168,746.37
净资产	2,436,255.96	2,302,928.55	2,148,927.13
营业收入	134,848.16	209,558.83	145,347.21
净利润	158,451.10	133,805.58	109,564.30

五、专项计划账户资金收支情况及收益分配情况

本报告期内，本专项计划账户共有一笔基础资产现金流回款，共 92,041,923.58 元。专项计划将于 2018 年 12 月 31 日（遇节假日顺延至 2019 年 1 月 2 日）进行了第三次兑付，此次兑付后不动产 02 本金兑付完毕。

六、其他事项

1、本报告期内原始权益人持续经营，未发送违反合同约定的损害基础资产及其收益的情况；

2、本报告期内专项计划管理人、托管人、评级机构未发生变更；

3、本报告期内专项计划资产支持证券的信用评级未发生变化。

七、备查文件目录

- 1、《平安汇通-平安金融大厦资产管理费资产支持专项计划_计划说明书》
- 2、《平安汇通-平安金融大厦资产管理费资产支持专项计划_标准条款》
- 3、《平安汇通-平安金融大厦资产管理费资产支持专项计划_资产买卖协议》
- 4、《平安汇通-平安金融大厦资产管理费资产支持专项计划_资产支持证券认购协议及风险揭示书》
- 5、《平安不动产有限公司关于平安汇通-平安金融大厦资产管理费资产支持专项计划_差额支付承诺函》
- 6、《平安汇通-平安金融大厦资产管理费资产支持专项计划_托管协议》
- 7、《平安汇通-平安金融大厦资产管理费资产支持专项计划_服务协议》
- 8、《平安汇通-平安金融大厦资产管理费资产支持专项计划_法律意见书》
- 9、《平安汇通-平安金融大厦资产管理费资产支持专项计划_资产支持证券信用评级报告》
- 10、《平安汇通-平安金融大厦资产管理费资产支持专项计划_现金流预测分析报告》
- 11、《平安不动产有限公司关于基础资产及其转让安排真实性、合法性的承诺函》

- 12、 《平安不动产有限公司关于资产支持证券赎回承诺函》
- 13、 计划管理人的业务资格批件、营业执照和公司章程
- 14、 原始权益人的营业执照和公司章程
- 15、 重要债务人的营业执照和公司章程
- 16、 托管人的业务资格批件和营业执照

八、信息披露的查阅方式

深圳平安大华汇通财富管理有限公司

联系地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 31 层

联系人：王名伦、沈荣

联系电话：0755-22620854

传真：0755-23997878

深圳平安大华汇通财富管理有限公司

2018 年 12 月 28 日

