

# 平安汇通-平安金融大厦资产管理费资产支持 专项计划 2017 年度管理报告

(报告期间: 2017 年 6 月 9 日至 2017 年 12 月 31 日)

管理人: 深圳平安大华汇通财富管理有限公司

原始权益人: 平安不动产有限公司

2018 年 4 月 24 日

## 重要提示

本报告依据中国证监会《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》以及其他相关规定制作。本报告由管理人深圳平安大华汇通财富管理有限公司负责编制,管理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。

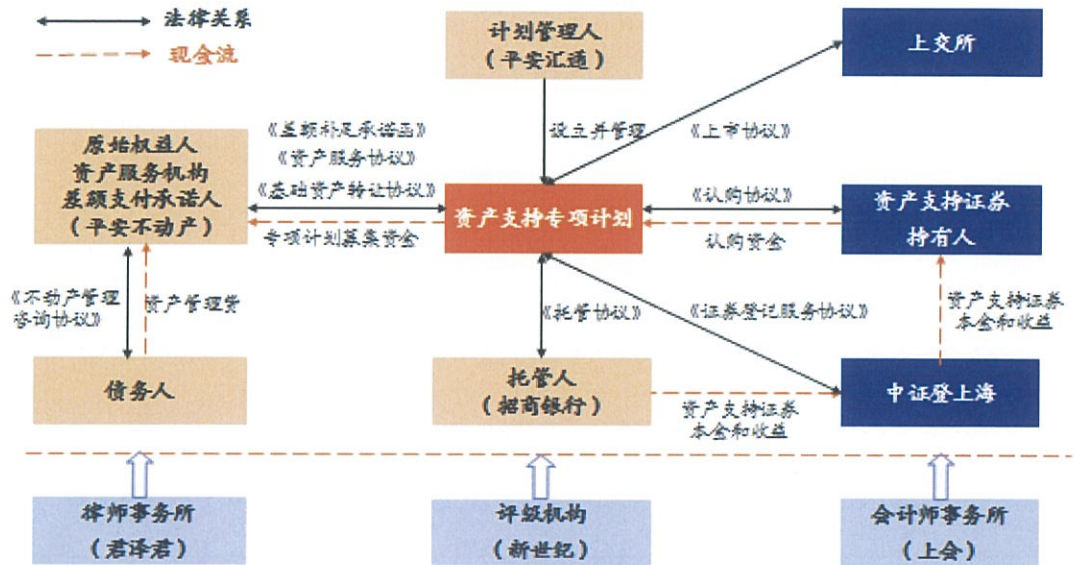
本报告托管账户数据由平安汇通-平安金融大厦资产管理费资产支持专项计划托管银行提供并确认,且与托管报告相应内容一致。专项计划基础资产运营情况数据由原始权益人平安不动产有限公司(以下简称“平安不动产”)提供并确认。以上信息管理人已进行核对并与相应参与机构确认。

## 目录

重要提示 .....	2
一、 专项计划基本情况 .....	4
未来收益分配安排如下: .....	5
二、 基础资产运行情况 .....	5
三、 底层回款情况 .....	6
四、 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.....	6
五、 专项计划资产隔离情况 .....	6
六、 底层物业运营情况 .....	7
七、 特定原始权益人的经营情况 .....	7
八、 专项计划账户投资运作情况 .....	8
九、 收益分配及本金偿还情况 (如有) .....	9
十、 计划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 .....	9
十一、 具备从事证券期货相关业务资格的会计师事务所对专项计划年度运行情况出具的 审计意见 .....	10
十二、 其他事项 .....	10
十三、 备查文件目录 .....	10
十四、 信息披露的查阅方式 .....	11

## 一、 专项计划基本情况

平安汇通-平安金融大厦资产管理费资产支持专项计划（以下简称“本专项计划”）成立于2017年6月9日，交易结构如下：



本专项计划的基础资产为由原始权益人在专项计划设立日转让给计划管理人的、原始权益人依据管理咨询合同自基准日（含该日）起对债务人享有的资产管理费债权及其他权利。

本专项计划的原始权益人/差额支付承诺人为平安不动产，原始权益人对专项计划资金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。

本专项计划通过上海证券交易所固定收益平台转让，登记机构为中国证券登记结算有限公司上海分公司

各档资产支持证券详细信息如下：

证券名称	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				

未来收益分配安排如下：

兑付日期	不动产 01 本金兑付比例	不动产 02 本金兑付比例	不动产 03 本金兑付比例	不动产 04 本金兑付比例
2017/12/31	100.00%	\	\	\
2018/12/31	\	100%	\	\
2019/12/31	\	\	100%	\
2020/12/31	\	\	\	100%
合计	100.00%	100.00%	100.00%	100.00%

## 二、基础资产运行情况

### 1、基础资产回款情况

自专项计划设立日（含该日）起，正常情况下，资产服务机构应于专项计划存续期内每个“兑付日”前的第 7 个工作日（遇法定节假日顺延至下一个工作日）将基础资产回收款转付至专项计划账户。

（1）截至 2017 年 12 月 31 日，基础资产回款情况如下：

单位：元/份

期初应收资产管理费余额	391,838,527.20
当期应收资产管理费回款	97,959,631.80
期末应收资产管理费余额	293,878,895.40

期初尚未到期的合同数	7
当期终止的合同数	0
期末尚未终止的合同数	7

(2) 期初基础资产按实际发生数:

期初应收资产管理费余额	391,838,527.20
当期核销资产管理费	0
当期核销正常回收当期应收资产管理费	0
当期核销收回以前期应收资产管理费	0
当期核销收回下期应收资产管理费	0
当期核销的坏账	0
可列入现金流回款的其他款项	0
期末应收资产管理费余额	293,878,895.40
当期收到的现金流回款	97,959,631.80
期初尚未终止的合同数	7
当期终止的合同数	0
期末尚未终止的合同数	7

(3) 逾期资产管理费明细

本报告期内无逾期资产管理费。

## 2、与基础资产相关的资产运营状况及重大事项变化等

2017年度内未发生与基础资产运营相关的重大事项。

## 3、可能影响基础资产现金流的因素

可能影响基础资产现金流的因素包括：原始权益人破产或持续经营能力下降、原始权益人和差额支付承诺人信用风险、基础资产对应的债务过于集中的风险、债务人更换资产管理服务机构的风险、基础资产现金流不足风险、现金流预测风险、现金流混同风险等。

上述风险因素均在专项计划之《计划说明书》、《风险揭示书》中详细披露。报告期内未出现上述风险事件。

## 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》、《监管协议》等履行相关约定，未发生违约事件。

## 四、专项计划资产隔离情况

计划管理人在托管银行处设立专项计划账户，自专项计划设立日起，对专项计划单独记账、独立核算，专项计划账户独立于原始权益人收款账户和其他账户，保证了基础资产独立于原始权益人的其他资产。

## 五、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，平安不动产生生产经营正常，

2017 年度审计报告，原始权益人主要经营指标如下：

单位：万元

	2017	2016
总资产	6,007,357.82	5,168,746.37
净资产	2,302,928.55	2,148,927.13
营业收入	209,558.83	145,347.21
净利润	133,805.58	109,564.30

截至 2017 年年底，原始权益人总资产同比增长 16.22%，净资产同比增长 7.17%，营业收入同比增长 44.18%，净利润同比增长 22.13%。

## 六、 专项计划账户投资运作情况

根据计划说明书的约定，本专项计划存续期间，除向原始权益人购买基础资产和支付专项计划费用外，专项计划账户资金可以投资于银行存款、大额存单、货币市场基金、短期融资券、期限在一年以下（含一年）的商业银行理财计划、专项资产管理计划、定向资产管理计划、信托计划、委托贷款以及证监会认可的其他风险低、变现能力强的固定收益类产品等方式投资。无论投资于任何产品，计划管理人应确保变现时间不影响每一期的分配、且投资收益归属于专项计划。

以下为托管账户运作情况：

交易日	收	支	余额	摘要
2017/6/9	300,000,000.00		300,000,000.00	
2017/6/9		300,000,000.00	-	
2017/6/21	3,906,437.23 <sup>1</sup>		3,906,437.23	不动产管理费

<sup>1</sup> 包括 300 万元管理人的管理费收入，在收益分配日付给管理人



				金额归集
2017/6/30		253,067.00	3,653,370.23	146134 不动产 03 兑息
2017/6/30		2,589.04	3,650,781.19	托管费
2017/6/30		200,070.00	3,450,711.19	146135 不动产 04 兑息
2017/6/30		242,352.00	3,208,359.19	146133 不动产 02 兑息
2017/6/30		208,314.00	3,000,045.19	146132 不动产 01 兑息
2017/6/30		283,200.00	2,716,845.19	风险准备金
2017/6/30		2,716,800.00	45.19	管理费
2017/7/7		15.00	30.19	批量扣费
2017/9/21	703.21		733.40	利息
2017/9/21		254.34	479.06	账户管理费
2017/12/21	0.87		479.93	利息
2017/12/21	97,053,194.57		97,053,674.50	不动产管理费 金额归集
2017/12/27		2,218,704.88	94,834,969.62	146134 不动产 03 兑息
2017/12/27		22,684.93	94,812,284.69	托管费
2017/12/27		72,829,051.27	21,983,233.42	146132 不动产 01 兑付本息
2017/12/27		2,124,440.17	19,858,793.25	146133 不动产 02 兑息
2017/12/27		1,753,137.65	18,105,655.60	146135 不动产 04 兑息
2017/12/28		18,000,000.00	105,655.60	购买货币基金管 家

本报告期内，专项计划账户内收到基础资产现金流回款 97,959,631.80 元，取得银行存款利息 704.08 元，取得理财收益 0 元；支付专项计划资产支持证券投资者本息合计 79,829,136.97 元，申购货币基金 18,000,000.00 元，支付管理费 300 万元，支付托管费 25,273.97 元。截止到 2017 年 12 月 31 日，专项计划账户余额为 105,655.60 元。

## 七、收益分配及本金偿还情况（如有）

根据专项计划《计划说明书》等文件的约定，专项计划成立后每季度付息，到期还本。截至 2017 年 12 月 31 日，共进行 2 次兑付，兑付优先级本金 7,100 万元，利息 882.32 万元。

#### **八、 计划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**

本专项计划认购资金中，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的情况。

#### **九、 专项计划特殊条款**

本专项计划设置了回售和赎回安排，原始权益人承诺若在专项计划存续期间发生管理咨询合同未续订的情形，原始权益人将按照《赎回承诺函》的约定赎回全部剩余未到期资产支持证券。

截至报告期末，未发现以上情形。

#### **十、 具备从事证券期货相关业务资格的会计师事务所对专项计划年度运行情况出具的审计意见**

平安汇通-平安金融大厦资产管理费资产支持专项计划财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》及中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的资产证券化业务实务操作的有关规定编制，公允反映了本专项计划 2017 年 12 月 31 日的财务状况及 2017 年度的经营成果和所有者权益变动情况。

## 十一、 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。

## 十二、 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\_标准条款》
2. 《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》
3. 《平安汇通-平安金融大厦资产管理费资产支持专项计划\_资产支持证券认购协议及风险揭示书》
4. 《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》
5. 《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》
6. 《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》
7. 《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》
8. 《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》

9. 《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》
10. 《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》
11. 《平安不动产有限公司关于资产支持证券赎回承诺函》
12. 计划管理人的业务资格批件、营业执照和公司章程
13. 原始权益人的营业执照和公司章程
14. 重要债务人的营业执照和公司章程

### 十三、 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 号平安金融大厦 31 楼

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4月24日

