

中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划

2017 年年度资产管理报告

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》、中国证券投资基金业协会出具的《资产支持专项计划备案确认函》及其他有关规定制作。

本报告中关于中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划基础资产数据由资产服务机构中建投信托有限责任公司提供,专项计划账户的数据由托管银行浙商银行股份有限公司提供。

中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划于 2017 年 01 月 11 日成立。

报告期间: 2017 年 01 月 11 日至 2017 年 12 月 31 日

二、专项计划基本情况

1、资产支持证券概况

产品全称	中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划优先 A 级资产支持证券	中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划优先 B 级资产支持证券	中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划次级资产支持证券
证券简称	PR 投 1A	PR 投 1B	PR 投次
证券代码	142621	142622	142623
发行量 (亿元)	1.60	1.82	0.151
期限 (天)	321	594	594
计划起息日	2017/1/11	2017/1/11	2017/1/11
到期日	2017/11/28	2018/8/28	2018/8/28

年收益率 (%)	4.95	6.50	N/A
利息种类	付息式固定利率	付息式固定利率	N/A
付息方式	2017 年 2 月、5 月、8 月、11 月及提前兑付日付息	2017 年 2 月、5 月、8 月、11 月、2018 年 2 月、8 月及提前兑付日付息	到期获得所有剩余收益
发行价格 (元)	100	100	100
信用等级	AAA	AA	N/A
信用等级评定单位	联合信用评级有限公司	联合信用评级有限公司	N/A
专项计划计划备案日	2017 年 1 月 19 日	2017 年 1 月 19 日	2017 年 1 月 19 日
管理人	北京方正富邦创融资产管理有限公司		
托管银行	浙商银行股份有限公司		
登记机构	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司		

2、专项计划收益分配情况

根据《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划说明书》的约定，本专项计划优先级资产支持证券投资者获得分配本金的具体情况如下表所示：

兑付日期	中建投1A 本金兑付比例	中建投1B 本金兑付比例	中建投次 本金兑付比例
2017年2月9日	35.95%	0	0
2017年2月17日	3.47%	0	0
2017年2月28日	0.00%	0	0
2017年4月20日	33.54%	0	0
2017年5月31日	27.04%	2.74%	0
2017年8月28日	0	29.06%	0
2017年11月28日	0	52.29%	0
2018年2月28日	0	15.91%	100%
合计	100%	100%	100%

本报告期内，共有 7 次收益分配，各档次资产支持证券本息兑付情况：

单位：元

兑付日期	中建投1A 收益兑付	中建投1B 收益兑付	中建投次 收益兑付
2017年2月9日	624,000.00	946,400.00	0
2017年2月17日	112,000.00	254,800.00	0
2017年2月28日	144,000.00	364,000.00	0
2017年4月20日	672,000.00	1,656,200.00	0
2017年5月31日	224,000.00	1,237,600.00	0
2017年8月28日	0	2,893,800.00	0
2017年11月28日	0	2,038,400.00	0
合计	1,776,000.00	9,391,200.00	0

单位：元

兑付日期	中建投1A 本金兑付	中建投1B 本金兑付	中建投次 本金兑付
2017年2月9日	57,520,000.00	0	0
2017年2月17日	5,552,000.00	0	0
2017年2月28日	0	0	0
2017年4月20日	53,664,000.00	0	0
2017年5月31日	43,264,000.00	4,986,800.00	0
2017年8月28日	0	52,889,200.00	0
2017年11月28日	0	95,167,800.00	0
合计	160,000,000.00	153,043,800.00	0

详细情况请参考《北京方正富邦创融资产管理有限公司关于中建投集合信托受益权1号资产支持专项计划第1、2、3、4、5、6、7期收益分配的公告》。

三、基础资产运行情况

(一) 基础资产回收统计

单位：元，个

当期收到信托本金	357,100,000.00
- 当期正常回收的信托本金	246,500,000.00
- 当期回收以前期应收信托本金	0
- 当期回收下期应收信托本金	0
- 当期回收的提前还款中的相应信托本金	110,600,000.00

可列入信托本金的其他款项	0
当期收到的信托收益回收款	20,237,625.64
期初尚未终止的合同数	8
当期终止的合同数	8
期末尚未终止的合同数	0

(二) 期末信托利益逾期情况

	期初应收信托利益余额	期末应收信托利益余额	占比	合同数	占比
逾期 1-7 日(含)	无	无	无	无	无
逾期 7-14 日(含)	无	无	无	无	无
逾期 14 日-20 日(含)	无	无	无	无	无
逾期 20 日-30 日(含)	无	无	无	无	无
逾期 30-90 日(含)	无	无	无	无	无
逾期 90-180 日个月(含)	无	无	无	无	无
逾期 180 日以上	无	无	无	无	无

(三) 逾期信托利益明细

项目编号	项目名称	信托利益分配日	应分配信托利益金额	实际分配日	实际分配信托利益金额	逾期原因	期末逾期金额
无	无	无	无	无	无	无	无

(四) 合同变更明细

项目编号	项目名称	合同变更日	变更内容	变更原因	其他说明
无	无	无	无	无	无

(五) 诉讼/仲裁进展情况

项目编号	项目名称	应分配信托利益金额	诉讼/仲裁进展情况
无	无	无	无

(六) 不合格基础资产的赎回

被赎回基础资产的受托人名称	被赎回基础资产对应基础债权的债务人名称	赎回时间	被赎回基础资产的未偿价款余额	赎回原因
无	无	无	无	无
合计	无	无	无	无

四、专项计划资金收支情况

日期	摘要	本期收入	本期支出	余额
2017.01.11	投资款中建投1号ABS 募集转托管	357,100,000.00	-	357,100,000.00
2017.01.11	收益转让权-中建投信 托	-	357,100,000.00	0
2017.01.20	海亮租赁项目向受益人 分配本金及收益	2,517,013.89	-	2,517,013.89
2017.01.22	众富控股终止分配	54,868,220.0	-	57,385,233.89
2017.01.23	融禾信托利益	407,534.25	-	57,792,768.14
2017.01.24	天易收益分配	17,472.22	-	57,810,240.36
2017.01.25	荣盛花语城信托利益分 配	507,534.25	-	58,317,774.61
2017.02.06	募集期利息与信托分配 及本金返还	6,599,547.95	-	64,917,322.56
2017.02.06	中南建设项目分配信托 收益	518,219.18	-	65,435,541.74
2017.02.06	中南建设项目分配信托 收益	279,041.10	-	65,714,582.84
2017.02.08	收益分配 兴业银行基 金托管专户	-	3,634,000.00	62,080,582.84
2017.02.08	收益分配 长城证券股 份有限公司（龙江银行 1号）	-	3,634,000.00	58,446,582.84
2017.02.08	收益分配 兴业银行基 金托管专户	-	32,706,000.00	25,740,582.84
2017.02.08	收益分配 “薪满益足” 人民币理财计划	-	18,170,000.00	7,570,582.84
2017.02.08	收益分配 长城证券股 份有限公司（龙江银行 1号）	-	104,000.00	7,466,582.84
2017.02.08	收益分配 长城证券股 份有限公司（龙江银行 1号）	-	520,000.00	6,946,582.84
2017.02.08	收益分配 长城证券股 份有限公司（龙江银行 1号）	-	322,400.00	6,624,182.84
2017.02.16	“142621 中建投1A” 证券登记费	-	1,600.00	6,622,582.84
2017.02.16	“142622 中建投1B”证 券登记费	-	3,640.00	6,618,942.84

2017.02.16	“142623 中建投次”证 券登记费	-	302.00	6,618,640.84
2017.02.17	收益分配 长城长益集 合资产管理计划	-	354,000.00	6,264,640.84
2017.02.17	收益分配 长城证券股 份有限公司（龙江银行 1号）	-	354,000.00	5,910,640.84
2017.02.17	收益分配 兴业银行基 金托管专户	-	3,186,000.00	2,724,640.84
2017.02.17	收益分配 “薪满益足” 人民币理财计划	-	1,770,000.00	954,640.84
2017.02.17	收益分配 长城证券股 份有限公司（龙江银行 1号）	-	28,000.00	926,640.84
2017.02.17	收益分配 光大保德-益 民1号资产管理计划	-	140,000.00	786,640.84
2017.02.17	收益分配-中建投信托 有限责任公司	-	86,800.00	699,840.84
2017.02.23	收益分配		508,000.00	191,840.84
2017.02.23	142621、142622 支付 2017年2月28日代理 兑息费		25.40	191,815.44
2017.03.02	代垫管理费	556,569.86		748,385.30
2017.03.07	风险准备金-北京方正 富邦创融资产管理有限 公司		52,540.20	695,845.10
2017.03.07	支付托管费		9,392.22	686,452.88
2017.03.07	法律服务费-北京金杜 律师事务所上海分所		120,000.00	566,452.88
2017.03.07	支付管理费-北京方正 富邦创融资产管理有限 公司		504,029.66	62,423.22
2017.03.09	资产服务费-中建投信 托有限责任公司		46,961.10	15,462.12
2017.03.15	成都新益州受益人分配	2,843,506.85		2,858,968.97
2017.03.21	对公普通活期按季结息	10,651.01		2,869,619.98
2017.03.27	往来结算款中建投1号 募集转托管	7,142.00		2,876,761.98
2017.03.27	收益分配		602.78	2,876,159.20
2017.03.27	收益分配		875.00	2,875,284.20
2017.03.27	收益分配 长城证券股 份有限公司（龙江银行 1号）		97.22	2,875,186.98

2017.03.27	收益分配 长城长益集合资产管理计划		97.22	2,875,089.76
2017.03.27	收益分配 光大保德-益民1号资产管理计划		972.22	2,874,117.54
2017.03.27	收益分配		146.81	2,873,970.73
2017.03.27	收益分配 “薪满益足”人民币理财计划		486.11	2,873,484.62
2017.03.27	收益分配 长城证券股份有限公司（龙江银行1号）		194.44	2,873,290.18
2017.03.30	财顾费	2,350,430.14		5,223,720.32
2017.04.06	锦江环城分配收益及返还本金	51,926,388.89		57,150,109.21
2017.04.10	中南建设项目分配信托收益	1,195,890.41		58,345,999.62
2017.04.20	收益分配 “薪满益足”人民币理财计划		16,980,000.00	41,365,999.62
2017.04.20	收益分配-博时资本长江2号专项资产管理计划		18,200.00	41,347,799.62
2017.04.20	收益分配		30,564,000.00	10,783,799.62
2017.04.20	收益分配 长城长益集合资产管理计划		3,396,000.00	7,387,799.62
2017.04.20	收益分配 光大保德-益民1号资产管理计划		910,000.00	6,477,799.62
2017.04.20	收益分配 长城证券股份有限公司（龙江银行1号）		3,396,000.00	3,081,799.62
2017.04.20	收益分配 长城证券股份有限公司（龙江银行1号）		182,000.00	2,899,799.62
2017.04.20	收益分配 中航信托股份有限公司		546,000.00	2,353,799.62
2017.04.24	天易收益分配	21,250.00		2,375,049.62
2017.04.26	财务顾问费-华菁证券有限公司		2,350,430.14	24,619.48
2017.05.08	分配信托收益	50,345,479.45		50,370,098.93
2017.05.24	优先级A收益分配+兑付兑息		43,490,174.40	6,879,924.53
2017.05.24	优先级B收益分配+兑付兑息		6,224,711.22	655,213.31
2017.05.31	向中建投信托返还其垫付的管理费		556,569.86	98,643.45

2017.05.31	支付托管费		14,338.90	84,304.55
2017.05.31	支付资产服务机构费		71,694.50	12,610.05
2017.06.16	收益到账	2,119,178.08		2,131,788.13
2017.06.21	银行结息	16,627.85		2,148,415.98
2017.06.21	收益到账	2,368,493.15		4,516,909.13
2017.07.17	荣盛花语城信托利益分配	50,338,356.16		54,855,265.29
2017.07.24	天易收益分配	1,021,486.11		55,876,751.40
2017.08.23	优先级 B 收益分配+兑付兑息		55,785,789.15	90,962.25
2017.08.28	支付托管费		9,684.61	81,277.64
2017.08.28	支付资产服务机构费		48,423.05	32,854.59
2017.09.18	收益分配及返还部分本金（成都新益州）	4,219,397.26		4,252,251.85
2017.09.18	收益分配及返还部分本金	93,022,931.51		97,275,183.36
2017.09.21	对公普通活期按季结息	24,020.69		97,299,204.05
2017.11.23	优先级 B 收益分配+兑付兑息		97,211,060.31	88,143.74
2017.11.28	支付托管费		7,018.42	81,125.32
2017.11.28	支付资产服务机构费		35,092.08	46,033.24
2017.12.18	建泉 38 号（融禾发展）信托利益	2,130,821.92		2,176,855.16
2017.12.21	对公普通活期按季结息	59,672.49		2,236,527.65
2017.12.22	建泉 38 号（融禾发展）信托利益	50,069,863.01		52,306,390.66

截至 2017 年 12 月 31 日，托管账户余额为 52,306,390.66 元。

五、特定原始权益人财务情况

以下财务数据由中建投信托有限责任公司 2017 年审计报告：

德师报（审）字（18）第 P02800 号

	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
总资产（元）	891,991.08	813,705.75
总负债（元）	224,958.85	235,820.04
净资产（元）	667,032.23	577,885.71
资产负债率（%）	25.22	28.98
营业收入（元）	182,278.27	172,320.76
净利润（元）	99,978.11	85,156.47
销售净利率（%）	54.85	49.42
经营活动现金流净额（元）	83,421.62	102,849.47

截至 2017 年末，中建投信托有限责任公司的总资产为 891,991.08 万元，资产规模较 2016 年末上涨了 9.62%，截至 2017 年末，中建投信托有限责任公司的总负债为 224,958.85 万元，公司负债规模小幅下降了 4.61%。2016 年末资产负债率为 28.98%，2017 年末小幅下降至 25.22%。2017 年度，中建投信托有限责任公司实现营业收入 182,278.27 万元，实现净利润 99,978.11 万元。

六、参与方的履约情况

本报告期内，管理人严格遵守《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》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划标准条款》、《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划说明书》等文件的约定进行，不存在任何损害资产支持证券持有人利益的行为。

本报告期内，托管人在专项计划托管活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，妥善保管专项计划账户内资金，确保专项计划账户内资金的独立和安全，依法保护资产支持证券持有人的财产权益。在各重要方面的运作严格按照《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划标准条款》、《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划说明书》及《托管协议》的约定，管理专项计划账户，不存在任何损害资产支持证券持有人利益的行为。

本报告期内，原始权益人按照《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划标准条款》、《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划说明书》及《服务协议》的约定，全权负责与基础资产管理服务、租金回收有关的事项，进行承租人的关系维护、回收租金的资金管理、租赁项目的跟踪评估、租金回收情况的查询和报告等相关工作，不存在任何损害资产支持证券持有人利益的行为。

本报告期内，其他业务参与人在专项计划存续期间按照《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划标准条款》、《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划说明书》及相关协议的约定，履行了各自的职责和义务。

七、管理人以自有资金或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

管理人未以其管理的资产管理计划、其他客户资产、证券投资基金等在一级市场认购中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划资产支持证券。

八、其他事项

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。

九、备查文件

(一) 备查文件目录

- 1、《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划说明书》
- 2、《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划标准条款》
- 3、《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划法律意见书》
- 4、《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划信用评级报告》
- 5、《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划认购协议与风险揭示书》
- 6、《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划资产买卖协议》
- 7、《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划托管协议》
- 8、《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划服务协议》
- 9、《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划会计处理意见的评论报告》
- 10、《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划现金流预测表》
- 11、《中建投集合信托受益权 1 号资产支持专项计划尽职调查报告》
- 12、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、托管人的业务资格批件和营业执照

(二) 查阅方式

北京方正富邦创融资产管理有限公司

联系地址：北京市西城区车公庄大街 12 号核建大厦 8 层

联系人：于洋

联系电话：010-57303859

传 真：010-57303718

北京方正富邦创融资产管理有限公司

2018 年 4 月 20 日



二
一
八
八