

华夏资本-中粮购房尾款1号资产支持专项计划

2020年第2期（总第7期）资产管理季度报告

（报告期间：2020年2月1日-2020年4月30日）

第一节 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》、《深圳证券交易所资产证券化业务指引》（2014年修订）、《深圳证券交易所企业应收账款资产支持证券信息披露指南》以及其他相关规定制作。

华夏资本-中粮购房尾款1号资产支持专项计划于2018年7月31日成立，并根据《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》和《资产支持专项计划备案管理办法》等法律法规、规范性文件及自律规则的要求，于2018年8月22日在中国证券投资基金业协会备案，备案编码为469180807001，中国证券投资基金业协会出具了备案确认函。

本报告中关于华夏资本-中粮购房尾款1号资产支持专项计划（以下简称“专项计划”）基础资产的数据由专项计划资产服务机构中粮地产（集团）股份有限公司（现更名为大悦城控股集团股份有限公司）提供。本专项计划资产管理报告数据由专项计划托管人中国农业银行股份有限公司深圳市分行复核确认。

报告期间：2020年2月1日至2020年4月30日。

第二节 专项计划基本情况

产品名称	华夏资本-中粮购房尾款1号资产支持专项计划
产品类型	基金公司子公司资产支持专项计划
推广对象	由合格投资者认购
推广机构	中信证券股份有限公司
计划管理人	华夏资本管理有限公司
托管银行	中国农业银行股份有限公司深圳市分行
登记机构	中国证券登记结算有限公司深圳分公司
流通场所	深圳证券交易所综合协议交易平台

产品设立日	2018年7月31日
挂牌起始日	2018年8月29日
产品到期日	2020年8月12日

证券类别	优先级资产支持证券	次级资产支持证券
募集规模（亿元）	14.25	0.75
初始面值（元）	100	100
信用评级（鹏元资信）	AAA	无评级
预期期限（年）	2.04	2.04
分配方式	定期付息、 摊还期过手还本	循环期不参与分配，摊还期劣后 于优先级证券获得剩余收益
预期年收益率	5.90%	无

第三节 原始权益人的经营情况

根据《华夏资本-中粮购房尾款1号资产支持专项计划计划说明书》的约定，本专项计划的原始权益人为中粮地产（集团）股份有限公司，现更名为大悦城控股集团股份有限公司（以下简称“大悦城控股”）。

大悦城控股是一家全国性、综合性的房地产开发上市企业，总部位于深圳市，主要业务范围包括房地产开发、经营、销售、出租及管理住宅、商用物业，经营业态涵盖住宅、商业地产及部分产业地产。2019年，大悦城控股销售类项目（包含权益类项目）实现全口径签约面积（包含权益类项目）290万平方米（操盘口径为259.55万平方米），全口径签约金额（包含权益类项目）710.82亿元（操盘口径为618.54亿元）。同时，公司拥有在建及拟建的大悦城8个，位于北京、武汉、重庆、成都、济南、三亚等城市；在建拟建的大悦城春风里3个及祥云小镇项目1个，位于北京、苏州、青岛等城市；持有运营的写字楼项目数目5家，分别为北京中粮广场、西单大悦城写字楼、中粮·置地广场、香港中粮大厦及中粮地产集团中心大厦，写字楼可出租面积共计21.16万平米¹。

截至2020年3月31日，大悦城控股主要财务数据及主要财务指标如下：

¹以上经营情况来源为《大悦城控股集团股份有限公司2019年年度报告》。

表 1 大悦城控股主要财务数据及主要财务指标

单位：万元

项目	2020 年 1 季度末	2019 年末
总资产	19,222,893.16	18,418,801.38
总负债	14,942,784.46	14,170,412.24
所有者权益	4,280,108.70	4,248,389.14
资产负债率	77.73%	76.93%
流动比率	1.71	1.57
速动比率	0.80	0.68
项目	2020 年 1 季度	2019 年 1 季度
营业收入	545,873.78	841,901.57
营业利润	91,873.94	251,846.21
净利润	46,181.68	179,449.13
经营活动产生的现金流量净额	-253,811.30	14,450.44
投资活动产生的现金流量净额	-50,145.77	23,877.25
筹资活动产生的现金流量净额	918,228.09	641,945.43

注：

- 1、因 2020 年 1 季度发生同一控制下企业合并，原始权益人新增合并中粮（北京）农业生态谷发展有限公司，故在上述表格中列示经追溯调整后的 2019 年末及 2020 年 1 季度的财务数据及财务指标。
- 2、本表格中数据源自《大悦城控股集团股份有限公司 2020 年第一季度报告》，本表格中所有数据均未经审计。

第四节 基础资产的运行情况

本专项计划的基础资产系指《资产买卖协议》项下计划管理人以认购人交付的认购资金及循环期内计划管理人使用专项计划资金，自专项计划设立日（含该日）、循环购买执行日（含该日）起，向原始权益人购买的符合合格标准及资产保证的自封包日（含该日）、循环购买基准日（含该日）起对购房人享有的债权和其他权利。

根据专项计划资产服务机构大悦城控股出具的《华夏资本-中粮购房尾款1号资产支持专项计划第八期服务报告》（以下简称“《服务报告》”），2020年1月29日（含）至2020年4月29日（不含）期间，基础资产运作情况如下：

专项计划第五次循环购买基础资产总计1,768笔，金额合计为1,182,286,193.00元。本报告期内，第五次循环购买的基础资产回款44笔，回款金额合计61,005,806.00元。

专项计划第六次循环购买基础资产总计960笔，金额合计为1,249,694,000.00元。本报告期内，第六次循环购买的基础资产回款480笔，回款金额合计595,491,000.00元。

专项计划第七次循环购买基础资产总计256笔，金额合计为1,031,050,000元。本报告期内，第七次循环购买的基础资产回款86笔，回款金额合计402,920,000.00元。

资产服务机构于当个回收款归集日（2020年04月28日）将基础资产回收款合计1,059,416,806.00元划付至监管账户，并于当个回收款转付日（2020年04月29日）将以上基础资产回收款1,059,416,806.00元自专项计划监管账户划付至专项计划账户。

《服务报告》期内，未发现不合格基础资产、灭失基础资产、涉诉基础资产。未发现基础资产有争议、纠纷、诉讼、仲裁、赔偿的情形。

第五节 基础资产循环购买情况

截至2020年02月03日，原始权益人已向计划管理人提供可供购买的基础资产清单。计划管理人确认第七次循环购买的基础资产总计256笔，资产规模为1,031,050,000.00元。

2020年02月04日，专项计划向原始权益人支付1,031,050,000.00元的基础资产购买价款，完成第七次循环购买。

第六节 专项计划账户资金收支情况

本报告期内，专项计划账户资金收支情况如下表：

日期	收付方向	交易金额（元）	账户余额（元）	摘要
2020-02-04	付	1,031,050,000.00	68,162,705.09	支付第七次循环购买基础资产购买价款
2020-02-12	付	42,845,840.20	25,316,864.89	中粮优先（代码：139057）收益分配及手续费
2020-02-12	付	68,794.52	25,248,070.37	支付中粮尾款项目托管费 20190812（含）-20200214（不含）
2020-02-24	付	200.00	25,247,870.37	支付本账户 202002期柜台渠道对公跨行柜台转账汇款手续费（大额）
2020-03-04	付	200.00	25,247,670.37	支付对公账户银行询证函费用
2020-03-06	付	2,705,070.31	22,542,600.06	支付中粮尾款项目增值税和附加税费

2020-03-21	收	296,428.72	22,839,028.78	20191221-20200320 期间银行活期存款结息
2020-03-24	付	54.10	22,838,974.68	支付本账户 202003 期柜台渠道对公跨行柜台转账汇款手续费（大额）
2020-04-29	收	1,059,416,806.00	1,082,255,780.68	收到转付的基础资产回收款（第 8 次）

截至2020年4月30日，专项计划托管账户余额为1,082,255,780.68元人民币。

第七节 各档次资产支持证券的本息兑付情况

根据《华夏资本-中粮购房尾款1号资产支持专项计划计划说明书》等专项计划文件中关于收益分配的规定，本专项计划于2020年2月14日进行第三次收益分配，计息期间为2019年8月12日（含）至2020年2月14日（不含）。具体本息兑付情况如下：

“中粮优先”（证券代码：139057）本次兑付本金和收益合计为42,843,698.01元人民币²，其中本次本金偿还比例为0%，兑付本金共0元人民币；本次分配收益为42,843,698.01元人民币。

第八节 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专项计划资产支持证券持有人本金及收益的情况。本报告期内，专项计划的计划管理人、托管人及评级机构均未发生变更。

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。

第九节 备查文件目录

- 1、《华夏资本-中粮购房尾款1号资产支持专项计划计划说明书》
- 2、《华夏资本-中粮购房尾款1号资产支持专项计划标准条款》
- 3、《华夏资本-中粮购房尾款1号资产支持专项计划资产买卖协议》

² 根据《深圳证券交易所资产支持证券临时报告信息披露指引》的《专项计划收益分配报告》模板：本次兑付本金和收益合计=每10份兑付本金*发行份数/10+每10份分配收益*发行份数/10，保留两位小数，舍去第三位小数。《华夏资本管理有限公司关于华夏资本-中粮购房尾款1号资产支持专项计划2020年第1期（总第3期）收益分配报告》中计算“中粮优先”本次兑付本金和收益为42,843,698.02元人民币；中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司实际分配时对每个持有人均采用去尾方式，故“中粮优先”实际分配收益为42,843,698.01元人民币。

- 4、《华夏资本-中粮购房尾款1号资产支持专项计划资产服务协议》
- 5、《华夏资本-中粮购房尾款1号资产支持专项计划托管协议》
- 6、《华夏资本-中粮购房尾款1号资产支持专项计划监管协议》
- 7、《华夏资本-中粮购房尾款1号资产支持专项计划差额支付承诺函》
- 8、《华夏资本-中粮购房尾款1号资产支持专项计划资产支持证券认购协议与风险揭示书》
- 9、《华夏资本-中粮购房尾款1号资产支持专项计划信用评级报告》
- 10、《北京奋迅（琼海）律师事务所关于华夏资本管理有限公司设立华夏资本-中粮购房尾款1号资产支持专项计划发售资产支持证券之法律意见书》
- 11、《中粮地产（集团）股份有限公司拟设立购房尾款资产支持专项计划现金流预测分析咨询报告》

备查文件查阅地点：

上述备查文件的存放及查阅地点：

华夏资本管理有限公司

联系地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座9层

联系电话：010-88066155、010-88066079

传真：010-88066270

联系人：张鹏、陈迪迪



华夏资本管理有限公司

2020年5月22日