招商证券资产管理有限公司关于远东五期资产支持专项计划的

资产管理季度报告

(报告期间：2015年11月26日至2016年02月25日）

一、重要提示

1. 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。
2. 远东五期资产支持专项计划于2015年11月27日设立，并于2015年12 月17日取得中国证券投资基金业协会发放的《资产支持专项计划备案确认函》

(备案编码：125151204001 )。

1. 本报告由计划管理人招商证券资产管理有限公司负责编制，计划管理人 声明保证本报告信息披露的内容真实、准确、完整、没有虚假记载、误导性陈述 或者重大遗漏。本报告关于远东五期资产支持专项计划（以下简称“本专项计划”） 基础资产运营的相关数据由远东国际租赁有限公司以及远东宏信（天津）融资租 赁有限公司提供，专项计划账户的资金收付情况由托管人招商银行股份有限公司 上海银行提供并确认。

二、专项计划基本情况

1、专项计划名称：远东五期资产支持专项计划

2、设立日期：2015年11月27日

3、计划管理人：招商证券资产管理有限公司。

4、托管人：招商银行股份有限公司上海分行。

5、证券要素

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 证券代码 | 131136 | 131137 | 131138 | 131139 | 无 |
| 证券简称 | 远东五A1 | 远东五A2 | 远东五A3 | 远东五B | 远东次级 |
| 募集规模(亿  元） | 3 | 10.50 | 19.23 | 3.65 | - |
| 预期到期曰 | 2016/02/26 | 2017/11/26 | 2019/05/26 | 2019/11/26 | 2020/11/26 |
| 每份面值（元） | 100 | 100 | 100 | 100 | 100 |
| 预期收益率 | 3.96% | 4.10% | 4.20% | 6.80% | 期间收益 3% |
| 还本付息方式 | 一次性还本 付息 | 计划还本， 按季度付息 | 过手型，按 季度付息 | 过手型，\_按 季度付息 |  |
| 利率形式 | 固定利率 | 固定利率 | 固定利率 | 固定利率 |  |
| 证券评级 | AAA | AAA | AAA | AA+ | - |
| 评级机构 | 上海新世纪资信评估投资服务有限公司 | | | |  |

6、推广对象：由合格的机构投资者认购

7、登记托管机构：中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（“中国结算 深圳分公司”）

8、交易场所：上海证券交易所固定收益证券综合电子平台

三、基础资产运行情况

根据《资产服务机构报告〉X报告期2015年11月26日至2016年02月25日）， 本专项计划基础资产运行情况如下：

1、基減资产回收情况统计

1 )按租赁合同

|  |  |
| --- | --- |
| 期初应收租赁款余额 | 4408662494.42 |
| 当期应收租赁款 | 430385277.56 |
| 当期应收本金回收款 | 340716224.46 |
| 当期应收收入回收款 | 89883906.57 |
| 期末应收租赁款余额 | 4067921873.22 |
| 期初尚未到期的合同数 | 0 |
| 当期终止的合同数 | 0 |
| 期末尚未终止的合同数 | 0 |

2)按实际发生数

|  |  |
| --- | --- |
| 期初应收租赁款余额 | 4408662494.42 |
| 当期核销租赁款 | 430385277.56 |
| 当期核销正常回收当期应收租赁款[[1]](#footnote-1) | 340740621.2 |
| 当期核销收回以前期应收租赁款 | 0 |
| 当期核销收回下期应收租赁款 | 0 |
| 当期核销的坏账 | 0 |
| 可列入租赁回收款的其他款项 | 0 |
| 期末应收租赁款余额 | 4067921873.22 |
| 当期收到的回收款(即本金回收款与收入回收款之和) | 430385277.56 |
| 当期收到本金回收款 | 340740621.2 |
| 当期正常回收的基础资产本金 | 340740621.2 |
| 当期回收以前期应收基灿资产本金 | 0 |
| 当期回收下期应收基础资产本金 | 0 |
| 当期核销的坏账中的相应本金 | 0 |
| 可列入本金回收款的其他款项 | 0 |
| 当期收到的收入回收款 | 89644656.36 |
| 当期应扣除的税款 | 1712900.03 |
| 期初尚未终止的合同数 | 0 |
| 当期终止的合同数 | 0 |
| 期末尚未终止的合同数 | 0 |

1. 期末租赁款逾期情况 本报告期内无此情况。
2. 提前退租明细

本报告期内无此情况。

1. 合同变更明细

本报告期内无此情况。

1. 违约基础资产情况

本报告期内无此情况。

1. 诉讼/仲裁进展情况

本报告期内无此情况。

四、专项计划账户资金收支情况

2015年11月26日至2016年02月25日内，专项计划账户资金收支情况如下:

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 金额（元） |
| 1、期初账户现金余额 | 0 |
| 2、支付基础资产购买价款及会计师、律 师、首次评级机构费用 | 3595927197.00 |
| 3、收到的回收款合计 | 430385277.56 |
| 3-1本金回收款 | 340740621.2 |
| 3-2收入回收款 | 89644656.36 |
| 4、再投资收益（注1 ) | 77016 |
| 5、专项计划相关费用（注2) | 445 |
| 6、资产支持证券分配合计（注3 ) | 426307321.14 |
| 6-1优先级资产支持证券分配合计 | 426307321.1444 |
| 6-2次级资产支持证券分配合计 | 0 |
| 7、期末账户现金佘额 | 428748948.53 |
| 7-1期末本金账户现金余额 | 88008327.33 |
| 7-2期末收入账户现金余额 | 340740621.2 |

注1、再投资收益指按照《计划说明书》和本标准条款的约定，计划管理人可以将专项计划 账户中的资金进行合格投资，即将该等资金以银行存款的方式存放于托管银行或购买托管银 行的保本型理财产品，由此而获得的收益。再投资收益为收入和本金账户再投资收益合计数。

2、专项计划相关费用包括但不限于计划管理人的管理费、牵头代理销售机构的牵头费、代 理销售机构的代理销售服务费、资产服务机构的服务费、托管银行的托管费、跟踪评级费、 审计费，并在10万元限额内支付其他专项计划费用。

3、 详见本报告第五点

五、资产支持证券的本息兑付情况

本报告期内本专项计划未进行收益分配，本专项计划第一次收益分配将于#BondPeriodEndDate#进行，相应的收益分配公告已于2015年2月19日公告，谇细 分配情况请参见《招商证券资产管理有限公司关于远东五期资产支持专项计划第 一期收益分配报告》，其中部分金额以中国证券登记结算有限责任公司上海分公 司反馈确认的数据为准。

六、其他事项

本报告期间，原始权益人持续经营，未发生违反合同约定的损害基础资产及 其收益的情况；

本报告期间，计划管理人、托管银行、资产服务机构未发生变更，不存在违反合同约定的损害基础资产及其收益的情况。

本报告期间，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、查阅地点及联系方式

本专项计划的备查文件如下：

1、上海证券交易所《关于远东五期资产支持证券的无异议函》（上证函 [2015]2158 号）

2、《远东五期资产支持专项计划标准条款》

3、《远东五期资产支持专项计划资产支持证券认购协议与风险揭示书》

4、《远东五期资产支持专项计划资产买卖协议》

5、《远东五期资产支持专项计划托管协议》

6、《远东五期资产支持专项计划服务协议》

7、《远东五期资产支持专项计划资产支持证券代理销售协议》

8、《关于招商证券资产管理有限公司远东五期资产支持专项计划的法律意见 书》

9、《远东五期资产支持专项计划资产支持证券信用评级报告》

10、《招商证券资产管理有限公司拟设立远东五期资产支持专项计划瑞华会 计师事务所针对基础资产池信息及现金流预测数据执行商定程序的报告》

11、计划管理人的业务资格批件、营业执照和公司章程

12、原始权益人的营业执照和公司章程

13、托管银行的业务资格批件和营业执照

备查文件查阅地点：

招商证券资产管理有限公司

联系地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-41楼

联系电话：0755-25310470

传真：0755-82943121

计划管理人：招商证券资产管理有限公司

2016年02月25日

1. 该金额可能由于提前退租的核销方法的不同而与“当期正常回收的租赁款”有所不同. [↑](#footnote-ref-1)