

魔方公寓信托受益权资产支持专项计划 2017 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。

本报告中关于魔方公寓信托受益权资产支持专项计划的数据由魔方(中国)投资有限公司提供,专项计划账户的资金数据由招商银行股份有限公司苏州分行提供并确认。

魔方公寓信托受益权资产支持专项计划于2017年01月10日正式成立。

报告期间:2017年01月01日至2017年12月31日。

二、专项计划基本情况

产品序列	预期期限 (年)	预期 收益率	发行规模 (亿元)	面值 (元)	还本付息方式
优先级资产支持证券概况					
魔方 01	1	4.80%	1	100	利息:2017年4月、7月、10月、2018年1月及提前兑付日付息; 本金:2017年4月、7月、10月、2018年1月及提前兑付日过手偿还
魔方 02	2	5.00%	1	100	利息:2017年4月、7月、10月、2018年1月、4月、7月、10月、2019年1月及提前兑付日付息; 本金:2018年4月、7月、10月、2019年1月及提前兑付日过手偿还

魔方 03	3	5.40%	1.15	100	利息：2017 年 4 月、7 月、10 月、2018 年 1 月、4 月、7 月、10 月、2019 年 1 月、4 月、7 月、10 月、2020 年 1 月及提前兑付日付息； 本金：2019 年 4 月、7 月、10 月、2020 年 1 月及提前兑付日过手偿还
次级资产支持证券概况					
魔方次级	3	无	0.35	100	到期分配剩余收益
信用评级	中诚信证券评估有限公司给予魔方 01、魔方 02、魔方 03 的评级均为 AAA 级，魔方次级不做评级。				
销售对象	由合格机构投资者认购，优先级认购金额为 100 万元的整数倍				
托管银行	招商银行股份有限公司苏州分行				
登记机构	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司				

三、基础资产运行情况

■ 2017 年还款信息

2017 年还款日		还本付息金额			
信托还款日	日期	魔方中国	魔方北京	魔方上海	魔方广州
第 1 个	2017/3/23	6,710,000.00	6,424,000.00	8,760,000.00	7,306,000.00
第 2 个	2017/6/23	6,888,500.00	6,596,333.33	8,995,000.00	7,503,500.00
第 3 个	2017/9/21	6,823,166.67	6,534,000.00	8,910,000.00	7,432,833.33
第 4 个	2017/12/25	67,017,08.33	6,417,583.33	8,751,250.00	7,300,291.67

■ 2017 年入池资产平均出租率，平均租金

序号	门店名称	全部房间数	1-12 月平均租金	1-12 月平均出租率
1	北京北苑店	127	4,004	89%

2	北京褡裢坡店	107	3,581	94%
3	北京通州梨园店	138	2,810	74%
4	北京亦庄荣京道店	208	2,898	83%
5	北京紫竹院店	115	5,236	96%
6	广州宝岗大道店	71	2,731	85%
7	广州黄沙大道店	88	2,970	95%
8	广州科学城店	102	2,624	80%
9	广州泰沙路店	140	2,648	89%
10	杭州江南大道店	94	3,447	93%
11	南京常府街店	74	2,150	97%
12	南京大桥南路店	58	1,731	92%
13	南京清凉门店	105	1,882	95%
14	南京万达紫金店	167	1,318	92%
15	南京中保村店	95	1,894	93%
16	上海行知路店	118	3,527	92%
17	上海行知路新店	56	3,858	95%
18	上海金桥店	245	1,992	94%
19	上海宁国路店	201	3,735	91%
20	上海宁桥路店	113	2,399	93%
21	上海塘桥店	67	4,206	92%
22	上海张江店	236	3,067	88%
23	上海中环百联店	55	4,121	96%
24	深圳东门步行街店	66	3,572	86%
25	深圳国贸店	444	3,010	92%
26	苏州观前街店	212	2,117	85%
27	苏州三香路店	61	1,668	94%
28	苏州团结桥店	241	1,766	92%
29	武汉江汉一桥店	104	1,473	89%
30	武汉鲇鱼套店	106	1,498	87%

四、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《魔方公寓信托受益权资产支持专项计划标准条款》、

《魔方公寓信托受益权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《魔方公寓信托受益权资产支持专项计划标准条款》、《魔方公寓信托受益权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《魔方公寓信托受益权资产支持专项计划标准条款》、《魔方公寓信托受益权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《魔方公寓信托受益权资产支持专项计划标准条款》、《魔方公寓信托受益权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。

五、原始权益人的经营情况

原始权益人的审计报告尚未出具，待出具后我们会第一时间补充原始权益人的财务数据并及时披露。

六、专项计划账户资金收支情况

本报告期内，专项计划账户共收到资金 467,806,705.31 元。

本报告期内，专项计划账户共支出资金 436,649,370.34 元。

本报告期末，专项计划账户余额为 31,157,334.97。

单位：元

账户合计收入 金额	467,806,705.31
账户合计支出 金额	436,649,370.34

期末账户资金 余额	31,157,334.97	
专项计划账户资金收入明细		
20170109	350,000,000.00	北京方正富邦创融资产管理有限公司
20170321	7,000.00	结息
20170323	29,130,000.00	中航信托股份有限公司
20170621	7,836.33	结息
20170623	29,900,277.78	中航信托股份有限公司
20170921	8,993.87	结息
20170925	29,621,666.67	中航信托股份有限公司
20171010	23,600.00	北京方正富邦创融资产管理有限公司（退票）
20171221	6,011.22	结息
20171229	29,101,319.44	中航信托股份有限公司
专项计划账户资金支出明细		
20170110	350,000,000.00	魔方（南京）企业管理咨询有限公司
20170321	200.00	汇划手续费
20170405	26,185,309.20	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）
20170405	1,233,061.65	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）
20170405	1,531,876.59	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）
20170405	17,260.27	其他应付款-托管费收入
20170508	255.30	汇划手续费
20170705	25,899,294.90	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）

20170705	1,247,062.35	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）
20170705	1,547,977.40	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）
20170710	226,400.00	北京方正富邦创融资产管理有限公司
20170710	23,600.00	北京方正富邦创融资产管理有限公司
20170710	16,205.48	其他应付款-托管费收入
20170807	280.90	汇划手续费
20170929	25,606,280.25	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）
20170929	1,260,063.00	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）
20170929	1,565,228.26	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）
20171010	15,123.29	其他应付款-托管费收入
20171010	226,400.00	北京方正富邦创融资产管理有限公司
20171010	23,600.00	北京方正富邦创融资产管理有限公司
20171010	23,600.00	北京方正富邦创融资产管理有限公司（退回重付）
20171013	256.50	汇划手续费
20171107	35.00	汇划手续费

七、各档次资产支持证券的本息兑付情况

根据《魔方公寓信托受益权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	魔方01 本金兑付比 例	魔方02 本金兑付比 例	魔方03 本金兑付比 例	魔方次级 本金兑付比 例
2017年4月10日	25%	0	0	0

2017年7月10日	25%	0	0	0
2017年10月10日	25%	0	0	0
2018年1月10日	25%	0	0	0
2018年4月10日	0	25%	0	0
2018年7月10日	0	25%	0	0
2018年10月10日	0	25%	0	0
2019年1月10日	0	25%	0	0
2019年4月10日	0	0	25%	0
2019年7月10日	0	0	25%	0
2019年10月10日	0	0	25%	0
2020年1月10日	0	0	25%	0
合计	100%	100%	100%	0

本报告期内，共有 3 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	魔方 01 收益兑付	魔方 02 收益兑付	魔方 03 收益兑付	魔方次级 收益兑付
2017年4月10日	1,184,000.00	1,233,000.00	1,531,800.00	0
2017年7月10日	898,000.00	1,247,000.00	1,547,900.00	0
2017年10月10日	605,000.00	1,260,000.00	1,565,150.00	0
合计	2,687,000.00	3,740,000.00	4,644,850.00	0

单位：元

兑付日期	魔方 01 本金兑付	魔方 02 本金兑付	魔方 03 本金兑付	魔方次级 本金兑付
2017年4月10日	25,000,000.00	0	0	0
2017年7月10日	25,000,000.00	0	0	0
2017年10月10日	25,000,000.00	0	0	0
合计	75,000,000.00	0	0	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魔方公寓信托受益权资产支持专项计划第 1、2、3 期收益分配报告》。

八、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魔方公寓信托受益权资产支持专项计划资产支持证券。

九、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发生变化。

十、备查文件

(一) 备查文件目录

- 1、《魔方公寓信托受益权资产支持专项计划标准条款》
- 2、《魔方公寓信托受益权资产支持专项计划资产支持证券认购协议和风险提示书》
- 3、《魔方公寓信托受益权资产支持专项计划信托受益权转让合同》
- 4、《魔方公寓信托受益权资产支持专项计划监管协议》
- 5、《魔方公寓信托受益权资产支持专项计划托管协议》
- 6、《魔方公寓信托受益权资产支持专项计划差额支付承诺函》
- 7、《魔方公寓信托受益权资产支持专项计划服务协议》
- 8、《关于北京方正富邦创融资产管理有限公司设立魔方公寓信托受益权资产支持专项计划暨发行资产支持证券之法律意见书》
- 9、《魔方公寓信托受益权资产支持专项计划优先级资产支持证券信用评级报告》
- 10、《魔方公寓信托受益权资产支持专项计划项目现金流预测分析咨询报告》
- 11、《魔方公寓信托受益权资产支持专项计划尽职调查报告》

12、《魔方公寓信托受益权资产支持专项计划说明书》

13、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、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

公司网址：<http://www.founderfcam.com/>

北京方正富邦创融资产管理有限公司

2018 年 04 月 20 日

