

华泰证券（上海）资产管理有限公司关于
太平人寿保单质押贷款 2016 年第一期资产支持专项计划
的 2016 年 3 季度资产管理报告

（报告期间：2016 年 7 月 1 日至 2016 年 9 月 30 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》、《深圳证券交易所资产证券化业务指引》（2014 年修订）以及其他相关规定制作。

2、说明资产支持专项计划备案情况。

太平人寿保单质押贷款 2016 年第一期资产支持专项计划已于 2016 年 5 月 6 日在中国证券投资基金业协会备案成功。

3、本报告由管理人华泰证券（上海）资产管理有限公司负责编制，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。本报告关于专项计划账户资金收支情况的数据由兴业银行股份有限公司提供提供，已经兴业银行股份有限公司复核确认。

4、管理人认为对投资者有重大影响的其他事项，应当通过重要提示提醒投资者关注。

二、资产支持专项计划基本情况

产品全称	太平人寿保单质押贷款 2016 年第一期资产支持专项计划		
产品简称	聚信三期		
产品设立日	2016 年 3 月 31 日	产品到期日	2020 年 10 月 28 日
募集总额（亿元）	5	挂牌起始日	2016 年 6 月 23 日

证券简称	太平 1 优	太平 1 次
是否转让	是	是
证券类型	优先级	次级
存续期（月）	6	6
到期日	2016 年 10 月 28 日	2016 年 10 月 28 日
募集金额(亿元)	4.50	0.50
还本付息方式	到期还本付息，若 3 个月后专项计划账户内资金足够还本付息，则进行兑付	到期分配剩余收益
利率形式	固定利率	无
预期年收益率	3.8%	—
证券评级	AAA	无
计划管理人	华泰证券（上海）资产管理有限公司	
托管银行	中国农业银行股份有限公司上海分行	
登记机构	中国证券登记结算有限公司上海分公司	
流动性安排	通过上海证券交易所综合协议交易平台转让	

三、基础资产运行情况

3.1 基础资产回收统计

（1）按借款文件：

期初应收借款本金余额	432,078,700.54
当期应收借款本金	432,078,700.54
当期应收回收款	432,078,700.54
期末应收借款本金余额	—
期初尚未到期的合同数	686
当期终止的合同数	686
期末尚未终止的合同数	—

(2) 按实际发生数:

期初应收借款本金余额	432,078,700.54
当期冲还借款本金	-
可列入回收款的其他款项	-
期末应收借款本金余额	-
当期收到的回收款（即本金回收款与收入回收款之和）	
当期收到的回收款	439,981,817.98
当期正常回收的基础资产借款本金	432,078,700.54
当期回收下期应收基础资产借款本金	-
当期回收的提前清偿的相应借款本金	-
当期回收的借款利息	7,903,117.44
可列入回收款的其他款项	-
期初尚未终止的合同数	686
当期终止的合同数	686
期末尚未终止的合同数	-

3.2 提前清偿明细

本报告期无提前清偿。

3.3 合同变更明细

编号	借款人名称	合同变更日	变更内容	变更原因	其他说明
/	/	/	/	/	/
/	/	/	/	/	/
/	/	/	/	/	/

3.4 诉讼/仲裁进展情况

编号	借款名称	应收借款本金余额	诉讼/仲裁进展情况
/	/	/	/
/	/	/	/

/	/	/	/
---	---	---	---

3.5 提前回购情况

被回购基础资产的借款人名称	回购时间	被回购基础资产的未偿借款本金余额	回购价格（可计入回收款的金额）	回购原因
/	/	/	/	/
合计	/	/	/	/

3.6 不合格基础资产的赎回

被赎回基础资产的借款人名称	赎回时间	被赎回基础资产的未偿借款本金余额	赎回价格（可计入回收款的金额）	赎回原因
/	/	/	/	/
合计	/	/	/	/

四、业务参与人履约情况

本报告期内，管理人严格遵守《证券公司客户资产业务管理办法》、《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《标准条款》和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《标准条款》、《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。

五、专项计划账户资金收支情况

交易日期	支出（元）	收入（元）
------	-------	-------

2016-07-04	-	2,145,293.96
2016-07-06	-	1,211,790.90
2016-07-08	-	1,053,424.98
2016-07-11	-	2,668,668.25
2016-07-14	-	2,822,525.97
2016-07-18	-	6,615,661.56
2016-07-21	67,342,650.00	-
2016-07-21	-	4,657,675.94
2016-07-22	-	1,081,998.92
2016-07-26	-	7,385,615.30
2016-07-28	-	6,973,647.79
2016-07-29	-	3,240,674.20
2016-07-29	1,240.75	-
2016-07-29	30.00	-
2016-08-03	-	4,757,365.15
2016-08-05	-	3,235,585.70
2016-08-10	-	5,064,968.18
2016-08-15	-	4,458,290.78
2016-08-19	-	3,226,437.95
2016-08-23	-	27,181,704.99
2016-08-26	-	6,116,222.69
2016-08-29	-	62,773,256.44
2016-08-31	30.00	-
2016-09-05		59,054,471.62
2016-09-07		51,146,370.22
2016-09-09		22,743,587.70
2016-09-12		56,353,725.44
2016-09-14		15,152,119.81
2016-09-18		13,870,764.11
2016-09-21		13,877,989.95
2016-09-26		24,391,287.32
2016-09-28		22,083,219.11
2016-09-30		464,424.00
2016-09-30	30.00	

六、专项计划资金投资管理情况

报告期内没有对专项计划的资金进行投资。

七、各档次资产支持证券的本息兑付情况

报告期内，本专项计划进行了第一次收益分配，兑付日为 2016 年 7 月 21 日，共计向优先级资产支持证券持有人分配收益 67,342,650.00 元。

八、备查文件目录、查阅地点及联系方式

- 1、《太平人寿保单质押贷款 2016 年第一期资产支持专项计划计划说明书》
- 2、《太平人寿保单质押贷款 2016 年第一期资产支持专项计划标准条款》
- 3、《太平人寿保单质押贷款 2016 年第一期资产支持专项计划资产买卖协议》
- 4、《太平人寿保单质押贷款 2016 年第一期资产支持专项计划托管协议》
- 5、《太平人寿保单质押贷款 2016 年第一期资产支持专项计划监管协议》
- 6、《太平人寿保单质押贷款 2016 年第一期资产支持专项计划服务协议》
- 7、《太平人寿保单质押贷款 2016 年第一期资产支持专项计划资产支持证券认购协议》
- 8、《关于华泰证券（上海）资产管理有限公司拟设立太平人寿保单质押贷款 2016 年第一期资产支持专项计划之法律意见书》
- 9、《太平人寿保单质押贷款 2016 年第一期资产支持专项计划优先级资产支持证券信用评级报告》
- 10、《拟设立太平人寿保单质押贷款 2016 年第一期资产支持专项计划模拟基础资产池现金流预测表及审核报告》
- 11、《太平人寿保单质押贷款 2016 年第一期资产支持专项计划会计处理意见书》
- 12、《太平人寿保单质押贷款 2016 年第一期资产支持专项计划尽职调查报告》
- 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

备查文件查阅地点：华泰证券（上海）资产管理有限公司

联系地址：上海浦东新区东方路 18 号保利广场 E 栋 21 层

联系人：周南

电话：021-28972153

传真：021-28972120

华泰证券（上海）资产管理有限公司

2016 年 10 月 18 日

