

专项计划名称：南昌西外环高速车辆通行费收益权资产支持专项计划

证券代码：149817、149818、149819、149820、149821、149822、149823、149824、149825

证券简称：昌西01/PR昌西01、昌西02/PR昌西02、昌西03、昌西04、昌西05、昌西06、昌西07、昌西08、昌西09

申万宏源证券有限公司

关于南昌西外环高速车辆通行费收益权资产支持专项计划 2020年第1期（总第3期）收益分配报告

申万宏源证券
骑缝

本公司保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担相应的法律责任。

一、 资产支持证券基本情况

南昌西外环高速车辆通行费收益权资产支持专项计划（以下简称“专项计划”）自2018年9月26日由申万宏源证券有限公司（以下简称“管理人”）设立并开始运作。专项计划设置优先级和次级两种资产支持证券，基本信息如下：

证券代码	证券简称	起息日	到期日	收益分配方式	信用评级	年化收益率	发行金额（亿元）	未偿本金余额（亿元）
149817	昌西01/PR昌西01	2018/9/26	2019/3/28	到期固定分配	AAA	5.30%	1.07	0
149818	昌西02/PR昌西02	2018/9/26	2020/3/28	半年付息，固定分配	AAA	5.40%	0.82	0.46002
149819	昌西03	2018/9/26	2021/3/28	半年付息，固定分配	AAA	5.60%	0.94	0.94

149820	昌西 04	2018/9/26	2022/3/28	半年付息, 固定分配	AAA	5.90%	1.06	1.06
149821	昌西 05	2018/9/26	2023/3/28	半年付息, 固定分配	AAA	6.30%	1.13	1.13
149822	昌西 06	2018/9/26	2024/3/28	半年付息, 固定分配	AAA	6.50%	1.20	1.20
149823	昌西 07	2018/9/26	2025/3/28	半年付息, 固定分配	AAA	6.50%	1.28	1.28
149824	昌西 08	2018/9/26	2026/3/28	半年付息, 固定分配	AAA	6.50%	1.41	1.41
149825	昌西 09	2018/9/26	2027/3/28	半年付息, 固定分配	AAA	6.50%	1.54	1.54
149826	昌西次	2018/9/26	2027/3/28	按约付息, 优先级本金偿还完毕后分配本金及剩余收益	/	/	0.55	0.55

二、收益分配计划

根据《计划说明书》约定以及专项计划历史收益分配情况，专项

计划的本金分配安排如下:

[illegible]

2027/3/28									53.25%
合计	100.00%	100.00%	100.00%	100.00%	100.00%	100.00%	100.00%	100.00%	100.00%

三、 本次收益分配方案

本资产支持专项计划将于收益分配日 2020 年 3 月 28 日（T 日）将实际分配的资金划付至资产支持证券持有人的资金账户（如遇法定节假日或休息日顺延至其后的第 1 个交易日）。债权登记日 2020 年 3 月 27 日（T-1 日）在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（以下简称“中证登上海公司”）本专项计划持有人名册上登记的资产支持证券持有人可获得相应的收益分配款项。

本次资产支持证券本金和收益的分配安排如下：

证券代码	证券简称	收益分配类型	分配本金（元/份）	分配收益（元/份） ¹	持有人份额（份）	分配资金合计（元）	剩余本金面值（元）	剩余本金余额（元）
149817	昌西 01/PR 昌西 01	-	-	-	-	-	-	-
149818	昌西 02/PR 昌西 02	到期兑付	56.10	1.5147	820,000	47,244,054.00	0.00	0.00
149819	昌西 03	付息	-	2.8000	940,000	2,632,000.00	100.00	94,000,000.00
149820	昌西 04	付息	-	2.9500	1,060,000	3,127,000.00	100.00	106,000,000.00
149821	昌西 05	付息	-	3.1500	1,130,000	3,559,500.00	100.00	113,000,000.00
149822	昌西 06	付息	-	3.2500	1,200,000	3,900,000.00	100.00	120,000,000.00
149823	昌西 07	付息	-	3.2500	1,280,000	4,160,000.00	100.00	128,000,000.00
149824	昌西 08	付息	-	3.2500	1,410,000	4,582,500.00	100.00	141,000,000.00
149825	昌西 09	付息	-	3.2500	1,540,000	5,005,000.00	100.00	154,000,000.00
149826	昌西次	付息		39.1752	550,000	21,546,375.15	100.00	55,000,000.00

注：1、上表中“分配资金合计”=（“分配本金”+“分配收益”）*“持有人份额”；
“剩余本金余额”=“剩余本金面值”*“持有人份额”；

昌西 01/PR 昌西 01 已于 2019 年 3 月 28 日本金兑付完毕并终止挂牌

¹根据中证登上海公司最新规定，资产支持证券的计息周期为“约定的前次收益分配日（自然日）至约定的本次收益分配日（自然日，含当日）的前一日（自然日，含当日）”，与实际资金发放日无关。由于第二期计息期间截至实际资金发放日 2019 年 9 月 30 日（不含当日），本期分配计息期间为 2019 年 9 月 30 日（含当日）至 2020 年 3 月 28 日（不含当日）。

转让,最后交易日为 2019 年 3 月 25 日,摘牌日为 2019 年 3 月 28 日。
本次分配完成后,昌西 02/PR 昌西 02 本金兑付完毕并终止挂牌转让,
最后交易日为 2020 年 3 月 25 日,摘牌日为 2020 年 3 月 28 日。

四、 收益分配方式

本专项计划优先级资产支持证券分配将由托管人根据管理人发出的分配指令,将本次分配资金划至中证登上海公司,并由中证登上海公司支付至资产支持证券持有人的资金账户。

本专项计划次级资产支持证券分配将由托管人根据管理人发出的分配指令,将本次分配资金直接支付至资产支持证券持有人的资金账户。

五、 关于专项计划资产支持证券利息所得税的征收

资产支持证券利息所得税的征收事宜敬请持有人参考中证登上海公司相关业务规则与通知。

六、 管理人联系方式

地址:上海市徐汇区长乐路 989 号 40 楼

电话: 021-33388322

传真: 021-33388150

特此公告。

