

专项计划名称：方正证券-水电八局六安叶集PPP项目资产支持专项计划

证券代码：169870 证券简称：20八局01(PR八局01)

证券代码：169871 证券简称：20八局02

证券代码：169872 证券简称：20八局03

证券代码：169873 证券简称：20八局04

证券代码：169874 证券简称：20八局05

证券代码：169875 证券简称：20八局06

证券代码：169876 证券简称：20八局次

方正证券股份有限公司

关于方正证券-水电八局六安叶集 PPP 项目资产支持专项计划

2026 年第 1 期（总第 11 期）收益分配的公告

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

方正证券-水电八局六安叶集 PPP 项目资产支持专项计划（以下简称“专项计划”）自 2020 年 11 月 13 日由方正证券股份有限公司（以下简称“管理人”）设立并开始运作。本专项计划设置优先级资产支持证券和次级资产支持证券两种资产支持证券，其中优先级资产支持证券共 6 个品种，为“20 八局 01”、“20 八局 02”、“20 八局 03”、“20 八局 04”、“20 八局 05”、“20 八局 06”。本期专项计划资产支持证券的募集总规模为 5.32 亿元。



基本信息如下：

证券代码	证券简称 ¹	按面值分期偿还后的简称	起息日	到期日	收益分配方式 ²	信用评级	年化收益率 ³	发行金额（亿元）	未偿本金余额（亿元） ⁴
169870	20八局01	PR八局01	2020年11月13日	2021年9月26日	按半年按计划还本付息	AAA	3.80%	0.94	0.00
169871	20八局02	-	2020年11月13日	2022年9月26日	按半年按计划还本付息	AAA	4.20%	0.91	0.00
169872	20八局03	-	2020年11月13日	2023年9月26日	按半年按计划还本付息	AAA	4.50%	0.88	0.00
169873	20八局04	-	2020年11月13日	2024年9月26日	按半年按计划还本付息	AAA	2.70% ⁵	0.88	0.00
169874	20八局05	-	2020年11月13日	2025年9月26日	按半年按计划还本付息	AAA	2.90%	0.87 ⁶	0.00
169875	20八局06	-	2020年11月13日	2026年9月26日	按半年按计划还本付息	AAA	3.70%	0.58	0.58
169876	20八局次	-	2020年11月13日	2026年9月26日	按半年付息(如有),最后一次分配时,待优先级本息全部分配完毕且支付差额支付承诺人已实际履行的差	无	非第六个兑付日和最后一个兑付日,按不超过6%/年的期间收益率分配;在第六个兑付日和最后一个	0.26	0.26

¹ 如该证券进行过分期偿还，应同时披露分期偿还前和分期偿还后的证券简称。

² 应披露例如固定分配、过手分配、混合分配等分配形式、分配频率和分配顺序。

³ 涉及利率调整的应当在此列具体说明。

⁴ “未偿本金余额”填写的数据应精确至百分位。

⁵ 根据《水电八局六安叶集 PPP 项目资产支持专项计划 2023 年更改预期收益率调整结果的公告》，2023 年 9 月 26 日起【20 八局 04、169873】预期收益率调整为 2.70%、【20 八局 05、169874】预期收益率调整为 2.90%、【20 八局 06、169875】预期收益率调整为 3.70%。

⁶ 【20 八局 05、169874】发行金额 0.87 亿元，根据《方正证券-水电八局六安叶集 PPP 项目资产支持专项计划 2023 年优先级资产支持证券转售实施结果公告》，该证券注销未转售金额 50 万元，未偿本金余额 0.8650 亿元。



					额支付款项本金及利息（如有）后，剩余资金分配次级		兑付日，按不超过10%/年的最高收益率分配未偿收益（如有）	
--	--	--	--	--	--------------------------	--	-------------------------------	--

该专项计划到期日为 2026 年 9 月 26 日。

二、 收益分配计划⁷

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：

收益分配日期 ⁸	【20 八局 01】本金分配比例 ⁹	【20 八局 02】本金分配比例	【20 八局 03】本金分配比例	【20 八局 04】本金分配比例	【20 八局 05】本金分配比例	【20 八局 06】本金分配比例	【20 八局次】本金分配比例
2021 年 3 月 26 日	41.49%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2021 年 9 月 26 日	58.51%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2022 年 3 月 26 日		41.76%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2022 年 9 月 26 日		58.24%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2023 年 3 月 26 日			43.19%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2023 年 9 月 26 日			56.81%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2024 年 3 月 26 日				15.91%	0.00%	0.00%	0.00%
2024 年 9 月 26 日				84.09%	0.00%	0.00%	0.00%
2025 年 3 月 26 日					42.78%	0.00%	0.00%
2025 年 9 月 26 日					57.22%	0.00%	0.00%
2026 年 3 月 26 日						62.07%	0.00%
2026 年 9 月 26 日						37.93%	预计 100.00%
合计	100%	100%	100%	100%	100%	100%	预计 100%

⁷ 该收益分配计划表中涉及本次分配的信息应当采用加粗文本填写。

⁸ “收益分配日期”应填写专项计划已发生的收益分配日期和合同约定的未来收益分配日期。管理人填写时无需转换为本所交易日。

⁹ 管理人应当填写已发生的收益分配比例和根据合同可以确定的未来收益分配比例。对于因特定收益分配方式（例如过手摊还）导致未来收益分配比例无法确定的，管理人应当逐一注明原因，并填写“过手摊还”或“不适用”等，该列合计分配比例可不为 100%。

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¹⁰2026年3月26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2026年3月25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 ¹¹	分配本金(元/份) ¹²	分配收益(元/份) ¹³	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)
169875	20八局06	按面值分期偿还	62.07	1.8348	580000	37,064,784.00	37.93	21,999,400.00
169876	20八局次	付息	0.00	2.9753	260000	773,578.00	100.00	26,000,000.00

注：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”。

四、 收益分配方式

资产支持证券进行收益分配的，应当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，或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。

¹⁰ 另根据中证登上海公司规定，资产支持证券的计息周期应为“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。该计息周期的定义不得自定义。

¹¹ “收益分配类型”填写“付息”、“按面值分期偿还”、“到期兑付”或“提前兑付”。

¹² “分配本金”填写的数额可精确至不超过百分位。

¹³ “分配收益”填写的数额可精确至不超过万分位。

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

方正证券股份有限公司

地址：北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号兆泰国际中心 A 座 18 层

电话：13466620042/ 010-56992789

传真：010-57395057

特此公告。

方正证券股份有限公司
2026 年 3 月 19 日

