

专项计划名称：天风-中交一航局第2期应收账款资产支持专项计划
(数据资产)

证券代码：266496、266497

证券简称：25一航优、25一航次

天风（上海）证券资产管理有限公司（管理人）关于天风-中交一航局第 2 期应收账款资产支持专项计划（数据资产）
2026 年第 2 期（总第 2 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

天风-中交一航局第 2 期应收账款资产支持专项计划（数据资产）（以下简称“专项计划”）自 2025 年 9 月 23 日由天风（上海）证券资产管理有限公司（以下简称“管理人”）设立并开始运作。专项计划设置优先级资产支持证券及次级资产支持证券，基本信息如下：

证券代码	证券简称	起息日	预期到期日	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）
266496	25 一航优	2025-9-23	2027-9-23	半年度付息、过手摊还本金	AAAsf	2.12%	2.45	2.41 ¹
266497	25 一航次	2025-9-23	2027-9-23	优先级证券预期收益偿付完毕后，按照不超过	-	6.10%	0.13	0.13

¹ 25 一航优存续金额精确值为 240,614,500.00 元。

证券代码	证券简称	起息日	预期到期日	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）
				6.10%/年的期间收益率分配收益，并获得剩余收益。				
合计							2.58	2.54 ²

二、 收益分配计划

根据《计划说明书》、《标准条款》的约定，天风-中交一航局第2期应收账款资产支持专项计划（数据资产）的本金分配安排如下：

收益分配日期	25 一航优 (266496) 本金分配比例	25 一航次 (266497) 本金分配比例
2026-3-25	1.79%	0.00%
2026-9-24	2.01%	0.00%
2027-3-24	过手摊还	0.00%
2027-9-23	过手摊还	100.00%
合计	100.00%	100.00%

注：因尚无 2027 年及其之后的法定节假日安排，以上兑付日安排仅供参考，实际日期可能存在变动，以当期的收益分配报告为准。

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 2026 年 9 月 24 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 9 月 23 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：

² 专项计划各档证券合计存续金额精确值为 253,614,500.00 元。

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)	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)
266496	25 一航优	按面值分期偿还	2.01	1.0439	2,450,000.00	7,482,055.00	96.20	235,690,000.00
266497	25 一航次	付息	-	3.0584	130,000.00	397,592.00	100.00	13,000,000.00

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。

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按照税收法律法规、部门规章和规范性文件等相关规定执行。

六、 管理人联系方式

网址： www.tfzqam.com
联系电话： 010-59226539
传真： 010-59226527
地点： 天风（上海）证券资产管理有限公司
地址： 北京市西城区德胜门外大街 83 号德胜国际中心 B 座
特此公告。

天风（上海）证券资产管理有限公司
2026 年 9 月 14 日