

沪公积金2016年第二期个人住房贷款资产支持证券

受托机构报告

2026年第9期（总第123期）

建信信托有限责任公司

受托人管理信托财产应恪尽职守，履行诚实、信用、谨慎、有效管理义务。依据信托合同规定管理信托财产所产生的风险，由信托财产承担，即由委托人交付的财产以及由受托人对该财产运用后形成的财产承担；受托人违背信托合同、处理信托事务不当使信托财产受到损失，由受托人赔偿。

2016年06月17日，经发起机构上海市公积金管理中心设立、本公司承诺受托管理的沪公积金2016年第二期个人住房贷款资产支持证券依法成立。作为受托人，根据本期上海市公积金管理中心的《沪公积金2016年第二期个人住房贷款资产支持证券服务机构报告》和中国建设银行股份有限公司上海市分行的《沪公积金2016年第二期个人住房贷款资产支持证券资金保管报告》，本公司现向您报告本信托信托财产的管理、运用、处分及收益情况。在以上报告的基础上和范围内，本公司对本报告内容的真实性、准确性、完整性负责。

报告日期：【2026】年【9】月【20】日

报告内容

一、证券概况	3
二、资产池情况	4
三、基础资产整体情况	6
四、资产存续期重大事件	7

注：1. 本报告内容仅在以下网站披露：中国货币网（www.chinamoney.com.cn），银行间市场清算所股份有限公司（www.shclearing.com）

2. 本报告内容根据自然月服务机构报告等报告内容编制

3. 本报告金额单位均以人民币元计

4. 收款期间格式为：【】年【】月【】日至【】年【】月【】日

机构类型	机构名称	机构地址	联系电话
受托机构	建信信托有限责任公司	北京市西城区闹市口大街1号院	010-67594441
贷款服务机构	上海市公积金管理中心	上海市金陵东路569号17楼	021-63843088
资金保管机构	中国建设银行股份有限公司上海市分行	上海市淮海中路200号	021-58880000-1317
登记托管机构	银行间市场清算所股份有限公司	上海市黄浦区北京东路2号	021-23198888

一、证券概况

1、证券日期概况

信托设立日	2016年06月17日
本期期初日	2026年08月26日
本期期末日	2026年09月26日
优先级计息方式	优先档付息浮动利率

2、各档证券本金、利息还款情况

证券名称	信托设立日余额 (元)	本期期初余额 (元)	本期本金还款 (元)	本期期末余额 (元)	还款比例
优先档	15,200,000,000.00	302,480,000.00	44,080,000.00	258,400,000.00	0.29%
次级档	1,117,000,000.00	1,117,000,000.00	0.00	1,117,000,000.00	0.00%

证券名称	证券执行利率	利息支付金额 (元)	每100元支付 利息 (元)	本金支付金额 (元)	每100 元支付 本金 (元)	总支付金额 (元)
优先档	3.13%	804,099.57	0.01	44,080,000.00	0.29	44,884,099.57
次级档	—	0.00	—	0.00	0.00	0.00
总计	—	804,099.57	—	44,080,000.00	—	44,884,099.57

二、资产池情况

1、资产池整体表现情况

收款期间：2026年08月01日至2026年08月31日，资产池情况如下：

贷款状态	贷款笔数 (笔)	占期末住房贷款 笔数百分比	本金余额 (元)	占期末住房 贷款本金余 额百分比
(1) 正常	16,850	98.90%	2,090,710,410.74	98.98%
(2) 逾期1至30天	144	0.85%	16,613,005.49	0.79%
(3) 逾期31至60天	8	0.05%	744,735.13	0.04%
(4) 逾期61至90天	8	0.05%	856,486.63	0.04%
(5) 逾期90天以上未被 注销	27	0.16%	3,410,064.67	0.16%
(6) 回购或替换贷款	0	0.00%	0.00	0.00%

2、现金流归集表：（见附件）

3、资产池现金流入及证券兑付情况：

		科目	上次报告期（元）	本次报告期（元）
收入账	利息	正常回收	4,762,635.74	4,654,340.20
		提前偿还	0.00	770.01
		拖欠回收	3,006.55	2,783.29
		违约回收	22,370.50	20,547.87
		合计	4,788,012.79	4,678,441.37
	其他收入		395.01	237.92
	本金分账户回补		0.00	0.00
	合格投资		0.00	0.00
	合计		4,788,407.80	4,678,679.29
本金账	本金	正常回收	29,970,029.30	29,713,917.54
		提前偿还	12,941,408.35	9,555,542.46
		拖欠回收	26,095.06	20,431.67
		违约回收	159,387.53	122,913.76
		合计	43,096,920.24	39,412,805.43
	其他收入		0.00	0.00
	收入分账户回补		0.00	0.00
	上期转存		1,396,220.56	1,021,426.38
	合计		44,493,140.80	40,434,231.81
收入及本金合计			49,281,548.60	45,112,911.10
		科目	上次报告期（元）	本次报告期（元）
税收			156,204.37	152,624.87
费用支出	服务总费用支出		54,472.20	33,336.29
	其他费用支出 ¹		84.33	230.00
证券账户支出	证券利息总支出		929,361.32	804,099.57
	证券本金总支出		47,120,000.00	44,080,000.00

¹ 资金保管机构因管理账户而发生的资金划付费及其他手续费。

三、基础资产整体情况

1、资产池情况

	初始起算日	上次报告期	本次报告期
贷款笔数	61,117	17,201	17,037
贷款户数	60,988	17,182	17,019
未偿本金余额（元）	16,752,824,041.08	2,151,747,508.09	2,112,334,702.66
单笔贷款最高本金余额（元）	778,992.29	548,139.65	545,944.78
单笔贷款平均本金余额（元）	274,110.71	125,094.33	123,985.13
贷款合同金额（元）	21,277,117,900.00	6,512,412,400.00	6,456,298,000.00
加权平均合同期限（月）	238.80	291.57	292.46
加权平均剩余期限（月）	194.88	125.04	124.88
加权平均账龄（月）	43.92	166.53	167.58
贷款最长到期期限（月）	336	209	208
贷款最短到期期限（月）	13	0	0
加权平均贷款利率（%）	3.2810	2.6399	2.6398
最高贷款利率（%）	3.5750	3.0750	3.0750
最低贷款利率（%）	2.7500	2.6000	2.6000

2、违约住房贷款在本收款期间期末所处的处置状态及抵销权风险监控

处置状态分类	违约住房贷款笔数（笔）	占初始起算日资产池住房贷款笔数百分比	违约时点本金余额（元）	占初始起算日资产池余额百分比
经处置目前无拖欠	52	0.09%	9,184,955.95	0.05%
非诉讼类处置	52	0.09%	8,214,816.80	0.05%
诉讼处置	0	0.00%	0.00	0.00%
进入诉讼准备程序	0	0.00%	0.00	0.00%
进入法庭受理程序	0	0.00%	0.00	0.00%
进入执行拍卖程序	0	0.00%	0.00	0.00%
经处置已核销或结清	180	0.29%	29,683,638.40	0.18%
汇总	284	0.46%	47,083,411.15	0.28%

注：因四舍五入的关系，分项百分比之和可能不等于汇总的百分比。

四、资产存续期重大事件

1、资产池累计违约情况：

期数	报告日期	累计违约率	期数	报告日期	累计违约率
第1期	2016/06/30	0.0000%	第63期	2021/08/31	0.1687%
第2期	2016/07/31	0.0005%	第64期	2021/09/30	0.1713%
第3期	2016/08/31	0.0021%	第65期	2021/10/31	0.1741%
第4期	2016/09/30	0.0074%	第66期	2021/11/30	0.1741%
第5期	2016/10/31	0.0079%	第67期	2021/12/31	0.1747%
第6期	2016/11/30	0.0079%	第68期	2022/01/31	0.1747%
第7期	2016/12/31	0.0107%	第69期	2022/02/28	0.1751%
第8期	2017/01/31	0.0152%	第70期	2022/03/31	0.1751%
第9期	2017/02/28	0.0165%	第71期	2022/04/30	0.1770%
第10期	2017/03/31	0.0188%	第72期	2022/05/31	0.1819%
第11期	2017/04/30	0.0226%	第73期	2022/06/30	0.1842%
第12期	2017/05/31	0.0242%	第74期	2022/07/31	0.1916%
第13期	2017/06/30	0.0242%	第75期	2022/08/31	0.1966%
第14期	2017/07/31	0.0276%	第76期	2022/09/30	0.1994%
第15期	2017/08/31	0.0283%	第77期	2022/10/31	0.2015%
第16期	2017/09/30	0.0283%	第78期	2022/11/30	0.2037%
第17期	2017/10/31	0.0331%	第79期	2022/12/31	0.2081%
第18期	2017/11/30	0.0354%	第80期	2023/01/31	0.2115%
第19期	2017/12/31	0.0363%	第81期	2023/02/28	0.2136%
第20期	2018/01/31	0.0363%	第82期	2023/03/31	0.2146%
第21期	2018/02/28	0.0389%	第83期	2023/04/30	0.2159%
第22期	2018/03/31	0.0395%	第84期	2023/05/31	0.2168%
第23期	2018/04/30	0.0409%	第85期	2023/06/30	0.2182%
第24期	2018/05/31	0.0409%	第86期	2023/07/31	0.2182%
第25期	2018/06/30	0.0435%	第87期	2023/08/31	0.2202%
第26期	2018/07/31	0.0469%	第88期	2023/09/30	0.2204%
第27期	2018/08/31	0.0506%	第89期	2023/10/31	0.2233%
第28期	2018/09/30	0.0537%	第90期	2023/11/30	0.2233%
第29期	2018/10/31	0.0559%	第91期	2023/12/31	0.2256%
第30期	2018/11/30	0.0635%	第92期	2024/01/31	0.2268%
第31期	2018/12/31	0.0652%	第93期	2024/02/29	0.2319%
第32期	2019/01/31	0.0773%	第94期	2024/03/31	0.2326%
第33期	2019/02/28	0.0788%	第95期	2024/04/30	0.2333%
第34期	2019/03/31	0.0788%	第96期	2024/05/31	0.2349%
第35期	2019/04/30	0.0822%	第97期	2024/06/30	0.2365%
第36期	2019/05/31	0.0854%	第98期	2024/07/31	0.2375%
第37期	2019/06/30	0.0882%	第99期	2024/08/31	0.2408%
第38期	2019/07/31	0.0909%	第100期	2024/09/30	0.2418%
第39期	2019/08/31	0.0963%	第101期	2024/10/31	0.2472%
第40期	2019/09/30	0.0987%	第102期	2024/11/30	0.2476%
第41期	2019/10/31	0.1030%	第103期	2024/12/31	0.2476%
第42期	2019/11/30	0.1096%	第104期	2025/01/31	0.2490%
第43期	2019/12/31	0.1151%	第105期	2025/02/28	0.2507%
第44期	2020/01/31	0.1163%	第106期	2025/03/31	0.2567%

第45期	2020/02/29	0.1188%	第107期	2025/04/30	0.2579%
第46期	2020/03/31	0.1214%	第108期	2025/05/31	0.2589%
第47期	2020/04/30	0.1287%	第109期	2025/06/30	0.2616%
第48期	2020/05/31	0.1291%	第110期	2025/07/31	0.2628%
第49期	2020/06/30	0.1308%	第111期	2025/08/31	0.2634%
第50期	2020/07/31	0.1355%	第112期	2025/09/30	0.2650%
第51期	2020/08/31	0.1371%	第113期	2025/10/31	0.2675%
第52期	2020/09/30	0.1422%	第114期	2025/11/30	0.2700%
第53期	2020/10/31	0.1458%	第115期	2025/12/31	0.2700%
第54期	2020/11/30	0.1470%	第116期	2026/01/31	0.2710%
第55期	2020/12/31	0.1518%	第117期	2026/02/28	0.2724%
第56期	2021/01/31	0.1520%	第118期	2026/03/31	0.2736%
第57期	2021/02/28	0.1548%	第119期	2026/04/30	0.2754%
第58期	2021/03/31	0.1557%	第120期	2026/05/31	0.2785%
第59期	2021/04/30	0.1566%	第121期	2026/06/30	0.2797%
第60期	2021/05/31	0.1590%	第122期	2026/07/31	0.2798%
第61期	2021/06/30	0.1611%	第123期	2026/08/31	0.2810%
第62期	2021/07/31	0.1674%			

2、报告期内重大事件：

事件	是否发生	备注
加速清偿事件	否	
违约事件	否	
权利完善事件	否	
个别通知事件	否	
资产赎回事件	否	
清仓回购事件	否	
丧失清偿能力事件	否	
受托机构终止事件	否	
重大不利影响事件	否	
受托人解任事件	否	
贷款服务机构解任事件	否	
资金保管机构解任事件	否	
资产支持证券持有人大会	否	
其他影响证券本息兑付或投资者利益的事项	否	

指标释义：

1. 服务总费用：包括交易文件约定的受托机构、服务机构、登记服务机构、资金保管机构、贷款服务机构收取费用及跟踪评级费用；
2. 累计违约率：就某一收款期间而言，该收款期间的累计违约率系指A/B所得的百分比，其中，A为该收款期间以及之前各收款期间内的所有违约贷款在成为违约贷款时的未偿本金余额之和，B 为初始起算日资产池余额；
3. 其他费用支出：就各相关主体而言，系指该等实际支出和费用包括该方作为当事人与其他本次交易相关主体之间发生的与本次证券化交易相关的诉讼或仲裁而发生的合理律师费、诉讼费、仲裁费和执行费（扣除按照法院判决或仲裁裁决应当由对方承担的律师费、诉讼费、仲裁费和执行费）以及该方为管理“信托财产”所支出的根据“交易文件”的约定由“信托财产”承担的必要费用，但不包括：①该方因过失、故意的不当行为、违约或欺诈情况下按法院判决或仲裁裁决须由其自身承担的律师费、诉讼费、仲裁费和执行费，以及②该方提供服务应获取的报酬。其中，就“信托受托人”而言，除上述费用和支出外，该等实际支出和费用还包括相关级别“资产支持证券”的上市流通费用（如有）、召集“资产支持证券持有人大会”发生的费用、“后备贷款服务机构”或“替代贷款服务机构”接收服务发生的费用等；就“贷款服务机构”而言，除上述费用和支出外，该等实际支出和费用还包括“贷款服务机构”向“信托账户”转付资金所产生的资金汇划费和因变更“公积金借款合同”、“《保证合同》”而使“贷款服务机构”承担的额外费用等，但不包括“执行费用”；就“资金保管机构”而言，除上述费用和支出外，该等实际支出和费用还包括资金汇划费等。当出现其他费用支出时，受托机构将在之后受托机构报告中对设计的具体费用进行披露；
4. 累计违约率监控指标：2016年6月—2017年6月：0.5%；2017年6月—2021年6月：1.5%；2021年6月—2026年6月：3.0%；2026年6月及以后：6.0%。



附件： 现金流归集表（元）

信托核算日	期初本金总余额	本期应收本金	本期应收利息	期末本金总余额
2026-09-30	2,090,710,410.74	29,291,138.07	4,599,425.35	2,061,419,272.67
2026-10-31	2,061,419,272.67	29,239,268.60	4,534,841.77	2,032,180,004.07
2026-11-30	2,032,180,004.07	29,208,125.45	4,470,377.05	2,002,971,878.62
2026-12-31	2,002,971,878.62	29,182,902.55	4,405,979.87	1,973,788,976.07
2027-01-31	1,973,788,976.07	29,167,148.49	4,341,639.05	1,944,621,827.58
2027-02-28	1,944,621,827.58	29,147,136.03	4,277,335.12	1,915,474,691.55
2027-03-31	1,915,474,691.55	29,157,622.93	4,213,076.38	1,886,317,068.62
2027-04-30	1,886,317,068.62	29,145,595.16	4,148,796.49	1,857,171,473.46
2027-05-31	1,857,171,473.46	29,059,135.26	4,084,544.99	1,828,112,338.20
2027-06-30	1,828,112,338.20	28,949,803.46	4,020,486.91	1,799,162,534.73
2027-07-31	1,799,162,534.73	28,696,329.03	3,956,669.54	1,770,466,205.70
2027-08-31	1,770,466,205.70	28,383,407.29	3,893,406.73	1,742,082,798.41
2027-09-30	1,742,082,798.41	27,973,807.61	3,830,825.53	1,714,108,990.80
2027-10-31	1,714,108,990.80	27,547,835.50	3,769,148.54	1,686,561,155.29
2027-11-30	1,686,561,155.29	27,045,547.56	3,708,417.90	1,659,515,607.73
2027-12-31	1,659,515,607.73	26,671,975.45	3,648,801.27	1,632,843,632.28
2028-01-31	1,632,843,632.28	26,307,490.51	3,590,021.26	1,606,536,141.77
2028-02-29	1,606,536,141.77	25,975,963.12	3,532,056.01	1,580,560,178.66
2028-03-31	1,580,560,178.66	25,560,673.00	3,474,826.35	1,554,999,505.65
2028-04-30	1,554,999,505.65	24,976,553.84	3,418,519.14	1,530,022,951.81
2028-05-31	1,530,022,951.81	24,311,556.52	3,363,502.05	1,505,711,395.29
2028-06-30	1,505,711,395.29	23,259,572.93	3,309,954.77	1,482,451,822.36
2028-07-31	1,482,451,822.36	22,427,314.35	3,258,720.63	1,460,024,508.01
2028-08-31	1,460,024,508.01	21,752,772.76	3,209,325.94	1,438,271,735.25

信托核算日	期初本金总余额	本期应收本金	本期应收利息	期末本金总余额
2028-09-30	1,438,271,735.25	21,159,821.70	3,161,425.14	1,417,111,913.55
2028-10-31	1,417,111,913.55	20,538,232.89	3,114,835.84	1,396,573,680.66
2028-11-30	1,396,573,680.66	19,774,198.96	3,069,632.25	1,376,799,481.70
2028-12-31	1,376,799,481.70	19,219,543.27	3,026,122.87	1,357,579,938.43
2029-01-31	1,357,579,938.43	18,508,644.78	2,983,840.36	1,339,071,293.65
2029-02-28	1,339,071,293.65	18,074,992.47	2,943,132.28	1,320,996,301.18
2029-03-31	1,320,996,301.18	17,410,244.86	2,903,383.86	1,303,586,056.32
2029-04-30	1,303,586,056.32	16,901,432.46	2,865,109.93	1,286,684,623.86
2029-05-31	1,286,684,623.86	16,379,539.96	2,827,961.30	1,270,305,083.89
2029-06-30	1,270,305,083.89	15,835,243.03	2,791,963.92	1,254,469,840.86
2029-07-31	1,254,469,840.86	15,335,740.24	2,757,171.77	1,239,134,100.62
2029-08-31	1,239,134,100.62	14,972,321.54	2,723,479.51	1,224,161,779.08
2029-09-30	1,224,161,779.08	14,620,647.36	2,690,588.18	1,209,541,131.72
2029-10-31	1,209,541,131.72	14,176,520.86	2,658,467.65	1,195,364,610.86
2029-11-30	1,195,364,610.86	13,883,485.63	2,627,321.53	1,181,481,125.23
2029-12-31	1,181,481,125.23	13,427,145.10	2,596,828.89	1,168,053,980.13
2030-01-31	1,168,053,980.13	12,735,359.13	2,567,335.72	1,155,318,621.00
2030-02-28	1,155,318,621.00	11,988,491.09	2,539,347.13	1,143,330,129.91
2030-03-31	1,143,330,129.91	11,554,952.04	2,512,978.49	1,131,775,177.87
2030-04-30	1,131,775,177.87	11,251,403.30	2,487,548.73	1,120,523,774.57
2030-05-31	1,120,523,774.57	11,168,300.94	2,462,777.48	1,109,355,473.63
2030-06-30	1,109,355,473.63	11,167,334.96	2,438,188.21	1,098,188,138.67
2030-07-31	1,098,188,138.67	11,151,026.27	2,413,600.24	1,087,037,112.40
2030-08-31	1,087,037,112.40	11,138,962.89	2,389,048.01	1,075,898,149.50
2030-09-30	1,075,898,149.50	11,114,204.64	2,364,521.13	1,064,783,944.86

信托核算日	期初本金总余额	本期应收本金	本期应收利息	期末本金总余额
2030-10-31	1,064,783,944.86	11,098,261.38	2,340,047.10	1,053,685,683.48
2030-11-30	1,053,685,683.48	11,063,071.53	2,315,609.23	1,042,622,611.95
2030-12-31	1,042,622,611.95	11,020,857.54	2,291,247.18	1,031,601,754.41
2031-01-31	1,031,601,754.41	11,007,422.19	2,266,977.56	1,020,594,332.21
2031-02-28	1,020,594,332.21	10,999,585.56	2,242,736.75	1,009,594,746.65
2031-03-31	1,009,594,746.65	10,961,879.05	2,218,513.10	998,632,867.60
2031-04-30	998,632,867.60	10,901,104.88	2,194,373.42	987,731,762.72
2031-05-31	987,731,762.72	10,897,712.37	2,170,365.87	976,834,050.35
2031-06-30	976,834,050.35	10,895,707.75	2,146,366.17	965,938,342.60
2031-07-31	965,938,342.60	10,886,267.48	2,122,370.13	955,052,075.13
2031-08-31	955,052,075.13	10,855,294.87	2,098,396.56	944,196,780.25
2031-09-30	944,196,780.25	10,845,924.35	2,074,490.78	933,350,855.91
2031-10-31	933,350,855.91	10,809,721.99	2,050,605.38	922,541,133.91
2031-11-30	922,541,133.91	10,782,759.03	2,026,799.41	911,758,374.89
2031-12-31	911,758,374.89	10,764,735.28	2,003,055.11	900,993,639.61
2032-01-31	900,993,639.61	10,736,222.65	1,979,349.98	890,257,416.95
2032-02-29	890,257,416.95	10,706,489.78	1,955,708.97	879,550,927.18
2032-03-31	879,550,927.18	10,682,528.61	1,932,133.87	868,868,398.56
2032-04-30	868,868,398.56	10,661,066.67	1,908,610.23	858,207,331.90
2032-05-31	858,207,331.90	10,635,962.13	1,885,132.68	847,571,369.77
2032-06-30	847,571,369.77	10,548,844.09	1,861,709.07	837,022,525.69
2032-07-31	837,022,525.69	10,469,726.16	1,838,477.29	826,552,799.53
2032-08-31	826,552,799.53	10,391,237.63	1,815,420.84	816,161,561.90
2032-09-30	816,161,561.90	10,304,967.64	1,792,540.92	805,856,594.26
2032-10-31	805,856,594.26	10,209,562.88	1,769,851.73	795,647,031.39

信托核算日	期初本金总余额	本期应收本金	本期应收利息	期末本金总余额
2032-11-30	795,647,031.39	10,112,112.00	1,747,376.44	785,534,919.39
2032-12-31	785,534,919.39	10,033,832.42	1,725,120.03	775,501,086.97
2033-01-31	775,501,086.97	9,894,087.33	1,703,039.46	765,606,999.64
2033-02-28	765,606,999.64	9,808,087.72	1,681,273.98	755,798,911.92
2033-03-31	755,798,911.92	9,710,845.27	1,659,696.67	746,088,066.64
2033-04-30	746,088,066.64	9,623,529.46	1,638,340.60	736,464,537.18
2033-05-31	736,464,537.18	9,506,381.55	1,617,179.75	726,958,155.63
2033-06-30	726,958,155.63	9,375,795.72	1,596,279.84	717,582,359.90
2033-07-31	717,582,359.90	9,242,741.12	1,575,667.72	708,339,618.78
2033-08-31	708,339,618.78	9,140,009.18	1,555,350.10	699,199,609.60
2033-09-30	699,199,609.60	9,068,526.92	1,535,259.09	690,131,082.68
2033-10-31	690,131,082.68	8,983,891.27	1,515,326.17	681,147,191.41
2033-11-30	681,147,191.41	8,857,540.40	1,495,583.85	672,289,651.01
2033-12-31	672,289,651.01	8,743,093.03	1,476,122.44	663,546,557.98
2034-01-31	663,546,557.98	8,636,943.00	1,456,911.35	654,909,614.98
2034-02-28	654,909,614.98	8,597,392.79	1,437,942.25	646,312,222.19
2034-03-31	646,312,222.19	8,522,164.98	1,419,061.64	637,790,057.21
2034-04-30	637,790,057.21	8,434,681.04	1,400,348.48	629,355,376.17
2034-05-31	629,355,376.17	8,364,246.03	1,381,827.85	620,991,130.14
2034-06-30	620,991,130.14	8,261,289.38	1,363,463.63	612,729,840.77
2034-07-31	612,729,840.77	8,217,303.12	1,345,329.81	604,512,537.65
2034-08-31	604,512,537.65	8,153,318.79	1,327,292.36	596,359,218.86
2034-09-30	596,359,218.86	8,103,967.16	1,309,396.55	588,255,251.70
2034-10-31	588,255,251.70	8,076,784.20	1,291,609.98	580,178,467.50
2034-11-30	580,178,467.50	8,021,667.07	1,273,883.46	572,156,800.42

信托核算日	期初本金总余额	本期应收本金	本期应收利息	期末本金总余额
2034-12-31	572,156,800.42	7,939,463.21	1,256,277.01	564,217,337.22
2035-01-31	564,217,337.22	7,863,776.86	1,238,849.57	556,353,560.36
2035-02-28	556,353,560.36	7,805,271.30	1,221,585.63	548,548,289.06
2035-03-31	548,548,289.06	7,768,417.91	1,204,450.29	540,779,871.15
2035-04-30	540,779,871.15	7,772,865.33	1,187,396.04	533,007,005.82
2035-05-31	533,007,005.82	7,752,797.05	1,170,332.49	525,254,208.77
2035-06-30	525,254,208.77	7,735,498.71	1,153,312.38	517,518,710.06
2035-07-31	517,518,710.06	7,730,416.78	1,136,331.22	509,788,293.28
2035-08-31	509,788,293.28	7,709,267.61	1,119,360.89	502,079,025.66
2035-09-30	502,079,025.66	7,703,150.54	1,102,438.33	494,375,875.12
2035-10-31	494,375,875.12	7,692,244.22	1,085,528.99	486,683,630.91
2035-11-30	486,683,630.91	7,678,978.53	1,068,642.80	479,004,652.38
2035-12-31	479,004,652.38	7,662,545.08	1,051,785.71	471,342,107.30
2036-01-31	471,342,107.30	7,636,571.27	1,034,964.68	463,705,536.03
2036-02-29	463,705,536.03	7,625,077.81	1,018,201.10	456,080,458.22
2036-03-31	456,080,458.22	7,613,084.47	1,001,462.98	448,467,373.75
2036-04-30	448,467,373.75	7,589,684.43	984,750.38	440,877,689.32
2036-05-31	440,877,689.32	7,564,018.58	968,089.26	433,313,670.73
2036-06-30	433,313,670.73	7,527,112.41	951,483.27	425,786,558.32
2036-07-31	425,786,558.32	7,492,963.17	934,957.48	418,293,595.15
2036-08-31	418,293,595.15	7,472,465.44	918,507.61	410,821,129.71
2036-09-30	410,821,129.71	7,464,506.50	902,102.72	403,356,623.21
2036-10-31	403,356,623.21	7,451,742.80	885,715.44	395,904,880.41
2036-11-30	395,904,880.41	7,434,375.87	869,356.47	388,470,504.54
2036-12-31	388,470,504.54	7,407,134.25	853,035.46	381,063,370.29

信托核算日	期初本金总余额	本期应收本金	本期应收利息	期末本金总余额
2037-01-31	381,063,370.29	7,396,780.82	836,773.01	373,666,589.47
2037-02-28	373,666,589.47	7,385,546.15	820,532.52	366,281,043.32
2037-03-31	366,281,043.32	7,372,125.86	804,316.31	358,908,917.46
2037-04-30	358,908,917.46	7,356,765.58	788,130.15	351,552,151.88
2037-05-31	351,552,151.88	7,303,554.22	771,976.79	344,248,597.66
2037-06-30	344,248,597.66	7,255,826.38	755,942.45	336,992,771.28
2037-07-31	336,992,771.28	7,180,588.83	740,016.69	329,812,182.45
2037-08-31	329,812,182.45	7,139,492.91	724,256.19	322,672,689.54
2037-09-30	322,672,689.54	7,079,149.79	708,587.30	315,593,539.75
2037-10-31	315,593,539.75	7,002,596.04	693,050.38	308,590,943.71
2037-11-30	308,590,943.71	6,937,048.32	677,685.61	301,653,895.39
2037-12-31	301,653,895.39	6,898,559.93	662,463.24	294,755,335.46
2038-01-31	294,755,335.46	6,843,468.64	647,325.31	287,911,866.82
2038-02-28	287,911,866.82	6,801,585.91	632,309.44	281,110,280.91
2038-03-31	281,110,280.91	6,753,215.72	617,385.66	274,357,065.19
2038-04-30	274,357,065.19	6,695,508.00	602,570.75	267,661,557.19
2038-05-31	267,661,557.19	6,635,963.13	587,884.65	261,025,594.06
2038-06-30	261,025,594.06	6,564,946.24	573,327.18	254,460,647.82
2038-07-31	254,460,647.82	6,495,809.50	558,926.53	247,964,838.32
2038-08-31	247,964,838.32	6,442,775.40	544,676.89	241,522,062.92
2038-09-30	241,522,062.92	6,393,754.49	530,543.30	235,128,308.43
2038-10-31	235,128,308.43	6,354,907.37	516,518.31	228,773,401.06
2038-11-30	228,773,401.06	6,325,359.17	502,577.87	222,448,041.89
2038-12-31	222,448,041.89	6,278,926.97	488,703.40	216,169,114.91
2039-01-31	216,169,114.91	6,223,791.55	474,929.69	209,945,323.36

信托核算日	期初本金总余额	本期应收本金	本期应收利息	期末本金总余额
2039-02-28	209,945,323.36	6,200,729.71	461,276.97	203,744,593.65
2039-03-31	203,744,593.65	6,156,364.83	447,675.15	197,588,228.82
2039-04-30	197,588,228.82	6,058,193.63	434,171.89	191,530,035.19
2039-05-31	191,530,035.19	5,962,699.96	420,883.30	185,567,335.23
2039-06-30	185,567,335.23	5,856,511.70	407,802.97	179,710,823.54
2039-07-31	179,710,823.54	5,780,947.86	394,954.45	173,929,875.67
2039-08-31	173,929,875.67	5,716,032.07	382,271.50	168,213,843.60
2039-09-30	168,213,843.60	5,632,558.42	369,729.23	162,581,285.18
2039-10-31	162,581,285.18	5,584,955.26	357,369.78	156,996,329.92
2039-11-30	156,996,329.92	5,534,033.23	345,115.02	151,462,296.70
2039-12-31	151,462,296.70	5,463,930.05	332,971.00	145,998,366.64
2040-01-31	145,998,366.64	5,415,004.88	320,980.79	140,583,361.76
2040-02-29	140,583,361.76	5,364,557.93	309,096.58	135,218,803.83
2040-03-31	135,218,803.83	5,322,320.46	297,323.39	129,896,483.37
2040-04-30	129,896,483.37	5,273,696.04	285,643.57	124,622,787.34
2040-05-31	124,622,787.34	5,219,225.58	274,072.30	119,403,561.76
2040-06-30	119,403,561.76	5,149,065.03	262,620.96	114,254,496.73
2040-07-31	114,254,496.73	5,081,731.02	251,322.80	109,172,765.71
2040-08-31	109,172,765.71	5,030,181.53	240,171.72	104,142,584.18
2040-09-30	104,142,584.18	4,975,612.59	229,133.20	99,166,971.59
2040-10-31	99,166,971.59	4,896,146.16	218,212.61	94,270,825.43
2040-11-30	94,270,825.43	4,764,187.22	207,465.88	89,506,638.22
2040-12-31	89,506,638.22	4,663,460.76	197,005.11	84,843,177.46
2041-01-31	84,843,177.46	4,532,145.05	186,762.28	80,311,032.41
2041-02-28	80,311,032.41	4,416,411.49	176,803.66	75,894,620.92

信托核算日	期初本金总余额	本期应收本金	本期应收利息	期末本金总余额
2041-03-31	75,894,620.92	4,231,555.03	167,096.72	71,663,065.89
2041-04-30	71,663,065.89	4,102,077.45	157,795.63	67,560,988.44
2041-05-31	67,560,988.44	4,015,728.15	148,778.08	63,545,260.29
2041-06-30	63,545,260.29	3,885,090.31	139,948.70	59,660,169.97
2041-07-31	59,660,169.97	3,786,331.03	131,405.34	55,873,838.94
2041-08-31	55,873,838.94	3,695,122.82	123,077.67	52,178,716.11
2041-09-30	52,178,716.11	3,630,220.55	114,949.56	48,548,495.56
2041-10-31	48,548,495.56	3,526,206.68	106,965.37	45,022,288.88
2041-11-30	45,022,288.88	3,447,728.27	99,209.07	41,574,560.61
2041-12-31	41,574,560.61	3,317,768.13	91,627.05	38,256,792.48
2042-01-31	38,256,792.48	3,269,849.20	84,328.33	34,986,943.27
2042-02-28	34,986,943.27	3,234,920.61	77,136.78	31,752,022.66
2042-03-31	31,752,022.66	3,201,989.28	70,022.52	28,550,033.38
2042-04-30	28,550,033.38	3,145,081.64	62,984.82	25,404,951.74
2042-05-31	25,404,951.74	3,048,879.62	56,073.35	22,356,072.12
2042-06-30	22,356,072.12	2,842,522.01	49,372.62	19,513,550.11
2042-07-31	19,513,550.11	2,610,797.55	43,121.53	16,902,752.56
2042-08-31	16,902,752.56	2,336,619.70	37,374.40	14,566,132.86
2042-09-30	14,566,132.86	2,119,269.66	32,226.16	12,446,863.20
2042-10-31	12,446,863.20	1,976,178.82	27,550.94	10,470,684.38
2042-11-30	10,470,684.38	1,825,287.33	23,189.78	8,645,397.06
2042-12-31	8,645,397.06	1,630,339.22	19,161.90	7,015,057.84
2043-01-31	7,015,057.84	1,476,631.58	15,564.65	5,538,426.25
2043-02-28	5,538,426.25	1,305,352.67	12,304.53	4,233,073.58
2043-03-31	4,233,073.58	1,145,173.14	9,420.27	3,087,900.44

信托核算日	期初本金总余额	本期应收本金	本期应收利息	期末本金总余额
2043-04-30	3,087,900.44	982,779.16	6,888.59	2,105,121.28
2043-05-31	2,105,121.28	817,458.76	4,714.06	1,287,662.52
2043-06-30	1,287,662.52	554,762.66	2,903.46	732,899.86
2043-07-31	732,899.86	329,656.54	1,672.00	403,243.33
2043-08-31	403,243.33	142,389.23	930.83	260,854.10
2043-09-30	260,854.10	119,014.42	601.61	141,839.68
2043-10-31	141,839.68	82,375.92	325.69	59,463.77
2043-11-30	59,463.77	46,446.91	136.04	13,016.85
2043-12-31	13,016.85	13,016.85	28.99	0.00

注：1. 以上现金流归集表未包含在本报告期末处于逾期状态的资产共187笔，这些资产于报告期末未偿本金余额为21,624,291.92元。

2. 以上现金流根据2026年8月31日数据计算得出，未考虑在此时点后的调息、早偿及违约等情况。