

南山租赁二期资产支持专项计划 2016 年度资产管理报告

本报告依据《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《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》、上海证券交易所出具的《关于对南山租赁二期资产支持专项计划资产支持证券挂牌转让无异议的函》及其他有关规定制作。

本报告中关于南山租赁二期资产支持专项计划基础资产的运行情况、特定原始权益人的经营情况由本专项计划资产服务机构南山融资租赁（天津）有限公司提供。

本报告中专项计划账户的资金数据由中国光大银行股份有限公司北京分行提供。

南山租赁二期资产支持专项计划于 2016 年 9 月 8 日正式成立。

报告期间：2016 年 9 月 8 日至 2016 年 12 月 31 日。

一、专项计划概况

1.概况

系列	到期日	还本付息方式	评级	预期年收益率	发行规模（亿元）
南山二 01	2016 年 9 月 30 日	按季付息、到期一次还本并支付最后一期利息	AA+	4.00%	0.39
南山二 02	2016 年 12 月 31 日	按季付息、到期一次还本并支付最后一期利息	AA+	4.10%	0.44
南山二 03	2017 年 3 月 31 日	按季付息、到期一次还本并	AA+	4.20%	0.31

		支付最后一期利息			
南山二 04	2017 年 6 月 30 日	按季付息、到期一次还本并 支付最后一期利息	AA+	4.30%	0.44
南山二 05	2017 年 9 月 30 日	按季付息、到期一次还本并 支付最后一期利息	AA+	4.40%	0.31
南山二 06	2017 年 12 月 31 日	按季付息、到期一次还本并 支付最后一期利息	AA+	4.50%	0.44
南山二 07	2018 年 3 月 31 日	按季付息、到期一次还本并 支付最后一期利息	AA+	4.60%	0.34
南山二 08	2018 年 6 月 30 日	按季付息、到期一次还本并 支付最后一期利息	AA+	4.70%	0.47
南山二 09	2018 年 9 月 30 日	按季付息、到期一次还本并 支付最后一期利息	AA+	5.10%	0.33
南山二 10	2018 年 12 月 31 日	按季付息、到期一次还本并 支付最后一期利息	AA+	5.10%	0.45
南山二 11	2019 年 3 月 31 日	按季付息、到期一次还本并 支付最后一期利息	AA+	5.10%	0.30
南山二 12	2019 年 6 月 30 日	按季付息、到期一次还本并 支付最后一期利息	AA+	5.10%	0.34
次级资产支 持证券	2019 年 6 月 30 日	到期一次还本付息	无	无	0.36
总计					4.92

2.管理人并未以自有资金或者其管理的资产管理计划、其他客户资产、证券投资基金等认购资产支持证券。

（二）增信措施

1、南山租赁差额支付承诺

南山租赁出具《差额支付承诺函》，承诺若每一个资金确认日可供分配的资金不足以偿付当期优先级资产支持证券投资者应分配的本金及预期收益，则由其对该差额部分进行补足，在差额支付承诺人划款日将差额部分资金划转至专项计划账户。若上述差额支付事项是由于承租人未能按期支付租金导致的且该承租人后续又支付了该笔租金和逾期罚息，在不构成违约基础资产赎回情况下，专项计划受到该笔租金和逾期罚息后，专项计划将南山租赁支付的差额支付款划转给南山租赁。南山集团承诺为南山租赁上述差额支付款提供流动性支持。

2、南山集团担保

担保人南山集团与计划管理人、原始权益人签订《担保合同》，约定为专项计划按照《认购协议》的规定向优先级资产支持证券持有人分配本金和预期收益提供无条件的不可撤销的连带责任担保。每一个资金确认日可供分配的资金不足以偿付当期优先级资产支持证券投资者应分配的本金及预期收益时，若差额支付承诺人南山租赁未能按照约定在差额支付承诺人划款日足额划转差额资金，则由计划管理人向担保人发出《担保履约通知书》，担保人根据《担保合同》的约定，按《担保履约通知书》的要求将相应款项划转至专项计划账户。

（三）原始权益人

南山融资租赁（天津）有限公司

（四）管理人

信达证券股份有限公司

（五）担保人

南山集团有限公司

（六）托管人

中国光大银行股份有限公司北京分行

（七）监管银行

江苏银行股份有限公司镇江分行

（八）资产支持证券登记及转让

专项计划存续期内，优先级资产支持证券将在中证登上海分公司登记托管。优先级资产支持证券在上交所固定收益证券综合电子平台进行转让、交易；次级资产支持证券由原始权益人持有到期，不进行挂牌。

二、基础资产的运行状况

ABS 二期项目统计（截止到 2016 年末）

合同号	承租人	租赁期限	投放金额 (万元)	2016 年底止已 收租金（元）	2016 年底至 2019 年 6 月 28 日租金余额 (元)
-----	-----	------	--------------	---------------------	---

NSFL[融] 字第 2015015 号	朝阳市中心医院	2015.05.12- 2020.05.11	10,000.00	42,118,750.00	60,687,500.00
NSFL[融] 字第 2015018 号	朝阳市第二医院	2015.06.06- 2020.06.05	5,500.00	22,952,187.50	33,214,843.75
NSFL[融] 字第 2015014 号	常德市城市建设投 资集团有限公司	2015.06.09- 2018.12.08	10,000.00	49,614,105.00	66,152,140.00
NSFL[融] 字第 2015019 号	都江堰兴市旅游发 展有限公司	2015.08.05- 2020.08.04	10,000.00	103,721,727.24	-
NSFL[融] 字第 2015016 号	成都市新都区兴水 投资有限责任公司	2015.08.21- 2020.08.20	10,000.00	30,578,360.00	61,156,720.00
NSFL[融] 字第 2015034 号	三都水族自治县人 民医院	2015.09.30- 2018.09.29	3,300.00	15,830,800.00	22,084,895.00
NSFL[融] 字第 2015027 号	景东彝族自治县人 民医院	2015.09.01- 2020.08.31	3,500.00	12,315,625.00	21,634,375.00
NSFL[融] 字第 2015029 号	兴文县中医医院	2015.09.29- 2020.9.28	2,000.00	6,276,180.00	12,480,910.00
NSFL[融] 字第 2015028 号	兴文县人民医院	2015.09.29- 2020.09.28	1,000.00	3,138,090.00	6,240,460.00
NSFL[融] 字第 2015031 号	盈江县人民医院	2015.09.22- 2020.09.21	2,000.00	6,264,210.00	12,457,050.00
NSFL[融] 字第 2015041 号	澜沧拉祜族自治县 第一人民医院	2015.11.13- 2020.11.12	3,500.00	10,020,587.50	22,194,156.25
NSFL[融] 字第 2015040 号	大邑县人民医院	2015.11.12- 2020.11.11	2,200.00	5,566,592.00	13,916,490.00
NSFL[融] 字第 2015039 号	麻栗坡县人民医院	2015.11.12- 2020.11.11	2,500.00	6,816,082.00	15,729,420.00
合计			65,500.00	315,213,296.24	347,948,960.00

注：NSFL[融]字第 2015019 号融资租赁合同项下都江堰兴市旅游发展有限公司的租金已提前偿还并划付至专项计划托管账户。

三、特定原始权益人的经营情况

2016 年签约项目行业分布和承租人背景

单位：亿元

行业	2015 年底租赁余额	各行业占比	2016 年底租赁余额(元)	各行业占比
医疗	9.85	26.81%	12.25	34.56%
航空	4.59	12.50%	10.17	28.70%
公共事业	9.34	25.42%	10.31	29.08%
通道	11.79	32.10%	2.71	7.66%
其他	1.16	3.17%	-	-
合计	36.73	100%	35.44	100%

单位：亿元

	租赁余额 2015 年底	租赁余额 2016 年底
国有控股	28.81	26.75
私人控股	7.92	8.69
外资控股		
台港澳与境内合资		
其他		
合计	36.73	35.44

四、增信机构的财务情况

以下数据引自担保人南山集团有限公司 2016 年审计报告和 2015 年审计报告。

单位：万元

项目	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
总资产	11,602,439.31	10,042,720.20
净资产	5,703,508.28	5,439,143.60
营业总收入	2,848,353.64	2,976,685.77
净利润	292,619.18	286,646.81
经营活动现金流量净额	342,488.92	369,393.46

五、业务参与人的履约情况

本报告期内，专项计划管理人、托管人、原始权益人等业务参与人均按照《南山租赁二期资产支持专项计划标准条款》及相关协议的

约定，恪尽职守，严格履行了各自的职责和义务。

六、专项计划账户资金收支情况

报告期内，专项计划向原始权益人支付基础资产购买价款 492,000,000.00 元，报告期内，收到原始权益人归集的基础资产款项 119,926,112.25 元，截至 2016 年 12 月 31 日，专项计划账户资金余额为 30,834,139.06 元。

七、专项计划资产投资运作情况

专项计划存续期间专项计划投资于南山租赁收益权，截至 2016 年 12 月 31 日，专项计划账户资金余额为 30,834,139.06 元。

八、专项计划资产收益分配情况

根据《南山租赁二期资产支持专项计划说明书》中关于收益分配的规定，本专项计划于 2016 年 9 月 30 日进行第 1 次收益分配。本次分配的分配对象为权益登记日登记在册的本专项计划优先级资产支持证券的全体持有人，向南山二 01、南山二 02、南山二 03、南山二 04、南山二 05、南山二 06、南山二 07、南山二 08、南山二 09、南山二 10、南山二 11、南山二 12 持有人共分配金额 4,026.50 万元。由于本次分配时本集合计划尚未在中国证券登记结算有限公司上海分公司登记，由管理人自行进行收益分配，手续费 0 元。

本专项计划于 2016 年 12 月 31 日进行第 2 次收益分配，本次分配的分配对象为权益登记日在中国证券登记结算有限公司上海分公

司登记在册的本专项计划优先级资产支持证券的全体持有人，向南山二 02、南山二 03、南山二 04、南山二 05、南山二 06、南山二 07、南山二 08、南山二 09、南山二 10、南山二 11、南山二 12 持有人共分配金额 4,887.91 万元，手续费 2,443.97 元。

九、其他事项

1、报告期内，专项计划管理人、托管人、监管银行均未发生变更。

2、本计划管理人信达证券于 2016 年 9 月 5 日收到中国证监会出具的《行政处罚决定书》，中国证监会就信达证券在推荐振隆特产股份有限公司首次公开发行股票并上市过程中，未能勤勉尽责地执行法定职责，没收公司业务收入 160 万元，并处以 320 万元罚款。上述处罚信达证券已履行完毕。目前，证监会已恢复受理信达证券的保荐业务，其他各项业务均正常开展。

十、备查文件

（一）备查文件

《南山租赁二期资产支持专项计划标准条款》

《南山租赁二期资产支持专项计划资产支持证券认购协议》

《南山租赁二期资产支持专项计划资产买卖协议》

《南山租赁二期资产支持专项计划监管协议》

《南山租赁二期资产支持专项计划托管协议》

《南山租赁二期资产支持专项计划差额支付承诺函》

《南山租赁二期资产支持专项计划违约基础资产回购承诺函》

《南山租赁二期资产支持专项计划服务协议》

《关于南山融资租赁（天津）有限资产公司应收账款权益资产支持专项计划的法律意见书》

《南山租赁二期资产支持专项计划信用评级报告》

管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

托管人业务资格批件和营业执照

原始权益人关于基础资产及其转让安排真实性、合法性的承诺函

（二）查阅地点

信达证券股份有限公司公司网站

联系地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

联系电话：010-83326851

信达证券股份有限公司

2017年4月27日

