

**兴业圆融-太平洋寿险保单贷款 1 期资产支持专项计划
2020 年度托管报告**

招商银行股份有限公司上海分行

二〇二一年四月

重要提示

本报告依据《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》《证券公司及基金管理公司子公司资产证券化业务信息披露指引》《上海证券交易所资产支持证券定期报告内容与格式指引》以及其他相关规定制作。本报告由托管人招商银行股份有限公司上海分行负责编制，托管人保证本报告的内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并承担相应的法律责任。

本专项计划年度资产管理报告中“专项计划账户资金管理、运用、处分情况”与年度托管报告核对一致，有关数据的真实性、准确性、完整性已进行复核无误。

目录

重要提示.....	2
第一节 报告期内履行职责和义务的情况.....	4
一、 遵守法规规定、合同约定情况.....	4
二、 勤勉尽责情况.....	4
三、 保管专项计划资产情况.....	4
四、 监督管理人情况.....	4
第二节 专项计划资产隔离情况.....	4
第三节 监督管理人情况.....	4
一、 对计划管理人指令的复核情况.....	4
二、 计划管理人指令是否合规.....	4
三、 其他监督事项的执行情况.....	4
第四节 专项计划资金运用、处分情况.....	5
一、 专项计划账户资金收支情况.....	5
二、 专项计划投资管理情况.....	5
三、 向金融机构等借款情况.....	5
四、 专项计划资金运用、处分的其他情况.....	5
第五节 附件目录.....	6

第一节 报告期内履行职责和义务的情况

在报告期内专项计划资产托管过程中是否严格遵守了法律、法规规定和计划说明书、托管协议约定，勤勉尽责地履行托管职责和义务，安全保管专项计划相关资产

是 否

在报告期内是否积极监督管理人对专项计划资产的运作，不存在违反计划说明书及托管协议约定的情形

是 否

第二节 专项计划资产隔离情况

托管的专项计划资产是否独立于其自身固有财产和所托管的其他资产，且托管的专项计划资产所产生的债权不与其自身固有财产和所托管的其他资产产生的债务相抵销

是 否

第三节 监督管理人情况

报告期内是否认真复核管理人的每项管理指令

是 否

计划管理人指令是否存在违反相关规定或计划说明书及托管协议约定的情形或损害资产支持证券投资者利益的情形

是 否

其他监督事项的执行情况

适用 不适用

第四节 专项计划资金运用、处分情况

一、 专项计划账户资金收支情况

单位：元币种：人民币

收支日期	收支金额	收入来源	支出用途	支出用于分配的 证券代码	备注
报告期初余额	0.00				
2020年9月22日	2,000,000,000.00	募集资金转托管户			
2020年9月23日	-2,000,000,000.00		购买基础资产		
2020年10月19日	20,300.00	垫付太保 ABS 登记费及手续费			
2020年10月19日	-18,000.00		169314 初始登记费		
2020年10月19日	-1,400.00		169315 初始登记费		
2020年10月19日	-600.00		169316 初始登记费		
2020年10月19日	-200.00		批量扣费		
2020年10月28日	594,025,516.99	保单贷款资金			
2020年10月28日	-592,522,216.99		第一次循环购买价款		
2020年10月28日	-130,000.00		返还太保 1 期 ABS 垫付的初始评级费		
2020年10月28日	-20,300.00		返还兴证资管垫付的登记费&手续费		
2020年10月28日	-100,000.00		太保 1 期 ABS 初始会计师费		
2020年10月28日	-250,000.00		太保 1 期 ABS 初始律师费		
2020年10月28日	-500,000.00		太保 1 期 ABS 管理费		
2020年10月28日	-200,000.00		太保 1 期 ABS 托管费		
2020年10月28日	-300,000.00		太保 1 期 ABS 销售费		

2020 年 11 月 6 日	-280.00		批量扣费		
2020 年 11 月 26 日	390,701,733.91	保单贷款资金			
2020 年 11 月 26 日	-390,704,253.91		第二次循环购买		
2020 年 12 月 7 日	-200.00		批量扣费		
2020 年 12 月 21 日	19,445.32	存款利息			
2020 年 12 月 28 日	358,628,823.38	保单贷款资金			
2020 年 12 月 28 日	-358,628,823.38		第三次循环购买价款		
报告期末余额	19,545.32				

二、 专项计划投资管理情况

适用 不适用

三、 向金融机构等借款情况

适用 不适用

四、 专项计划资金运用、处分的其他情况

适用 不适用

第五节 附件目录

无

(以下无正文, 为兴业圆融-太平洋寿险保单贷款 1 期资产支持专项计划 2020 年度托管报告盖章页)

招商银行股份有限公司上海分行

2021 年 4 月 29 日



