

东方财富证券瑞高保理（财盈二期）资产支持专项计划

2016 年年度资产管理报告

一、 重要提示

1、本报告依据中国证监会《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》以及其他相关规定制作。

2、本报告由管理人西藏东方财富证券股份有限公司编制，管理人声明保证本报告信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本报告关于专项计划基础资产运行情况及原始权益人经营情况的数据由瑞高商业保理(上海)有限公司提供。

3、西藏东方财富证券瑞高保理（财盈二期）资产支持专项计划于 2016 年 04 月 19 日成立。

4、本报告期自 2016 年 04 月 19 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

二、 专项计划基本概况

本专项计划发行的资产支持证券各类别情况如下表所示：

系列	规模 (万元)	产品期限	还本付息方式	评级	预期收益率
优先级	21,000	20 个月	产品届满 12 个月进行第一次本息兑付； 产品届满 20 个月，到期还本付息	AAA	产品成立后第 0-12 个月届满 5.5%/年； 产品成立后第 12-20 个月届满 8.0%/年
次级	3,000	20 个月	到期一次性还本付息	无	-
销售对象	由合格机构投资者认购，最低认购金额为 100 万元。				
管理人	西藏东方财富证券股份有限公司				
托管银行 票据服务银行	中信银行股份有限公司上海分行				



三、 主要财务指标和集合计划净值表现

1、基础资产回收情况统计

项目	金额
期初应收票据本金余额（万元）	24,000.00
当期本金回收款（万元）	0.00
当期利息回收款（万元）	0.00
期末应收票据本金余额（万元）	24,000.00
期初应收票据数（笔）	3
当期到期票据数（笔）	3

2、基础资产逾期情况

无

3、新增基础资产情况

无

4、不合格基础资产赎回

无

四、 专项计划资金投资运营情况

专项计划账户内全部资金用于支付基础资产购买价款及管理费后，无余额。

五、 专项计划账户资金收支情况

本报告期内，账户资金具体收支情况如下表所示：

科目：	万元人民币
期初余额（万元）	24,000.00
支付基础资产购买价款（万元）	(23,976.00)
支付管理人管理费（万元）	(24.00)
期末余额（万元）	0.00

六、 各档次资产支持证券的本息兑付情况

根据《东方财富证券瑞高保理（财盈二期）资产支持专项计划说明书》规定，本报告期内优先级、次级资产支持证券均无收益分配。

七、 其他事项



本报告期内原始权益人持续经营，未发生违反合同约定的损害基础资产及其收益的情况。

本报告期内专项计划管理人、托管人、评级机构未发生变更。

本报告期内专项计划优先级资产支持证券的评级未发生变化。

八、 备查文件目录

- 1、《东方财富证券瑞高保理（财盈二期）资产支持专项计划标准条款》；
- 2、《东方财富证券瑞高保理（财盈二期）资产支持专项计划资产买卖协议》；
- 3、《东方财富证券瑞高保理（财盈二期）资产支持专项计划资产服务协议》；
- 4、《东方财富证券瑞高保理（财盈二期）资产支持专项计划托管协议》；
- 5、《东方财富证券瑞高保理（财盈二期）资产支持专项计划票据服务协议》；
- 6、《东方财富证券瑞高保理（财盈二期）资产支持专项计划票据质押协议》；
- 7、《东方财富证券瑞高保理（财盈二期）资产支持专项计划认购协议与风险揭示书》；
- 8、《东方财富证券瑞高保理（财盈二期）资产支持专项计划说明书》；
- 9、《东方财富证券瑞高保理（财盈二期）资产支持专项计划尽调报告》；
- 10、《东方财富证券瑞高保理（财盈二期）资产支持专项计划法律意见书》；
- 11、《东方财富证券瑞高保理（财盈二期）资产支持专项计划评级报告》；
- 12、《保险赔款转让协议》；
- 13、专项计划管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 14、托管人业务资格批件和营业执照复印件。

备查文件查阅地点：

西藏东方财富证券股份有限公司

文件存放地点：上海市宛平南路 88 号金座 17 层

信息披露网址：<http://www.xzsec.com/>

联系人：向明、徐斐斐

联系电话：4009112233 23586418

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人西藏东方财富证券股份有限公司。

西藏东方财富证券股份有限公司

2017 年 03 月

