

管理报告

产品名称：云南信托天富宝稳健 1期集合资金信托计划-第 21期

成立时间：2016 年12月29日

报告期间：2022 年度

报 告 人：云南国际信托有限公司

本报告书是依据《中华人民共和国信托法》《信托公司管理办法》及本信托文件规定完成。在信托存续期间，云南国际信托有限公司（以下简称云南信托）认真履行了受托人职责，诚实、信用、谨慎和有效地对信托财产进行了管理。

第一节 信托产品概况及信托资金管理情况

信托成立于 2016 年12 月29 日，成立时信托规模为人民币 伍仟万（小写：50000000.00），信托期限不少于 12 个月。信托项目自成立到报告期已存续 72 个月。

第二节 信托财产专户开立情况

信托财产专户名：云南国际信托有限公司

信托财产专户账号：216200100100923049

信托财产专户开户行：兴业银行上海分行营业部

第三节 信托资金管理、运用、处分及收益情况

受托人严格按照信托合同的约定，对信托资金进行管理、运用及处分。截止报告期信托资金管理、运用、处分及收益情况如下：

资产负债表

云南国际信托有限公司____（云南信托天富宝稳健 1期集合资金信托计划-
第 21期）____专用表（2022-12-31）

单位：元

项目	年初数	期末数
信托资产：		
货币资金	9,901.20	39,901.20
拆出资金	0.00	0.00
存出保证金	0.00	0.00
交易性金融资产	59,308,109.59	16,098,109.59
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00
其中：买入返售证券	0.00	0.00
买入返售信贷资产	0.00	0.00
应收款项	0.00	0.00
贷款	0.00	0.00
其他债权投资	0.00	0.00
债权投资	0.00	0.00
其他债权投资 1	0.00	0.00
长期应收款	0.00	0.00
长期股权投资	0.00	0.00
投资性房地产	0.00	0.00
固定资产	0.00	0.00
无形资产	0.00	0.00
长期待摊费用	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
信托资产总计	59,318,010.79	16,138,010.79
信托负债：		
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
应付受托人报酬	248,714.98	290,369.36
应付托管费	82,905.03	96,789.82
应付受益人收益	0.00	0.00

应交税费	303,642.40	303,642.40
应付销售服务费	0.00	0.00
其他应付款项	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00
信托负债合计	635,262.41	690,801.58
信托权益：		
实收信托	44,350,000.00	44,350,000.00
其中：资金信托	44,350,000.00	44,350,000.00
财产信托	0.00	0.00
资本公积	0.00	0.00
其他综合收益	0.00	0.00
未分配利润	14,332,748.38	-28,902,790.79
信托权益合计	58,682,748.38	15,447,209.21
信托负债及信托权益总计	59,318,010.79	16,138,010.79

信托项目利润及利润分配表

云南国际信托有限公司____（云南信托天富宝稳健1期集合资金信托计划-第21期）__专用表（2022-12-31）

单位：元

项目	上期金额	本期金额
1. 营业收入	1,315,307.56	-43,180,000.00
1.1 利息收入	0.00	0.00
1.2 投资收益	1,315,307.56	0.00
其中：交易性债券利息收入	1,315,307.56	0.00
交易费用	0.00	0.00
1.3 公允价值变动损益	0.00	-43,180,000.00
1.4 租赁收入	0.00	0.00
1.5 汇兑损益	0.00	0.00
1.6 其它收入	0.00	0.00
2. 支出	121,834.17	55,539.17
2.1 营业税金及附加	4,735.16	0.00
2.2 受托人报酬	87,824.25	41,654.38
其中：暂估受托人报酬	0.00	0.00

2.3 托管费	29,274.76	13,884.79
2.4 投资管理费	0.00	0.00
2.5 销售服务费	0.00	0.00
2.6 信用减值损失	0.00	0.00
2.7 其它费用	0.00	0.00
3. 信托净利润	1,193,473.39	-43,235,539.17
4. 其它综合收益	0.00	0.00
5. 综合收益	1,193,473.39	-43,235,539.17
加：期初未分配信托利润	13,139,274.99	14,332,748.38
加：未分配信托利润平准金	0.00	0.00
6. 可供分配的信托利润	14,332,748.38	-28,902,790.79
减：本期已分配信托利润	0.00	0.00
7. 期末未分配信托利润	14,332,748.38	-28,902,790.79

净资产变动表

云南国际信托有限公司____（云南信托天富宝稳健 1 期集合资金信托计划-第 21 期）__专用表（2022-12-31）

单位：元

项目	本期金额_实收资金	本期金额_其他综合收益	本期金额_未分配利润	本期金额_净资产合计
一、上期期末余额	44,350,000.00	0.00	14,332,748.38	58,682,748.38
加：会计政策变更	0.00	0.00	0.00	0.00
前期差错更正	0.00	0.00	0.00	0.00
其他	0.00	0.00	0.00	0.00
二、本期期初余额	44,350,000.00	0.00	14,332,748.38	58,682,748.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	0.00	0.00	-43,235,539.17	-43,235,539.17
（一）综合收益总额	0.00	0.00	-43,235,539.17	-43,235,539.17

(二) 产品持有人 申购和赎回	0.00	0.00	0.00	0.00
其中: 1、产品申购	0.00	0.00	0.00	0.00
2、产品赎回	0.00	0.00	0.00	0.00
(三) 利润分配	0.00	0.00	0.00	0.00
(四) 其他综合收 益结转留存收益	0.00	0.00	0.00	0.00
四、本期期末余额	44,350,000. 00	0.00	-28,902,790.7 9	15,447,209.21

项目	上期金额_ 实收资金	上期金 额_其他综合 收益	上期金额_未 分配利润	上期金额_净 资产合计
一、上期期末余额	44,350,000. 00	0.00	13,139,274.9 9	57,489,274.9 9
加: 会计政策变更	0.00	0.00	0.00	0.00
前期差错更正	0.00	0.00	0.00	0.00
其他	0.00	0.00	0.00	0.00
二、本期期初余额	44,350,000. 00	0.00	13,139,274.9 9	57,489,274.9 9
三、本期增减变动 额(减少以“-”号填列)	0.00	0.00	1,193,473.39	1,193,473.39
(一) 综合收益总 额	0.00	0.00	1,193,473.39	1,193,473.39
(二) 产品持有人 申购和赎回	0.00	0.00	0.00	0.00
其中: 1、产品申购	0.00	0.00	0.00	0.00
2、产品赎回	0.00	0.00	0.00	0.00
(三) 利润分配	0.00	0.00	0.00	0.00
(四) 其他综合收 益结转留存收益	0.00	0.00	0.00	0.00
四、本期期末余额	44,350,000. 00	0.00	14,332,748.3 8	58,682,748.3 8

第四节 信托经理变更情况

以信托经理变更临时信息披露公告为准。

第五节 重大变动说明及其它管理情况

本信托单元的信托资金投资于【16 美兰机场 MTN001】，受托人从《海口美兰国际机场有限责任公司关于不行使 2016 年度第一期中期票据赎回权及票面利率重置的公告》《海口美兰国际机场有限责任公司 2016 年度第一期中期票据 2019 年递延支付利息的公告》中获悉：

1. 发行人（海口美兰国际机场有限责任公司）在 2019 年 12 月 29 日（即本期债券第 3 个付息日）不行使赎回权；
2. 将 2019 年当期利息以及已经递延的所有利息及其孳息推迟至下一个付息日支付；
3. 按照《募集说明书》相关约定重置该笔债券在第 4 个计息年度至第 6 个计息年度的票面利率，具体重置情况如下：
 - （1）利率类型：固定利率；
 - （2）利率重置期限：在第 4 个计息年度至第 6 个计息年度内保持不变；
 - （3）首得利率重置日：2019 年 12 月 29 日；
 - （4）下一个利率重置日：2022 年 12 月 29 日
 - （5）利率重置规则：票面利率从 2019 年 12 月 29 日起跳升为当期基准利率加上初始利差 3.57% 再加上 300 个基点。当期基准利率为 2019 年 12 月 23 日-2019 年 12 月 27 日中国债券信息网（www.chinabond.com.cn）（或中央国债登记结算有限责任公司认可的其他网站）公布的中债银行间固定利率国债收益率曲线中，待偿期为 3 年的国债收益率算术平均值（四舍五入计算到 0.01%）。

2020 年 9 月 23 日，大公国际资信评估有限公司发布编号为大公报 SDP【2020】324 号的《跟踪评级公告》，从中获悉：大公国际资信评估有限公司确定海口美

兰国际机场有限责任公司的主体长期信用等级维持 AA+，列入观察信用名单，“16 美兰机场 MTN001”、“17 美兰机场 MTN001”的信用等级维持 AA+。

2020 年11 月24 日，海口美兰国际机场有限责任公司发布《海口美兰国际机场有限责任公司关于公司股东股权结构调整的公告》，从中获悉：公司股东海南省发展控股有限公司将其所持有公司 18.23%股权全部转让给海南省国有资产监督管理委员会，本次股权划转后，海南省国资委持有公司股权占公司注册资本总额的 18.23%。上述变更事项尚未完成工商变更。

2020 年12 月1日，大公国际资信评估有限公司发布《大公关于关注海口美兰国际机场有限责任公司关于公司股东股权结构调整的公告》，其中表示：大公评定美兰机场主体信用等级为 AA+，“16 美兰机场 MTN001”、“17 美兰机场 MTN001”的信用等级为 AA+，并将美兰机场主体与“16 美兰机场 MTN001”、“17 美兰机场 MTN001”列入信用观察名单。

2020 年12 月22 日，海口美兰国际机场有限责任公司发布《海口美兰国际机场有限责任公司 2016 年度第一期中期票据 2020 年递延支付利息的公告》称：“16 美兰机场 MTN001”应于 2020 年12 月29 日兑付利息，公司依据“16 美兰机场 MTN001”的募集说明书条款约定，决定递延支付本期债券的当期利息，该票据 2020 年12 月29 日应付的 13,995 万元利息进行递延支付，该笔利息递延期间按 12.33%计息。

2021 年3月1日，大公国际资信评估有限公司发布《大公关于将海口美兰国际机场有限责任公司主体信用等级下调至 AA-的公告》，称：大公决定调整美兰机场主体信用等级为 AA-，“16 美兰机场 MTN001”和“17 美兰机场 MTN001”的信用等级调整为 AA-，同时将美兰机场主体与“16 美兰机场 MTN001”和“17 美兰机场 MTN001”继续列入信用观察名单。

2021 年3月16 日，海口美兰国际机场有限责任公司发布《关于海口美兰国际机场有限责任公司被法院裁定重整的公告》，称：2021 年3月13 日，海南省高院依法裁定海口美兰国际机场有限责任公司重整。重整案第一次债权人会议将于 2021 年6月4日上午9:00 在最高人民法院全国企业破产重整案件信息网 (<http://pccz.court.gov.cn/>) 采取网络方式召开，具体会议细节由海航集团有限公司管理人另行通知。

2021年3月18日，海口美兰国际机场有限责任公司发布《海口美兰国际机场有限责任公司关于法院裁定重整暨相关债券到期的公告》，海口美兰国际机场有限责任公司目前在银行间市场存续三期债务融资工具：19 美兰机场 SCP001、16 美兰机场 MTN001、17 美兰机场 MTN001。上述三期债务融资工具于 2021 年2月10日到期并停止计息。美兰机场公告自 2021 年2月10日起，本期债券提前到期。发行人未能将兑付本息划付至银行间市场清算所股份有限公司，构成实质违约。

我司根据委托人的建议，已进行债权申报。

2021年3月18日，大公国际资信评估有限公司发布《大公关于将海口美兰国际机场有限责任公司主体信用等级下调至 C的公告》，称：大公决定调整美兰机场主体信用等级为 C。

2021年6月4日上午 9:00，公司重整案第一次债权人会议在最高人民法院全国企业破产重整案件信息网（<http://pccz.court.gov.cn/>）采取网络方式召开，我司通过线上参与了此次会议。

根据海口美兰国际机场有限责任公司 2021 年6月9日披露的《海口美兰国际机场有限责任公司关于第一次债权人会议召开情况的公告》整理会议情况如下：

（一）会议议程

主要包括：合议庭介绍案件受理及管理人指定情况；管理人作重整期间阶段性工作报告；联合工作组通报债务人企业自行管理工作情况；管理人作债务人企业财产状况调查报告；管理人对债权申报及审查情况进行情况说明等。

（二）会议召开情况

本次债权人会议以网络会议的方式召开，相关债权人、债务人、职工代表、工会代表与会。公司第一次债权人会议顺利完成既定会议议程。

（三）会议表决情况

本次债权人会议无表决事项。

此次会议，债权人审核了《海航集团有限公司等 321 家公司实质合并重整案第一次债权人会议债权表》，本信托单元的部分申报金额未给予认定。根据要求，债权人需在会议结束后 15 日内向管理人提交《债权异议申报书》进行异议申报。

我司已将会议纪要向委托人进行披露。委托人未向我司出具异议申报的相关建议。

2021年7月16日,本信托单元的信托经理现场参与了海航集团破产重整进展通报会。

2021年9月10日,本信托单元的信托经理现场参加了海航集团债务沟通会。2021年9月29日上午9:00,海航集团等321家公司实质合并重整案第二次债权人会议通过“全国企业破产重整案件信息网(<http://pccz.court.gov.cn>),采取网络方式召开,并对《海航集团有限公司等三百二十一家公司实质合并重整案重整计划(草案)》进行表决。本次债权人会议采用线下纸质投票和网络投票相结合的形式,两者具有同等的法律效力。我司通过线上方式参与了此次会议,并采取纸质投票的方式进行表决。

2021年10月15日,我司收到受益人出具的关于对《海航集团有限公司等三百二十一家公司实质合并重整案重整计划(草案)》进行表决的书面回复,建议同意《海航集团有限公司等三百二十一家公司实质合并重整案重整计划(草案)》。

2021年10月18日,我司根据受益人的建议向管理人提交《海航集团有限公司等三百二十一家公司实质合并重整案第二次债权人会议普通债权组表决票》同意《海航集团有限公司等三百二十一家公司实质合并重整案重整计划(草案)》。

2021年10月23日,海航清算组通过“全国企业破产重整案件信息网”(<http://pccz.court.gov.cn/pcajxxw/pcgg/ggxq?id=D0DDD94F0F3915EC7EA7153AB2DFC6D6>)发布《海航集团有限公司等三百二十一家公司实质合并重整案重整计划(草案)》表决结果公告,从中获悉:海航集团等三百二十一家公司各表决组已表决通过《重整计划草案》。后续,将依法向海南高院提出批准重整计划的申请。

2021年10月25日,海口美兰国际机场有限责任公司亦发布了《海口美兰国际机场有限责任公司关于第二次债权人会议召开及表决结果的公告》。

2021年11月11日,我司根据《受领偿债资源的账户信息/登记信息告知书填写指引》向管理人提交了《受领偿债资金及/或信托份额登记信息告知书》。

2022 年1月10 日，本信托单元收到海口美兰国际机场有限责任公司的 3 万元小额清偿款。

2022 年4月19 日，“海航集团破产重整专项服务信托”成立（以下简称“专项信托”）。由中信信托有限责任公司和光大兴陇信托有限责任公司组成的联合体为专项信托的受托人。

2022 年4月24 日，海航集团收到海南省高院送达的（2021）琼破号之三百八十三《民事裁定书》，裁定确认海航集团有限公司等三百二十一家公司已执行完毕《海航集团等三百二十一家公司实质合并重整案重整计划》，该裁定为终审裁定。

2022 年5月11 日，我司通过海航集团破产重整专项服务信托系统确认受领信托份额 58,879,069.68 份。

专项信托通过海航集团破产重整专项服务信托系统发布《海航集团破产重整专项服务信托第一次受益人大会会议通知》，该次会议定于 2022 年6月22 日9 时整通过中信银行股份有限公司“银法通”系统召开，受益人通过网络会议系统审议议案并表决。网络投票截止为 2022 年6月22 日17 时整。我司已向委托人披露上述受益人大会事宜，但因我司未收到委托人的参会建议以及投票建议，故未参加本次会议且未参与投票。

2022 年8月31 日，海口美兰国际机场有限责任公司披露《海口美兰国际机场有限责任公司关于不能按时披露 2022 年半年度报告的公告》。

根据 2022 年9月30 日披露的《中国光大银行股份有限公司关于海口美兰国际机场有限责任公司 2016 年度第一期中期票据违约后续进展情况的公告（2022 年 9 月）》，截至 2022 年9月30 日，主承销持续督促发行人尽快配合召开持有人会议，同时提示投资人尽快拟定持有人会议议案。

2022 年11 月3日，海口美兰国际机场有限责任公司披露《海口美兰国际机场有限责任公司关于债券注销的公告》，从中获悉：银行间市场清算所股份有限公司注销前期美兰机场发行的债券，包含：16 美兰机场MTN001（代码：101661036）、17 美兰机场MTN001（代码：101761024）、19 美兰机场 SCP001（代码：011900659）。

云南信托天富宝稳健 1 期集合资金信托计划各单元独立核算、独立运作。云南信托将持续关注本信托投资标的的后续进展情况。

本报告系就云南信托根据本报告期内所能知悉的公开信息或能够以合法手段获取的其他信息出具，本报告未尽事宜，以临时信息披露为准。

云南国际信托有限公司

（签章处）

2023-2-2