

华菁证券有限公司关于华融·共赢一期 信托受益权资产支持专项计划第1期收益分配的公告

华融·共赢一期信托受益权资产支持专项计划（以下简称“本专项计划”）于2017年2月23日由华菁证券有限公司（以下简称“管理人”）设立并开始运作。本专项计划设置优先级资产支持证券和次级资产支持证券两类资产支持证券。其中优先级资产支持证券共分为三个类别：优先A档资产支持证券、优先B档资产支持证券及优先C档资产支持证券。截至目前，本次发行的资产支持证券各类别情况如下表所示：

证券代码	系列	到期日	还本付息方式	评级	预期年收益率(%)	总规模(亿元)
SQ7099	华融 1A	2018/7/24	按季/半年付息，过手还本；兑付日为2017年7月24日、2018年1月24日、2018年7月24日、2018年10月24日以及2019年1月24日，若该日为非工作日则为该日后的第一个工作日。	AAA	5.38	28.27
SQ7100	华融 1B	2018/10/24		AA+	6.00	5.11
SQ7101	华融 1C	2019/1/24		AA	6.45	3.84
SQ7041	华融 1次	2019/1/24	按季/半年取得不超过5%/年期间收益，在优先级证券本金偿付完毕后剩余专项计划资产将按其当时原状分配给次级。	-	-	2.81
						40.03

根据《华融·共赢一期信托受益权资产支持专项计划说明书》的约定，本专项计划优先级资产支持证券投资者第一期获得分配本金的具体情况如下所示：

华融 1A：期初规模：2,827,000,000.00 元；本期兑付本金：1,627,645,000.00 元；本次兑付后未偿本金余额：1,199,355,000.00 元；

华融 1B：期初规模：511,000,000.00 元；本期兑付本金：0 元；本次兑付后未



偿本金余额：511,000,000.00 元；

华融 1C：期初规模：384,000,000.00 元；本期兑付本金：0 元；本次兑付后未偿本金余额：384,000,000.00 元。

现将有关分配的具体事宜公告如下：

一、分配对象

本专项计划优先级资产支持证券本次分配对象为权益登记日登记在册的全体持有人。

本专项计划次级资产支持证券共计 2,810,000 份。

二、分配方案

1、优先级资产支持证券分配资金

兑付日优先级资产支持证券的预期收益=该兑付日该优先级资产支持证券届时的未偿本金余额×该优先级资产支持证券的预期收益率×该兑付日所在的预期收益计算期间÷365。

华融 1A：

本期分配预期收益= 2,827,000,000.00*5.38%*151/365=62,920,500.27 元；

本期分配本金= 1,627,645,000.00 元。

华融 1B：

本期分配预期收益= 511,000,000.00*6.00%*151/365=12,684,000.00 元；

本期分配本金= 0 元。

华融 1C：

本期分配预期收益= 384,000,000.00*6.45%*151/365=10,246,487.67 元；

本期分配本金= 0 元。

本次优先级资产支持证券的分配预期收益= 85,850,987.94 元；

本次优先级资产支持证券的分配本金= 1,627,645,000.00 元；

本次优先级资产支持证券分配总资金= 1,713,495,987.94 元。

2、次级资产支持证券分配资金

按不超过 5%/年的收益率支付该管理人分配日应支付的次级资产支持证券的期间收益。优先级资产支持证券本金全部偿付完毕后，剩余专项计划资产（包括但不限于剩余专项计划资金和基础资产）将按其当时原状分配给次级资产支持证券持有人。

华融 1 次：

本期分配预期收益 = $281,000,000.00 \times 5.00\% \times 151/365 = 5,812,465.75$ 元；

本期分配本金 = 0 元。

本次次级资产支持证券分配资金 = 5,812,465.75 元。

总计，本次资产支持证券共还本付息 1,719,308,453.69 元。如下表：

系列	规模 (亿元)	利率 (%)	计息 天数	付息金额 (元)	兑付本金 (元)	分配金额合计 (元)
华融 1A	28.27	5.38	151	62,920,500.27	1,627,645,000.00	1,690,565,500.27
华融 1B	5.11	6.00	151	12,684,000.00	0.00	12,684,000.00
华融 1C	3.84	6.45	151	10,246,487.67	0.00	10,246,487.67
华融 1 次	2.81	5.00	151	5,812,465.75	0.00	5,812,465.75
						1,719,308,453.69

三、资产支持专项计划分期偿还情况

华融 1A、华融 1B、华融 1C 本次分配后，本金未兑付完毕，将继续进行交易。

四、分配时间

1、华融 1A、华融 1B、华融 1C、华融 1 次的权益登记日均为 2017 年 7 月 21 日。资产支持证券持有人对应登记日登记在中证机构间报价系统所提供的本专项计划持有人名册上的优先级资产支持证券投资者可获得相应的收益分配资金款项。

2、华融 1A、华融 1B、华融 1C、华融 1 次的计息期间为 2017 年 2 月 23 日(含)至 2017 年 7 月 24 日(不含)。

3、兑付(息)日为 2017 年 7 月 24 日。中证机构间报价系统将相应款项划拨

至证券公司结算备付金账户，证券公司根据报价系统结算数据中的预期支付额的明细数据将相应款项划拨至资产支持证券持有人的资金账户。

五、分配方式

1. 现金分配。

2. 本专项计划优先级资产支持证券分配将由托管人根据管理人发出的分配指令，进行专项计划费用的提取和资金划付，并将相应资金划拨至中证机构间报价系统的指定账户用于支付资产支持证券本金和预期收益。

3. 本专项计划次级资产支持证券分配将由托管人根据管理人发出的分配指令，进行专项计划费用的提取和资金划付，并将相应资金划拨至中证机构间报价系统的指定账户用于支付资产支持证券本金和预期收益。

六、咨询方式

网址：www.huajingsec.com

电话：021-60156816

传真：021-60156733

地点：华菁证券有限公司

地址：上海市虹口区吴淞路575号虹口SOHO25楼

特此公告。

