

深圳平安大华汇通财富管理有限公司关于平安科慧供暖合同债权资产支持专项计划 2017 年第二期收益分配报告

一、 重要提示

深圳平安大华汇通财富管理有限公司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。

深圳平安大华汇通财富管理有限公司认为对投资者有重大影响的事项，将通过重要提示提醒投资者关注。

根据《平安科慧供暖合同债权资产支持专项计划说明书》（以下简称“《计划说明书》”）以及《平安科慧供暖合同债权资产支持专项计划标准条款》（以下简称“《标准条款》”）中的相关约定，平安科慧供暖合同资产支持专项计划（以下简称“本专项计划”）将于 2017 年 4 月 23 日（非工作日顺延至 4 月 24 日）进行第二次收益分配，计息期间为 2016 年 4 月 23 日（含该日）至 2017 年 4 月 23 日（不含该日）。

“科慧 02” 将于本次收益分配偿还全部本金，并于 2017 年 4 月 23 日（非工作日顺延至 4 月 24 日）摘牌。

二、 专项计划基本情况

平安科慧供暖合同债权资产支持专项计划（以下简称“专项计划”）于 2015 年 4 月 23 日由深圳平安大华汇通财富管理有限公司（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种资产支持证券，其中优先级资产支持证券



共分为 5 个品种，分别为：平安科慧优先 01（以下简称“科慧 01”）、平安科慧优先 02（以下简称“科慧 02”）、平安科慧优先 03（以下简称“科慧 03”）、平安科慧优先 04（以下简称“科慧 04”）、平安科慧优先 05（以下简称“科慧 05”）、平安科慧次级（以下简称“科慧次级”）。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：

证券全称	证券代码	证券简称	预期年化收益率	证券到期日	付息频率	本次付息的期间
平安科慧优先 01	119172	科慧 01	5.9%	2016年4月23日	每年分配一次收益，到期分配本金和收益	已兑付完毕
平安科慧优先 02	119173	科慧 02	6.45%	2017年4月23日	每年分配一次收益，到期分配本金和收益	2016年4月23日（含）至2017年4月23日（不含）
平安科慧优先 03	119174	科慧 03	6.5%	2018年4月23日	每年分配一次收益，到期分配本金和收益	2016年4月23日（含）至2017年4月23日（不含）
平安科慧优先 04	119175	科慧 04	7.2%	2019年4月23日	每年分配一次收益，到期分配本金和收益	2016年4月23日（含）至2017年4月23日（不含）
平安科慧优先 05	119176	科慧 05	7.4%	2020年4月23日	每年分配一次收益，到期分配本金和收益	2016年4月23日（含）至2017年4月23日（不含）
平安科慧次级	119177	科慧次级	不设预期收益率	2020年4月23日	每年向优先级资产支持证券分配本息的同时向次级资产支持证券持有人分配一次，在专项计划存续期内共向次级资产支持证券持有人分配 5 次。	托管户余额分配，优先级分配后专项计划账户剩余资金为 10 万元。

三、 分配方案

本次分配对象为：截止至 2017 年 4 月 21 日下午深圳证券交易所收市后，在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（以下简称“中

国结算深圳分公司”) 登记在册的全体平安科慧供暖合同债权资产支持专项计划优先级及次级资产支持证券持有人。

本专项计划资产支持证券每份发行面值为 100 元, 每 10 份发行面值为 1000 元。

1. 科慧 02

根据《计划说明书》分配约定的测算, “科慧 02” 本次兑付本金和收益合计为 53,225,000.00 元人民币¹, 其中本次本金偿还比例为 100%, 兑付本金共 50,000,000.0000 元人民币; 本次分配收益为 3,225,000.0000 元人民币。

“科慧 02” 本次每 10 份分配

$1000+1000 \times 6.45\%=1064.5000$ 元人民币 (含税), 其中本金 1000 元人民币, 派发收益 64.5000 元人民币 (含税)。

扣税后个人、证券投资基金资产支持证券持有人每 10 份分配

$1000+64.5000 \times (1-20\%)=1051.6000$ 元人民币, 其中本金 1000 元人民币, 派发收益为 51.6000 元人民币;

扣税后非居民企业 (包含 QFII、RQFII) 资产支持证券持有人每 10 份分配

$1000+64.5000 \times (1-10\%)=1058.0500$ 元人民币, 其中本金 1000 元人民币, 派发收益 58.0500 元人民币。

本次分配完成后, “科慧 02” 资产支持证券本金全部兑付完毕, 拟于兑付日摘牌。

¹本次兑付本金和收益合计=兑付本金总额+每 10 份分配收益*发行份数/10, 四舍五入, 保留两位小数。

2. 科慧 03

根据《计划说明书》分配约定的测算，“科慧 03”本次兑付收益合计为 3,250,000.00 元人民币。

“科慧 03”本次每 10 份分配

$1000 \times 6.5\% = 65.000000$ 元人民币（含税）

扣税后个人、证券投资基金资产支持证券持有人每 10 份分配

$65.000000 \times (1-20\%) = 52.000000$ 元人民币

扣税后非居民企业（包含 QFII、RQFII）资产支持证券持有人
每 10 份分配

$65.000000 \times (1-10\%) = 58.500000$ 元人民币

3. 科慧 04

根据《计划说明书》分配约定的测算，“科慧 04”本次兑付收益合计为 3,600,000.00 元人民币。

“科慧 04”本次每 10 份分配

$1000 \times 7.2\% = 72.000000$ 元人民币（含税）

扣税后个人、证券投资基金资产支持证券持有人每 10 份分配

$72.000000 \times (1-20\%) = 57.600000$ 元人民币

扣税后非居民企业（包含 QFII、RQFII）资产支持证券持有人
每 10 份分配

$72.000000 \times (1-10\%) = 64.800000$ 元人民币

4. 科慧 05

根据《计划说明书》分配约定的测算，“科慧 05”本次兑付收益

合计为 3,700,000.00 元人民币。

“科慧 05”本次每 10 份分配

$1000 \times 7.4\% = 74.000000$ 元人民币（含税）

扣税后个人、证券投资基金资产支持证券持有人每 10 份分配

$74.000000 \times (1 - 20\%) = 59.200000$ 元人民币

扣税后非居民企业（包含 QFII、RQFII）资产支持证券持有人每 10 份分配

$74.000000 \times (1 - 10\%) = 66.600000$ 元人民币

5. 科慧次级

若托管户有余额，则余额分配给次级资产支持证券，分配完成后托管户余额为 10 万元。

四、分配时间

1、计息期间：2016 年 4 月 23 日（含该日）至 2017 年 4 月 23 日（不含该日）；

2、权益登记日：2017 年 4 月 21 日；

3、兑付兑息日：2017 年 4 月 23 日（非工作日顺延至 4 月 24 日）；

4、“科慧 02”摘牌日：2017 年 4 月 23 日（非工作日顺延至 4 月 24 日）

五、分配方式

1、优先级资产支持证券

本专项计划优先级资产支持证券的分配将由托管人根据管理人发出的分配指令，将当期分配资金划至中国结算深圳分公司公司指定账户，再由中国结算深圳分公司按其业务规则将相应款项划拨至优先级资产支持证券持有人的资金账户。

2、次级资产支持证券

本专项计划次级资产支持证券的分配将由托管人根据管理人发出的分配指令，将当期分配资金直接划至次级资产支持证券持有人的资金账户。

六、有关税费的说明

1、个人投资者缴纳企业资产证券化资产支持证券利息个人所得税的说明

根据《中华人民共和国个人所得税法》以及其他相关税收法规和文件的规定，本期资产支持证券个人（包括证券投资基金）资产支持证券持有者应缴纳资产支持证券利息个人所得税，征税税率为利息额的 20%。根据《国家税务总局关于加强企业债券利息个人所得税代扣代缴工作的通知》（国税函[2003]612 号）规定，本期资产支持证券利息个人所得税统一由各付息网点在向资产证券化资产支持证券投资者支付利息时负责代扣代缴，就地入库。

2、QFII（RQFII）缴纳企业资产证券化资产支持证券利息非居民企业所得税的说明

根据《中华人民共和国企业所得税法》及其实施条例、《非居民

企业所得税源泉扣缴管理暂行办法》（国税发[2009]3号）、《关于中国居民企业向 QFII 支付股息、红利、利息代扣代缴企业所得税有关问题的通知》（国税函[2009]47号）等规定，本期资产支持证券非居民企业（包括 QFII，RQFII）资产支持证券持有人取得的本期资产支持证券利息应缴纳 10%非居民企业所得税，由本计划管理人负责代扣代缴。

3、其他资产支持证券持有者缴纳公司资产支持证券利息所得税的说明

对于其他资产支持证券投资者，其资产支持证券利息所得税自行缴纳。资产支持证券投资者就其获得的分配资金自行纳税，本计划管理人不负责代扣代缴。

七、 咨询联系方式

1.发行人：天津市静海区科慧热力有限责任公司

法定代表人：杨林静

咨询地址：天津静海北环工业区

邮政编码：301600

咨询联系人：张世敏

咨询电话：022-68600063

传真电话：022-68600159

2.受托管理人：深圳平安大华汇通财富管理有限公司

法定代表人：罗春风

咨询地址：深圳市福田区福华路星河发展中心 2 楼

邮政编码：518000

咨询联系人：王名伦、沈荣

咨询电话：0755-22620854

传真电话：0755-23997878

特此公告。

深圳平安大华汇通财富管理有限公司



2017年4月17日

