

长城证券股份有限公司关于
长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划

2020 年第 1 期的收益分配报告

（报告期间：2019 年 8 月 15 日至 2020 年 2 月 17 日）

一、 重要提示

本报告由管理人长城证券股份有限公司负责编制，管理人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。

根据《长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划说明书》（以下简称“《计划说明书》”）以及《长城证券-云龙安置房信托受益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，长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划（以下简称“本专项计划”）将于 2020 年 2 月 17 日进行 2020 年第 1 次权益分配，计息期间为 2019 年 8 月 15 日（含该日）至 2020 年 2 月 17 日（不含该日）。“17 云龙 03”将于本次收益分配偿还全部本金，并于 2020 年 2 月 17 日摘牌。

二、 专项计划基本情况

长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划于 2017 年 11 月 23 日由长城证券股份有限公司（以下简称“本计划管理人”）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：“17 云龙 01”、“17 云龙 02”、“17 云龙 03”、“17 云龙 04”、

“17 云龙 05”。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	证券简称	发行规模 (亿元)	发行利率 (%)	起息日	到期日	还本付息方式	已偿还本金比例 (%)
116729	17 云龙 01	0.60	6.0	2017/11/23	2018/2/15	半年付息、到期一次还本	100
116730	17 云龙 02	0.80	6.2	2017/11/23	2019/2/15	半年付息、到期一次还本	100
116731	17 云龙 03	1.40	6.6	2017/11/23	2020/2/15	半年付息、到期一次还本	0
116732	17 云龙 04	0.80	6.7	2017/11/23	2021/2/15	半年付息、到期一次还本	0
116733	17 云龙 05	1.40	6.8	2017/11/23	2022/2/15	半年付息、到期一次还本	0
116734	17 云龙次	0.50	无	2017/11/23	2022/2/15	每个预期到期日对应的兑付日分配剩余专项计划资产，到期分配全部剩余专项计划资产	0

三、 分配方案

本次分配的对象为：截止至 2020 年 2 月 14 日（该日期为权益登记日）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”）登记在册的全体长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划优先级及次级（如有）资产支持证券持有人。

本专项计划资产支持证券每份面值 100.00 元，每 10 份发行面值 1,000.00 元。

1、17 云龙 03（116731）

根据《计划说明书》分配约定的测算，“17 云龙 03”本次兑付本金和收益合计为 144,708,592.00 元人民币，其中本次本金偿还比例为 100%，兑付本金共 140,000,000.00 元人民币；本次分配收益为 4,708,592.00 元人民币。

“17 云龙 03”每 10 份分配 1033.6328 元人民币（含税），其中本金 1000.00 元人民币，派发收益 33.6328 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 1026.9062 元人民币，其中本金 1000.00 元人民币，派发收益为 26.9062 元人民币；非居民企业（包含 QFII、RQFII）资产支持证券持有人每 10 份分配 1033.6328 元人民币，其中本金 1000.00 元人民币，派发收益 33.6328 元人民币。

2、17 云龙 04（116732）

根据《计划说明书》分配约定的测算，“17 云龙 04”本次兑付本金和收益合计为 2,731,397.20 元人民币，其中本次本金偿还比例为 0%，兑付本金共 0.00 元人民币；本次分配收益为 2,731,397.20 元人民币。

“17 云龙 04”每 10 份分配 34.142465 元人民币（含税），其中本金 0.00 元人民币，派发收益 34.142465 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 27.313972 元人民币，其中本金 0.00 元人民币，派发收益为 27.313972 元人民币；非居民企业（包含 QFII、RQFII）资产支持证券持有人每 10 份分配

34.142465 元人民币，其中本金 0.00 元人民币，派发收益 34.142465 元人民币。

3、17 云龙 05（116733）

根据《计划说明书》分配约定的测算，“17 云龙 05”本次兑付本金和收益合计为 4,851,287.56 元人民币，其中本次本金偿还比例为 0%，兑付本金共 0.00 元人民币；本次分配收益为 4,851,287.56 元人民币。

“17 云龙 05”每 10 份分配 34.652054 元人民币（含税），其中本金 0.00 元人民币，派发收益 34.652054 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 27.721643 元人民币，其中本金 0.00 元人民币，派发收益为 27.721643 元人民币；非居民企业（包含 QFII、RQFII）资产支持证券持有人每 10 份分配 34.652054 元人民币，其中本金 0.00 元人民币，派发收益 34.652054 元人民币。

4、17 云龙次（116734）

“17 云龙次”无预期年收益率，根据计划说明书的约定，按照剩余收益为上限在优先级资产支持证券的预期到期日对应的兑付日向次级资产支持证券持有人分配期间收益，如该兑付日是专项计划最后一个兑付日的，剩余收益则作为次级资产支持证券持有人的收益支付给次级资产支持证券持有人。

根据《计划说明书》分配约定的测算，“17 云龙次”本次兑付本金和收益合计为 1,496,532.90 元人民币，其中本次本金偿还比例为

0%，兑付本金共 0.00 元人民币；本次分配收益为 1,496,532.90 元人民币。

“17 云龙次”每 10 份分配 29.930658 元人民币（含税），其中本金 0.00 元人民币，派发收益 29.930658 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 23.944526 元人民币，其中本金 0.00 元人民币，派发收益为 23.944526 元人民币；非居民企业（包含 QFII、RQFII）资产支持证券持有人每 10 份分配 29.930658 元人民币，其中本金 0.00 元人民币，派发收益 29.930658 元人民币。

四、 分配时间

- 1、计息时间：2019 年 8 月 15 日（含该日）-2020 年 2 月 17 日（不含该日）
- 2、权益登记日：2020 年 2 月 14 日
- 3、兑付兑息日：2020 年 2 月 17 日
- 4、“17 云龙 03”摘牌日：2020 年 2 月 17 日

五、 分配方式

- 1、优先级资产支持证券的分配：

本专项计划分配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资金账户。

- 2、次级资产支持证券的分配：

本专项计划分配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次级资产支持证券持有人资金账户。

六、 面值及开盘参考价调整

1、面值调整方式

(1) “17 云龙 03” 在本次偿还 100%后摘牌，资产支持证券面值

=本次兑付兑息日前面值-100 元×本次偿还比例

=100 元-100 元×100%

=0 元

(2) “17 云龙 04” 在本次偿还 0%后至下次收益分配前，资产支持证券面值

=本次兑付兑息日前面值-100 元×本次偿还比例

=100 元-100 元×0%

=100 元

(3) “17 云龙 05” 在本次偿还 0%后至下次收益分配前，资产支持证券面值

=本次兑付兑息日前面值-100 元×本次偿还比例

=100 元-100 元×0%

=100 元

(4) “17 云龙次” 在本次偿还 0%后至下次收益分配前，资产支持证券面值

=本次兑付兑息日前面值-100 元×本次偿还比例

=100 元-100 元×0%

=100 元

2、开盘参考价调整方式

(1) “17 云龙 03” 的开盘参考价=本次兑付兑息日前收盘价-100 元×本次偿还比例-每份派息金额

(2) “17 云龙 04” 的开盘参考价=本次兑付兑息日前收盘价-每份派息金额

(3) “17 云龙 05” 的开盘参考价=本次兑付兑息日前收盘价-每份派息金额

(4) “17 云龙次” 的开盘参考价=本次兑付兑息日前收盘价-每份派息金额

特别提示，以上调整的面值表示每份资产支持证券对应的本金，调整的面值、开盘参考价均采用四舍五入方式保留两位小数。若按照上述调整方式计算的兑付日开盘参考价无法提供价格参考（即为零或负数），则将兑付日开盘参考价调整为与兑付日开盘面值一致。敬请投资者留意每份资产支持证券本金（即面值）、开盘参考价的变化。

七、 有关税费的说明

(一) 个人投资者缴纳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）资产支持证券持有人应缴纳企业资产证券化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《国家税务局关于加强企业债券利息个人所得税

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支持证券持有人支付利息时负责代扣代缴,就地入库。

(二) QFII (RQFII) 缴纳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扣缴管理暂行办法》(国税发[2009]3号)、《关于境外机构投资境内债券市场企业所得税 增值税政策的通知》(财税[2018]108号)等规定,2018年11月7日至2021年11月6日期间,本期资产支持证券非居民企业(包含QFII、RQFII)资产支持证券持有人取得的本期资产支持证券利息暂免征收企业所得税。

(三) 其他资产证券化资产支持证券持有人应缴纳公司资产证券化资产支持证券利息所得税的说明

对于其他资产支持证券持有人,其资产支持证券利息所得税自行缴纳。资产支持证券持有人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。

八、 备查文件目录、查阅地点及联系方式

1、备查文件目录:

《长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划说明书》

《长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划标准条款》

《长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划资产支持证券认购协议》

《长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划信托受益权转让协议》

《长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划托管协议》

万向信托-云龙1号事务管理类单一资金信托信托文件

《北京盈科（长沙）律师事务所关于长城证券股份有限公司设立长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划之法律意见书》

《长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划资产支持证券信用评级报告》

《长城证券-云龙安置房信托受益权资产支持专项计划现金流预测分析咨询报告书》

计划管理人营业执照、业务许可证和业务资格批件

原始权益人的营业执照和公司章程

托管人的业务资格批件和营业执照

2、查阅地点：

深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 11 层

3、联系方式

管理人：长城证券股份有限公司

网站：www.cgws.com

电话：0755-83689472

传真：0755-83531612

地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 11

层

特此公告。

长城证券股份有限公司

2020 年 2 月 12 日

