

上海电力股份有限公司

关于下属子公司参与资产支持专项计划的 成立公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

经上海电力股份有限公司（以下简称“公司”）2017 年第九次临时董事会批准，公司下属子公司拟参与由公司控股股东国家电力投资集团有限公司（以下简称“国家电投”）与平安证券股份有限公司（以下简称“平安证券”）设立的“平安-国家电投电费应收账款资产支持专项计划”。

截至 2018 年 5 月 18 日，“平安-国家电投电费应收账款资产支持专项计划(二期)”（以下简称“本专项计划”）正式成立，并于当日开始起息。

一、本专项计划基本情况

类别	发行规模（亿元）	预期到期日	评级	预期年化收益率
18 电投优	7.3730	2020 年 12 月 31 日	AAA	5.2%
18 电投次	0.3880	2020 年 12 月 31 日	无	无
托管银行	平安银行股份有限公司北京分行			
登记机构	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司			
流动性安排	优先级资产支持证券在上海证券交易所固定收益证券综合电子平台进行转让。次级资产支持证券除非根据生效判决或裁定，次级份额持有人认购次级证券后，不得转让其所持任何部分或全部次级资产支持证券。			

二、公司参与的基础资产情况

公司向专项计划转让的应收账款为上海电力下属子公司在经营活动中形成的应收电费账款，基础资产清单见下表。

电力类型	单位名称	应收电费账面价值 2017/09/30 (元)
火电	上海外高桥发电有限责任公司	79,957,365.75
火电	上海上电漕泾发电有限公司	255,614,377.12
火电	上海电力股份有限公司吴泾热电厂	133,430,754.47

公司下属子公司与国家电投签署《委托代理协议》，协议约定委托国家电投处置应收账款债权、办理与被处置应收账款债权相关资金的代收和转付以及与设立平安-国家电投电费应收账款资产支持专项计划所有相关事宜，委托费用为0元。同时国家电投与平安证券签署《基础资产买卖协议》。

特此公告。

上海电力股份有限公司董事会
二〇一八年五月十九日