

吉林电力股份有限公司关于拟设立公司 电力上网收益权资产支持专项计划的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

重要内容提示：

1.公司拟开展电力上网收益权的资产证券化工作，即通过上海兴瀚资产管理有限公司（以下简称“兴瀚资管”）设立公司电力上网收益权资产支持专项计划（以下简称“本次专项计划”、“专项计划”），并通过专项计划发行资产支持证券进行融资；

2.本专项计划的实施不构成重大资产重组；

3.本专项计划的实施不存在重大法律障碍；

4.本专项计划已经公司第六届董事会第六十次会议审议通过，尚需提交公司股东大会审议；

5.本专项计划作为创新性资产运作模式，其顺利实施还将受到政策环境和市场利率水平等多重因素的影响，可能存在一定的不确定性。

一、专项计划概述

本次专项计划拟发行的资产支持证券规模不超过 10 亿元，期限

为 2 年，募集资金计划用于补充公司营运资金。拟发行的资产支持证券分为优先级资产支持证券和次级资产支持证券，其中优先级资产支持证券向符合规定条件的合格投资者发售，占比 95%，次级资产支持证券向符合规定条件的合格投资者发售，占比 5%，优先级和次级资产支持证券规模占比等项目相关要素可能因监管机构要求或市场需要进行调整。优先级资产支持证券的发行利率将根据发行时的市场利率水平通过询价方式确定，优先级资产支持证券每年还本付息三次。次级资产支持证券无票面利率，专项计划终止时的剩余资产由次级资产支持证券持有人享有。专项计划成立后，资产支持证券将在深圳证券交易所上市交易。相关要素可能因监管机构要求或市场需要进行调整。

二、专项计划管理人情况介绍

本专项计划管理人兴瀚资管于 2015 年 2 月 16 日获得证监会批复并成立。截至 2016 年 6 月 30 日，兴瀚资管注册资本为人民币 2000 万元。经证监会批准，兴瀚资管依法开展特定客户资产管理业务及中国证监会许可的其他业务。经营范围包括债券、证券投资基金、央行票据、非金融企业债务融资工具、资产支持证券、商品期货及、金融衍生品以及未通过证券交易所转让的股权、债权、其他财产权利等。

三、专项计划基本情况

（一）基础资产

资产证券化的基础是存在能够产生可预测现金流的基础资产。本次专项计划的基础资产来源于公司分公司白城发电公司、四平第一

热电公司、松花江第一热电公司以及全资子公司吉林松花江热电公司在业务经营活动中形成的上网电费收益权。根据入池选择标准，基础资产的整体风险较低。

（二）交易结构

兴瀚资管作为管理人通过向投资者发行资产支持证券的方式募集资金并设立专项计划，专项计划向公司购买基础资产。在专项计划存续期间，基础资产回收资金产生的现金流将按约定划入指定账户，由专项计划托管人根据管理人的分配指令对现金流进行分配。

（三）拟发行的资产支持证券情况

本资产支持专项计划向资本市场发行的证券将分为优先级资产支持证券和次级资产支持证券，总发售规模不超过 10 亿元，其中优先级资产支持证券的预期收益率视市场询价情况而定，目标发售规模占总发售规模的 95%，由合格的机构投资者认购；次级资产支持证券不设预期收益率，目标发售规模占总发售规模的 5%。优先级资产支持证券每年还本付息三次。项目所募集的资金将主要用于补充公司营运资金。

四、专项计划对上市公司的影响

公司利用电力上网收益权进行资产证券化，可以拓宽融资渠道，优化短期贷款结构，降低融资成本，有利于公司业务更好的开展。

五、影响专项计划的因素

由于今年年内宏观经济增长仍略显疲弱，而发行时的市场利率将随宏观经济环境的变化而波动，因此存在市场利率波动较大而影响

融资成本，进而影响项目发行窗口选择的因素。

特此公告。

吉林电力股份有限公司董事会

二〇一六年七月二十五日