

债券代码：136034.SH

债券简称：15 沪国资

债券代码：132005.SH

债券简称：15 国资 EB

债券代码：136159.SH

债券简称：16 沪国资

中国国际金融股份有限公司 关于上海国有资产经营有限公司公司债券的 临时受托管理事务报告

中国国际金融股份有限公司作为上海国有资产经营有限公司 2015 年公司债券（第一期）（债券简称：15 沪国资，债券代码：136034）、上海国有资产经营有限公司 2015 年可交换公司债券（债券简称：15 国资 EB，债券代码：132005）和上海国有资产经营有限公司 2016 年公司债券（第一期）（债券简称：16 沪国资，债券代码：136159）的债券受托管理人（以下简称“受托管理人”），持续密切关注对债券持有人权益有重大影响的事项。根据《公司债券发行与交易管理办法》、《公司债券受托管理人执业行为准则》等相关规定及《债券受托管理协议》的约定，现就重大事项进行报告。

根据发行人于 2020 年 8 月 24 日发布的《上海国有资产经营有限公司发生超过上年末净资产百分之十的重大损失的公告（二）》，提请注意事项如下：

上海国有资产经营有限公司（以下简称“上海国资”或“公司”）是综合性国有资产经营公司，主要业务包括股权经营业务、金融企业不良资产收购处置业务以及财务投资业务。受业务模式和定位影响，可供出售金融资产在总资产中占有较大比重，公司对可供出售金融资产科目采用公允价值进行后续计量。

受到证券市场行情波动影响，公司 2020 年一季度末可供出售金融资产公允价值变动，导致其他综合收益较 2019 年末减少 92.97 亿，占公司上年末净资产（2019 年末公司经审计的净资产规模为 554.55 亿）的 16.76%。公司已于 2020 年 4 月 29 日披露《上海国有资产经营有限公司发生超过上年末净资产百分之十的重大损失的公告》。

2020 年二季度，证券市场行情有所回暖，但一季度因新冠疫情爆发而下跌较多，后续企稳回升有限。公司 2020 年半年度末可供出售金融资产公允价值较

2019 年末变动较大，导致其他综合收益较 2019 年末减少 79.13 亿元，占公司上年末净资产（2019 年末公司经审计的净资产规模为 554.55 亿元）的 14.27%，仍超过上年末净资产百分之十。

本次重大损失具体情况请参见发行人于 2020 年 8 月 24 日发布的《上海国有资产经营有限公司发生超过上年末净资产百分之十的重大损失的公告（二）》。

中国国际金融股份有限公司作为债券受托管理人，根据《公司债券受托管理人执业行为准则》第十一条、第十七条要求出具本受托管理事务临时报告并就发行人发生超过上年末净资产百分之十的重大损失事项提醒投资者关注相关风险。

特此公告。

（本页无正文，为《中国国际金融股份有限公司关于上海国有资产经营有限公司公司债券的临时受托管理事务报告》之盖章页）



2020年8月27日