

债券简称：19 沪国 02	债券代码：155475.SH
债券简称：20 沪国 01	债券代码：163387.SH
债券简称：20 沪国 02	债券代码：163388.SH
债券简称：20 沪国 03	债券代码：175237.SH
债券简称：21 沪国 01	债券代码：175740.SH
债券简称：22 沪国 01	债券代码：185429.SH
债券简称：22 沪国 K2	债券代码：185797.SH
债券简称：22 沪国 03	债券代码：137724.SH

海通证券股份有限公司

关于上海国有资产经营有限公司涉及发生 超过上年末净资产百分之十的重大损失事项 的临时受托管理事务报告

受托管理人



海通证券股份有限公司
HAITONG SECURITIES CO., LTD.

（住所：上海市广东路 689 号）

二〇二二年十一月

重要声明

本报告依据《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》《上海国有资产经营有限公司 2022 年公开发行公司债券（面向专业投资者）受托管理协议》《上海国有资产经营有限公司 2019 年公开发行公司债券受托管理协议》（以下简称《受托管理协议》）等相关规定、公开信息披露文件以及上海国有资产经营有限公司（以下简称公司或发行人）出具的相关说明文件以及提供的相关资料等，由受托管理人海通证券股份有限公司（以下简称受托管理人、海通证券）编制。

本报告不构成对投资者进行或不进行某项行为的推荐意见，投资者应对相关事宜做出独立判断，而不应将本报告中的任何内容据以作为海通证券所作的承诺或声明。在任何情况下，未经海通证券书面许可，不得将本报告用作其他任何用途。

根据发行人披露的《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》，发行人 2022 年三季度末“其他权益工具投资”公允价值变动较大，较 2021 年末减少 145.25 亿元，减少值占发行人上年末净资产（2021 年末发行人经审计的净资产规模为 535.72 亿元）的 27.11%，具体情况如下：

发行人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，财务报表中的“其他权益工具投资”在总资产中占有较大比重，主要为持有的国泰君安证券股份有限公司、中国太平洋保险（集团）股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司股权；上述股权主要为公司战略资产，计划长期持有。公司对“其他权益工具投资”采用公允价值进行后续计量，且其变动计入“其他综合收益”。

受到证券市场行情波动影响，公司 2022 年三季度末“其他权益工具投资”公允价值变动较大，较 2021 年末减少 145.25 亿元，减少值占公司上年末净资产（2021 年末公司经审计的净资产规模为 535.72 亿元）的 27.11%。

海通证券作为“19 沪国 02”、“20 沪国 01”、“20 沪国 02”、“20 沪国 03”、“21 沪国 01”、“22 沪国 01”、“22 沪国 K2”、“22 沪国 03”债券受托管理人，为充分保障债券投资人的利益，履行债券受托管理人职责，在获悉相关事项后，及时与发行人进行了沟通，根据《公司债券受托管理人执业行为准则》相关规定出具本受托管理事务临时报告。

海通证券后续将密切关注发行人对本期债券的本息偿付情况以及其他对债券持有人利益有重大影响的事项，并将严格按照《公司债券受托管理人执业行为准则》《受托管理协议》等规定和约定履行债券受托管理人职责。

特此提请投资者关注相关风险，请投资者对相关事宜做出独立判断。

（本页以下无正文）

（本页无正文，为《海通证券股份有限公司关于上海国有资产经营有限公司涉及发生超过上年末净资产百分之十的重大损失事项的临时受托管理事务报告》之盖章页）



2022 年 11 月 7 日