

光大永明资产管理股份有限公司关于投资20光穗中铁ABN001优先资金运用关联交易的信息披露公告

根据《关于加强保险机构资金运用关联交易监管工作的通知》（银保监规〔2022〕11号）、《保险公司资金运用信息披露准则第1号：关联交易》（保监发〔2014〕44号）等相关规定，现将光大永明资产管理股份有限公司关于投资20光穗中铁ABN001优先资金运用关联交易的有关信息披露如下：

一、交易概述及交易标的基本情况

（一）交易概述

永聚固收159号于2024年3月26日通过二级交易，买入中铁光大股权投资基金管理(上海)有限公司2020年度第一期光穗中国中铁定向资产支持票据优先级（20光穗中铁ABN001优先 082000116.IB），本金额290000000元，我方拟投资期限为不超过1年，构成一般关联交易。

（二）交易标的基本情况

中铁光大股权投资基金管理(上海)有限公司2020年度第一期光穗中国中铁定向资产支持票据优先级，发行规模39.99亿元，剩余本金100元，固定票面利率3.74%，半年度付息,到期一次性还本付息。

二、交易各方的关联关系和关联方基本情况

（一）交易各方的关联关系

关联方：中铁光大股权投资基金管理（上海）有限公司

交易各方的关联关系：（六）根据“银保监2022年1号令”第八条，按照实质重于形式和穿透的原则认定的关联方

关联关系具体描述：光大证券间接施加重大影响的公司

（二）关联方情况

关联方：中铁光大股权投资基金管理（上海）有限公司

关联方名称	中铁光大股权投资基金管理（上海）有限公司	经济性质或类型	中央国有企业
法定代表人	吴岳	注册地址	上海市黄浦区广东路500号2407（G）-A室
注册资本（万元）	5000	成立时间	2016-02-05
统一社会信用代码		91310000MA1FL1N06D	
主营业务或经营范围		股权投资管理，投资管理。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】	

三、关联交易金额及相应比例

关联交易相应比例	不涉及
中铁光大股权投资基金管理（上海）有限公司关联交易金额（万元）	2900

四、交易的定价政策及定价依据

（一）定价政策

在证券交易所挂牌交易的固定收益类资产以及在银行间市场交易的固定收益类资产，主要依据第三方估值机构提供的相应资产估值数据确定公允价值；如第三方估值机构未提供相应资产的估值数据，采用其他估值技术进行估值。符合相关法律法规要求，按照公平、公正的市场化原则进行定价。

（二）定价依据

资产支持证券或资产支持票据交易方式为二级市场交易，交易场所为交易所和银行间，实际开展时定价基准参照中债或中证估值，根据《关于调整固定收益证券综合电子平台交易事宜的通知》固定收益平台债券现券交易价格（净价）偏离交易当日日终相关比较基准超过2%（含）的需向交易所报告，实际开展时定价偏离度将符合以上规定，不超过参照基准的2%，且与非关联方交易价格相比，不优于非关联方价格。综上，本次交易的定价政策及定价依据符合相关法律法规要求，按照公平、公正的市场化原则进行定价。

五、交易协议主要内容

(一) 生效时间

2024-03-25

(二) 交易价格

101.2064元

(三) 交易结算方式

券款对付

(四) 协议生效条件、履行期限

通过中国银行间市场本币平台成交

不超过1年

(五) 其他信息

无

六、交易决策及审议情况

该交易已于当日根据公司授权由投资经理审批通过。

七、其他需要披露的信息

无

我公司承诺：已充分知晓开展此项交易的责任和风险，并对本公告所披露信息的真实性、准确性、完整性和合规性负责，愿意接受有关方面监督。对本公告所披露信息如有异议，可以于本公告发布之日起10个工作日内，向监管部门反映。

光大永明资产管理股份有限公司

2024年03月29日