

光大借呗第二期消费贷款资产支持专项计划成立公告

上海光大证券资产管理有限公司拟设立光大借呗第二期消费贷款资产支持专项计划（简称“专项计划”或“本专项计划”）。截至 2018 年 9 月 17 日，本专项计划项下的资产支持证券已经得到全额认购。

经过安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本专项计划实际收到的参与资金为 3,000,000,000.00 元，托管账户中的金额已经达到《光大借呗第二期消费贷款资产支持专项计划说明书》约定的专项计划资金规模，本专项计划于 2018 年 9 月 17 日正式成立。

一、本专项计划基本情况

产品名称	期限（年）	参考年化收益率	发行规模（亿元）	面值（元）	债项评级
18 借呗 2A	2	5.19%	25.50	100	AAA
18 借呗 2B	2	5.39%	2.25	100	AA+
18 借呗 2C	2	无	2.25	100	无

二、备查文件

- 1、《光大借呗第二期消费贷款资产支持专项计划标准条款》
- 2、《光大借呗第二期消费贷款资产支持专项计划资产支持证券认购协议与风险揭示书》
- 3、《光大借呗第二期消费贷款资产支持专项计划资产买卖协议》
- 4、《光大借呗第二期消费贷款资产支持专项计划托管协议》
- 5、《光大借呗第二期消费贷款资产支持专项计划服务协议》
- 6、《光大借呗第二期消费贷款资产支持专项计划监管协议》
- 7、《关于上海光大证券资产管理有限公司设立光大借呗第二期消费贷款资产

支持专项计划之法律意见书》

8、《光大借呗第二期消费贷款资产支持专项计划资产支持证券信用评级报告》

9、管理人的业务资格批件、营业执照和公司章程

10、原始权益人的营业执照和公司章程

11、托管人的业务资格批件和营业执照

备查文件查阅地点：上海光大证券资产管理有限公司

地址：上海市静安区新闸路 1508 号

电话：021-22169999

传真：010-22169634

联系人：史文杰、袁越

特此公告。

上海光大证券资产管理有限公司

2018年9月17日

