

## 关于平安凯迪电力上网收费权资产支持专项计划 凯迪 04 和凯迪 05 资产支持证券评级下调的临时公告

深圳平安大华汇通财富管理有限公司作为专项计划管理人（以下简称“管理人”）于 2015 年 6 月 12 日设立平安凯迪电力上网收费权资产支持专项计划（以下简称“专项计划”），目前处于存续期的产品为凯迪 03（证券代码：119187）、凯迪 04（证券代码：119188）、凯迪 05（证券代码：119189）。本专项计划原始权益人为隆回县凯迪绿色能源开发有限公司（以下简称“隆回凯迪”）、南陵县凯迪绿色能源开发有限公司（以下简称“南陵凯迪”）、松滋市凯迪阳光生物能源开发有限公司（以下简称“松滋凯迪”）。凯迪生态环境科技股份有限公司（原名：武汉凯迪电力股份有限公司，以下简称“凯迪生态”）作为专项计划的差额支付承诺人对专项计划承担差额支付义务。

大公国际资信评估有限公司（以下简称“大公”）于 2018 年 5 月 9 日出具了《大公关于下调平安凯迪电力上网收费权资产支持专项计划凯迪 04 和凯迪 05 资产支持证券信用等级至 BBB-的公告》。

### 一、评级报告关注事项

“大公于 2015 年 5 月 29 日评定本计划各档优先级资产支持证券（以下分别简称“平安凯迪优先 01、平安凯迪优先 02、平安凯迪优先 03、平安凯迪优先 04 和平安凯迪优先 05”）信用等级均为 AA+，大公于 2016 年 6 月 23 日及 2017 年 6 月 19 日对本计划进行跟踪评级。截至 2017 年 6 月 19 日，平安凯迪优先 01 和平安凯迪优先 02 已到期

偿还，大公维持平安凯迪优先 03~05 信用等级均为 AA+。

本计划于 2015 年 6 月 12 日设立，平安凯迪优先 01~05 发行规模均为 2 亿元，期限分别为 1 年、2 年、3 年、4 年和 5 年，每半年付息，到期一次性偿还本金。本计划原始权益人分别为隆回县凯迪绿色能源开发有限公司、南陵县凯迪绿色能源开发有限公司及松滋市凯迪阳光生物能源开发有限公司，凯迪生态为本计划的差额支付承诺人。

根据凯迪生态于 2017 年 12 月 27 日出具的《关于平安凯迪电力上网收费权资产支持专项计划差额支付承诺人凯迪生态筹划重大资产重组事项问询的回复》称，凯迪生态资产重组初步计划出售的资产包括风水矿、煤矿、林业等非生物质发电资产，本计划基础资产不在计划出售范围内，不会对生物质电厂现金流回款产生影响。2018 年 3 月 31 日凯迪生态发布的《凯迪生态环境科技股份有限公司 2017 年度业绩预告》称，2017 年营业期间，凯迪生态拟对部分资产计提资产减值准备，预计归属于上市公司股东的净利润为亏损 13 亿元~16 亿元（上年同期为盈利 3.33 亿元）。2018 年 4 月 23 日凯迪生态发布《凯迪生态环境科技股份有限公司关于无法在法定期限内披露定期报告及股票可能被暂停上市的提示性公告》称，凯迪生态无法在 2018 年 4 月 30 日前披露 2017 年年度报告；若凯迪生态在 2018 年 7 月 2 日前仍无法完成 2017 年年度报告的披露工作，则凯迪生态股票将自 2018 年 7 月 2 日起复牌，同时凯迪生态股票将被实行退市风险警示。2018 年 5 月 7 日，凯迪生态发行的“11 凯迪 MTN1”未按期足额兑付本息，已构成实质性违约。”

## 二、 评级报告结论

大公决定维持本计划平安凯迪优先 03 资产支持证券信用等级为 AA+, 将本计划平安凯迪优先 04 和平安凯迪优先 05 资产支持证券信用等级调整为 BBB-。

## 三、 应对措施

基于上述情况，管理人应对如下：

### 1. 密切关注及跟进事态发展，积极履行管理人职责

管理人已安排人员前往凯迪生态现场了解并跟进其债务处理情况等。同时，管理人将密切关注原始权益人及基础资产的运营情况。

管理人已披露《深圳平安大华汇通财富管理有限公司关于平安凯迪电力上网收费权资产支持证券停牌的公告》、《关于平安凯迪电力上网收费权资产支持专项计划风险提示的临时公告》管理人会密切关注事态发展，及时披露相关信息，根据监管及专项计划约定切实履行管理人职责，保护投资者利益。

### 2. 专项计划资产支持证券停牌

由于凯迪生态上述相关事项存在不确定性，为维护广大投资者的利益，避免资产支持证券异常波动，管理人深圳平安大华汇通财富管理有限公司申请资产支持证券自 2018 年 5 月 8 日上午开市起停牌。

### 3. 权利完善通知

根据《计划说明书》《标准条款》等文件定，若评级机构给予差额支付承诺人的主体信用等级低于 BB 级，将触发权利完善事件。计划管理人可要求原始权益人向《购售电合同》项下的电力公司和其他

相关方（如需）发送的通知，通知电力公司将基础资产对应的电费收入直接支付至专项计划账户或其他指定账户。由于中诚信证评将凯迪生态主体信用等级由 AA 下调至 C 已触发权利完善事件，管理人已向原始权益人发送权利完善通知，并将向投资者及时反馈权利完善通知落实情况。

#### 4、投资者沟通

管理人高度重视投资者沟通工作，将根据最新的持有人名册与投资者保持持续沟通及时向投资者反馈相关事项。敬请投资者关注管理人后续公告。

特此公告。

深圳平安大华汇通财富管理有限公司

2018年5月11日

