

中国葛洲坝集团股份有限公司
关于“华泰资管-葛洲坝水电上网收费权绿色资产支持专项计划”
设立的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

2016年10月28日，中国葛洲坝集团股份有限公司（以下简称“公司”）第六届董事会第二十三次会议（临时）审议通过了《关于实施水电站发电上网收费权绿色资产证券化的议案》。（具体内容详见公司公告：临2016-055）

2016年11月17日，公司收到华泰证券（上海）资产管理有限公司转发的上海证券交易所《关于对华泰资管-葛洲坝水电上网收费权绿色资产支持证券挂牌转让无异议的函》（上证函〔2016〕2128号）。（具体内容详见公司公告：临2016-059）

截至2016年11月22日，华泰资管-葛洲坝水电上网收费权绿色资产支持专项计划（以下简称“专项计划”）已获得全额认购，且募集资金已全部划入专项计划托管人开立的托管专户。专项计划已符合成立条件，并于2016年11月22日正式设立。现就相关情况公告如下：

| 品种 | 优先 A1 档 | 优先 A2 档 | 优先 A3 档 | 优先 A4 档 | 优先 A5 档 | 次级档 |
|-----|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| 起息日 | 2016/11/22 | 2016/11/22 | 2016/11/22 | 2016/11/22 | 2016/11/22 | 2016/11/22 |

| | | | | | | |
|--------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|------------------------|
| 品种 | 优先 A1 档 | 优先 A2 档 | 优先 A3 档 | 优先 A4 档 | 优先 A5 档 | 次级档 |
| 到期日 | 2017/11/22 | 2018/11/22 | 2019/11/22 | 2020/11/23 | 2021/11/22 | 2021/11/22 |
| 评级 | AAA | AAA | AAA | AAA | AAA | 无 |
| 预期收益率 | 3.20% | 3.30% | 3.45% | 3.50% | 3.60% | 无 |
| 发行规模 (亿元) | 1.5 | 1.5 | 1.5 | 1.5 | 1.6 | 0.4 |
| 面值 (元) | 100 | 100 | 100 | 100 | 100 | 100 |
| 兑付方式 | 按年付息， 到期还本 | 按年付息， 到期还本 | 按年付息， 到期还本 | 按年付息， 到期还本 | 按年付息， 到期还本 | 每满一年获 得当期全部 剩余收益 |

专项计划设立后，将根据相关规定和相关监管机构的要求进行备案，优先级资产支持证券将在上海证券交易所固定收益证券综合电子平台上流通。

特此公告。

中国葛洲坝集团股份有限公司董事会

2016年11月24日