

华能国际-大庆热电能源基础设施投资资产支持专项计划

成立公告

中信证券股份有限公司设立“华能国际-大庆热电能源基础设施投资资产支持专项计划”(简称“专项计划”或“本专项计划”)并向投资者发行本专项计划项下的优先级资产支持证券和次级资产支持证券。2026年9月14日,本专项计划项下的优先级资产支持证券和次级资产支持证券已经得到全额认购。

经立信会计师事务所(特殊普通合伙)验资,本专项计划实际收到的参与资金为人民币贰拾壹亿肆仟伍佰万元整(¥2,145,000,000.00),募集专用账户中的金额已经达到《华能国际-大庆热电能源基础设施投资资产支持专项计划说明书》约定的专项计划目标募集规模,本专项计划于2026年9月15日正式成立。本专项计划的资产支持证券具体情况如下:

产品名称	投资回报率 ¹	认购倍数	发行规模 (亿元)	面值 (元)	收益分配方式
优先级资产支持证券	1.90%	1.73	21.44	100	按年支付投资回报,前3个普通分配兑付日不还本,自第4个普通分配兑付日过手摊还本金,另设临时分配兑付日
次级资产支持证券	-	-	0.01	100	过手摊还本金,处置分配时取得剩余收益
信用评级	中诚信国际信用评级有限责任公司给予优先级资产支持证券的评级为AAA _{sf} 级; 次级资产支持证券未进行评级				
推广对象	优先级资产支持证券由专业投资者中的机构投资者认购				
托管人	中信银行股份有限公司北京分行				
登记机构	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司				

特此公告。

¹ 投资回报率作为投资者权益投资回报率,并非对投资人的投资回报承诺或保证,亦不构成对投资回报的保底约定。

(此页无正文，为《华能国际-大庆热电能源基础设施投资资产支持
专项计划成立公告》之盖章页)

