

招商证券股份有限公司关于
“ 华能澜沧江水电收益资产支持受益凭证 ”
通过深圳证券交易所大宗交易系统转让的公告

根据深圳证券交易所《关于同意“ 华能澜沧江水电收益资产支持受益凭证 ” 挂牌转让的通知》(深证会【2006】33 号), 华能澜沧江水电收益资产支持受益凭证(“ 华能澜沧江受益凭证 ”、“ 本受益凭证 ”) 将于 2006 年 5 月 16 日开始通过深圳证券交易所大宗交易系统进行转让。招商证券股份有限公司作为计划管理人, 现将本受益凭证基本情况公告如下:

本受益凭证共包括 3 期产品, 产品简称为澜电 01、澜电 02、澜电 03, 产品代码为 119002、119003、119004, 存续期为 3 年、4 年、5 年, 澜电 01、澜电 02 为优先级固定利率品种受益凭证, 受益凭证利率分别为 3.57%、3.77%, 澜电 03 为优先级浮动利率品种受益凭证, 利率为“ 基准利率 + 180BP ”, 基准利率计算所用的数据为中国外汇交易中心(“ 同业拆借中心 ”) 每天公布的 7 天回购加权利率数值, 首个分配期的基准利率为 2006 年 4 月 25 日(批文取得日、不含当日) 之前 10 个交易日的 7 天回购加权利率的算术平均值; 第二至第十个分配期的基准利率为当个分配期间的起始日 (不含当日) 之前 10 个交易日的 7 天回购加权利率的算术平均值。本受益凭证获得大公国际资信评估有限公司 AAA 的信用等级, 由中国农业银行提供无条件连带责任担保, 由中国证券登记结算有限公司提供登记结算服务, 由招商

证券股份有限公司提供双边报价服务。

本受益凭证的具体情况见下表：

项目	华能澜沧江 受益凭证 01	华能澜沧江 受益凭证 02	华能澜沧江 受益凭证 03
深圳所简称	澜电 01	澜电 02	澜电 03
深交所代码	119002	119003	119004
计划设立时间	2006 年 5 月 11 日	2006 年 5 月 11 日	2006 年 5 月 11 日
到期日	2009 年 5 月 11 日	2010 年 5 月 11 日	2011 年 5 月 11 日
存续期	3 年	4 年	5 年
募集规模	面值为 6.6 亿元	面值为 6.6 亿元	面值为 6.8 亿元
受益凭证利率	3.57%/年	3.77%/年	基准利率 + 180BP
发行方式	面值发行	面值发行	面值发行
发行价格	人民币 100 元/每 份	人民币 100 元/每 份	人民币 100 元/每 份
还本付息方式	半年付息,到期一 次性还本	半年付息,到期一 次性还本	半年付息,到期一 次性还本

受益凭证预期收益 = 持有的优先级受益凭证面值总额 × 该分配期间的实际天数 × 优先级受益凭证利率 / 365 天

澜电 03 中包括 2000 万元人民币的次级受益凭证,此次级受益凭证由原始权益人云南华能澜沧江水电有限公司全额认购,且该次级受益凭证在华能澜沧江水电收益专项资产管理计划存续期间内不得进行转让。

税务提示：根据国家有关税收法律、法规的规定，投资者投资本收益计划所应缴纳的税款由投资者自行承担。

本受益凭证的备查文件包括：

- 1、《华能澜沧江水电收益专项资产管理计划募集说明书》
- 2、《华能澜沧江水电收益专项资产管理计划》
- 3、《上海市锦天城律师事务所关于招商证券设立华能澜沧江水电收益专项资产管理计划的法律意见书》
- 4、《华能澜沧江水电收益专项资产管理计划水电收益买卖合同》
- 5、《华能澜沧江水电收益专项资产管理计划信用评级报告》
- 6、《华能澜沧江水电收益专项资产管理计划资产托管协议》
- 7、《华能澜沧江水电收益专项资产管理计划担保合同》
- 8、《华能澜沧江水电收益专项资产管理计划账户及资金监管协议》

备查文件查阅地点：招商证券股份有限公司

地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 40 层

电话：0755 - 82943666

传真：0755 - 82943517

联系人：刘入领、曹宇霞

招商证券股份有限公司

二 00 六年五月十六日