

证券代码：000027

证券简称：深圳能源

公司债券代码：112616

公司债券简称：17 深能 02

深圳能源集团股份有限公司 关于“17深能02”第二个计息年度票面利率的 提示公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

重要提示：

根据深圳能源集团股份有限公司（以下简称：本公司或发行人）《深圳能源集团股份有限公司 2017 年面向合格投资者公开发行公司债券（第一期）募集说明书》（以下简称：《募集说明书》）的有关约定，本期债券品种二（以下简称：17 深能 02）的票面利率由固定利率加上浮动利率构成，固定利率根据市场询价结果，由发行人与主承销商按照国家有关规定协商一致，以簿记建档方式确定，并在品种二存续期限内保持不变；浮动利率与加权煤炭价格指数 Q 挂钩，确定方式如下：

加权煤炭价格指数 $Q = \text{CCTD 秦皇岛动力煤 (Q5500) 现货价格} \times 50\% + \text{环渤海动力煤价格指数} \times 50\%$ 。

浮动利率自第二个计息年度起每年调整一次，具体确定方式如下：

当加权煤炭价格指数 Q 上一个计息年度内上涨或平均跌幅小于 5% 时，该计息年度浮动利率为 0；

当加权煤炭价格指数 Q 上一个计息年度内平均跌幅大于或等于 20% 时，该计息年度浮动利率为 0.50%；

当加权煤炭价格指数 Q 上一个计息年度内平均跌幅大于或等于 5% 且小于 20% 时，该计息年度浮动利率 $= 0.025 \times \text{加权煤炭价格指数 Q 上一个计息年度内平均跌幅}$ 。（计算结果四舍五入后保留两位小数）

其中：

1、首个计息年度浮动利率为 0；

2、第 2 个计息年度，加权煤炭价格指数 Q 上一个计息年度内平均跌幅=1-【债券在第 1 个计息年度起息日至第 1 个计息年度付息日前 20 个交易日加权煤炭价格指数 Q 的算术平均值】/【债券在第 1 个计息年度起息日之前 365 日加权煤炭价格指数 Q 的算术平均值】×100%；

3、自第 3 个计息年度起，第 N 个计息年度起之后的每个计息年度，加权煤炭价格指数 Q 上一个计息年度内平均跌幅=1-【债券在 N-1 个计息年度起息日至 N-1 个计息年度付息日前 20 个交易日加权煤炭价格指数 Q 的算术平均值】/【债券在 N-2 个计息年度加权煤炭价格指数 Q 的算术平均值】×100%（N≥3）。

CCTD 秦皇岛动力煤（Q5500）现货价格于中国煤炭市场网每周公布一次，环渤海动力煤价格指数于及秦皇岛煤炭网每周公布一次，该年度加权煤炭价格指数 Q 的算术平均值为年内每周公布的 CCTD 秦皇岛动力煤（Q5500）现货价格与环渤海动力煤价格指数加权均值的年度算术平均值。

若在债券存续期内，加权煤炭价格指数 Q 无法获得而导致当期浮动利率无法计算，则浮动利率沿用之前一期数值。

现将第二个计息年度（2018 年 11 月 20 日至 2019 年 11 月 19 日）票面利率事宜公告如下：

本期债券品种二在第 1 个计息年度起息日之前 365 日加权煤炭价格指数 Q 的算术平均值 602.85；

本期债券品种二在第 1 个计息年度起息日至第 1 个计息年度付息日前 20 个交易日（2017 年 11 月 20 日至 2018 年 10 月 23 日）加权煤炭价格指数 Q 的算术平均值为 583.18；

根据《募集说明书》约定，第 2 个计息年度，加权煤炭价格指数 Q 上一个计息年度内平均跌幅=1-（583.18/602.85）=3.26%，平均跌幅小于 5.00%。因此，第二个计息年度（2018 年 11 月 20 日至 2019 年 11 月 19 日）浮动利率为 0，票面利率为 5.20%。

特此公告。

深圳能源集团股份有限公司

2018 年 11 月 14 日