

证券代码：601878


证券简称：浙商证券

债券代码：113060

债券简称：浙 22 转债

浙商证券股份有限公司
公开发行可转换公司债券
受托管理事务报告
(2022 年度)

债券受托管理人：

 华安证券股份有限公司

(住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号)

二〇二三年六月

重要声明

华安证券股份有限公司（以下简称“华安证券”）编制本报告的内容及信息来源于浙商证券股份有限公司（以下简称“浙商证券”、“公司”或“发行人”）对外公布的公开信息披露文件及发行人向华安证券提供的资料。

华安证券按照《公司债券发行与交易管理办法》《公司债券受托管理人执业行为准则》等相关规定及与浙商证券签订的《浙商证券股份有限公司公开发行可转换公司债券受托管理协议》（以下简称“《受托管理协议》”）的约定编制本报告。

本报告不构成对投资者进行或不进行某项行为的推荐意见，投资者应对相关事宜做出独立判断，而不应将本报告中的任何内容据以作为华安证券所作的承诺或声明。请投资者独立征询专业机构意见，在任何情况下，投资者不能将本报告作为投资行为依据。

华安证券提请投资者及时关注发行人的信息披露文件，并已督促发行人及时履行信息披露义务。

第一节 本次可转债概况

一、核准文件及核准规模

经中国证券监督管理委员会“证监许可[2022]679号”文核准，公司公开发行了7,000万张可转换公司债券，每张面值100元，发行总额700,000万元。

经上海证券交易所自律监管决定书[2022]169号文同意，公司公开发行的700,000万元可转换公司债券于2022年7月8日起在上海证券交易所上市交易。

二、本次公司债券的基本情况

（一）债券名称

2022年浙商证券股份有限公司公开发行可转换公司债券。

（二）债券代码及简称

债券代码：113060；债券简称：浙22转债。

（三）本次债券发行日期

本次债券发行日为2022年6月14日。

（四）发行规模

本次发行可转债总额为人民币70亿元。

（五）票面金额和发行价格

本次发行的可转债每张面值为100元人民币，按面值发行。

（六）债券期限

本次发行的可转债期限为自发行之日起六年，即自2022年6月14日至2028年6月13日。

（七）票面利率

第一年0.2%、第二年0.4%、第三年0.6%、第四年1.0%、第五年1.5%、第六年2.0%。

（八）还本付息的期限和方式

本次发行的可转换公司债券采用每年付息一次的付息方式，到期归还本金和

最后一年利息。

1、年利息计算

年利息指可转换公司债券持有人按持有的可转换公司债券票面总金额自可转换公司债券发行首日起每满一年可享受的当期利息。

年利息的计算公式为： $I=B\times i$

I：指年利息额；

B：指本次发行的可转债持有人在计息年度（以下简称“当年”或“每年”）付息债权登记日持有的可转债票面总金额；

i：指可转债的当年票面利率。

2、付息方式

①本次发行的可转换公司债券采用每年付息一次的付息方式，计息起始日为可转换公司债券发行首日。

②付息日：每年的付息日为本次发行的可转换公司债券发行首日起每满一年的当日。如该日为法定节假日或休息日，则顺延至下一个工作日，顺延期间不另付息。每相邻的两个付息日之间为一个计息年度。

转股年度有关利息和股利的归属等事项，由公司董事会根据相关法律法规及上海证券交易所的规定确定。

③付息债权登记日：每年的付息债权登记日为每年付息日的前一交易日，公司将在每年付息日之后的五个交易日内支付当年利息。在付息债权登记日前（包括付息债权登记日）申请转换成公司股票的可转换公司债券，公司不再向其持有人支付本计息年度及以后计息年度的利息。

④可转换公司债券持有人所获得利息收入的应付税项由持有人承担。

（九）转股期限

本次发行的可转债转股期自可转债发行结束之日满六个月后的第一个交易日起至可转债到期日止，即 2022 年 12 月 20 日至 2028 年 6 月 13 日止（如遇法定节假日或休息日延至其后的第 1 个工作日；顺延期间付息款项不另计息）。

（十）转股价格的确定及其调整

1、初始转股价格的确定依据

本次发行的可转换公司债券初始转股价格为 10.49 元/股，不低于募集说明书

公告日前三十个交易日公司 A 股股票交易均价（若在该三十个交易日内发生过因除权、除息引起股价调整的情形，则对调整前交易日的交易均价按经过相应除权、除息调整后的价格计算）、前二十个交易日公司 A 股股票交易均价（若在该二十个交易日内发生过因除权、除息引起股价调整的情形，则对调整前交易日的交易均价按经过相应除权、除息调整后的价格计算）和前一个交易日公司 A 股股票交易均价，以及最近一期经审计的每股净资产和股票面值。

前三十个交易日公司股票交易均价=前三十个交易日公司股票交易总额÷该三十个交易日公司股票交易总量；前二十个交易日公司股票交易均价=前二十个交易日公司股票交易总额÷该二十个交易日公司股票交易总量；前一个交易日公司股票交易均价=前一个交易日公司股票交易总额÷该日公司股票交易量。

2、转股价格的调整方式及计算公式

在本次发行之后，若公司发生派送红股、转增股本、增发新股（不包括因本次发行的可转换公司债券转股而增加的股本）、配股以及派送现金股利等情况，将按下述公式进行转股价格的调整（保留小数点后两位，最后一位四舍五入）：

派送红股或转增股本： $P_1 = P_0 \div (1+n)$ ；

增发新股或配股： $P_1 = (P_0 + A \times k) \div (1+k)$ ；

上述两项同时进行： $P_1 = (P_0 + A \times k) \div (1+n+k)$ ；

派送现金股利： $P_1 = P_0 - D$ ；

上述三项同时进行： $P_1 = (P_0 - D + A \times k) \div (1+n+k)$ 。

其中： P_1 为调整后转股价； P_0 为调整前转股价； n 为派送红股或转增股本率； A 为增发新股价或配股价； k 为增发新股或配股率； D 为每股派送现金股利。

当公司出现上述股份和/或股东权益变化情况时，将依次进行转股价格调整，并在中国证券监督管理委员会指定的上市公司信息披露媒体上刊登转股价格调整的公告，并于公告中载明转股价格调整日、调整办法及暂停转股期间（如需）；当转股价格调整日为本次发行的可转换公司债券持有人转股申请日或之后，转换股份登记日之前，则该持有人的转股申请按公司调整后的转股价格执行。

当公司可能发生股份回购、合并、分立或任何其他情形使公司股份类别、数量和/或股东权益发生变化从而可能影响本次发行的可转换公司债券持有人的债权利益或转股衍生权益时，公司将视具体情况按照公平、公正、公允的原则以及

充分保护本次发行的可转换公司债券持有人权益的原则调整转股价格。有关转股价格调整内容及操作办法将依据当时国家有关法律法规及证券监管部门的相关规定来制订。

3、当前转股价格

截至本报告出具日，因公司实施 2022 年半年度利润分配，本次可转债转股价格由 10.49 元/股调整为 10.32 元/股。

(十一) 转股价格向下修正条款

1、修正权限与修正幅度

在本次发行的可转换公司债券存续期间，当公司 A 股股票在任意连续三十个交易日中至少有十五个交易日的收盘价低于当期转股价格的 80%时，公司董事会会有权提出转股价格向下修正方案并提交公司股东大会审议表决。

上述方案须经出席会议的股东所持表决权的三分之二以上通过方可实施。股东大会进行表决时，持有本次发行的可转换公司债券的股东应当回避。修正后的转股价格应不低于该次股东大会召开日前三十个交易日公司 A 股股票交易均价、前二十个交易日公司 A 股股票交易均价和前一个交易日公司 A 股股票交易均价。同时，修正后的转股价格不得低于最近一期经审计的每股净资产值和股票面值。

若在前述三十个交易日内发生过转股价格调整的情形，则在调整前的交易日按调整前的转股价格和收盘价计算，调整后的交易日按调整后的转股价格和收盘价格计算。

2、修正程序

如公司决定向下修正转股价格时，公司将在中国证券监督管理委员会指定的上市公司信息披露媒体上刊登相关公告，公告修正幅度和股权登记日及暂停转股期间等。从股权登记日后的第一个交易日（即转股价格修正日）起，开始恢复转股申请并执行修正后的转股价格。

若转股价格修正日为转股申请日或之后，且为转换股份登记日之前，该类转股申请应按修正后的转股价格执行。

(十二) 转股股数确定方式以及转股时不足一股金额的处理方法

本次发行的可转换公司债券持有人在转股期内申请转股时，转股数量的计算方式为：

$$Q=V\div P$$

其中：Q 为转股数量，并以去尾法取一股的整数倍；V 为可转换公司债券持有人申请转股的可转换公司债券票面总金额；P 为申请转股当日有效的转股价。

可转换公司债券持有人申请转换成的股份须是整数股。转股时不足转换为一股的可转换公司债券余额，公司将按照上海证券交易所等部门的有关规定，在可转换公司债券持有人转股当日后的五个交易日内以现金兑付该部分可转换公司债券的票面金额及其所对应的当期应计利息。

（十三）赎回条款

1、到期赎回条款

在本次发行的可转换公司债券期满后五个交易日内，公司将按债券面值的 106%（含最后一期利息）的价格赎回未转股的可转债。

2、有条件赎回条款

在本次发行的可转换公司债券转股期内，当下述两种情形的任意一种出现时，公司董事会会有权决定按照债券面值加当期应计利息的价格赎回全部或部分未转股的可转换公司债券：

（1）在本次发行的可转换公司债券转股期内，如果公司 A 股股票连续三十个交易日中至少有十五个交易日的收盘价格不低于当期转股价格的 130%（含 130%）。

（2）当本次发行的可转换公司债券未转股余额不足人民币 3,000 万元时。

当期应计利息的计算公式为：

$$IA=B\times i\times t\div 365$$

其中：IA 为当期应计利息；B 为本次发行的可转债持有人持有的将被赎回的可转债票面总金额；i 为可转换公司债券当年票面利率；t 为计息天数，即从上一个付息日起至本计息年度赎回日止的实际日历天数（算头不算尾）。

若在前述三十个交易日内发生过转股价格调整的情形，则在调整前的交易日按调整前的转股价格和收盘价格计算，调整后的交易日按调整后的转股价格和收盘价格计算。

（十四）附加回售条款

若本次发行的可转换公司债券募集资金投资项目的实施情况与公司在募集

说明书中的承诺情况相比出现重大变化，且该变化根据中国证券监督管理委员会的相关规定被视作改变募集资金用途或被中国证券监督管理委员会认定为改变募集资金用途的，可转换公司债券持有人享有一次回售的权利。可转换公司债券持有人有权将其持有的可转换公司债券全部或部分按债券面值加当期应计利息的价格回售给公司。

当期应计利息的计算公式为：

$$IA=B \times i \times t \div 365$$

其中：IA 为当期应计利息；B 为本次发行的可转换公司债券持有人持有的将回售的可转换公司债券票面总金额；i 为可转换公司债券当年票面利率；t 为计息天数，即从上一个付息日起至本计息年度赎回日止的实际日历天数（算头不算尾）。

可转换公司债券持有人在附加回售条件满足后，可以在公司公告后的附加回售申报期内进行回售，本次附加回售申报期内不实施回售的，不应再行使附加回售权。

（十五）转股后的股利分配

因本次发行的可转换公司债券转股而增加的公司 A 股股票享有与原 A 股股票同等的权益，在股利发放的股权登记日当日登记在册的所有普通股股东（含因可转换公司债券转股形成的股东）均参与当期股利分配，享有同等权益。

（十六）本次募集资金用途

本次发行的可转债募集资金总额扣除发行费用后全部用于补充公司营运资金，支持业务发展；在可转债持有人转股后将增加公司资本金，以扩大业务规模，优化业务结构，提升公司的市场竞争力和抗风险能力。

本次募集资金主要用途如下表所示：

序号	募集资金投向	募集资金投资金额
1	投资与交易业务	不超过 35 亿元
2	资本中介业务	不超过 30 亿元
3	数字化建设及应用场景投入	不超过 5 亿元
合计		不超过 70 亿元

（十七）担保事项

本次发行的可转换公司债券不提供担保。

（十八）募集资金存管

公司已建立《募集资金管理制度》，本次发行的募集资金将存放于公司董事会决定的专项账户中，具体开户事宜在发行前由公司董事会确定，并在发行公告中披露募集资金专项账户的相关信息。

第二节 可转债受托管理人履行职责情况

华安证券作为浙商证券公开发行可转换公司债券的受托管理人，严格按照《公司债券发行与交易管理办法》《公司债券受托管理人执业行为准则》以及《受托管理协议》等规定和约定履行了受托管理人各项职责。存续期内，华安证券对发行人本次可转债情况进行了持续跟踪和监督，密切关注公司的经营情况、财务情况、资信情况，以及偿债保障措施的实施情况等，监督公司募集资金的接收、存储、划转和本息偿付情况，切实维护债券持有人利益。华安证券采取的核查措施主要包括：

- 1、查阅发行人公开披露的定期报告和临时公告；
- 2、收集募集资金专项账户的银行对账单等工作底稿；
- 3、不定期查阅发行人重大事项的会议资料；
- 4、对发行人相关人员进行电话沟通；
- 5、通过公开渠道持续关注发行人资信情况。

第三节 发行人年度经营情况和财务情况

一、发行人基本情况

公司名称：浙商证券股份有限公司

英文名称：ZHESHANG SECURITIES CO., LTD.

股票简称：浙商证券

股票代码：601878

股票上市地点：上海证券交易所

总股本：3,878,185,888 股（截至 2023 年 3 月 31 日）

成立日期：2002 年 5 月 9 日

注册地址：浙江省杭州市上城区五星路 201 号

办公地址：浙江省杭州市上城区五星路 201 号

邮政编码：310020

电话：0571-87901964

传真：0571-87901955

公司网站：www.stocke.com.cn

电子信箱：zszq@stocke.com.cn

经营范围：许可项目：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；证券投资基金托管；上市证券做市交易；中国证监会批准的其他业务。

二、发行人 2022 年度经营情况及财务状况

（一）年度经营情况

2022 年，俄乌战争、美元加息加速了百年未有之大变局的演进，全球经济不确定性导致资本市场加剧动荡。A 股指数经历两次探底，震荡下行。上证指数、深证成指、创业板指分别下跌 15.13%、25.85%、29.37%。两市累计成交额达到 223.89 万亿元，同比下降 12.9%；日均成交额 9,251.81 亿元，同比下降 12.58%。证券发行市场节奏放缓，全年有 428 家企业实现 IPO 上市，同比下降 18.32%，

融资规模 5,868.86 亿元，同比增长 8.15%；共发行各类债券 61.54 万亿元，同比下降 0.35%。根据中国证券业协会数据，2022 年全年，证券行业总资产 11.06 万亿元，同比上升 4.41%；净资产 2.79 万亿元，同比上升 8.52%；累计实现营业收入 3,949.73 亿元，实现净利润 1,423.01 亿元。

2022 年,公司以服务实体经济与管理居民财富为核心, 依托全牌照经营的优势, 积极构建全方位综合化金融服务能力, 加快传统经纪业务向财富管理转型, 大力布局投资银行、卖方研究, 强化资产管理、期货等业务发展, 加快上海自营分公司一体化建设, 综合能力进一步提高, 核心竞争力进一步彰显。

截至 2022 年 12 月 31 日, 公司总资产为 1,369.61 亿元, 同比增加 9.35%; 归属于母公司股东的权益为 261.25 亿元, 同比增加 9.60%。报告期内, 营业收入为 168.14 亿元, 同比增加 2.41%; 利润总额为 20.98 亿元, 同比减少 28.08%; 归属于上市公司股东的净利润 16.54 亿元, 同比减少 24.66%, 公司经营工作成果良好, 业绩符合预期。

(二) 合并资产负债表主要数据

单位：亿元

项目	2022 年末	2021 年末	变动比例
总资产	1,369.61	1,252.51	增加 9.35%
总负债	1,096.53	1,014.14	增加 8.12%
净资产	273.09	238.37	增加 14.57%
归属于母公司所有者 权益	261.25	238.37	增加 9.60%

2022 年末, 公司总资产为 1,369.61 亿元, 较 2021 年末增加 9.35%, 主要以货币资金、结算备付金、融出资金、存出保证金、买入返售金融资产及交易性金融资产等流动性资产为主。其中, 货币资金为 429.81 亿元, 占总资产的 31.38%; 结算备付金为 362.30 亿元, 占总资产的 4.55%; 融出资金为 175.57 亿元, 占总资产的 12.82%; 买入返售金融资产为 62.75 亿元, 占总资产的 4.58%; 交易性金融资产为 439.98 亿元, 占总资产的 32.12%。公司资产结构稳定, 固定资产、其他资产等长期资产占比较低, 资产的安全性高、流动性强。

2022 年末, 公司总负债为 1,096.53 亿元, 较上年同期增长 8.12%, 主要以应付短期融资款、卖出回购金融资产款、代理买卖证券款、应付职工薪酬、应付债券和其他负债为主。其中, 应付短期融资款为 35.67 亿元, 占总负债的 3.25%;

卖出回购金融资产款为 238.25 亿元，占总负债的 21.73%；代理买卖证券款为 208.18 亿元，占总负债的 18.99%；应付职工薪酬为 12.75 亿元，占总负债的 1.16%；应付债券为 215.70 亿元，占总负债的 19.67%；其他负债为 345.32 亿元，占总负债的 31.49%。发行人的资产负债率 76.49%，负债结构合理。发行人无到期未偿付债务，经营情况良好，盈利能力强，长短期偿债能力和流动性良好。

（三）合并利润表主要数据

单位：亿元

项目	2022 年度	2021 年度	变动比例
营业收入	168.14	164.18	增加 2.41%
营业支出	147.08	135.27	增加 8.73%
营业利润	21.06	28.91	下降 27.15%
利润总额	20.98	29.16	下降 28.08%
净利润	17.02	21.96	下降 22.51%
归属于母公司所有者的净利润	16.54	21.96	下降 24.66%

2022 年度，公司实现营业收入 168.14 亿元，较上年增加 3.96 亿元，增幅为 2.41%，其中利息净收入 7.83 亿元，同比增加 1.09 亿元，增幅 4.66%，主要是货币资金及结算备付金利息收入增加；手续费及佣金净收入 36.46 亿元，同比减少 4.22 亿元，降幅 10.37%，主要是受市场影响，证券经纪业务、投资银行业务收入同比均有所下降；投资收益及公允价值变动收益 6.96 亿元，同比减少 11.60 亿元，降幅 62.50%，主要是受弱市影响自营业务投资业绩大幅走低；其他业务收入 116.42 亿元，同比增幅 18.79%，主要由于期货仓单业务收入增加。

公司营业支出 147.08 亿元，较上年增加 11.81 亿元，增幅为 8.73%。其中业务及管理费 29.81 亿元，占比 20.27%，其他业务成本 116.67 亿元，占比 79.33%。

（四）合并现金流量表主要数据

单位：亿元

项目	2022 年度	2021 年度	变动比例
经营活动产生的现金流量净额	5.23	17.26	下降 69.69%
投资活动产生的现金流量净额	-2.88	-2.19	不适用
筹资活动产生的现金流量净额	-4.06	53.18	不适用

经营活动产生的现金流量净额为 5.23 亿元，其中，现金流入 375.61 亿元，主要包括收取利息、手续费及佣金的净额 79.97 亿元，为交易目的而持有的金融资产净减少额 11.41 亿元，代理买卖证券收到现金净额 6.23 亿元，融出资金净减少额 18.26 亿元，收到其他与经营活动有关的现金 249.52 亿元；现金流出 370.38 亿元，主要包括回购业务资金净减少额 14.25 亿元，支付给职工以及为职工支付的现金 22.78 亿元，支付其他与经营活动有关的现金 312.10 亿元。

投资活动产生的现金流量净额为-2.88 亿元，其中现金流入 0.28 亿元，现金流出为 3.17 亿元，包括购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金 2.49 亿元。

筹资活动产生的现金流量净额-4.06 亿元，其中现金流入 233.66 亿元，主要包括发行债券收到的现金 208.89 亿元；现金流出 237.72 亿元，主要包括偿还债务支付的现金 222.31 亿元，分配股利、利润或偿付利息支付的现金 14.00 亿元。

第四节 发行人募集资金使用情况

一、募集资金基本情况

公司经中国证券监督管理委员会证监许可[2022]679号文核准，由主承销商华安证券采用余额包销方式，向社会公众公开发行了可转换公司债券7,000.00万张，每张面值为人民币100.00元，按面值发行，共计募集资金总额为人民币700,000.00万元，坐扣券商承销佣金及保荐费用人民币12,600,000.00元（含税）后的募集资金金额为6,987,400,000.00元，由主承销商华安证券于2022年6月20日汇入公司募集资金监管账户。本次募集资金扣除承销及保荐费、律师费用、会计师费用、资信评级费用、信息披露及发行手续费用14,168,867.92元（不含税）后，公司本次募集资金净额为人民币6,985,831,132.08元。上述募集资金到位情况业经中汇会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并由其于2022年6月20日出具了《验证报告》（中汇会验[2022]5612号）。

二、本期可转换公司债券募集资金实际使用情况

2022年度使用募集资金653,829.48万元。截至2022年12月31日，结余募集资金（含利息收入扣除银行手续费的净额）余额为306,384,417.17元，具体情况如下：

单位：人民币元

开户银行	银行账号	存储余额	备注
兴业银行股份有限公司杭州分行	356980100102286088	296,853,344.42	专用账户（活期）
中国农业银行股份有限公司杭州玉泉支行	19042101040027886	9,531,072.75	专用账户（活期）
合计	-	306,384,417.17	-

注：中国农业银行股份有限公司杭州玉泉支行系中国农业银行股份有限公司杭州保傲支行的二级支行，公司募集资金存放于中国农业银行股份有限公司杭州玉泉支行。

本次可转债募集资金截至2022年12月31日的使用情况和结余情况如下：

单位：人民币万元

募集资金总额[注]			698,583.11			本年度投入募集资金总额			670,219.03			
变更用途的募集资金总额			-			已累计投入募集资金总额			670,219.03			
变更用途的募集资金总额比例			-									
承诺投资项目	已变更项目(含部分变更)	募集资金承诺投资总额	调整后投资总额	截至期末承诺投入金额(1)	本年度投入金额	截至期末累计投入金额(2)	截至期末累计投入金额与承诺投入金额的差额(3)=(2)-(1)	截至期末投入进度(%) (4)=(2)/(1)	项目达到预定可使用状态日期	本年度实现的效益	是否达到预计效益	项目可行性是否发生重大变化
投资与交易业务	-	不超过35亿元	350,000.00	350,000.00	350,000.00	350,000.00	-	100.00	不适用	不适用	不适用	否
资本中介业务	-	不超过30亿元	300,000.00	300,000.00	300,000.00	300,000.00	-	100.00	不适用	不适用	不适用	否
数字化建设及应用场景投入	-	不超过5亿元	48,583.11	48,583.11	20,219.03	20,219.03	-28,364.09	41.62	不适用	不适用	不适用	否
合计	-	-	698,583.11	698,583.11	670,219.03	670,219.03	-28,364.09	95.94	-	-	-	-
未达到计划进度原因(分具体募投项目)					不适用							
项目可行性发生重大变化的情况说明					未发生							
募集资金投资项目先期投入及置换情况					未发生							
用闲置募集资金暂时补充流动资金情况					未发生							
对闲置募集资金进行现金管理,投资相关产品情况					未发生							

用超募资金永久补充流动资金或归还银行贷款情况	不适用
项目资金结余的金额及形成原因	不适用
募集资金其他使用情况	无

[注] 募集资金总额系已扣除发行费用后的实际募集资金净额。

第五节 本次可转债本息偿付情况

本次发行的可转债的起息日为 2022 年 6 月 14 日，采用每年付息一次的付息方式。发行人于 2023 年 6 月 7 日公告《浙商证券股份有限公司关于“浙 22 转债”2023 年付息公告》，并于 2023 年 6 月 14 日支付“浙 22 转债”2022 年 6 月 14 日至 2023 年 6 月 13 日期间的利息，未出现延迟支付利息的情况。华安证券将持续掌握受托债券还本付息、赎回、回售等事项的资金安排，督促发行人按时履约。

第六节 发行人偿债意愿和能力分析

一、发行人偿债意愿情况

发行人于 2023 年 6 月 7 日公告《浙商证券股份有限公司关于“浙 22 转债”2023 年付息公告》，并于 2023 年 6 月 14 日支付“浙 22 转债”2022 年 6 月 14 日至 2023 年 6 月 13 日期间的利息，未出现延迟支付利息的情况。

华安证券将持续掌握受托债券还本付息、赎回、回售等事项的资金安排，督促发行人按时履约。

二、发行人偿债能力分析

2021 年和 2022 年，发行人主要偿债能力指标统计表如下：

项 目	2022 年 12 月 31 日/2022 年度	2021 年 12 月 31 日 /2021 年度
流动比率	3.41	2.54
速动比率	2.86	2.05
资产负债率（%）	76.49	77.35
EBITDA利息保障倍数	2.55	3.19
贷款偿还率（%）	100.00	100.00
利息偿付率（%）	100.00	100.00

截至本报告出具日，发行人生产经营及财务指标未出现重大不利变化，发行人偿债能力正常。

第七节 增信机制及偿债保障措施情况

一、增信机制

本次可转债不提供担保。

二、偿债保障措施及有效性分析

（一）发行人偿债保障措施

- 1、制定《债券持有人会议规则》；
- 2、设立专项账户，制定并严格执行资金管理计划；
- 3、充分发挥债券受托管理人的作用；
- 4、严格履行信息披露义务。

（二）发行人偿债保障措施的有效性分析

1、制定持有人会议规则

为充分保护债券持有人的合法权益，“浙 22 转债”设立债券持有人会议，制定持有人会议规则，明确约定了债券持有人通过债券持有人会议行使权利的范围、程序和其他重要事项，为保障本次债券的本息及时足额偿付做出了合理的制度安排。

2、设立专项账户，制定并严格执行资金管理计划

公司已建立了募集资金管理的相关制度并指定了募集资金专项账户，用于本次可转债募集资金的接收、存储、划转与本息偿付，账户实行专户管理、专款专用。

3、充分发挥债券受托管理人的作用

发行人已聘请华安证券担任债券受托管理人。华安证券作为“浙 22 转债”的债券受托管理人，通过持续关注发行人资信情况、定期查阅公司公开披露的定期报告、收集发行人募集资金专项账户对账单等方式履行受托管理职责，维护债券持有人权益。

4、严格履行信息披露义务

2022 年度，发行人遵循真实、准确、完整的信息披露原则，按《受托管理

协议》及中国证监会的有关规定进行重大事项信息披露，使发行人偿债能力、募集资金使用等情况受到债券持有人、债券受托管理人和股东的监督，防范偿债风险。截至 2022 年 12 月 31 日，发行人严格按照相关约定执行偿债保障措施，能够有效保障公司债券本息的偿付。2022 年度，“浙 22 转债”偿债保障措施未发生变更。

第八节 债券持有人会议召开情况

2022 年度，发行人未出现需召开债券持有人会议的情形。

第九节 本次可转债的信用评级情况

2021年12月14日，联合资信评估股份有限公司为浙商证券拟公开发行可转换公司债券进行了信用评级，根据其出具的《浙商证券股份有限公司公开发行可转换公司债券信用评级报告》（联合[2021]10691号），浙商证券的主体长期信用等级为AAA级，本次可转换公司债券的信用等级为AAA级，评级展望为稳定。

2022年6月30日，联合资信评估股份有限公司出具了《浙商证券股份有限公司公开发行可转换公司债券2022年跟踪评级报告》（联合[2022]5859号），确定维持公司主体长期信用等级为AAA，“浙22转债”信用等级为AAA，评级展望为稳定。

2023年5月29日，联合资信评估股份有限公司出具了《浙商证券股份有限公司公开发行可转换公司债券2023年跟踪评级报告》（联合[2023]3393号），确定维持公司主体长期信用等级为AAA，“浙22转债”信用等级为AAA，评级展望为稳定。

第十节 负责处理与公司债券相关事务专人的变动情况

2022 年度，发行人负责处理与公司债券相关事务的专人未发生变动。

第十一节 其他事项

一、是否发生债券受托管理协议第 3.4 条约定的重大事项

根据发行人与华安证券签署的《受托管理协议》第 3.4 条规定：

“3.4 本期债券存续期内，发生以下任何事项，甲方应当在 3 个工作日内书面通知乙方，并根据乙方要求持续书面通知事件进展和结果：

- （一）甲方经营方针、经营范围或生产经营外部条件等发生重大变化；
- （二）甲方主要资产被查封、扣押、冻结；
- （三）甲方出售、转让主要资产或发生重大资产重组；
- （四）甲方放弃债权、财产或其他导致甲方发生超过上年末净资产 10%的重大损失；
- （五）甲方当年累计新增借款或者对外提供担保超过上年末净资产的 20%；
- （六）甲方发生未能清偿到期债务的违约情况；
- （七）甲方涉及重大诉讼、仲裁事项，受到重大行政处罚、行政监管措施或自律组织纪律处分；
- （八）甲方减资、合并、分立、解散、申请破产或依法进入破产程序；
- （九）甲方及其董事、监事、高级管理人员或者履行同等职责的人员涉嫌犯罪或重大违法失信、无法履行职责或者发生重大变动；
- （十）甲方控股股东或者实际控制人涉嫌犯罪被立案调查或者发生变更；
- （十一）甲方发生可能导致不符合债券上市条件的重大变化；
- （十二）甲方主体或债券信用评级发生变化；
- （十三）保证人、担保物或者其他偿债保障措施发生重大变化；
- （十四）甲方拟变更募集说明书的约定；
- （十五）甲方不能按期支付本息；
- （十六）甲方管理层不能正常履行职责，导致甲方债务清偿能力面临严重不确定性，需要依法采取行动的；
- （十七）甲方提出债务重组方案的；
- （十八）本次债券可能被暂停或者终止提供交易或转让服务的；
- （十九）发生其他对债券持有人权益有重大影响的事项；

(二十) 法律、法规和规则规定的其他事项。

就上述事件通知乙方同时，甲方就该等事项是否影响本次债券本息偿还向乙方作出书面说明，并对有影响的事件提出有效且切实可行的应对措施，甲方受到重大行政处罚、行政监管措施或纪律处分的，还应当及时告知乙方相关违法违规行为的整改情况。

此外，发生可能对可转债的交易转让价格产生较大影响的重大事件，投资者尚未得知时，甲方应当立即将有关该重大事件的情况向中国证监会和证券交易场所报送临时报告，并予公告，说明事件的起因、目前的状态和可能产生的法律后果。前述所称重大事件包括：

(一) 《证券法》第八十条第二款、第八十一条第二款规定的重大事件；

(二) 因配股、增发、送股、派息、分立、减资及其他原因引起甲方股份变动，需要调整转股价格，或者依据募集说明书约定的转股价格向下修正条款修正转股价格；

(三) 募集说明书约定的赎回条件触发，甲方决定赎回或者不赎回；

(四) 可转债转换为股票的数额累计达到可转债开始转股前公司已发行股票总额的百分之十；

(五) 未转换的可转债总额少于三千万元；

(六) 可转债担保人发生重大资产变动、重大诉讼、合并、分立等情况；

(七) 中国证监会规定的其他事项。”

2022 年度，发行人未发生《受托管理协议》第 3.4 条列明的除实施 2022 年半年度利润分配方案对“浙 22 转债”转股价格进行调整以外的重大事项。

二、转股价格调整

本次可转债存续的起止时间为 2022 年 6 月 14 日至 2028 年 6 月 13 日，转股的起止时间为 2022 年 12 月 20 日至 2028 年 6 月 13 日，初始转股价格为 10.49 元/股。

由于公司实施 2022 年半年度利润分配，自 2022 年 10 月 31 日起，转股价格调整为 10.32 元/股。

(以下无正文)

（本页无正文，为《浙商证券股份有限公司公开发行可转换公司债券受托管理事务报告（2022 年度）》盖章页）

华安证券股份有限公司

2023年6月21日

