

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

华安证券股份有限公司

关于浙商证券股份有限公司公开发行可转换公司债券

2023 年第一次临时受托管理事务报告

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)

二〇二三年八月

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。

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。

(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。

三、本次债券重大事项具体情况

华安证券作为 2022 年浙商证券股份有限公司公开发行可转换公司债券的受托管理人，现将本次权益分派调整“浙 22 转债”转股价格的重大事项报告如下：

重要内容提示：

- 调整前转股价格：10.32 元/股
- 调整后转股价格：10.19 元/股
- “浙 22 转债”本次转股价格调整实施日期：2023 年 8 月 11 日

（一）转股价格调整依据

公司于 2023 年 6 月 15 日召开 2022 年年度股东大会并审议通过了 2022 年年度利润分配方案：公司 2022 年度利润分配采用现金分红的方式，向 2022 年度现金红利派发股权登记日登记在册的 A 股股东派发现金红利，以 2022 年末总股本为基数，向全体股东每 10 股派发现金红利人民币 1.30 元（含税），剩余未分配利润结转以后年度。

鉴于公司公开发行的可转换公司债券“浙 22 转债”已进入转股期，为保证公司本次权益分派时总股本不发生变化，自 2023 年 8 月 4 日至权益分派股权登记日期间，“浙 22 转债”停止转股，即本次权益分派股权登记日的总股本与 2023 年 8 月 3 日公司股票收盘后的总股本一致。具体内容详见公司在上海证券交易所网站披露的《浙商证券股份有限公司关于实施 2022 年度权益分派时“浙 22 转债”转股价格调整暨转股连续停牌的提示性公告》。

公司本次权益分派实施的股权登记日的总股本 3,878,190,132 股，扣除公司回购专用账户的股数 36,781,600 股，本次实际参与分配的股数为 3,841,408,532 股，每 10 股派发现金股利 1.30 元（含税），共计派发现金红利 499,383,109.16 元。剩余未分配利润结转下一年度，不进行资本公积转增股本，不送红股。具体内容详见公司在上海证券交易所网站披露的《浙商证券股份有限公司 2022 年年度权益分派实施公告》。

根据《浙商证券股份有限公司公开发行可转换公司债券募集说明书》（以下

简称“《募集说明书》”)的相关规定,在“浙 22 转债”发行之后,当公司发生派送红股、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时,将根据相关公式进行转股价格的调整。

因此,“浙 22 转债”转股价格将进行调整,本次调整符合《募集说明书》的规定。

(二) 转股价格调整公式与调整结果

根据《募集说明书》的相关条款,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: $P1=P0 \div (1+n)$;

增发新股或配股: $P1=(P0+A \times k) \div (1+k)$;

上述两项同时进行: $P1=(P0+A \times k) \div (1+n+k)$;

派送现金股利: $P1=P0-D$;

上述三项同时进行: $P1=(P0 - D+A \times k) \div (1+n+k)$ 。

其中: P1 为调整后转股价; P0 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。

根据上述公式中“派送现金股利: $P1=P0-D$ ”进行计算,调整前转股价 P0 为 10.32 元/股,根据公司 2022 年年度利润分配方案,每股派送现金股利 D 为 0.13 元,因此计算调整后的转股价 P1 为 10.19 元/股。

调整后的“浙 22 转债”转股价自公司实施 2022 年度利润分配时确定的除息日即 2023 年 8 月 11 日生效。

四、上述事项对发行人的影响分析

公司本次因实施 2022 年年度利润分配方案对“浙 22 转债”转股价格进行调整,符合《募集说明书》的规定,未对公司的日常及偿债能力构成影响。

华安证券将持续关注本次可转债本息偿付及对债券持有人权益有重大影响的事项,及时披露相关事项。华安证券将根据《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》《可转换公司债券管理办法》以及《受托管理协议》的有关规定及约定严格履行债券受托管理人的职责，并出具本临时受托管理事务报告。

特此提请投资者关注本次债券的相关风险，并请投资者对相关事项做出独立判断。

特此公告。

（以下无正文）

（本页无正文，为《华安证券股份有限公司关于浙商证券股份有限公司公开发行可转换公司债券 2023 年第一次临时受托管理事务报告》盖章页）

