

香港交易及結算所有限公司及香港聯合交易所有限公司對本公告之內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示，概不對因本公告全部或任何部分內容而產生或因依賴該等內容而引致之任何損失承擔任何責任。



(在中華人民共和國註冊成立之股份有限公司)

(股份代號：06881)

公告

建議發行A股可轉債

董事會於2021年8月30日審議通過了(其中包括)關於本公司A股可轉債發行方案的相關議案。

公司將召開臨時股東大會，以審議並酌情批准(其中包括)建議發行A股可轉債的相關議案。一份載有(其中包括)建議發行A股可轉債詳情的通函將適時寄發予股東。

董事會於2021年8月30日審議通過了(其中包括)關於本公司A股可轉債發行方案的相關議案。

一、A股可轉債發行方案

依據《中華人民共和國公司法》、《中華人民共和國證券法》、《上市公司證券發行管理辦法》、《可轉換公司債券管理辦法》以及《關於國有金融企業發行可轉換公司債券有關事宜的通知》等法律、法規及規範性文件的有關規定，本公司已符合公開發行A股可轉債的資格和條件。為提升本公司綜合競爭實力，增強持續發展能力，本公司建議公開發行A股可轉債，具體方案如下：

(一) 發行證券的種類

本次發行證券的種類為可轉換為A股的可轉換公司債券。A股可轉債及未來轉換的A股將在上海證券交易所上市。

(二) 發行規模

A股可轉債的發行總額不超過人民幣110億元(含人民幣110億元)，具體數額由股東大會授權董事會及董事會授權人士在上述額度範圍內確定。

(三) 票面金額和發行價格

A股可轉債每張面值為人民幣100元，按面值發行。

(四) 期限

A股可轉債的期限為自發行之日起六年。

(五) 利率

A股可轉債票面利率的確定方式及每一計息年度的最終利率水平，由股東大會授權董事會及董事會授權人士在發行前根據國家政策、市場狀況和本公司具體情況與保薦機構(主承銷商)協商確定。

(六) 還本付息的期限和方式

A股可轉債每年付息一次，到期歸還所有未轉股的A股可轉債本金和最後一年利息。

1. 年利息計算

年利息指A股可轉債持有人按持有的A股可轉債票面總金額自A股可轉債發行首日起每滿一年可享受的當期利息。

年利息的計算公式為： $I=B \times i$

I：指年利息額；

B：指A股可轉債持有人在計息年度付息債權登記日持有的A股可轉債票面總金額；

i：指A股可轉債的當年票面利率。

2. 付息方式

- (1) A股可轉債每年付息一次，計息起始日為A股可轉債發行首日。
- (2) 付息日：每年的付息日為A股可轉債發行首日起每滿一年的當日。如該日為法定節假日或休息日，則順延至下一個交易日，順延期間不另付息。每相鄰的兩個付息日之間為一個計息年度。

轉股年度有關利息和股利的歸屬等事項，由董事會根據相關法律法規及上海證券交易所的規定確定。

- (3) 付息債權登記日：每年的付息債權登記日為每年付息日的前一交易日，本公司將在每年付息日之後的五個交易日內支付當年利息。在付息債權登記日前(包括付息債權登記日)申請轉換成A股的A股可轉債，本公司不再向其持有人支付本計息年度及以後計息年度的利息。
- (4) A股可轉債持有人所獲得利息收入的應付稅項由A股可轉債持有人承擔。

(七) 轉股期限

A股可轉債轉股期自發行結束之日起滿六個月後的第一個交易日起至A股可轉債到期日止。

(八) 轉股價格的確定及其調整

1. 初始轉股價格的確定依據

A股可轉債的初始轉股價格不得低於募集說明書公告日前三十個交易日A股交易均價(若在該三十個交易日內發生過因除權、除息引起股價調整的情形，則對調整前交易日的交易均價按經過相應除權、除息調整後的價格計算)、前二十個交易日A股交易均價(若在該二十個交易日內發生過因除權、除息引起股價調整的情形，則對調整前交易日的交易均價按經過相應除權、除息調整後的價格計算)和前一個交易日A股交

易均價中的最高者，同時不低於最近一期經審計的每股淨資產和股票面值，且不得向上修正。具體初始轉股價格由股東大會授權董事會及董事會授權人士在發行前根據市場狀況與保薦機構(主承銷商)協商確定。

前三十個交易日A股交易均價=前三十個交易日A股交易總額÷該三十個交易日A股交易總量；前二十個交易日A股交易均價=前二十個交易日A股交易總額÷該二十個交易日A股交易總量；前一個交易日A股交易均價=前一個交易日A股交易總額÷該日A股交易總量。

2. 轉股價格的調整方法及計算公式

在A股可轉債發行之後，當本公司發生派送股票股利、轉增股本、增發新股或配股、派送現金股利等情況(不包括因A股可轉債轉股而增加股本的情形)時，將按下述公式進行轉股價格的調整(保留小數點後兩位，最後一位四捨五入)：

派送股票股利或轉增股本： $P1=P0 \div (1+n)$ ；

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

上述兩項同時進行： $P1=(P0+A \times k) \div (1+n+k)$ ；

派送現金股利： $P1= P0-D$ ；

上述三項同時進行： $P1=(P0-D+A \times k) \div (1+n+k)$ 。

其中： $P0$ 為調整前轉股價格， n 為派送股票股利或轉增股本率， k 為增發新股率或配股率， A 為增發新股價格或配股價格， D 為每股派送現金股利， $P1$ 為調整後轉股價格。

當本公司出現上述股份和／或股東權益變化時，將依次進行轉股價格調整，並在上海證券交易所網站和中國證監會指定的上市公司信息披露媒體上刊登公告，並於公告中載明轉股價格調整日、調整辦法及暫停轉股時期(如需)等有關信息。同時，本公司將根據香港上市規則的要求在香港市場予以公佈(如需)。當轉股價格調整日為A股可轉債持有人轉股申請日或之後、轉換股份登記日之前，則該持有人的轉股申請按本公司調整後的轉股價格執行。

當本公司可能發生股份回購、合併、分立或任何其他情形使本公司股份類別、數量和／或股東權益發生變化從而可能影響A股可轉債持有人的債權利益或轉股衍生權益時，本公司將視具體情況按照公平、公正、公允的原則以及充分保護A股可轉債持有人權益的原則調整轉股價格。有關轉股價格調整內容及操作辦法將依據屆時國家有關法律法規及證券監管部門的相關規定制訂。

(九) 轉股價格向下修正條款

1. 修正權限及修正幅度

在A股可轉債存續期間，當A股在任意連續三十個交易日中至少有十五個交易日的收盤價低於當期轉股價格的80%時，董事會有權提出轉股價格向下修正方案並提交股東大會審議表決。

若在上述交易日內發生過因除權、除息等引起公司轉股價格調整的情形，則在轉股價格調整日前的交易日按調整前的轉股價格和收盤價計算，在轉股價格調整日及之後的交易日按調整後的轉股價格和收盤價計算。

上述方案須經出席會議的股東所持表決權的三分之二以上通過方可實施。股東大會進行表決時，持有A股可轉債的股東應當迴避。修正後的轉股價格應不低於前述股東大會召開日前三十個交易日A股交易均價、前二十個交易日A股交易均價(若在該三十個交易日或二十個交易日內發生過因除權、除息引起股價調整的情形，則對調整前

交易日的交易均價按經過相應除權、除息調整後的價格計算)和前一個交易日A股交易均價中的最高者。同時，修正後的轉股價格不得低於最近一期經審計的每股淨資產和股票面值。

若在前述三十個交易日內發生過轉股價格調整的情形，則在轉股價格調整日前的交易日按調整前的轉股價格和收盤價計算，在轉股價格調整日及之後的交易日按調整後的轉股價格和收盤價計算。

2. 修正程序

如本公司決定向下修正轉股價格，本公司將在上海證券交易所網站和中國證監會指定的上市公司信息披露媒體上刊登相關公告，公告修正幅度、股權登記日及暫停轉股期間(如需)等有關信息。同時，本公司將根據香港上市規則的要求在香港市場予以公佈(如需)。從股權登記日後的第一個交易日(即轉股價格修正日)起，開始恢復轉股申請並執行修正後的轉股價格。

若轉股價格修正日為轉股申請日或之後、轉換股份登記日之前，該類轉股申請應按修正後的轉股價格執行。

(十) 轉股股數確定方式以及轉股時不足一股金額的處理方法

A股可轉債持有人在轉股期內申請轉股時，轉股數量的計算方式為： $Q=V \div P$ ，並以去尾法取一股的整數倍。

其中：Q為可轉換的股票數量；V為A股可轉債持有人申請轉股的A股可轉債票面總金額；P為申請轉股當日有效的轉股價格。

A股可轉債持有人申請轉換成的股份須是整數。轉股時不足轉換為一股的A股可轉債餘額，本公司將按照上海證券交易所等部門的有關規定，在A股可轉債持有人轉股當日後的五個交易日內以現金兌付該部分A股可轉債餘額及其所對應的當期應計利息(當期應計利息的計算方式參見「(十一)贖回條款」的相關內容)。

(十一) 贖回條款

1. 到期贖回條款

在A股可轉債期滿後五個交易日內，本公司將贖回全部未轉股的A股可轉債。具體贖回價格由股東大會授權董事會及董事會授權人士根據發行時的市場情況與保薦機構(主承銷商)協商確定。

2. 有條件贖回條款

在A股可轉債轉股期內，當下述兩種情形的任意一種出現時，本公司有權決定按照A股可轉債面值加當期應計利息的價格贖回全部或部分未轉股的A股可轉債：(1)在A股可轉債轉股期內，如果A股連續三十個交易日中至少有十五個交易日的收盤價不低於當期轉股價格的130%(含130%)；或(2)當A股可轉債未轉股餘額不足人民幣3,000萬元時。

當期應計利息的計算公式為： $IA=B \times i \times t \div 365$

IA：指當期應計利息；

B：指A股可轉債持有人持有的A股可轉債票面總金額；

i：指A股可轉債當年票面利率；

t：指計息天數，即從上一個付息日起至本計息年度贖回日止的實際日曆天數(算頭不算尾)。

若在前述三十個交易日內發生過轉股價格調整的情形，則在調整前的交易日按調整前的轉股價格和收盤價計算，在調整後的交易日按調整後的轉股價格和收盤價計算。

(十二) 回售條款

若A股可轉債募集資金運用的實施情況與本公司在募集說明書中的承諾相比出現重大變化，且該變化根據中國證監會的相關規定被視作改變募集資金用途的，A股可轉債持有人享有一次回售的權利。A股可轉債持有人有權將其持有的A股可轉債全部或部分按債券面值加當期應計利息的價格回售給本公司。

當期應計利息的計算公式為： $IA=B \times i \times t/365$

IA：指當期應計利息；

B：指A股可轉債持有人持有的將回售的A股可轉債票面總金額；

i：指A股可轉債當年票面利率；

t：指計息天數，即從上一個付息日起至本計息年度贖回日止的實際日曆天數(算頭不算尾)。

A股可轉債持有人在回售條件滿足後，可以在本公司公告後的回售申報期內進行回售，回售申報期內不實施回售的，不應再行使回售權。

(十三) 轉股年度有關股利的歸屬

因A股可轉債轉股而增加的A股享有與原A股同等的權益，在股利分配股權登記日下午收市後登記在冊的所有普通股股東(含因A股可轉債轉股形成的股東)均參與當期股利分配，享有同等權益。

(十四) 發行方式及發行對象

A股可轉債的具體發行方式由股東大會授權董事會及董事會授權人士與保薦機構(主承銷商)協商確定。

A股可轉債的發行對象為持有中國證券登記結算有限責任公司上海分公司證券賬戶的自然人、法人、證券投資基金、符合法律規定的其他投資者等(國家法律、法規禁止者除外)。

(十五) 向原A股股東配售的安排

擬發行的A股可轉債給予原A股股東優先配售權。具體優先配售數量由股東大會授權董事會及董事會授權人士在發行前根據市場情況確定，並在A股可轉債的發行公告中予以披露。該等優先配售將須遵守《中華人民共和國公司法》及香港上市規則或任何其他政府或監管機構的所有適用法律、法規及規則(包括但是不限於關聯交易／關連交易相關的規則和要求)，方可落實。

原A股股東優先配售之外的餘額和原A股股東放棄優先配售之後的部分，採用網下對機構投資者發售和通過上海證券交易所交易系統網上發行相結合的方式進行，餘額由承銷團包銷。具體發行方式由股東大會授權董事會及董事會授權人士與保薦機構(主承銷商)在發行前協商確定。

(十六) A股可轉債持有人會議相關事項

1. A股可轉債持有人的權利

- (1) 依照法律、行政法規等相關規定參與或委託代理人參與A股可轉債持有人會議並行使表決權；
- (2) 依照其所持有的A股可轉債數額享有約定利息；
- (3) 按募集說明書約定的期限和方式要求本公司償付A股可轉債本息；
- (4) 根據募集說明書約定的條件將所持有的A股可轉債轉為A股；
- (5) 根據募集說明書約定的條件行使回售權；
- (6) 依照法律、行政法規、公司章程及募集說明書的規定轉讓、贈與或質押其所持有的A股可轉債；
- (7) 依照法律、公司章程的規定獲得有關信息；
- (8) 法律、行政法規、公司章程及募集說明書所賦予的其作為公司債權人享有的其他權利。

2. A股可轉債持有人的義務

- (1) 遵守發行A股可轉債條款的相關規定；
- (2) 依其所認購的A股可轉債數額繳納認購資金；
- (3) 遵守A股可轉債持有人會議形成的有效決議；

- (4) 除法律、法規規定、公司章程及募集說明書約定之外，不得要求本公司提前償付A股可轉債的本金和利息；
 - (5) 法律、行政法規、公司章程及募集說明書規定應當由A股可轉債持有人承擔的其他義務。
- 3.** 在A股可轉債存續期內，發生下列情形之一的，A股可轉債受託管理人應召集A股可轉債持有人會議：
- (1) 本公司擬變更募集說明書的約定；
 - (2) 本公司未按期支付A股可轉債本息；
 - (3) 本公司發生減資(因員工持股計劃、股權激勵、過往收購交易對應的交易對手業績承諾事項導致的股份回購或本公司為維護公司價值及股東權益所必須回購股份導致的減資除外)、合併、分立、解散或者申請破產；
 - (4) 修訂A股可轉債持有人會議規則；
 - (5) 擬變更A股可轉債受託管理人或者受託管理協議的主要內容；
 - (6) 本公司管理層不能正常履行職責，導致本公司債務清償能力面臨嚴重不確定性，需要依法採取行動的；
 - (7) 本公司提出債務重組方案的；
 - (8) 發生其他對A股可轉債持有人權益有重大實質影響的事項；
 - (9) 董事會、單獨或合計持有A股可轉債未償還債券面值總額10%以上的A股可轉債持有人書面提議召開；

- (10) 根據法律、行政法規、中國證監會、上海證券交易所及A股可轉債持有人會議規則的規定，應當由A股可轉債持有人會議審議並決定的其他事項。

下列機構或人士可以提議召開A股可轉債持有人會議：

- (1) 董事會；
- (2) A股可轉債受託管理人；
- (3) 在董事會和A股可轉債受託管理人應當召集而未召集A股可轉債持有人會議時，單獨或合計持有A股可轉債未償還債券面值總額10%以上的A股可轉債持有人有權自行召集A股可轉債持有人會議；
- (4) 法律、法規、中國證監會規定的其他機構或人士。

(十七) 募集資金用途

發行A股可轉債募集資金總額不超過人民幣110億元(含人民幣110億元)，扣除發行費用後擬全部用於發展投資交易業務、資本中介業務、增加投行業務的資金投入及補充本公司其他營運資金，並將在A股可轉債轉股後按照相關監管要求用於補充本公司的資本金。募集資金的擬投資項目及擬投資金額情況如下：

募集資金投資項目	擬投資金額
投資交易業務	不超過人民幣50億元
資本中介業務	不超過人民幣40億元
投資銀行業務	不超過人民幣10億元
補充其他營運資金	不超過人民幣10億元
合計	不超過人民幣110億元

(十八) 擔保事項

A股可轉債不提供擔保。

(十九) 募集資金存管

本公司已建立募集資金管理辦法，發行A股可轉債的募集資金將存放於董事會決定的專項賬戶中，具體開戶事宜將在發行前由董事會確定，並在發行公告中披露募集資金專項賬戶的相關信息。

(二十) 違約責任

1. A股可轉債違約情形

- (1) 在A股可轉債到期、加速清償時，本公司未能償付到期應付本金；
- (2) 本公司未能按期償付A股可轉債的到期利息；
- (3) 本公司不履行或違反A股可轉債受託管理協議的任何承諾對本公司對A股可轉債的還本付息能力產生重大不利影響，且經A股可轉債受託管理人書面通知，或經單獨和／或合併代表未償還的A股可轉債10%以上表決權的A股可轉債持有人書面通知，該違約自收到通知之日起持續30個連續工作日仍未得到糾正；
- (4) 在A股可轉債存續期間內，本公司發生解散、註銷、吊銷營業執照、停業、清算、喪失清償能力、被法院指定破產管理人或已開始與上述事項相關的訴訟程序；
- (5) 本公司及其合併範圍內子公司的債務(公司債／債務融資工具／企業債／境外債券／金融機構貸款／其他融資)出現違約(本金、利息逾期／債務已被宣告加速到期／其他附加速到期宣告權認定的違約形式)或寬限期(如有)到期後應付未付；
- (6) 本公司觸發財務指標承諾條款(如有)、行為事先約束條款(如有)；
- (7) 其他對A股可轉債的按期兌付產生重大不利影響的情形。

2. 違約責任及其承擔方式

本公司承諾保證按照A股可轉債發行條款約定的還本付息安排向A股可轉債持有人支付利息及兌付本金，若不能按時支付A股可轉債利息或A股可轉債到期不能兌付本金，對於延遲支付的本金或利息，本公司承諾根據逾期天數按逾期利率向A股可轉債持有人支付逾期利息，逾期利率為A股可轉債票面利率上浮10%。

如果發生違約事件且一直持續30個連續工作日仍未解除，A股可轉債受託管理人可以根據A股可轉債持有人會議的決議，依法協調A股可轉債持有人採取任何可行的法律救濟方式催收A股可轉債本金和利息。

3. 爭議解決機制

A股可轉債發行適用於中國法律並依其解釋。

A股可轉債發行和存續期間所產生的爭議，首先應在爭議各方之間協商解決。如果協商解決不成，應提交A股可轉債受託管理人所在地有管轄權的人民法院訴訟解決。

當產生任何爭議及任何爭議正按前條約定進行解決時，除爭議事項外，各方有權繼續行使A股可轉債發行及存續期的其他權利，並應履行其他義務。

(二十一) A股可轉債的受託管理人

本公司已聘請浙商證券股份有限公司為本次公開發行A股可轉債的受託管理人，並與其就受託管理相關事宜簽訂受託管理協議。

(二) 本次發行方案的有效期

發行A股可轉債決議的有效期為股東大會審議通過發行方案之日起十二個月。

A股可轉債發行方案需經中國證監會核准後方可實施，且最終以中國證監會核准的方案為準。

二. 發行A股可轉債在中國監管規定下的影響

本公司本次擬發行的A股可轉債可能因行使轉股權而導致新A股的發行。因A股可轉債轉股將予發行的新A股具體數量將取決於各種因素，包括A股可轉債的轉股價格。董事會認為，A股可轉債轉換成新A股將導致現有股東於本公司股本中的權益被攤薄。

根據有關的中國境內法律和規則，擬發行A股可轉債須獲得股東大會上股東的批准及中國的相關監管機構的批准，方可作實。

三. 發行A股可轉債在香港上市規則下的影響

A股可轉債於轉股後而新發行的A股，擬根據於發行日期有效的一般性授權發行。

就董事所知，本公司關連人士概無意根據A股可轉債發行計劃認購A股可轉債。倘現有股東進行認購涉及香港上市規則所界定的關連交易，本公司須遵守香港上市規則第14A章下的關連交易相關規定，包括但不限於公告、通函及獨立股東批准規定。

董事會預計本公司將繼續維持足夠的公眾持股量以符合香港上市規則中適用於本公司的最低要求。

概無董事於A股可轉債發行中擁有或被視為擁有重大權益，因此，概無董事須就建議發行A股可轉債的決議案放棄投票。

四. 於過去十二個月的股本集資活動

於本公告日期前十二個月內，本公司並無進行任何股本集資活動。

五. 臨時股東大會

公司將召開臨時股東大會，以審議並酌情批准(其中包括)建議發行A股可轉債的相關議案。一份載有(其中包括)建議發行A股可轉債詳情的通函將適時寄發予股東。

務請投資者注意，建議發行A股可轉債：(i)須待股東於臨時股東大會上批准；及(ii)須獲中國證監會及其他相關機構批准後，方可作實。由於建議發行A股可轉債仍須待達成其所載多個條件後方可作實，故建議發行A股可轉債未必進行或成為無條件或生效。股東及潛在投資者買賣或擬買賣本公司證券時，務請審慎行事並僅應依賴本公司刊發的資料。

六. 釋義

於本公告內，除文義另有所指外，下列詞彙具有以下含義：

「公司章程」	指	本公司之公司章程，以不時修訂的內容為準
「A股」	指	本公司普通股股本中每股面值人民幣1.00元之內資股，其於上海證券交易所上市並以人民幣買賣
「A股可轉債」	指	本公司擬在中國境內公開發行的總額不超過人民幣110億元、可轉換為新A股的可轉換公司債券
「董事會」	指	本公司董事會
「本公司」	指	中國銀河證券股份有限公司，一間於2007年1月26日在中國註冊成立的股份有限公司，其H股於香港聯交所上市(股份代號：6881)，且其A股於上海證券交易所上市(股份代號：601881)

「關連人士」	指	具有香港上市規則賦予的涵義
「中國證監會」	指	中國證券監督管理委員會
「董事」	指	本公司董事
「銀河金控」	指	中國銀河金融控股有限責任公司，一間於2005年8月8日在中國註冊成立的有限責任公司，為本公司的控股股東
「一般性授權」	指	董事會獲股東授予之一般性授權，以配發、發行及處理不超過截至該議案獲得股東通過之日本公司已發行A股及／或H股各自20%之股份(包括但不限於普通股、優先股及可轉換為股份的證券)
「香港」	指	中國香港特別行政區
「H股」	指	本公司股本中每股面值人民幣1.00元的境外上市外資股，於香港聯交所上市及以港元交易
「香港上市規則」	指	香港聯交所證券上市規則，以不時修訂的內容為準
「香港聯交所」	指	香港聯合交易所有限公司
「中國」	指	中華人民共和國，僅就本公告而言，不包括香港、澳門特別行政區及台灣
「募集說明書」	指	本公司將就公開發行A股可轉債而刊發之募集說明書
「人民幣」	指	人民幣，中國法定貨幣

「股東」 指 股份持有人

「股份」 指 A股及／或H股

承董事會命
中國銀河證券股份有限公司
陳共炎
董事長及執行董事

中國北京
2021年8月30日

於本公告日期，本公司執行董事為陳共炎先生(董事長)及陳亮先生(副董事長及總裁)；非執行董事為劉丁平先生、楊體軍先生、劉昶女士、劉志紅先生及江月勝先生；以及獨立非執行董事為劉瑞中先生、王珍軍先生、劉淳女士及羅卓堅先生。