



## 中国宝武钢铁集团有限公司

(住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 370 号)

# 公开发行 2017 年可交换公司债券（第一期）发行公告 (面向合格投资者)

联席主承销商



中国国际金融股份有限公司

(住所：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层)



中信证券股份有限公司  
CITIC Securities Company Limited  
中信证券股份有限公司

(住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座)



中信建投证券股份有限公司  
CHINA SECURITIES CO., LTD.

中信建投证券股份有限公司

(住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼)



国泰君安证券股份有限公司

(住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号)

CREDIT SUISSE FOUNDER  
瑞信方正

瑞信方正证券有限责任公司

(住所：北京市昌平区回龙观镇金燕龙大厦 19 层 1903、1905 号)



华宝证券有限责任公司

(住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层)

签署日期：2017 年 11 月

发行人董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

## 特别提示

### 一、合格投资者参与网下发行的操作流程和重要提示

1、网下发行仅面向合格投资者。合格投资者通过向簿记管理人提交《中国宝武钢铁集团有限公司 2017 年可交换公司债券（第一期）网下利率询价及申购申请表》（以下简称“《网下利率询价及申购申请表》”）的方式参与网下询价申购。每个产品/证券账户网下单个标位下最低申购数量为 10,000 手（1,000 万元），超过 10,000 手的必须是 5,000 手（500 万元）的整数倍。每个产品/证券账户的最大申购金额不得超过本期债券的发行规模。

2、填制《网下利率询价及申购申请表》。拟参与网下询价的合格投资者可以从发行公告所列示的网站下载《网下利率询价及申购申请表》（见附件一，电子版可于 <http://www.cicc.com.cn> 首页→业务介绍→投资银行→项目公告下载），并按要求正确填写。

3、提交《网下利率询价及申购申请表》。投资者在向簿记管理人传真《网下利率询价及申购申请表》的同时须将电子版文件（EXCEL 版和扫描件）、及其他指定文件电子版文件（扫描件）发送至电子邮箱 [eb@cicc.com.cn](mailto:eb@cicc.com.cn)。请投资者务必保证电子版文件与传真的《网下利率询价及申购申请表》内容完全一致。如有差异，簿记管理人有权确认对应申购无效，敬请投资者注意核对，产生的损失由投资者自行承担。

4、缴纳申购定金。参与网下簿记的合格投资者应及时足额缴纳定金，每个产品的定金数量为 50 万元。若投资者以两个及以上产品参与申购，需分产品缴纳定金。每个产品缴纳定金数量为 50 万元，未分产品申购或未足额缴纳定金均为无效申购。每个产品所缴纳的定金须一笔划至簿记管理人指定账户，如多笔划账，簿记管理人有权确认对应申购无效。

参与网下询价的合格投资者，必须在 2017 年 11 月 23 日（T-1 日）15:00 前足额向簿记管理人指定账户（详见本公告之“二、网下向合格投资者利率询价”之“（四）询价方法”）划出申购定金，同时向簿记管理人发送网下申购表和划款凭证等指定文件，具体文件清单详见本公告之“二、网下向合格投资者利率询价”之“（四）询价办法”。投资者需考虑资金的在途时间，应确保申购定金于 2017 年 11 月 23 日（T-1 日）17:00 前汇至簿记管理人指定账户。申购定金未按时到账或未足额缴纳的，将视为无效申购。

网下合格投资者在办理定金付款时请务必在划款备注栏注明证券账户号码。如上海证券账户号码为：B123456789，则请在划款备注栏注明：“B123456789”。未填写备注栏或账户号码填写错误的，簿记管理人有权确认对应申购无效。

5、获得配售的合格投资者未及时于 2017 年 12 月 1 日（T+5 日）12:00 前足额缴纳认购款的，将被视为违约并应承担违约责任，已缴纳的认购定金将不予退还，主承销商（簿记管理人）有权处置该违约投资者认购要约项下的全部债券，主承销商（簿记管理人）将违约情况报中国证券业协会备案，并有权进一步依法追究违约投资者的法律责任。

## 二、其他重要事项提示

1、中国宝武钢铁集团有限公司按照中国证券监督管理委员会颁布的《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第 113 号）、《上市公司股东发行可交换公司债券试行规定》（证监会公告[2008]41 号）、国务院国有资产监督管理委员会颁布的《关于规范上市公司国有股东发行可交换公司债券及国有控股上市公司发行证券有关事项的通知》（国资发产权[2009]125 号）等有关法规，以及上海证券交易所颁布的《上海证券交易所可交换公司债券业务实施细则》和中国证券登记结算有限责任公司颁布的《中国证券登记结算有限责任公司可交换公司债券登记结算业务细则》等相关规定组织实施可交换公司债券发行。

2、本期可交换公司债券发行人为中国宝武钢铁集团有限公司，预备用于交换的

股票标的为宝山钢铁股份有限公司 A 股股票。与可转换公司债券相比，本期债券的发行人为上市公司股东，发行主体存在差异。投资者应当充分关注可交换债券及预备用于交换的股票的相关信息，根据自身的风险承受能力做出独立、慎重、适当的投资决策，并自行承担投资风险。发行人和主承销商郑重提示广大投资者注意投资风险，理性投资，认真阅读《中国宝武钢铁集团有限公司公开发行 2017 年可交换公司债券（第一期）募集说明书（面向合格投资者）》和《中国宝武钢铁集团有限公司公开发行 2017 年可交换公司债券（第一期）发行公告》，募集说明书摘要已刊登在 2017 年 11 月 22 日（T-2 日）的《上海证券报》上。

3、本期债券在发行方式、定价及配售方式等方面与可转换公司债券及公司债券均存在一定区别，敬请投资者重点关注《中国宝武钢铁集团有限公司公开发行 2017 年可交换公司债券（第一期）发行公告》中的相关内容。

4、本期债券发行金额不超过预备用于交换的股票公告募集说明书前 20 个交易日均价计算的市值的 70%，并将预备用于交换的股票设定为本期债券的担保物。但由于受到经济周期、调控政策以及其他不可控因素的影响，不排除作为担保的标的股票的价格短期内出现大幅下跌导致标的股票的市值无法实现对本期债券本金的超额担保，从而影响对本期债券本息清偿的最终保障效果。

## 重要提示

1、中国证监会于 2017 年 9 月 15 日以“证监许可[2017]1698 号”文核准中国宝武钢铁集团有限公司向合格投资者公开发行总额不超过 150 亿元的可交换公司债券（以下简称“本次债券”）。

发行人采取分期发行的方式发行本次债券，发行人首期发行规模为不超过 150 亿元（含 150 亿元）的中国宝武钢铁集团有限公司 2017 年可交换公司债券（第一期）（以下简称“本期债券”）。

2、中国宝武本期发行面值不超过 1,500,000 万元可交换公司债券，每张面值为人民币 100 元，发行数量为不超过 15,000 万张，发行价格为 100 元/张。

3、本公司主体信用级别为 AAA，本期债券信用级别为 AAA；本期债券上市前，本公司最近一期末的净资产（含少数股东权益）为 33,914,014.18 万元（2017 年 6 月 30 日合并报表中所有者权益合计）；本期债券上市前，本公司最近三个会计年度实现的年均可分配利润为 120,383.03 万元（2014 年度、2015 年度及 2016 年度经审计的合并报表中归属于母公司股东净利润的平均值），预计不少于本期债券一年利息的 1.5 倍。发行人在本期发行前的财务指标符合相关规定。

4、预备用于交换的宝钢股份 A 股股票及其孳息是本期发行可交换债的担保及信托财产，该等宝钢股份 A 股股票数量为 2,850,000,000 股，不超过公司对宝钢股份 A 股持股数量的 50%。

5、本期债券为 3 年期，票面利率询价区间为 1.00%-1.50%，最终票面利率将根据簿记建档结果确定。本期债券票面利率采取单利按年计息，不计复利。

发行人和主承销商将于 2017 年 11 月 23 日（T-1 日）向网下投资者利率询价，并根据簿记建档结果确定本期债券的最终票面利率。发行人和主承销商将于 2017 年 11 月 24 日（T 日）在上海证券交易所网站（<http://www.sse.com.cn>）上公告本期债券的最终票面利率，敬请投资者关注。

6、公司主体长期信用等级为 AAA，本期债券的信用等级为 AAA。发行人拟向上交所及债券登记机构申请新质押式回购安排。如获批准，具体折算率等事宜将按上交所及证券登记机构的相关规定执行。

7、本期债券发行采取网下面向《公司债券发行与交易管理办法》、《上海证券交易所债券市场投资者适当性管理办法》规定的合格投资者询价配售的方式。网下申购由发行人与主承销商根据簿记建档情况进行债券配售。具体发行安排将根据上海证券交易所的相关规定进行具体配售原则请详见本公告之“三、网下发行”之“（六）配售”。

8、投资者不得非法利用他人账户或资金进行认购，也不得违规融资或替他人违

规融资认购。投资者认购并持有本期债券应遵守相关法律法规和中国证监会的有关规定，并自行承担相应的法律责任。

9、敬请投资者注意本公告中本期债券的发行方式、发行对象、发行数量、发行时间、认购办法、认购程序、认购价格和认购款缴纳等具体规定。

10、发行人将在本期债券发行结束后尽快办理有关上市手续，本期债券具体上市时间另行公告。

11、本公告仅对本期债券发行的有关事宜进行说明，不构成针对本期债券的任何投资建议。投资者欲详细了解本期债券情况，请仔细阅读《中国宝武钢铁集团有限公司公开发行 2017 年可交换公司债券（第一期）募集说明书（面向合格投资者）》，募集说明书摘要已刊登在 2017 年 11 月 22 日（T-2 日）的《上海证券报》上。有关本期发行的相关资料，投资者亦可到上海证券交易所网站（<http://www.sse.com.cn>）查询。

12、有关本期债券发行的其他事宜，发行人和主承销商将视需要在《上海证券报》和上海证券交易所网站（<http://www.sse.com.cn>）上及时公告，敬请投资者关注。

13、如遇市场变化，导致本期债券有效申购或缴款认购金额不足发行规模，经发行人与主承销商协商一致后可以调整发行方案或取消本期债券发行。

## 释义

除非另有说明，下列简称在本公告中具有如下含义：

本公司、公司、发行人、 发行主体、中国宝武	指	中国宝武钢铁集团有限公司
本次债券、本次可交换债券	指	根据经公司第一届董事会第三次临时会议审议通过，经国务院国有资产监督管理委员会批复，并经中国证监会核准面向合格投资者公开发行总额不超过人民币150亿元（含150亿元）的可交换公司债券
本期债券、本期可交换债券		中国宝武钢铁集团有限公司公开发行2017年可交换公司债券（第一期）
标的公司、宝钢股份	指	宝山钢铁股份有限公司
预备用于交换的股票、标的股票	指	发行人持有并设定预备用于本次债券交换的宝钢股份A股股票（股票代码：600019.SH）
本次发行	指	本期债券的公开发行
募集说明书	指	发行人根据有关法律、法规为发行本期债券而制作的《中国宝武钢铁集团有限公司公开发行2017年可交换公司债券（第一期）募集说明书（面向合格投资者）》
发行公告	指	发行人根据有关法律、法规为发行本期债券而制作的《中国宝武钢铁集团有限公司公开发行2017年可交换公司债券（第一期）发行公告》
主承销商、联席主承销商	指	中国国际金融股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国泰君安证券股

		份有限公司、瑞信方正证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司的合称
债券受托管理人或受托管理人或簿记管理人	指	中国国际金融股份有限公司
资信评级机构、中诚信证评	指	中诚信证券评估有限公司
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
上交所	指	上海证券交易所
登记公司、证券登记机构、债券登记机构、中证登上海	指	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司
债券持有人	指	根据债券登记机构的记录显示在其名下登记拥有本期债券的投资者
元	指	如无特殊说明，人民币元
交易日	指	上交所的营业日
法定节假日或休息日	指	中华人民共和国的法定及政府指定节假日或休息日（不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区的法定节假日和/或休息日）



## 一、本次发行基本情况

### （一）本次发行证券的种类

本次发行证券的种类为可交换为中国宝武钢铁集团有限公司所持宝山钢铁股份有限公司 A 股股票（600019.SH）的可交换公司债券。

### （二）本期债券名称

中国宝武钢铁集团有限公司公开发行 2017 年可交换公司债券（第一期）。

### （三）发行主体

中国宝武钢铁集团有限公司。

### （四）发行规模

本次可交换债券发行规模为不超过人民币 150 亿元（含 150 亿元）。

### （五）票面金额和发行价格

本期可交换债每张面值 100 元人民币，按面值发行。

### （六）债券期限

本期可交换债期限为发行首日起 3 年。

### （七）票面利率

本期可交换债券为固定利率，在债券存续期内固定不变。本期可交换债券票面利率将由公司与主承销商根据网下利率询价结果在预设利率区间内协商确定。本期可交换债券票面利率采取单利按年计息，不计复利。

### （八）付息的期限和方式

#### 1、计息年度的利息计算

计息年度的利息（以下简称“年利息”）指本期可交换债券持有人按持有的本期可交换债券票面总金额自本期可交换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：指本期可交换债券持有人在计息年度（以下简称“当年”或“每年”）付息债权登记日持有的本期可交换债券票面总金额；

i：指可交换债当年票面利率。

## 2、付息方式

(1) 本期可交换债券采用每年付息一次的付息方式，计息起始日为本期可交换债券发行首日。

(2) 计息日：每年的计息日为本期可交换债券发行首日起每满一年的当日，每相邻的两个计息日之间为一个计息年度（算头不算尾，即包括该计息年度起始的计息日，但不包括该计息年度结束的计息日）。

(3) 付息债权登记日：每年的付息债权登记日为每年计息日的前一交易日，公司将在每年计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（含付息债权登记日当日）申请交换成宝钢股份 A 股股票的可交换债，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) 付息日：本期可交换债券每年的付息日为本期可交换债券发行首日起每满一年的当日，公司将在每年付息日之后的五个交易日（含付息日当日）内支付当年利息。

(5) 本期可交换债券持有人所获得利息收入的应付税项由本期可交换债券持有人承担。

换股年度有关股利的归属等事项，根据相关法律法规及上交所等机构的规定确定。

## （九）换股期限

本期债券换股期限自本期债券发行结束日满 12 个月后的第一个交易日起至本期债券到期日止，即自 2018 年 11 月 29 日起至 2020 年 11 月 24 日止。若到期日为

法定节假日或休息日，则顺延至下一个交易日。

## （十）换股价格的确定及其调整

### 1、初始换股价格的确定依据

本期债券的初始换股价格为 10.00 元/股，不低于募集说明书公告日前一个交易日、前二十个交易日、前三十个交易日宝钢股份 A 股股票交易均价和发行前宝钢股份最近一期经审计的每股净资产的孰高者。

前一个交易日宝钢股份 A 股股票交易均价=前一个交易日宝钢股份 A 股股票交易总额/该日宝钢股份 A 股股票交易总量。

前二十个交易日宝钢股份 A 股股票交易均价=前二十个交易日宝钢股份 A 股股票交易总额/该二十个交易日宝钢股份 A 股股票交易总量。

前三十个交易日宝钢股份 A 股股票交易均价=前三十个交易日宝钢股份 A 股股票交易总额/该三十个交易日宝钢股份 A 股股票交易总量。

### 2、换股价格的调整方式及计算公式

在本期可交换债券发行后，当宝钢股份因派送股票股利、转增股本、增发新股或配股以及派送现金股利等情况使宝钢股份的股份和/或股东权益发生变化时，将按下述公式进行换股价格的调整（保留小数点后两位，最后一位四舍五入）：

派送股票股利或转增股本： $P1=P0/(1+n)$ ；

增发新股或配股： $P1=(P0+A \times k)/(1+k)$ ；

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

派送现金股利： $P1=P0-D$ ；

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

其中： $P0$  为调整前换股价， $n$  为送股或转增股本率， $k$  为增发新股或配股率， $A$  为增发新股价或配股价， $D$  为每股派送现金股利， $P1$  为调整后换股价。

当宝钢股份出现上述股份和/或股东权益变化情况时，将依次进行换股价格调

整，并在中国证监会指定的信息披露媒体及互联网网站上公告相关事宜，并于公告中载明换股价格调整日、调整办法及暂停换股期间（如需）。当换股价格调整日为本期债券持有人换股申请日或之后，交换股票登记日之前，则该持有人的换股申请按公司调整后的换股价格执行。

若调整换股价格从而造成预备用于交换的股票数量少于未偿还的本期可交换债券全部换股所需股票的，本公司将事先补充提供预备用于交换的股票，具体触发条件及时点如下：

派送股票股利或转增股本：不会出现预备用于交换的股票数量不足的情形。

增发新股或配股：若出现预备用于交换的股票数量少于未偿还的本期债券全部换股所需股票的情形，将以宝钢股份 A 股股票披露增发新股或配股刊登发行结果公告作为触发条件，本公司将在发行结果公告刊登后的 5 个交易日内公告换股价格调整事项，并在换股价格调整公告中约定换股价格调整日并在换股价格调整日之前补充提供预备用于交换的股票。

派送现金股利：若调整换股价格后出现预备用于交换的股票数量少于未偿还本期债券全部换股所需股票的情形，宝钢股份 A 股股东大会审议通过并公告派送现金股利事宜将作为触发条件，本公司将在五个交易日内公告换股价格调整事项，并在换股价格调整日（即派送现金股利除息日）之前补充提供预备用于交换的股票。

当宝钢股份发生股份回购、合并、分立或任何其他情形使宝钢股份类别、数量和/或股东权益发生变化从而可能影响本期债券持有人的债权利益或换股权益时，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期债券持有人权益的原则调整换股价格。有关换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。

若出现预备用于交换的股票数量少于未偿还本期债券全部换股所需股票而发行人又无法补足的情况，则相关方将召开债券持有人会议以作出其他补救安排。

#### **（十一）换股价格向下修正条款**

本期债券未设置换股价格向下修正条款。

## （十二）换股股数确定方式

本期可交换债券持有人在换股期限内申请换股时，换股数量的计算方式为： $Q=V/P$ ，并以去尾法取一股的整数倍。

其中： $V$  为本期可交换债券持有人申请换股的可交换债票面总金额； $P$  为申请换股当日有效的换股价。

可交换债券持有人申请换股所得的股份须是整数股。换股时不足交换为一股的本期可交换债券余额，本公司将按照上交所、证券登记机构等部门的有关规定，在本期债券持有人换股当日后的五个交易日内以现金兑付该可交换债余额。该不足交换为一股的可交换债余额对应当期应计利息的支付将根据证券登记机构等部门的有关规定办理。

## （十三）到期赎回条款

在本期可交换债券期满后五个交易日内，公司将以本期可交换债券票面面值的103%（不含最后一期年利息）的价格向持有人赎回全部未换股的可交换债。

此外，在本期可交换债券换股期内，当本期可交换债券未换股余额不足人民币3,000万元（如适用的上市规则另有规定，则适用相应规定）时，公司董事会（或由董事会授权的机构或人士）有权决定按照本期可交换债券面值加当期应计利息的价格赎回全部未换股的本期可交换债券。

当期应计利息的计算公式为： $IA = B \times i \times t / 365$

$IA$ ：指当期应计利息；

$B$ ：指本期可交换债券持有人持有的本期可交换债券票面总金额；

$i$ ：指本期可交换债券当年票面利率；

$t$ ：指计息天数，即从上一个计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）。

## （十四）回售条款

本期债券未设置有条件回售条款。

#### **（十五）发行方式及配售规则**

本期债券发行采取网下面向合格投资者询价配售相结合的方式。本期可交换债券具体的发行方式及配售规则详见本发行公告。

#### **（十六）发行对象**

在中国证券登记结算有限责任公司开立合格证券账户的合格投资者（法律、法规禁止购买者除外）。

#### **（十七）起息日**

本期债券的起息日为 2017 年 11 月 24 日。

#### **（十八）本金支付日**

本期债券的本金支付日为 2020 年 11 月 24 日。如遇法定节假日或休息日，则顺延至其后的第 1 个交易日；顺延期间兑付款项不另计利息。

#### **（十九）募集资金专项账户**

公司将根据相关法律、法规的规定指定募集资金专项账户，用于本期债券募集资金的接收、存储、划转与本息偿付。

#### **（二十）信用级别及资信评级机构**

经中诚信证评综合评定，公司的主体信用等级为 AAA，本期可交换债券的债项信用等级为 AAA。中诚信证评将在本期债券有效存续期间对发行人进行定期跟踪评级以及不定期跟踪评级。

#### **（二十一）簿记管理人、债券受托管理人**

本期可交换债券的簿记管理人、债券受托管理人为中国国际金融股份有限公司。

#### **（二十二）联席主承销商**

本期债券的联席主承销商为中国国际金融股份有限公司、中信证券股份有限公

司、中信建投证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、瑞信方正证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司。

### **（二十三）向公司股东配售的安排**

本期可交换债券不向公司股东优先配售。

### **（二十四）担保及信托事项**

预备用于交换的宝钢股份 A 股股票及其孳息是本期可交换债券的担保及信托财产，该等宝钢股份 A 股股票数额为 2,850,000,000 股，不超过公司对宝钢股份 A 股持股数量的 50%。

### **（二十五）承销方式**

本期债券由主承销商负责组建承销团，以承销团余额包销的方式承销。

### **（二十六）拟上市地及上市安排**

本期可交换债券拟于上交所上市，未来经本期可交换债券交换的宝钢股份 A 股股票将继续在上交所交易流通。

### **（二十七）募集资金用途**

本期可交换债券募集资金扣除发行费用后，拟用于偿还公司债务。

### **（二十八）新质押式回购**

公司主体信用等级为 AAA，本期可交换债券的信用等级为 AAA，符合进行新质押式回购交易的基本条件，本期债券新质押式回购相关申请尚需有关部门最终批复，具体折算率等事宜按上交所及证券登记机构的相关规定执行。

### **（二十九）税务提示**

根据国家有关税收法律、法规的规定，投资者投资本期可交换债券所应缴纳的税款由投资者承担。

### **（三十）与本期债券发行有关的时间安排**

交易日	工作事项
T-2日 (2017年11月22日)	刊登募集说明书及其摘要、发行公告、信用评级报告
T-1日 (2017年11月23日)	簿记建档日,投资者将认购定金于当日17:00前汇至簿记管理人指定账户 确定票面利率
T日 (2017年11月24日)	网下认购起始日、发行首日 公告最终票面利率
T+1日 (2017年11月27日)	簿记管理人向获得网下配售的合格投资者发送配售确认及缴款通知书
T+5日 (2017年12月1日)	网下认购截止日 网下认购的各投资者应不晚于当日12:00前将认购余款划至簿记管理人指定的收款账户 簿记管理人通知收款银行退还未获配售的网下认购定金。
T+6日 (2017年12月4日)	刊登发行结果公告

注：上述日期为交易日。如遇重大突发事件影响发行，发行人和主承销商将及时公告，修改发行日程。

## 二、网下向合格投资者利率询价

### (一) 询价对象

本次发行网下利率询价对象/网下投资者为符合《证券期货投资者适当性管理办法》、《公司债券发行与交易管理办法》和《上海证券交易所债券市场投资者适当性管理办法》规定且在登记公司开立合格证券账户且持有中国结算上海分公司开立的A股证券账户的合格投资者法律、法规禁止购买者除外)。合格投资者的申购资金来源必须符合国家有关规定。

### (二) 利率询价预设区间及票面利率确定方法

本期债券的票面利率预设区间为 1.00%-1.50%，票面利率将由公司与主承销商根据网下利率询价结果在预设利率区间内以簿记建档方式确定。

### (三) 询价时间

本期债券网下利率询价的时间为 2017 年 11 月 23 日 (T-1 日)。参与询价的合格投资者必须在 2017 年 11 月 23 日 (T-1 日) 9:00 至 15:00 之间将《网下利率询价



及申购申请表》(见附件一) 传真至簿记管理人处。《网下利率询价及申购申请表》(EXCEL 版和扫描件) 及其他指定文件(扫描件), 必须不晚于 2017 年 11 月 23 日(T-1 日) 15:00 以电子邮件形式发送至簿记管理人处。

在投资者集中传真或邮件发送申购文件时可能发生线路拥堵, 为防止信号延迟、丢失等不利情况发生, 提请投资者按照发行公告要求准备相关文件并在簿记时间内尽早通过传真和邮件发送。如投资者需要与簿记室确认传真文件接收情况, 考虑文件处理需要时间, 请在传真发出 30 分钟后再致电咨询。邮件收悉以收到邮箱自动回复为准, 若在发送邮件 30 分钟内未收到邮箱自动回复, 请再致电咨询, 切勿重复发送。

#### (四) 询价办法

##### 1、 填制《网下利率询价及申购申请表》

拟参与网下询价的合格投资者可以从发行公告所列示的网站下载《网下利率询价及申购申请表》(见附件, 申购订单电子版可于 <http://www.cicc.com.cn> 首页→业务介绍→投资银行→项目公告下载), 并按要求正确填写。

填写《网下利率询价及申购申请表》应注意:

- (1) 应在发行公告所指定的利率预设区间内填写询价利率;
- (2) 每个产品最多可填写 3 个询价利率, 询价利率可不连续;
- (3) 填写询价利率时精确到 0.01%;
- (4) 询价利率应由低到高、按顺序填写;
- (5) 合格投资者网下最低申购数量为 10,000 手(1,000 万元), 超过 10,000 手的必须是 5,000 手(500 万元) 的整数倍;
- (6) 每一询价利率对应的申购总金额, 是当最终确定的票面利率不低于该申购利率时, 投资者的最大需求, 为累计需求;
- (7) 每个产品在《网下利率询价及申购申请表》中填入的最大申购金额不得超过本期债券的最大发行规模(150 亿元)。

## 2、提交

参与网下询价的各合格投资者应在 2017 年 11 月 23 日（T-1 日）9:00 至 15:00 之间将《网下利率询价及认购申请表》（见附件一，电子版可于 <http://www.cicc.com.cn> 首页→业务介绍→投资银行→项目公告下载）传真至簿记管理人处。每一页传真合格机构投资者须由经办人签字并加盖单位公章（或部门章或业务专用章）、合格个人投资者须签字，并写明投资者名称、页码/总页数、联系人和联系人电话。

传真号码：010-65353050；

咨询电话：010-65353092。

同时，以下文件连同《网下利率询价及认购申请表》EXCEL 版文件必须不晚于 2017 年 11 月 23 日（T-1 日）15:00 以电子邮件形式发送至簿记管理人处，申购邮箱：[eb@cicc.com.cn](mailto:eb@cicc.com.cn)。发送邮件时请务必按要求将邮件主题及 EXCEL 电子表格以“**机构全名-投资者类型-17 宝武 EB**”的形式命名（投资者类型包括基金、证券、保险、银行及其他）。例如：基金公司以“XX 基金管理有限公司-基金-17 宝武 EB”的形式命名。簿记管理人不承担因投资者邮件标题、附件命名不符合要求而引起可能的信息遗漏、申购失效等任何责任。

合格机构投资者需邮件发送以下材料：

（1）由经办人签字并加盖单位公章（或部门章或业务专用章）的《网下利率询价及认购申请表》（附件一）扫描件及 EXCEL 版；

（2）正确勾选并加盖单位公章（或部门章或业务专用章）的合格投资者确认函（附件二）扫描件；

（3）加盖单位公章（或部门章或业务专用章）的债券市场合格投资者风险揭示书（附件三）扫描件；

（4）支付定金的划款凭证扫描件；

（5）上交所证券账户卡或开户确认单扫描件（加盖单位公章或部门章或业务专用章）；

(6) 有效企业法人营业执照（副本）扫描件（加盖单位公章或部门章或业务专用章）或其他有效的法人资格证明文件扫描件（加盖单位公章或部门章或业务专用章）。

(7) 若符合《合格投资者确认函》（附件二）中 1-4 项条件的合格投资者或产品需要完成私募基金备案或其他相关备案，需提供“私募基金管理人登记证明”和“私募投资基金备案证明”或其他相关备案证明材料并加盖公章（或部门章或业务专用章）。若符合《合格投资者确认函》（附件二）中第 5 项条件的合格投资者须提供开户场所出具的债券合格投资者确认文件扫描件并加盖公章（或部门章或业务专用章）。

合格个人投资者需邮件发送以下材料：

(1) 个人签字的《网下利率询价及申购申请表》（附件一）扫描件及 EXCEL 电子版；

(2) 正确勾选并有个人签字的《合格投资人确认函》（附件二）扫描件；

(3) 个人签字的《债券市场合格投资者风险揭示书》（附件三）扫描件；

(4) 个人签字的有效个人身份证明文件复印件扫描件；

(5) 开户场所出具的债券合格投资者确认文件，所有证明材料请本人签字确认；

主承销商有权根据询价情况要求投资者提供其他资质证明文件。如投资者未在规定时间内按要求提交材料或出现不符合投资者适当性要求的情况，主承销商（簿记管理人）可认定该投资者报价为无效报价。

投资者填写的《网下利率询价及申购申请表》一旦传真或邮件发送至簿记管理人处，即具有法律约束力，不得撤回。若因合格投资者填写缺漏或填写错误而直接或间接导致预约认购无效或产生其他后果，由投资者自行负责。本期债券合格投资者不得对《网下利率询价及申购申请表》进行修改，若投资者发送多个《网下利率询价及申购申请表》，簿记管理人将以第一封申请表为准。投资者如需对已提交至主承销商（簿记管理人）处的《网下利率询价及申购申请表》进行修改的，须征得主承销商（簿

记管理人)的同意,方可进行修改并在规定的时间内提交修改后的《网下利率询价及申购申请表》。发送修改后的邮件时请务必在原有命名末尾添加“(以此为准)”字样。

请投资者务必保证《网下利率询价及申购申请表》的 EXCEL 版和扫描件、传真件内容完全一致。如有差异,簿记管理人有权确认对应申购无效,敬请投资者注意核对,产生的损失由投资者自行承担。

请投资者切勿对《网下利率询价及申购申请表》的 EXCEL 文件进行合并或拆分表格、增加或删除行/列、新增工作表以及改变工作表顺序等可能影响计算机程序获取表格数据的改动,因上述改动而引起可能的信息遗漏、认购失效等任何责任由投资者自行承担。未按要求传真《网下利率询价及申购申请表》或未按要求发送电子邮件,簿记管理人有权确认对应申购无效。

### 3、缴纳定金

参与网下询价的合格投资者,必须在 2017 年 11 月 23 日(T-1 日)15:00 前足额向簿记管理人指定账户(见下表)划出申购定金,同时向簿记管理人发送网下申购表和划款凭证等指定文件。投资者需考虑资金的在途时间,应确保申购定金于 2017 年 11 月 23 日(T-1 日)17:00 前汇至簿记管理人指定账户。每个产品/证券账户所缴纳的定金数量为 50 万元。若投资者以两个及以上产品参与申购,需分产品缴纳定金。每个产品/证券账户所缴纳的定金数量为 50 万元,未分产品申购或未足额缴纳定金均为无效申购。每个产品所缴纳的定金须一笔划至簿记管理人指定账户,如多笔划账,簿记管理人有权确认对应申购无效。

网下合格投资者在办理定金付款时,请务必在备注栏中注明投资者证券账户号码(上海),例如,投资者证券账户为 B123456789,则应在备注栏里填写:“B123456789”。未填写备注栏或证券账户号码填写错误的,簿记管理人有权确认对应申购无效。申购定金未按时到账或未足额缴纳的,将视为无效申购,敬请投资者仔细核对汇款信息以及留意款项在途时间,以免延误。

认购资金到账情况可向收款银行查询。

户名:	中国国际金融股份有限公司
账号:	110902035610880
开户行:	招商银行北京东三环支行
人行大额支付系统号:	308100005078
银行地址:	北京市朝阳区东三环北路1号
银行联系人:	付迪
银行联系电话:	010-64628779

户名:	中国国际金融股份有限公司
账号:	333757262908
开户行:	中国银行北京国际贸易中心支行
人行大额支付系统号:	104100004353
银行地址:	北京市朝阳区建外大街1号1号院8号楼L302A
银行联系人:	张萍/倪佳
银行联系电话:	联系电话: 010-65052291/65052012

#### 4、利率确定

发行人和主承销商将根据簿记建档结果在预设的利率区间内确定本期债券的最终票面利率,并将于2017年11月24日(T日)在上交所网站(<http://www.sse.com.cn>)上公告本期债券的最终票面利率。发行人将按上述确定的票面利率向投资者公开发行本期债券。

### 三、网下发行

#### （一）发行对象

网下发行的对象为符合《证券期货投资者适当性管理办法》和《公司债券发行与交易管理办法》和《上海证券交易所债券市场投资者适当性管理办法》规定且在登记公司开立合格证券账户且持有中国结算上海分公司开立的A股证券账户的合格投资者（法律、法规禁止购买者除外）。合格投资者的申购资金来源必须符合国家有关规定。

#### （二）发行数量

本期债券发行规模为不超过 150 亿元（含 150 亿元）。

参与本期网下发行的合格投资者单个标位下最低申购数量为 10,000 手（1,000 万元），超过 10,000 手的必须是 5,000 手（500 万元）的整数倍，每个产品在《网下利率询价及认购申请表》中填入的最大认购金额不得超过 150 亿元。

#### （三）发行价格

本期债券的发行价格为 100 元/张。

#### （四）发行时间

本期债券网下发行的期限为 6 个交易日，即 2017 年 11 月 24 日（T 日）至 2017 年 11 月 30 日（T+4 日）每日的 9:00-17:00；2017 年 12 月 1 日（T+5 日）的 9:00-12:00。

#### （五）申购办法

1、凡参与网下申购的合格投资者，申购时必须持有在登记公司开立的合格证券账户。尚未开户的合格投资者，必须在 2017 年 11 月 23 日（T-1 日）（含当日）前开立合格证券账户。

2、欲参与网下认购的合格投资者须参与网下询价，具体文件清单详见本公告之“二、网下向合格投资者利率询价”之“（四）询价办法”。

未参与簿记建档，在网下发行期间欲参与网下协议认购的投资者在网下发行期

间自行联系主承销商。未参与簿记建档的投资者应配合主承销商提供相应符合投资者适当性要求的资质文件。

## **(六) 配售**

簿记管理人对所有有效认购进行配售，并向获得配售的合格投资者发送《配售确认及缴款通知书》。合格投资者的获配售金额不会超过其有效认购中相应的最大认购金额。

配售依照以下原则：按照投资者的认购利率从低到高进行簿记建档，按照认购利率从低向高对认购金额进行累计，当累计金额超过或等于本期债券发行总额时所对应的最高认购利率确认为最终票面利率。认购利率低于最终票面利率的投资者认购数量全部获得配售；认购利率等于最终票面利率的投资者认购数量按比例配售（可根据投资者认购数量取整要求适当微调）；认购利率高于最终票面利率的投资者认购数量不予配售。在参与网下簿记建档的有效认购均已配售情况下，发行人及主承销商可向未参与网下簿记建档的合格投资者的网下认购进行配售。发行人和主承销商有权根据相关规定，自主决定本期债券的最终配售结果。

簿记管理人将安排专用簿记室开展本期债券的簿记工作，配备足够数量的传真机和专用邮箱以接收投资者的申购文件，安排专门的电话咨询岗负责接听投资者的咨询电话，以确保投资者的申购文件顺利传达至簿记管理人；发行人律师将现场见证簿记及配售过程，以确保簿记及配售过程的公平、公正与公允性。

## **(七) 认购资金的补缴或多余资金的退还**

簿记管理人将于 2017 年 11 月 27 日(T+1 日)向获得配售的合格投资者发送《配售确认及缴款通知书》，内容包括该合格投资者获配金额、应退还的多余认购定金（如有）或其应补缴的认购资金、付款日期、划款账户等。上述《配售确认与缴款通知书》与合格投资者提交的《网下利率询价及申购申请表》共同构成认购的要约与承诺，具备法律约束力。

簿记管理人将按《网下利率询价及申购申请表》中填写的联系人邮箱和/或电话进行通知，请投资者注意查收。申购投资者应保持《网下利率询价及申购申请表》

中预留的联系方式有效，若因《网下利率询价及申购申请表》中联系方式填写错误导致未按时收到配售缴款通知书，可能产生的损失由投资者自行承担。

投资者缴纳的认购定金将被直接抵作认购资金。若定金不足以缴付认购资金，则获得配售的合格投资者应按规定及时补缴认购款，补缴认购款须在 2017 年 12 月 1 日（T+5 日）12:00 前（指资金到账时间）足额划至簿记管理人指定的收款银行账户（同上述认购定金的收款账户）。划款时请注明合格投资者管理产品的证券账户号码，同时将划款凭证发送至电子邮箱 [eb@cicc.com.cn](mailto:eb@cicc.com.cn)。

未获配售投资者的认购定金，以及若定金大于认购资金的多余定金，簿记管理人将统一在 2017 年 12 月 1 日（T+5 日）通知收款银行按原路径退还。若技术原因导致部分定金在 2017 年 12 月 1 日（T+5 日）退还失败，则可能存在该部分定金于 2017 年 12 月 4 日（T+6 日）继续退还的情况。请投资者认真填写退款信息，如因投资者填写的退款信息错误导致的退款异常，产生的损失由投资者自行承担。

#### （八）、违约认购的处理

获得配售的投资者如果未能在《配售确认及缴款通知书》规定的时间内向主承销商（簿记管理人）指定账户补足认购款项，将被视为违约并承担违约责任，已缴纳的认购定金将不予退还，主承销商（簿记管理人）有权处置该违约投资者认购要约项下的全部债券，主承销商（簿记管理人）将违约情况报中国证券业协会备案，并有权进一步依法追究违约投资者的法律责任。

### 四、认购费用

本次发行不向投资者收取佣金、过户费、印花税等费用。

### 五、风险提示

发行人和主承销商就已知范围已充分揭示本次发行可能涉及的风险事项，详细风险揭示条款参见《中国宝武钢铁集团有限公司公开发行 2017 年可交换公司债券（第一期）募集说明书（面向合格投资者）》。



## 六、发行人和主承销商

### (一) 发行人

名称：中国宝武钢铁集团有限公司  
法定代表人：马国强  
住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 370 号  
办公地址：上海市世博大道 1859 号宝武大厦  
联系人：王行兵、何萍  
电话：021-20658325、021-20658715  
传真：021-20658899-8325、021-20658899-8715

### (二) 主承销商/联席主承销商

#### 1、中国国际金融股份有限公司

名称：中国国际金融股份有限公司  
法定代表人（代）：毕明建  
住所：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层  
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层  
项目负责人：张淑健、雷仁光  
项目组成员：徐志骏、银雷、李思仪、庄园、刘浏、陆隽怡  
电话：010-6505 1166  
传真：010-6505 1156

#### 2、中信证券股份有限公司

名称：中信证券股份有限公司  
法定代表人：张佑君  
住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座  
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦  
项目负责人：宋颐岚、李颖婕  
项目组成员：常唯、杨昕、寇志博、方嘉、杜涵、张煜清、何方、陈

雅楠

电话：010-60836755、60833990

传真：010-60833504

### 3、中信建投证券股份有限公司

名称：中信建投证券股份有限公司

法定代表人：王常青

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B、E 座 3 层

项目负责人：王晨宁、赵启、洪悦

项目组成员：王艺浩、黄多、汪家富、王立庚、张骁然

电话：010-85130588

传真：010-65185227

### 4、国泰君安证券股份有限公司

名称：国泰君安证券股份有限公司

法定代表人：杨德红

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区东园路 18 号中国金融信息中心 5 层

项目负责人：胡玮瑛、时光

项目组成员：夏艺源

电话：021-38676666

传真：021-50688712

### 5、瑞信方正证券有限责任公司

名称：瑞信方正证券有限责任公司

法定代表人：高利

住所：北京市昌平区回龙观镇金燕龙大厦 19 层 1903、1905 号

办公地址：北京市西城区金融大街甲九号金融街中心南楼 15 层

项目负责人：郭宇辉、刘潇潇

项目组成员：韩颖姣、王锦、赵庞、乔倩、焦斯宇

电话：010-6653 8666

传真： 010-6653 8566

6、华宝证券有限责任公司

名称： 华宝证券有限责任公司

法定代表人： 陈林

住所： 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

办公地址： 上海市浦东新区世博大道 1859 号宝武大厦 1 号楼

项目负责人： 曾诚

项目组成员： 邱燕、张文晶

电话： 021-2032 1389

传真： 021-20321004

（本页以下无正文）

（此页无正文，为《中国宝武钢铁集团有限公司公开发行 2017 年可交换公司债券（第一期）发行公告（面向合格投资者）》之盖章页）



中国宝武钢铁集团有限公司

2017 年 11 月 28 日

(本页无正文,为《中国宝武钢铁集团有限公司公开发行 2017 年可交换公司债券(第一期) 发行公告(面向合格投资者)》之盖章页)



中国国际金融股份有限公司

2017年11月28日

(本页无正文,为《中国宝武钢铁集团有限公司公开发行2017年可交换公司债券(第一期)发行公告(面向合格投资者)》之盖章页)



(本页无正文,为《中国宝武钢铁集团有限公司公开发行 2017 年可交换公司债券(第一期) 发行公告 (面向合格投资者)》之盖章页)



(本页无正文,为《中国宝武钢铁集团有限公司公开发行 2017 年可交换公司债券(第一期) 发行公告(面向合格投资者)》之盖章页)



国泰君安证券股份有限公司

2017年11月28日



(本页无正文,为《中国宝武钢铁集团有限公司公开发行 2017 年可交换公司债券(第一期) 发行公告》之盖章页)



瑞信方正证券有限责任公司

2017年11月28日

（本页无正文，为《中国宝武钢铁集团有限公司公开发行 2017 年可交换公司债券（第一期）发行公告（面向合格投资者）》之盖章页）



## 附件1：中国宝武钢铁集团有限公司2017年可交换公司债券（第一期）网下利率询价及申购申请表

### 重要声明

本表一经申购人完整填写，合格投资者由经办人签字及加盖单位公章（或部门章或业务专用章），传真或邮件发送至簿记管理人，即构成申购人发出的、对申购人具有法律约束力的要件，不可撤销。申购人承诺并保证将根据主承销确定的配售数量按时完成缴款。本申购表电子版可于<http://www.cicc.com.cn> 首页→业务介绍→投资银行→项目公告下载。

### 重要提示：

参与询价的合格投资者必须在2017年11月23日（T-1日）9:00至15:00之间将《网下利率询价及申购申请表》传真至簿记管理人处。《网下利率询价及申购申请表》（EXCEL版和扫描件）及其他指定文件（扫描件），必须不晚于2017年11月23日（T-1日）15:00以电子邮件形式发送至簿记管理人处。发送邮件时请务必按要求将邮件主题及Excel电子表格以“机构全名-投资者类型-17宝武EB”的形式命名（投资者类型包括基金、证券、保险、银行及其他）。例如：基金公司以“XX基金管理有限公司-基金—17宝武EB”的形式命名。簿记管理人不承担因投资者邮件标题、附件命名不符合要求而引起可能的信息遗漏、申购失效等任何责任。申购传真号码：010-65353050，申购邮箱：eb@cicc.com.cn。

请投资者务必保证《网下利率询价及申购申请表》的EXCEL版和扫描件、传真件内容完全一致。如有差异，簿记管理人有权确认对应申购无效，敬请投资者注意核对，产生的损失由投资者自行承担。未按要求传真《网下利率询价及申购申请表》或未按要求发送电子邮件，簿记管理人有权确认对应申购无效。

请投资者切勿对《网下利率询价及申购申请表》的EXCEL文件进行合并或拆分表格、增加或删除行/列、新增工作表以及改变工作表顺序等可能影响计算机程序获取表格数据的改动，因上述改动而引起可能的信息遗漏、认购失效等任何责任由投资者自行承担。

在投资者集中传真或邮件发送申购文件时可能发生线路拥堵，为防止信号延迟、丢失等不利情况发生，提请投资者按照发行公告要求准备相关文件并在簿记时间内尽早通过传真和邮件发送。如投资者需要与簿记室确认传真文件接收情况，考虑文件处理需要时间，请在传真发出30分钟后再次致电咨询。邮件收悉以收到邮箱自动回复为准，若在发送邮件30分钟内未收到邮箱自动回复，请再致电咨询，切勿重复发送。咨询电话：010-65353092。

如遇市场变化，导致本期债券有效申购或缴款认购金额不足发行规模，经发行人与主承销商协商一致后可以调整发行方案或取消本期债券发行。

单位全称										电子邮箱				
经办人姓名		经办人身份证号								电子邮箱				
办公电话		移动电话								传真号码				
认购主体信息				申购信息						退款信息				
序号	证券账户户名 (上海)	证券账户 代码(上海)	身份证明 号码	票面 利率 1	申购金 额(万 元)	票面 利率2	申购金 额(万 元)	票面 利率3	申购金 额(万 元)	退款汇 入行全 称	退款收款 人账号	退款收款 人全 称	退款汇入 行地点	大额支 付系统 号
1														
2														
3														
合计申购单数		合计最大申购金额(万元)				合计缴纳定金(万元)								

申购人在此承诺：

- 1、申购人以上填写内容真实、有效、完整；
- 2、申购人的申购资格、本次申购行为及本次申购资金来源符合有关法律、法规以及中国证监会的有关规定及其他适用于自身的相关法定或合同约定要求，已就此取得所有必要的内外部批准，并将在认购本期债券后依法办理必要的手续；
- 3、认购人承诺：认购人为符合《证券期货投资者适当性管理办法》、《公司债券发行与交易管理办法》及《上海证券交易所债券市场投资者适当性管理办法》规定并拥有中国证券登记结算有限责任公司上海分公司A股证券账户的合格投资者；
- 4、本次最终申购金额为网下利率询价表中不高于最终票面利率的询价利率对应的最大有效的申购金额；
- 5、申购人在此承诺接受发行人与主承销商制定的本次网下发行申购规则；申购人同意主承销商按照网下利率询价表的申购金额最终确定其具体配售金额，并接受主承销商所确定的最终配售结果和相关费用的安排；簿记管理人向申购人发出《中国宝武钢铁集团有限公司2017年可交换公司债券（第一期）配售缴款通知书》（简称“《配售缴款通知书》”），即构成对本申购要约的承诺；
- 6、申购人理解并接受，如果其获得配售，则有义务按照《配售缴款通知书》规定的时间、金额和方式，将认购款足额划至簿记管理人通知的划款账户。如果申购人违反此义务，其配售资格将被取消，已缴纳的申购定金将不予退还，主承销商有权处置该违约申购人订单下的全部债券；同时，本申购人同意就逾时未划部分按每日万分之五的比例向主承销商支付违约金，并赔偿主承销商由此遭受的损失；此外，主承销商（簿记管理人）将违约情况报中国证券业协会备案，并有权进一步依法追究违约投资者的法律责任。
- 7、申购人理解并接受，如遇市场变化，导致本期债券有效申购或缴款认购金额不足发行规模，经发行人与主承销商协商一致后可以调整发行方案或取消本期债券发行。
- 8、认购人遵循独立、客观、诚信的原则进行合理报价，不得协商报价或故意压低或抬高价格，获得配售后严格履行缴款义务。

**经办人签字：**

**（单位盖章）**

**2017年 月 日**

**附件 2：合格投资者确认函（需正确勾选合格投资者类型并加盖公章（或部门章/业务专用章）传真至簿记管理人处）**

根据《公司债券发行与交易管理办法》、《证券期货投资者适当性管理办法》及《上海证券交易所债券市场投资者适当性管理办法》等其他相关法规之规定，本机构为：请在（）中勾选

（）1、经有关金融监管部门批准设立的金融机构，包括证券公司、期货公司、基金管理公司及其子公司、商业银行、保险公司、信托公司、财务公司等；经行业协会备案或者登记的证券公司子公司、期货公司子公司、私募基金管理人；

（）2、上述金融机构面向投资者发行的理财产品，包括但不限于证券公司资产管理产品、基金及基金子公司产品、期货公司资产管理产品、银行理财产品、保险产品、信托产品；以及经行业协会备案的私募基金（如拟将主要资产投向单一债券，请同时勾选★项）；

（）3、合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；

（）4、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金；

（）5、同时符合下列条件的法人或者其他组织：

1、最近 1 年末净资产不低于 2000 万元；

2、最近 1 年末金融资产不低于 1000 万元；

3、具有 2 年以上证券、基金、期货、黄金、外汇等投资经历；

（如为合伙企业拟将主要资产投向单一债券，请同时勾选★项）；

（）6、同时符合下列条件的个人：

1、申请资格认定前 20 个交易日名下金融资产日均不低于 500 万元，或者最近 3 年个人年均收入不低于 50 万元；

2、具有 2 年以上证券、基金、期货、黄金、外汇等投资经历，或者具有 2 年以上金融产品的设计、投资、风险管理及相关工作经历，或者属于上述第一项规定的合格投资者的高级管理人员、获得职业资格认证的从事金融相关业务的注册会计师和律师；

（）7、中国证监会认可的其他合格投资者；

前款所称金融资产，是指银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货及其他衍生产品等。

★如理财产品、合伙企业拟将主要资产投向单一债券，根据穿透原则（《公司债券发行与交易管理办法》第十四条之规定）核查最终投资者是否为符合基金业协会标准所规定的合格投资者。是（）否（）

机构名称（单位盖章）

年 月 日

附件 3:

**重要声明：本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明债券交易的所有风险。投资者在参与债券投资或交易前，应认真阅读债券上市说明书以及交易所相关业务规则，并做好风险评估与财务安排，确定自身有足够的风险承受能力，避免因参与债券投资或交易而遭受难以承受的损失。**

## 债券市场合格投资者风险揭示书

一、总则：参与债券投资或交易具有信用风险、市场风险、流动性风险、放大交易风险、标准券欠库风险、政策风险及其他各类风险。

二、投资者适当性：投资者应当根据自身的财务状况、实际需求、风险承受能力，以及内部制度（若为机构），审慎决定参与债券投资或交易。

三、信用风险：投资者参与债券投资或交易将面临债券发行人无法按期还本付息的风险。如果投资者购买或持有资信评级较低的信用债，将面临显著的信用风险。

四、市场风险：投资者参与债券投资或交易将面临由于市场环境或供求关系等因素导致的债券价格波动的风险。

五、流动性风险：投资者参与债券投资或交易将面临在短期内无法以合理价格买入或卖出债券，从而遭受损失的风险。

六、放大交易风险：投资人利用现券和回购两个品种进行债券投资的放大操作，从而放大投资损失的风险。

七、标准券欠库风险：投资者在回购期间需要保证回购标准券足额。如果回购期间债券价格下跌，标准券折算率相应下调，融资方面临标准券欠库风险。融资方需要及时补充质押券避免标准券不足。

八、政策风险：由于国家法律、法规、政策、交易所规则的变化、修改等原因，可能会对投资者的交易产生不利影响，甚至造成经济损失。

机构名称：\_\_\_\_\_

（公章或部门章或业务章）

年 月 日

#### 附件 4:

声明及提示：以下示例中的利率和金额均为虚设，不含有任何暗示，请投资者根据自己的判断填写。投资者向簿记管理人提交申购要约时不必传真本填报说明。

#### 网下利率询价及认购申请表填报说明

1. 身份证明号码填写：为投资者在开立证券账户时提供的身份证明资料编码，其中一般法人填写其营业执照注册号；证券投资基金填写“基金简称”+“证基”+“证监会同意设立证券投资基金的批文号码”；全国社保基金填写“全国社保基金”+“投资组合号码”；企业年金基金填写“企业年金基金监管机构出具的企业年金计划确认函中的登记号”。

2. 每一申购利率对应的申购总金额不得少于 1,000 万元（含 1,000 万元），并为 500 万元的整数倍，且不超过本期债券网下发行规模；

3. 申购利率的最小变动单位为 0.01%；申购利率应由低到高、按顺序填写；每一询价利率对应的申购总金额，是当最终确定的票面利率不低于该申购利率时，投资者的最大需求，为累计需求；

4. 每个产品最多可填写 3 个询价利率，询价利率可不连续

5. 认购示例：

申购利率（%）	申购金额（万元）
1.00	10,000
1.05	20,000
1.10	30,000

就上述认购，当该品种发行的票面利率：

高于或等于 1.10%时，该认购的有效申购金额为 30,000 万元；

高于或等于 1.05%，但低于 1.10%时，该认购的有效申购金额为 20,000 万元；

高于或等于 1.00%，但低于 1.05%时，该认购的有效申购金额为 10,000 万元。

低于 1.00%时，该认购无效。