

证券代码：601881

证券简称：中国银河

债券代码：113057

债券简称：中银转债

中国银河证券股份有限公司
A 股可转换公司债券
受托管理事务报告
（2023 年度）

债券受托管理人：



（浙江省杭州市五星路 201 号）

二〇二四年四月

重要声明

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

浙商证券按照《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》等相关规定及与中国银河签订的《中国银河证券股份有限公司公开发行 A 股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，投资者应对相关事项做出独立判断，而不应将本报告中的任何内容据以作为浙商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。

浙商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

中国银河于 2022 年 3 月 16 日取得中国证券监督管理委员会《关于核准中国银河证券股份有限公司公开发行可转换公司债券的批复》（证监许可[2022]547 号）文核准，批复核准中国银河向社会公开发行面值总额 78 亿元 A 股可转换公司债券，期限 6 年。

二、本次公司债券的基本情况

（一）债券名称

中国银河证券股份有限公司 2022 年 A 股可转换公司债券（以下简称“可转债”）。

（二）债券代码及简称

债券代码：113057；债券简称：中银转债。

（三）本次债券发行日期

本次债券发行日为 2022 年 3 月 24 日。

（四）发行规模

本次发行可转债总额为人民币 78 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 3 月 24 日至 2028 年 3 月 23 日。（本次可转债已于 2023 年 12 月 29 日在上海证券交易所摘牌，下

同。)

(七) 债券利率

本次发行的可转债票面利率设定为：第一年 0.2%、第二年 0.4%、第三年 0.6%、第四年 1.0%、第五年 1.8%、第六年 2.0%。

(八) 还本付息的期限和方式

本次发行的可转债采用每年付息一次的付息方式，到期归还所有未转股的可转债本金和最后一年利息。

1、年利息计算

年利息指可转债持有人按持有的可转债票面总金额自可转债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) 本次发行的可转债采用每年付息一次的付息方式，计息起始日为可转债发行首日。

(2) 付息日：每年的付息日为本次发行的可转债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，则顺延至下一个交易日，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交所的规定确定。

(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 A 股股票的可转债，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) 可转债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起满 6 个月后的第一个交易日起至可转债到期日止，即 2022 年 9 月 30 日至 2028 年 3 月 23 日止（如遇法定节假日或休息日则延至其后的第一个工作日，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

本次发行可转债的初始转股价格为 10.24 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 股股票交易均价中的最高者，同时不低于最近一期经审计的每股净资产和股票面值，且不得向上修正。

前三十个交易日公司 A 股股票交易均价=前三十个交易日公司 A 股股票交易总额/该三十个交易日公司 A 股股票交易总量。

前二十个交易日公司 A 股股票交易均价=前二十个交易日公司 A 股股票交易总额/该二十个交易日公司 A 股股票交易总量。

前一个交易日公司 A 股股票交易均价=前一个交易日公司 A 股股票交易总额/该日公司 A 股股票交易总量。

2、转股价格的调整方式及计算公式

在本次发行之后，当公司发生派送股票股利、转增股本、增发新股或配股、派送现金股利等情况（不包括因本次发行的可转债转股而增加的股本）时，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： $P0$ 为调整前转股价格， n 为派送股票股利或转增股本率， k 为增发新股率或配股率， A 为增发新股价格或配股价格， D 为每股派送现金股利， $P1$ 为调整后转股价格。

当公司出现上述股份和/或股东权益变化时，将依次进行转股价格调整，并在上海证券交易所（以下简称“上交所”）网站（www.sse.com.cn）和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）指定的上市公司信息披露媒体上刊登公告，并于公告中载明转股价格调整日、调整办法及暂停转股时期（如需）。同时，公司将根据《香港联合交易所有限公司证券上市规则》（经不时修订）的要求在香港市场予以公布（如需）。当转股价格调整日为本次发行的可转债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债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债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届时国家有关法律法规及证券监管部门的相关规定制订。

3、最新转股价格

因公司实施 2021 年度、2022 年度利润分配，本次可转债转股价格由 10.24 元/股调整为 9.70 元/股。

（十一）转股价格向下修正条款

1、修正权限与修正幅度

在本次发行的可转债存续期间，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。

若在上述交易日内发生过因除权、除息等引起公司转股价格调整的情形，则在转股价格调整日前的交易日按调整前的转股价格和收盘价计算，在转股价格调整日及之后的交易日按调整后的转股价格和收盘价计算。

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债的股东应当回避。修正后的转股价格应不低于前述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（若在该三十个交易日或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 股股票交易均价中的最高者。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，则在转股价格调整日前的交易日按调整前的转股价格和收盘价计算，在转股价格调整日及之后的交易日按调整后的转股价格和收盘价计算。

2、修正程序

如公司决定向下修正转股价格，公司将在上交所网站（www.sse.com.cn）和中国证监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、股权登记日和暂停转股期间等有关信息（如需）。同时，公司将根据《香港联合交易所有限公司证券上市规则》（经不时修订）的要求在香港市场予以公布（如需）。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、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

本次发行的可转债持有人在转股期内申请转股时，转股数量的计算方式为： $Q=V/P$ ，并以去尾法取一股的整数倍。

其中：Q 为可转换的股票数量；V 为可转债持有人申请转股的可转债票面总金额；P 为申请转股当日有效的转股价格。

可转债持有人申请转换成的股份须是整数。转股时不足转换为一股的可转债余额，公司将按照上交所等部门的有关规定，在可转债持有人转股当日后的五个交易日内以现金兑付该可转债余额及该余额所对应的当期应计利息（当期应计利息的计算方式参见“（十三）赎回条款”的相关内容）。

（十三）赎回条款

1、到期赎回条款

在本次发行的可转债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

在本次发行的可转债转股期内，当下述两种情形的任意一种出现时，公司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债：

（1）在本次发行的可转债转股期内，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不低于当期转股价格的 130%（含 130%）；

（2）当本次发行的可转债未转股余额不足 3,000 万元时。

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：指本次发行的可转债持有人持有的可转债票面总金额；

i：指可转债当年票面利率；

t：指计息天数，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计算，在调整后的交易日按调整后的转股价格和收盘价计算。

（十四）回售条款

若本次发行的可转换公司债券募集资金运用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监会的相关规定被视作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：

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

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回售的

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）。

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）转股年度有关股利的归属

因本次发行的可转债转股而增加的公司 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下午收市后登记在册的所有普通股股东（含因可转债转股形成的股东）均参与当期股利分配，享有同等权益。

（十六）募集资金用途

本次可转债募集资金总额扣除发行费用后拟全部用于发展投资交易业务、资本中介业务、增加投行业务的资金投入及补充公司其他营运资金。在可转债转股后按照相关监管要求用于补充公司的资本金。本次募集资金各投资项目及拟投资金额等情况如下：

募集资金投资项目	拟投资金额
投资交易业务	不超过 30 亿元
资本中介业务	不超过 30 亿元
投资银行业务	不超过 10 亿元
补充其他营运资金	不超过 8 亿元
合计	不超过 78 亿元

（十七）募集资金用途

本次发行的可转债不提供担保。

（十八）募集资金存管

公司已建立《募集资金管理办法》，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。

（十九）违约责任

1、可转债违约情形

（1）在本期债券到期、加速清偿时，公司未能偿付到期应付本金；

（2）公司未能按期偿付本期债券的到期利息；

（3）公司不履行或违反《受托管理协议》的任何承诺对公司对本期债券的还本付息能力产生重大不利影响，且经债券受托管理人书面通知，或经单独和/或合并代表未偿还的本期债券 10%以上表决权的债券持有人书面通知，该违约自收到通知之日起持续 30 个连续工作日仍未得到纠正；

（4）在本期债券存续期间内，公司发生解散、注销、吊销营业执照、停业、清算、丧失清偿能力、被法院指定破产管理人或已开始与上述事项相关的诉讼程序；

（5）公司及其合并范围内子公司的债务（公司债/债务融资工具/企业债/境外债券/金融机构贷款/其他融资）出现违约（本金、利息逾期/债务已被宣告加速到期/其他附加加速到期宣告权认定的违约形式）或宽限期（如有）到期后应付未付；

（6）公司触发财务指标承诺条款（如有）、行为事先约束条款（如有）；

（7）其他对本期债券的按期兑付产生重大不利影响的情形。

2、违约责任及其承担方式

公司承诺保证按照本期债券发行条款约定的还本付息安排向债券持有人支付本期债券利息及兑付本期债券本金，若不能按时支付本期债券利息或本期债券到期不能兑付本金，对于延迟支付的本金或利息，公司承诺根据逾期天数按逾期利率向债券持有人支付逾期利息，逾期利率为本期债券票面利率上浮 10%。

如果发生违约事件且一直持续 30 个连续工作日仍未解除，债券受托管理人可以根据债券持有人会议的决议，依法协调债券持有人采取任何可行的法律救济方式催收本期债券本金和利息。

3、争议解决机制

本次债券发行适用于中国法律并依其解释。

本次债券发行和存续期间所产生的争议，首先应在争议各方之间协商解决。如果协商解决不成，应提交债券受托管理人所在地有管辖权的人民法院诉讼解决。

当产生任何争议及任何争议正按前条约定进行解决时，除争议事项外，各方有权继续行使本期债券发行及存续期的其他权利，并应履行其他义务。

第二节 债券受托管理人履行职责情况

浙商证券作为中国银河公开发行 A 股可转换公司债券的债券受托管理人，于报告期内严格按照《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债券受托管理人各项职责。

存续期内，浙商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。

浙商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；
- 2、不定期查阅发行人重大事项的会议资料；
- 3、对发行人进行现场检查；
- 4、对发行人相关人员进行访谈；
- 5、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：中国银河证券股份有限公司

英文名称：China Galaxy Securities Co., Ltd.

股票简称：中国银河

英文简称：China Galaxy

A 股股票代码：601881

H 股股票代码：06881

A 股股票上市地点：上海证券交易所

H 股股票上市地点：香港联交所

法定代表人：王晟

总股本：10,934,402,256 股

成立日期：2007 年 1 月 26 日

注册地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101

办公地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦

邮政编码：100073

电话：010-80929800

传真：010-80926725

公司网站：www.chinastock.com.cn

电子信箱：zgyh@chinastock.com.cn

经营范围：许可项目：证券业务；公募证券投资基金销售；保险兼业代理业务；证券公司为期货公司提供中间介绍业务；证券投资基金托管。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动，具体经营项目以相关部门批准文件或许可证件为准）一般项目：金银制品销售。（除依法须经批准的项目外，凭营业执照依法自主开展经营活动）（不得从事国家和本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）

二、发行人 2023 年度经营情况及财务状况

（一）年度经营情况

2023 年，面对复杂多变的国际形势及充满挑战的市场环境，公司紧紧围绕学习贯彻习近平新时代中国特色社会主义思想主题教育和党的二十大精神主题主线，在公司的坚强领导和全体干部员工的不懈努力下，牢牢把握高质量发展要求，坚定信心、团结奋斗，攻坚克难、锐意进取，以高效系统的战略执行力，推动各项工作稳步有序进行：深化财富管理转型发展，持续扩展服务空间，坚决落实“降费让利、降低交易成本”监管要求，不断提升买方投顾精细化服务；纵深推进投行业务专业化改革，牢牢把握全面注册制机遇，不断完善管理体制机制，专业能力持续夯实；聚焦投资业务提质增效，持续拓宽业务协同范围，紧密把握市场节奏调整优化资产配置，整体投资规模保持稳健；全新推进机构业务，全面提速平台化建设及全链条客户服务体系和能力；深化境内外一体化协同发展，持续探索金融服务“一带一路”建设新模式，保持公司在东南亚核心市场优势地位；推动分子公司稳健发展，业务结构不断优化；坚持风控为本、合规为先，全面加强风险管理和内部治理，持续强化内控体系建设，有效防范化解各类风险；深刻领会金融工作的政治性、人民性，聚焦服务国家重大战略及实体经济，充分发挥并不断完善金融国企的功能作用，着力做好“科技金融、绿色金融、普惠金融、养老金融、数字金融”五篇大文章。

2023 年，公司经营业绩稳健增长，行业地位保持稳固，实现集团口径营业收入人民币 336.44 亿元，归属于母公司股东的净利润人民币 78.79 亿元；公司总资产、净资产规模稳定增长，期末总资产人民币 6,632.05 亿元，净资产人民币 1,304.95 亿元，打造国内一流、国际优秀现代投行的战略目标实现了平稳开局。

（二）合并资产负债表主要数据

单位：万元

项目	2023 年末	2022 年末	变动比例 (%)
资产总额	66,320,529.72	62,522,292.82	6.08
负债总额	53,271,051.07	52,260,101.77	1.93

项目	2023 年末	2022 年末	变动比例 (%)
所有者权益总额	13,049,478.64	10,262,191.05	27.16
归属于母公司股东的权益	13,046,636.19	10,259,872.59	27.16

注：2022 年 11 月 30 日，财政部发布了《关于印发<企业会计准则解释第 16 号>的通知》（财会〔2022〕31 号），规定关于单项交易产生的资产和负债相关的递延所得税不适用初始确认豁免的会计处理，并自 2023 年 1 月 1 日起施行。公司按照上述解释和《企业会计准则第 18 号——所得税》将累积影响数调整财务报表列报最早期间的期初留存收益及其他相关财务报表项目的规定，相应调整了 2022 年同期数据，下同。

2023 年末，公司资产总额为人民币 6,632.05 亿元，较 2022 年末增加 6.08%。其中：货币资金为人民币 1,136.25 亿元，占总资产的 17.13%；结算备付金为人民币 279.00 亿元，占总资产的 4.21%；融出资金为人民币 912.18 亿元，占总资产的 13.75%；交易性金融资产为人民币 2,061.83 亿元，占总资产的 31.09%；其他债权投资为人民币 973.58 亿元，占总资产的 14.68%；其他权益工具投资为人民币 451.73 亿元，占总资产的 6.81%。公司资产流动性良好、结构合理。此外，根据会计政策，公司以预期信用损失为基础，对金融工具计提相应减值并确认损失准备，资产质量良好。

2023 年末，公司总负债人民币 5,327.11 亿元，扣除代理买卖证券款和代理承销证券款后，自有负债为人民币 4,124.49 亿元。其中：自有流动负债人民币 3,358.31 亿元，占比 81.42%；自有非流动负债人民币 766.18 亿元，占比 18.58%。自有负债主要为应付短期融资款人民币 264.10 亿元，占比 6.40%；交易性金融负债人民币 396.54 亿元，占比 9.61%；卖出回购金融资产款人民币 1,613.53 亿元，占比 39.12%；应付债券（长期次级债、长期公司债和长期收益凭证等）人民币 1,005.46 亿元，占比 24.38%；其他负债人民币 451.57 亿元，占比 10.95%。公司的资产负债率 75.97%，负债结构合理。公司无逾期未偿付债务，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：万元

项目	2023 年度	2022 年度	变动比例 (%)
营业收入	3,364,408.28	3,364,199.34	0.01

项目	2023 年度	2022 年度	变动比例 (%)
营业成本	2,542,781.95	2,569,526.70	-1.04
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	788,561.41	769,371.15	2.49

2023 年度，公司实现营业收入人民币 336.44 亿元，较 2022 年度增加人民币 0.02 亿元，增幅为 0.01%。主要科目变动如下：利息净收入较 2022 年度下降 19.38%，主要由于信用类业务利息收入减少以及融资利息支出增加；手续费及佣金净收入较 2022 年度下降 12.80%，主要由于经纪业务手续费净收入减少；投资收益较 2022 年度减少 56.37%，主要由于处置金融工具取得投资收益减少；公允价值变动损益较 2022 年度增加，主要由于交易性金融资产和衍生金融工具公允价值变动的影响；汇兑收益较 2022 年度变化主要由于汇率波动影响；其他业务收入较 2022 年度下降 0.69%，主要由于银河德睿大宗商品销售业务收入减少；资产处置收益较 2022 年度增长，主要由于固定资产处置收益增加。

2023 年度，公司营业支出人民币 254.28 亿元，较 2022 年度减少人民币 2.67 亿元，降幅为 1.04%。主要科目变动如下：信用减值损失较 2022 年度下降 78.09%，主要由于预期信用减值损失转回；其他资产减值损失较 2022 年度增加，主要由于银河德睿大宗商品销售业务计提存货跌价损失增加；其他业务成本较 2022 年度下降 2.23%，主要由于银河德睿大宗商品销售业务成本减少；营业外收入较 2022 年度下降 82.16%，主要由于非经营性政府补贴收入减少；营业外支出较 2022 年度增加，主要为计提未决诉讼项目预计负债等营业外支出增加；所得税费用较 2022 年度增加 23.35%，主要由于应税利润增加。少数股东损益较 2022 年度增长 462.35%，主要由于子公司产生的少数股东权益增加。

（四）合并现金流量表主要数据

单位：万元

项目	2023 年度	2022 年度	变动比例 (%)
经营活动产生的现金流量净额	-4,426,069.17	3,079,859.94	-243.71
投资活动产生的现金流量净额	1,603,785.96	-2,176,323.97	不适用
筹资活动产生的现金流量净额	1,703,101.31	245,810.52	592.85

2023 年度，公司经营活动产生的现金流量净额为人民币-442.61 亿元，较 2022

年度减少现金流量净额人民币 750.59 亿元，其中：回购业务现金流量净额同比减少人民币 251.39 亿元；融出资金现金流量净额同比减少人民币 206.10 亿元；代理买卖证券的现金流量净额同比减少 106.29 亿元；交易性金融资产与负债及衍生金融工具的现金流量净额同比减少人民币 80.41 亿元。

2023 年度，公司投资活动产生的现金流量净额为人民币 160.38 亿元，较 2022 年度增加现金流量净额人民币 378.01 亿元，主要由于其他债权投资的现金流量净额同比增加人民币 419.91 亿元。

2023 年度，公司筹资活动产生的现金流量净额为人民币 170.31 亿元，较 2022 年度增加现金流量净额人民币 145.73 亿元，主要由于报告期内公司发行长长期限债券收到的现金流入同比增加。

第四节 发行人募集资金使用情况

一、募集资金基本情况

根据中国证券监督管理委员会于 2022 年 3 月 16 日印发的《关于核准中国银河证券股份有限公司公开发行可转换公司债券的批复》（证监许可[2022]547 号），公司于 2022 年 3 月 24 日向社会公众公开发行 78,000,000 张 A 股可转换公司债券，每张面值为人民币 100.00 元，按面值发行，共计募集资金 7,800,000,000.00 元，扣除保荐及承销费用、律师费用、会计师费用、资信评级费用、信息披露费用及发行手续费等发行费用合计 64,534,905.65 元（不含税）后，实际募集资金净额为 7,735,465,094.35 元。上述募集资金到位情况已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并由其于 2022 年 3 月 30 日出具《验资报告》（安永华明（2022）验字第 61517561_A01 号）。

二、本期可转换公司债券募集资金实际使用情况

截至 2022 年 12 月 31 日，公司本次募集资金已使用完毕，募集资金专户已经完成销户，公司募集资金实际使用情况与公司公告承诺一致，符合相关法律、法规及部门规章的要求，不存在变更募集资金投资项目的情况。

第五节 本次可转债本息偿付情况

发行人本次可转债的起息日为 2022 年 3 月 24 日，采用每年付息一次的付息方式。发行人于 2023 年 3 月 20 日公告《关于“中银转债”2023 年付息事宜的公告》，并于 2023 年 3 月 24 日支付“中银转债”2022 年 3 月 24 日至 2023 年 3 月 23 日期间的利息，未出现延迟支付利息的情况。

根据发行人于 2023 年 12 月 20 日公告的《关于“中银转债”赎回结果暨股份变动公告》，“中银转债”已于 2023 年 12 月 19 日全部赎回并摘牌，公司已于同日完成包括本次可转债本息在内的赎回款的发放。

第六节 债券持有人会议召开情况

2023 年度，发行人未出现需召开债券持有人会议的情形。

第七节 本次可转债的信用评级情况

2021年10月15日，联合资信评估股份有限公司（以下简称“联合资信”）为中国银河拟公开发行A股可转换公司债券进行了信用评级，根据其出具的《中国银河证券股份有限公司公开发行A股可转换公司债券信用评级报告》（联合[2021]9407号），中国银河的主体长期信用等级为AAA级，本次A股可转换公司债券的信用等级为AAA级，评级展望稳定。

2022年5月26日，联合资信出具了《中国银河证券股份有限公司公开发行A股可转换公司债券2022年跟踪评级报告》（联合[2022]3269号），确定维持公司主体长期信用等级为AAA，“中银转债”信用等级为AAA，评级展望为稳定。

2023年5月25日，联合资信出具了《中国银河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]3297号），确定维持公司主体长期信用等级为AAA，“中银转债”信用等级为AAA，评级展望为稳定。

2023年12月19日，联合资信出具了《关于终止“中银转债”信用等级的公告》（联合[2023]11353号）。根据公司于2023年12月19日提供的由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司出具的《委托发放债券兑付兑息现金确认表》，“中银转债”已于2023年12月19日兑付，不再存续。根据有关法规、监管规定、自律规则及联合资信《终止评级制度》，自该公告发布之日起，联合资信终止对“中银转债”的信用评级，并将不再更新“中银转债”的评级结果。

第八节 负责处理与公司债券相关事务专人的变动情况

2023 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。

第九节 其他事项

一、可转债转股价格调整

本次可转债初始转股价格为 10.24 元/股。由于公司实施 2021 年年度利润分配方案，“中银转债”转股价格自 2022 年 7 月 15 日起由 10.24 元/股调整为 9.93 元/股。

2023 年，因公司实施 2022 年年度利润分配方案，“中银转债”转股价格自 2023 年 7 月 17 日起由 9.93 元/股调整为 9.70 元/股。

二、可转债赎回及摘牌

因公司股票自 2023 年 11 月 6 日至 2023 年 11 月 24 日，连续 15 个交易日内已有 15 个交易日收盘价格不低于“中银转债”当期转股价格 9.70 元/股的 130%（即不低于 12.61 元/股），已触发“中银转债”的赎回条款。公司于 2023 年 11 月 24 日召开第四届董事会第二十二次会议（临时），审议通过了《关于提请按照程序提前赎回“中银转债”的议案》。自 2023 年 12 月 19 日起，公司发行的“中银转债”在上海证券交易所摘牌，公司已于同日完成包括本次可转债本息在内的赎回款的发放。

三、是否发生债券受托管理协议第 3.4 条约定的重大事项

根据发行人与浙商证券签署的《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。”

2023 年度，除实施 2022 年年度利润分配方案调整转股价格、“中银转债”触发赎回条款并于 2023 年 12 月 19 日自上海证券交易所摘牌事项外，发行人不存在《受托管理协议》第 3.4 条列明的对债券持有人权益有重大影响的其他事项。

（以下无正文）

（本页无正文，为《中国银河证券股份有限公司 A 股可转换公司债券受托管理事务报告（2023 年度）》盖章页）

