

证券代码：000027

证券简称：深圳能源

公司债券代码：112616

公司债券简称：17 深能 02

深圳能源集团股份有限公司 关于“17深能02”第三个计息年度票面利率 的提示公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

重要提示：

根据深圳能源集团股份有限公司（以下简称“发行人”）《深圳能源集团股份有限公司 2017 年面向合格投资者公开发行公司债券（第一期）募集说明书》（以下简称“《募集说明书》”）的有关约定，本期债券品种二（以下简称“17 深能 02”）的票面利率由固定利率加上浮动利率构成，固定利率根据市场询价结果，由发行人与主承销商按照国家有关规定协商一致，以簿记建档方式确定，并在品种二存续期限内保持不变；浮动利率与加权煤炭价格指数 Q 挂钩，确定方式如下：

加权煤炭价格指数 $Q = \text{CCTD 秦皇岛动力煤 (Q5500) 现货价格} \times 50\% + \text{环渤海动力煤价格指数} \times 50\%$ 。

浮动利率自第二个计息年度起每年调整一次，具体确定方式如下：

当加权煤炭价格指数 Q 上一个计息年度内上涨或平均跌幅小于 5% 时，该计息年度浮动利率为 0；

当加权煤炭价格指数 Q 上一个计息年度内平均跌幅大于或等于 20% 时，该计息年度浮动利率为 0.50%；

当加权煤炭价格指数 Q 上一个计息年度内平均跌幅大于或等于 5% 且小于 20% 时，该计息年度浮动利率 $= 0.025 \times \text{加权煤炭价格指数 Q 上一个计息年度内平均跌幅}$ 。（计算结果四舍五入后保留两位小数）

其中：

1. 首个计息年度浮动利率为 0；

2. 第 2 个计息年度，加权煤炭价格指数 Q 上一个计息年度内平均跌幅=1-【债券在第 1 个计息年度起息日至第 1 个计息年度付息日前 20 个交易日加权煤炭价格指数 Q 的算术平均值】/【债券在第 1 个计息年度起息日之前 365 日加权煤炭价格指数 Q 的算术平均值】×100%；

3. 自第 3 个计息年度起，第 N 个计息年度起之后的每个计息年度，加权煤炭价格指数 Q 上一个计息年度内平均跌幅=1-【债券在 N-1 个计息年度起息日至 N-1 个计息年度付息日前 20 个交易日加权煤炭价格指数 Q 的算术平均值】/【债券在 N-2 个计息年度加权煤炭价格指数 Q 的算术平均值】×100%（N≥3）。

CCTD 秦皇岛动力煤（Q5500）现货价格于中国煤炭市场网每周公布一次，环渤海动力煤价格指数于及秦皇岛煤炭网每周公布一次，该年度加权煤炭价格指数 Q 的算术平均值为年内每周公布的 CCTD 秦皇岛动力煤（Q5500）现货价格与环渤海动力煤价格指数加权均值的年度算术平均值。

若在债券存续期内，加权煤炭价格指数 Q 无法获得而导致当期浮动利率无法计算，则浮动利率沿用之前一期数值。

现将第三个计息年度（2019 年 11 月 20 日至 2020 年 11 月 19 日）票面利率事宜公告如下：

本期债券品种二在第二个计息年度起息日之前 365 日加权煤炭价格指数 Q 的算术平均值 582.70；

本期债券品种二在第二个计息年度起息日至第二个计息年度付息日前 20 个交易日（2018 年 11 月 20 日至 2019 年 10 月 23 日）加权煤炭价格指数 Q 的算术平均值为 576.71；

根据《募集说明书》约定，第三个计息年度，加权煤炭价格指数 Q 上一个计息年度内平均跌幅=1-（576.71/582.70）×100%=1.03%，平均跌幅小于 5.00%。因此，第三个计息年度（2019 年 11 月 20 日至 2020 年 11 月 19 日）浮动利率为 0，票面利率为 5.20%。

特此公告。

深圳能源集团股份有限公司

2019 年 11 月 13 日