

债券简称:19 东吴债

债券代码:155596



(江苏省苏州工业园区星阳街 5 号)

2019 年公开发行公司债券 发行公告

主承销商:



签署日期: 年 月 日

本公司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、完整性承担个别及连带责任。

重要提示

1、东吴证券股份有限公司（以下简称“发行人”或“公司”）公开发行公司债券（以下简称“本次债券”）已获得中国证券监督管理委员会证监许可（2019）1186号文核准。

2、东吴证券股份有限公司 2019 年公开发行公司债券（以下简称“本期债券”）发行总规模为人民币 30 亿元，不分期发行。本期债券票面金额为人民币 100 元，按票面金额平价发行。

3、根据《公司债发行与交易管理办法》相关规定，本期债券仅面向合格投资者发行，公众投资者不得参与发行认购。本期债券上市后将被实施投资者适当性管理，仅限合格投资者参与交易，公众投资者认购或买入的交易行为无效。

4、本期债券发行人主体评级为 AAA，债项评级为 AAA；截至 2018 年末，发行人经审计合并报表中所有者权益为 204.26 亿元；本期债券发行前，发行人最近三个会计年度实现的年均可分配利润为 8.82 亿元（2016 年、2017 年和 2018 年合并报表中归属于母公司所有者的净利润平均值），预计不少于本期债券一年利息的 1.5 倍。发行人在本期债券发行前的财务指标符合相关规定。

5、期限：本期债券期限为 3 年。

6、担保人及担保方式：本期债券无担保。

7、本期债券的票面利率询价区间为 3.2%-4.2%。最终票面利率将由发行人和主承销商根据簿记建档结果在利率询价区间内协商确定。

发行人和主承销商将于 2019 年 8 月 9 日（T-1 日）以簿记建档的方式向网下合格机构投资者进行簿记询价，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 2019 年 8 月 12 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。

8、发行人主体信用等级为 AAA，本期债券信用等级为 AAA，评级展望为稳定，符合进行新质押式回购交易的基本条件，新质押式回购相关申请尚需相关机构最终批复，具体折算率等事宜按上交所与登记公司的相关规定执行。

9、本期债券发行仅采取网下面向《公司债券发行与交易管理办法》规定的合格投资者申购和配售的方式。网下申购采取发行人与主承销商根据簿记建档情况进行配售的方式。具体发行安排将根据上海证券交易所的相关规定进行。具体配售原则详见本公告“三、网下发行”中“(六) 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。

10、网下发行对象为《公司债券发行与交易管理办法》规定的合格投资者。合格投资者通过向簿记管理人提交《网下利率询价及申购申请表》的方式参与网下询价申购。合格投资者网下最低申购单位为1,000手（100万元），超过1,000手（100万元）的必须是1,000手（100万元）的整数倍，簿记管理人另有规定的除外。

11、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。

12、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。

13、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。本期债券可同时在上海证券交易所竞价交易系统和固定收益证券综合电子平台挂牌上市。

14、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《东吴证券股份有限公司2019年公开发行公司债券募集说明书》。有关本期发行的相关资料，投资者亦可登录上海证券交易所网站（<http://www.sse.com.cn>）查询。

15、有关本期发行的其他事宜，发行人和主承销商将视需要在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。

释义

除非另有说明，下列简称在本公告中具有如下含义：

公司、发行人或东吴证券	指	东吴证券股份有限公司
本期债券	指	发行人本期面向合格投资者公开发行的总规模为人民币30亿元的公司债券
本期发行	指	本期债券的公开发行
发行公告、本公告	指	《东吴证券股份有限公司2019年公开发行公司债券发行公告》
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
上证所	指	上海证券交易所
登记公司、证券登记机构	指	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司
《管理办法》	指	《公司债券发行与交易管理办法》
主承销商、簿记管理人、债券受托管理人或光大证券	指	光大证券股份有限公司
资信评级机构、评级机构或联合评级	指	上海新世纪资信评估投资服务有限公司
承销团	指	主承销商为本期发行组织的、由主承销商和其他承销团成员组成的承销团
合格投资者	指	符合《管理办法》规定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）
交易日	指	上海证券交易所的营业日
网下利率询价及申购申请表	指	《东吴证券股份有限公司2019年公开发行公司债券网下利率询价及申购申请表》
配售缴款通知书	指	《东吴证券股份有限公司2019年公开发行公司债券配售缴款通知书》
认购协议	指	《东吴证券股份有限公司2019年公开发行公司债券认购协议》
元/万元/亿元	指	如无特别说明，指人民币元/万元/亿元

一、本期发行基本情况

1、发行主体：东吴证券股份有限公司。

2、债券名称：东吴证券股份有限公司2019年公开发行公司债券。

3、发行规模：本期公司债券发行总额30亿元，不分期。

4、票面金额及发行价格：本期债券票面金额为人民币100元，按票面金额发行。

5、债券期限：本期债券期限为3年。

6、债券利率或其确定方式：本期债券票面利率将以公开方式向具备相应风险识别和承担能力的合格投资者进行询价后，由发行人和主承销商根据利率询价确定利率区间后，通过簿记建档方式确定。

7、债券形式：实名制记账式公司债券。

8、还本付息期限和方式：本期债券采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。

9、利息登记日：本期债券存续期间，利息登记日按照上交所和证券登记机构相关规定执行。在利息登记日当日收市后登记在册的本期债券持有人，均有权就所持本期债券获得该利息登记日所在计息年度的利息。

10、起息日：2019年8月12日。

11、付息日期：本期债券的付息日期为2020年至2022年每年的8月12日，如遇法定节假日或休息日，则顺延至下一个工作日，顺延期间不另计息。

12、本金兑付日：本期债券的兑付日期为2022年8月12日，如遇法定节假日或休息日，则顺延至下一个工作日，顺延期间不另计息。

13、付息、兑付方式：本期债券本息支付将按照本期债券登记机构的有关规定统计债券持有人名单，本息支付方式及其他具体安排按照债券登记机构的相关规定办理。

14、发行首日：本期债券发行期限的第1日，即2019年8月12日。

15、发行期限：2个工作日，自发行首日至2019年8月13日。

16、计息期限：本期债券的计息期限为2019年8月12日至2022年8月11日。

17、发行方式、发行对象及配售安排：本期债券采取面向合格投资者簿记建档的方式公开发行。具体发行方式详见发行公告。

18、担保情况：本期债券无担保。

19、募集资金专项账户银行：中国工商银行股份有限公司苏州分行营业部、上海银行苏州分行。

20、信用级别及资信评级机构：经上海新世纪资信评估投资服务有限公司综合评定，发行人主体长期信用等级为AAA，本期债券信用等级为AAA。

21、主承销商：光大证券股份有限公司。

22、簿记管理人、债券受托管理人：光大证券股份有限公司。

23、承销方式：本期债券由主承销商光大证券采取余额包销的方式承销。

24、募集资金用途：本期发行公司债券的募集资金拟主要用于补充公司营运资金，偿还公司有息债务，满足公司业务发展需要，进一步优化负债结构和改善财务结构。

25、公司债券上市或转让安排：本期债券拟在上海证券交易所上市交易。本期发行结束后，发行人将尽快向上交所提出关于本期债券上市交易的申请，具体上市时间将另行公告。

26、新质押式回购：发行人主体信用等级为AAA，本期债券的信用等级为AAA，符合进行新质押式回购交易的基本条件，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，具体折算率等事宜按上交所及债券登记机构的相关规定执行。

27、税务提示：根据国家有关税收法律、法规的规定，投资者投资本期债券所应缴纳的税款由投资者承担。

28、与本期债券发行有关的时间安排：

日期	发行安排
T-2 日 (2019 年 8 月 8 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 (2019 年 8 月 9 日)	网下簿记建档日 确定票面利率
T 日 (2019 年 8 月 12 日)	公告最终票面利率 网下申购起始日 主承销商向获得网下配售的机构投资者发送配售缴款通知书或签订认购协议
T+1 日 (2019 年 8 月 13 日)	网下申购截止日 获得网下配售的合格投资者应不晚于当日 16:00 前将认购款划至主承销商指定的专用收款账户 主承销商向发行人划款、发行结束
T+2 日 (2019 年 8 月 14 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、网下向合格投资者簿记建档确定发行利率

(一) 网下投资者

本期网下参与簿记建档的对象为在中国证券登记结算有限责任公司上海分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）。

(二) 利率簿记建档区间及票面利率确定方法

本期债券票面利率簿记建档区间为 3.2%-4.2%，最终票面利率由发行人和主承销商根据簿记建档结果在上述利率区间范围内确定。

发行利率确认原则如下：

1、簿记管理人按照合格投资者的申购利率从低到高进行簿记建档，按照申购利率从低至高的原则，对合规申购金额逐笔累计，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申购利率确认为发行利率。

2、若合规申购的累计金额未能达到本期债券发行总额，则簿记建档区间的上限即为发行利率。

(三) 簿记建档申购时间

本期债券簿记建档的时间为 2019 年 8 月 9 日 (T-1 日), 参与申购的合格投资者必须在 2019 年 8 月 9 日 (T-1 日) 14: 00—16: 00 之间将《网下利率询价及申购申请表》(见附表一) 传真至簿记管理人处。

(四) 申购办法

1、填制《网下利率询价及申购申请表》

拟参与网下申购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》, 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) 企业营业执照注册号填写: 一般法人填写其营业执照中的注册号, 证券投资基金填写“基金简称”+“证基”+“中国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“劳动保障部门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) 票面利率应在询价利率区间内由低到高填写, 最小变动单位为 0.01%;

(3) 每一申购利率对应的申购金额是指当最终确定的发行利率不低于该申购利率时, 投资者的新增的投资需求, 每一标位单独统计, 不累计;

(4) 询价利率可不连续;

(5) 每一申购利率上的申购金额不得少于 100 万元 (含 100 万元), 并为 100 万元的整数倍; 本期债券的申购上限为 30 亿元 (含 30 亿元)。

2、提交

参与申购的合格投资者应在 2019 年 8 月 9 日 (T-1 日) 14: 00—16: 00 之间将以下资料传真至簿记管理人处, 并电话确认:

(1) 由经办人签字并加盖单位公章或业务章后的《网下利率询价及申购申请表》;

(2) 有效的企业法人营业执照 (副本) 复印件或其他有效的法人资格证明

文件复印件（须加盖单位公章或业务章）；

（3）经办人身份证复印件；

（4）簿记管理人根据申购情况要求投资者提供的其他资质证明文件。

上述资料提供不齐全的，簿记管理人有权认定投资人提交的申购是否有效。每家合格投资者只能报价一次，在未获得簿记管理人同意情况下，如投资者提交两份以上（含两份）《网下申购申请表》，则以最先到达的合规《网下申购申请表》视为有效，其后的均视为无效报价。投资者填写的《网下申购申请表》一旦传真至簿记管理人处，即构成投资者发出的、不可撤销的、对投资者具有法律约束力的申购要约。

投资者填写的《网下利率询价及申购申请表》一旦传真至簿记管理人处，即构成投资者发出的、不可撤销的、对投资者具有法律约束力的申购要约。

申购传真：021-52523004、021-52523014；

咨询电话：021-52523668、021-52523667；

联系人：黄驹

（五）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2019年8月12日（T日）在上交所网站（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合格投资者公开发行本期债券。

三、网下发行

（一）发行对象

本期网下发行的对象为符合《管理办法》规定且在登记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），包括未参与网下询价的合格投资者。合格投资者的认购资金来源必须符合国家有关规定。

（二）发行数量

本期公司债券发行总额为 30 亿元，不分期。参与本期网下发行的每家合格投资者的最低申购数量为 1,000 手（1 万张，100 万元），超过 1,000 手的必须是 1,000 手（1 万张，100 万元）的整数倍。每家投资者在《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发行总额，发行人和簿记管理人另有规定的除外。

（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 2 个交易日，即发行首日 2019 年 8 月 12 日（T 日）至 2019 年 8 月 13 日（T+1 日）的 16:00。

（五）申购办法

1、凡参与网下簿记建档的合格投资者，认购时必须持有在登记公司开立的合格证券账户。尚未开户的机构投资者，必须在 2019 年 8 月 8 日（T-1 日）前开立证券账户。

2、欲参与网下申购的合格投资者通过向簿记管理人传真《网下利率询价及申购申请表》、有效的企业法人营业执照（副本）复印件（加盖单位公章或业务章）、和经办人身份证复印件进行申购。簿记管理人根据网下合格投资者认购意向，根据网下簿记结果对所有有效申购进行配售，并向获得网下配售的机构投资者发送《配售缴款通知书》或签订《认购协议》。

（六）配售

簿记管理人根据网下簿记结果对所有有效申购进行配售，合格投资者的获配售金额不超过其有效申购中相应的最大申购金额。配售依照以下原则：按照投资者的申购利率从低到高进行簿记建档，按照申购利率从低到高对申购金额进行累计，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申购利率确认为发行利率；申购利率在最终发行利率以下（含发行利率）的投资者按照价格优先的原则配售；如遇到申购量超过可分配额度的情况，在价格优先原则

的前提下，同时适当考虑长期合作的投资者优先配售。发行人和主承销商有权决定本期债券的最终配售结果。

（七）缴款

获得配售的合格投资者应按规定及时缴纳认购款，认购款须在 2019 年 8 月 13 日（T+1 日）16:00 前足额划至簿记管理人指定的收款账户。划款时应注明合格投资者全称和“19 东吴债认购款”字样，同时向簿记管理人传真划款凭证。

收款单位：光大证券股份有限公司

开户银行：中国光大银行上海分行浦东支行

账号：36540188000102013

大额支付系统行号：303290000544

（八）违约申购的处理

获配有效申购的投资者如果未能在 2019 年 8 月 13 日（T+1 日）16:00 前向簿记管理人指定账户足额划付认购款项，将被视为违约申购，簿记管理人有权处置该违约投资者申购要约项下的全部债券，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

本期债券发行不向投资者收取佣金、过户费、印花税等费用。

五、风险揭示

发行人和主承销商在已知范围内已充分揭示本期发行可能涉及的风险事项，详细风险揭示条款参见《东吴证券股份有限公司2019年公开发行公司债券募集说明书》。

六、发行人和主承销商

1、发行人：东吴证券股份有限公司

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

联系人：叶犇、李文华

联系电话：0512-62938706

传真号码：0512-62938692

2、主承销商：光大证券股份有限公司

办公地址：上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场 1 号楼 51 层

联系人：黄亮、邢一唯、王一聪

联系电话：021-52523023

传真：021-52523004

（本页以下无正文）

（本页无正文，为发行人关于《东吴证券股份有限公司 2019 年公开发行公司债券发行公告》之盖章页）

发行人：东吴证券股份有限公司

年 月 日

（本页无正文，为主承销商关于《东吴证券股份有限公司 2019 年公开发行公司债券发行公告》之盖章页）

主承销商：光大证券股份有限公司

年 月 日

**东吴证券股份有限公司 2019 年公开发行公司债券
网下利率询价及申购申请表**

重要声明

填表前请仔细阅读发行公告及填表说明。

本表一经申购人完整填写并签字，申购负责人签字并盖章，传真至主承销商后，即对申购人具有法律约束力，不可撤销。申购人承诺并保证其将根据主承销商（簿记管理人）确定的配售数量按时完成缴款。

基本信息

机构名称			
法定代表人		营业执照注册号	
经办人姓名		传真号码	
联系电话		移动电话	
证券账户名称（上海）		证券账户号码（上海）	

利率询价及申购信息

票面利率（%）		申购金额（万元）	

重要提示：

请将此表填妥签字并盖章后，于 2019 年 8 月 9 日（T-1 日）14:00-16:00 连同盖章版《合格投资者确认函》、《债券市场合格投资者风险揭示书》、经办人身份证复印件，盖章版的相关证明材料（根据《合格投资者确认函》选项提供，详情见《合格投资者确认函》说明）一并传真至主承销商（簿记管理人）处，传真：021-52523004、021-52523014；咨询电话：021-52523668、021-52523667。已向光大证券提供合格投资者入库材料获得确认的投资者仅需提供《网下利率询价及申购申请表》。

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，并将在认购本次债券后依法办理必要的手续；
- 3、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申购金额之和；
- 4、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。
- 5、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》或《网下认购协议》规定的时间、金额和方式，将认购款足额划至主承销商（簿记管理人）通知的划款账户。如果申购人违反此义务，主承销商有权处置该违约申购人订单项下的全部债券；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；
- 6、申购人理解并接受，如果遇不可抗力、监管者要求或其他可能对本次发行造成重大不利影响的情况，在与主管机关协商后，发行人及主承销商有权暂停或终止本次发行。

申购负责人签字：

（单位盖章）

年 月 日

合格投资者确认函

根据《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（2017年修订）》、《深圳证券交易所债券市场投资者适当性管理办法（征求意见稿）》之规定，本机构为：请在相应类型中勾选，**并按照说明要求提供相关证明材料。**

勾选	合格投资者类型
	（一）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；
	（二）上述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、基金管理公司及其子公司产品、期货公司资产管理产品、银行理财产品、保险产品、信托产品、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★）
	（三）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，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；
	（四）同时符合下列条件的法人或者其他组织：（如将主要资产投向单一债券，请同时勾选★） 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；
	（五）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年以上金融产品设计、投资、风险管理及相关工作经历，或者属于本条第（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；
	（六）发行人的董事、监事、高级管理人员及持股比例超过百分之五的股东；
	（七）中国证监会和交易所认可的其他投资者。
必选	是否有来源于以下机构的不良诚信记录？ <input type="checkbox"/> 中国人民银行征信中心 <input type="checkbox"/> 最高人民法院失信被执行人名单 <input type="checkbox"/> 工商行政管理机构 <input type="checkbox"/> 税务管理机构 <input type="checkbox"/> 监管机构、自律组织 <input type="checkbox"/> 投资者在证券经营机构的失信记录 <input type="checkbox"/> 其他组织 <input type="checkbox"/> 无 <input type="checkbox"/> 有（请注明）：_____

★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），请确认最终投资者是否符合基金业协会标准所规定的合格投资者。是（ ） 否（ ）
（如勾选此项，需提供最终投资人人数）

说明：如勾选第（一）、（二）、（三）项的投资者，需提供营业执照复印件、经营业务许可证复印件、经办人身份证复印件、基金会法人登记证明（如需）、私募基金管理人登记材料（如需），**理财产品还需提供产品成立或备案文件等证明材料**；如勾选第（四）项的投资者需提供近一年经审计的财务报表、金融资产证明文件、投资经历等证明文件；如勾选第（五）项的投资者需提供其申请资格认定前20个交易日本人名下金融资产证明文件或者最近3年收入证明，投资经历或者工作证明、职业资格证书等证明文件；如勾选第（六）项的投资者需提供任职证明、股东名册等相关证明文件；如勾选第（七）项的投资者需提供证监会或交易所认可的证明文件。

机构名称：

（盖章）

债券市场合格投资者风险揭示书

(面向合格投资者公开/非公开发行公司债券、企业债券、资产支持证券适用)

尊敬的投资者:

为使贵公司更好地了解公开/非公开发行公司债券、企业债券、资产支持证券的相关风险,根据上海及深圳证券交易所关于债券市场投资者适当性管理的有关规定,本公司特为您(贵公司)提供此份风险揭示书,请认真仔细阅读,关注以下风险。

贵公司在参与公开/非公开发行公司债券、企业债券、资产支持证券的认购和转让前,应当仔细核对自身是否具备合格投资者资格(债券信用评级在 AAA 以下(不含 AAA)的公开发行公司债券、企业债券以及非公开发行公司债券、企业债券、资产支持证券仅限合格投资者中的机构投资者认购及交易),充分了解公开/非公开发行公司债券、企业债券、资产支持证券的特点及风险,审慎评估自身的经济状况和财务能力,考虑是否适合参与。具体包括:

一、债券投资具有信用风险、市场风险、流动性风险、放大交易风险、质押券价值变动风险、政策风险及其他各类风险。

二、投资者应当根据自身的财务状况、投资的资金来源、实际需求、风险承受能力、投资损失后的损失计提、核销等承担损失的方式及内部制度(若为机构),审慎决定参与债券认购和交易。

三、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或无资信评级的信用债,将面临显著的信用风险。

四、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、投资者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、投资者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、投资者在参与质押式回购业务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,融资方将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。投资者在参与质押式协议回购业务期间可能存在质押券价值波动、分期偿还、分期摊还、司法冻结或扣划等情形导致质押券贬值或不足的风险。

八、由于投资者操作失误,证券公司或结算代理人未履行职责等原因导致的操作风险。

九、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。对于因交易所制定、修改业务规则或者根据业务规则履行自律监管职责等造成的损失,交易所不承担责任。

十、因出现火灾、地震、瘟疫、社会动乱等不能预见、避免或客服的不可抗力情形给投资者造成的风险。

特别提示:本《风险揭示书》的提示事项仅为列举性质,未能详尽列明债券交易的所有风险。贵公司在参与债券交易前,应认真阅读本风险揭示书、债券募集说明书以及交易所相关业务规则,确认已知晓并理解风险揭示书的全部内容,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,并自行承担参与交易的相应风险,避免因参与债券交易而遭受难以承受的损失。

机构名称:

(盖章)

填表说明：（以下内容不需传真至主承销商（簿记管理人）处，但应被视为本发行公告不可分割的部分，填表前请仔细阅读）

- 1、票面利率应在询价利率区间内由低到高填写，最小变动单位为 0.01%；
- 2、最多可填写 5 档票面利率及对应的申购金额；
- 3、每个申购利率上的申购金额不得少于 100 万元（含 100 万元），超过 100 万元的必须是 100 万元的整数倍；
- 4、每一申购利率对应的申购金额是指当最终确定的发行利率不低于该申购利率时申购人新增的投资需求，**非累计**；
- 5、有关票面利率和申购金额的限制规定，请参阅发行公告相关内容；
- 6、票面利率及申购金额填写示例（声明：本示例数据为虚设，不含任何暗示，请投资者根据自己的判断填写）。

假设本期债券票面利率的询价区间为 2.70% -3.20%。某投资者拟在不同票面利率分别申购不同的金额，其可做出如下填写：

票面利率（%）	申购金额（万元）
2.70%	6,000
2.90%	3,000
3.10%	5,000

上述报价的含义如下：

- ◆当最终确定的票面利率高于或等于 3.10%时，有效申购金额为 14,000 万元；
- ◆当最终确定的票面利率低于 3.10%，高于或等于 2.90%时，有效申购金额 9,000 万元；
- ◆当最终确定的票面利率低于 2.90%，高于或等于 2.70%时，有效申购金额 6,000 万元；
- ◆当最终确定的票面利率低于 2.70%时，该询价要约无效。

7、参与网下利率询价的合格投资者请将**此表填妥签字并盖章**后，在本发行公告要求的时间内，连同盖章版《合格投资者确认函》、《债券市场合格投资者风险揭示书》、经办人身份证复印件，盖章版的相关证明材料（根据《合格投资者确认函》选项提供，详情见《合格投资者确认函》说明）一并传真至主承销商（簿记管理人）处。**已向光大证券提供合格投资者入库材料获得确认的投资者仅需提供《网下利率询价及申购申请表》。**

8、投资者须通过以下传真号码以传真方式参与本次网下利率询价，以其他方式传送、送达一概无效。传真：021-52523004、021-52523014；电话：021-52523668、021-52523667。