

603866

2019-090

2019 9

20 T

2

T+3

3 2019 9 23 T+1

2019 9 23 T+1

4 È >tH7•0 žifW L Ä

10.00

10.00

30%

3.00

30%

6

12

3

6

180

7

8

1

2019

9

19

T-1

753866

2

754866

1

10

1,000

1

754866

1	10	1,000	1		1	1
			1,000	1	100	

7

8

9 /

10

11

2019 9 18 T-2

<http://www.sse.com.cn>

12

13

<http://www.sse.com.cn>

/	/	
		10.00
		10.00 100
T-1	2019 9 19	
T	2019 9 20	
	1	
		1

--	--

			A	
			A	
			10.00	100
1,000				
		100		
				2019 9 20
2025 9 19				
			0.40%	0.60%
1.0%	1.50%	1.80%	2.00%	
1				
		I=B i		
I				
B				
i				
2				

1

2

3

4

5

5

2019 9 26

6

1

2020 3 26

2025 9 19

1

47.54 /

A

A

A

=

A

/

A

A

=

A

$$P_1 = P_0 / (1 + n)$$

$$P_1 = (P_0 + A \cdot k) / (1 + k)$$

$$P_1 = (P_0 + A \cdot k) / (1 + n + k)$$

$$P_1 = P_0 \cdot D$$

$$A = \frac{P_1 - P_0 \cdot D + A \cdot k}{P_0 \cdot D + A \cdot k} \cdot \frac{1}{1 + n + k}$$

/

2

$$Q=V/P$$

V

P

1

1

110%

2

1

130%

130%

2

3,000

$$I_A=B \quad i \quad t/365$$

I_A

B

i

t

1

2019 9 20 T

2

1

2019 9

19 T-1

2

3

3

2019 9 19 T-1

4

5

6

10.00

10.00

30%

3.00

30%

2019 9 19

T-1

2019 9 19

T-1

1.517

1,000 /

1

10

0.001517

1

1

2019 9

20 T

9:30 11:30 13:00 15:00

753866

2

1

1,000

1 1000

1

1

3

1

2

T

3

4

5

1

2019 9 20 T

2

1

2

1 10 1,000

1

1

2019 9 20 T

2019 9 23 T+1

2

2019 9 23 T+1

3

2019 9 23 T+1

2019 9 24 T+2

4

2019 9 24 T+2

1 10 1,000

12

3

6

180

2019 9 26 T+4

1 2019 9 25 T+3

2

70%

70%

10.00

10.00

30%

3.00

30%

2019

9 19 T-1 10:00-12:00

<http://roadshow.cnstock.com/>

1

1-1

1

4015

024-22817166

2

48

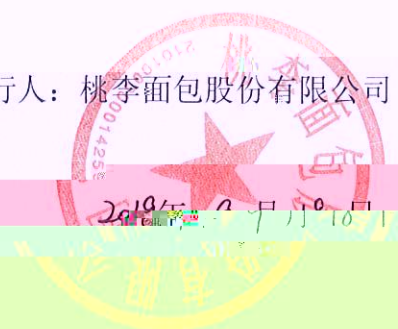
010-6083 7355 010-6083 3686

2019 9 18

《桃李面包股份有限公司公开发行可转换公司债券募集说明书》

之盖章页》

发行人：桃李面包股份有限公司



（此页无正文，为《桃李面包股份有限公司公开发行可转换公司债券发行公告》
之盖章页）

保荐机构（主承销商）：中信证券股份有限公司

2019年9月18日