

股票简称：海通证券

股票代码：600837

债券简称：13 海通 04、13 海通 05、13 海通 06

债券代码：122311、122312、122313

## 海通证券股份有限公司 2013 年公司债券（第二期） 受托管理事务报告（2016 年度）

发行人



海通证券股份有限公司

（上海市广东路 689 号）

债券受托管理人

中信证券股份有限公司



（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

2017 年 4 月

## 重要声明

中信证券股份有限公司（“中信证券”）编制本报告的内容及信息均来源于发行人对外公布的《海通证券股份有限公司2016年年度报告》等相关公开信息披露文件、海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”、“发行人”或“公司”）提供的证明文件以及第三方中介机构出具的专业意见。中信证券对报告中所包含的相关引述内容和信息未进行独立验证，也不就该等引述内容和信息的真实性、准确性和完整性做出任何保证或承担任何责任。

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，投资者应对相关事宜做出独立判断，而不应将本报告中的任何内容据以作为中信证券所作的承诺或声明。在任何情况下，投资者依据本报告所进行的任何作为或不作为，中信证券不承担任何责任。

## 目 录

第一节 本期公司债券概况 .....	4
第二节 发行人 2016 年度经营情况和财务状况 .....	7
第三节 发行人募集资金使用情况 .....	17
第四节 本期债券利息偿付情况 .....	18
第五节 债券持有人会议召开情况 .....	19
第六节 公司债券担保人资信情况 .....	20
第七节 本期公司债券的信用评级情况 .....	21
第八节 负责处理与公司债券相关事务专人的变动情况 .....	22
第九节 其他情况 .....	23

## 第一节 本期公司债券概况

### 一、发行人名称

中文名称：海通证券股份有限公司

英文名称：Haitong Securities Co., Ltd

### 二、本期公司债券核准文件及核准规模

海通证券股份有限公司 2013 年公司债经中国证券监督管理委员会“证监许可[2013]1220 号”文核准。发行人获准向社会公开发行面值不超过 230 亿元的公司债券。本次债券采取分期发行的方式，其中，债券的首期 120 亿元部分于 2013 年 11 月 27 日完成发行，第二期 110 亿元公司债券已于 2014 年 7 月 16 日发行完毕。

### 三、本期债券基本情况

1. 债券名称：海通证券股份有限公司 2013 年公司债券（第二期）（简称“本期债券”）
2. 债券简称及代码：3 年期品种简称为“13 海通 04”，上市代码为“122311”；5 年期品种简称为“13 海通 05”，上市代码为“122312”；10 年期品种简称为“13 海通 06”，上市代码为“122313”。
3. 发债券品种的期限及规模：本期债券分为 3 年期固定利率、5 年期固定利率和 10 年期固定利率三个品种。最终发行规模合计为 110 亿元。
4. 票面金额及发行价格：本期债券面值 100 元，按面值平价发行。
5. 票面利率：本期债券 3 年期品种的票面利率为 5.25%，5 年期品种的票面利率为 5.45%，10 年期品种的票面利率为 5.85%。
6. 债券形式：实名制记账式公司债券。
7. 还本付息方式及支付金额：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。本期债券于每年的付息日期向投资者支付的利息金额为投资者截至付息债权登记日收市时所持有的本期债券票面总额与对应的票面年利率的乘积；于兑付

日期向投资者支付的本息金额为投资者截至兑付债权登记日收市时所持有的本期债券最后一期利息及所持有的债券票面总额的本金。

8. 起息日：2014年7月14日。
9. 本期债券的付息日期为：

本期债券3年期品种的付息日为2015年至2017年每年的7月14日，前述日期如遇法定节假日或休息日，则兑付顺延至下一个工作日，顺延期间不另计息；

本期债券5年期品种的付息日为2015年至2019年每年的7月14日，前述日期如遇法定节假日或休息日，则兑付顺延至下一个工作日，顺延期间不另计息；

本期债券10年期品种的付息日为2015年至2024年每年的7月14日，前述日期如遇法定节假日或休息日，则兑付顺延至下一个工作日，顺延期间不另计息。
10. 本期债券的兑付日期为：

本期债券3年期品种的兑付日为2017年7月14日，前述日期如遇法定节假日或休息日，则兑付顺延至下一个工作日，顺延期间不另计息；

本期债券5年期品种的兑付日为2019年7月14日，前述日期如遇法定节假日或休息日，则兑付顺延至下一个工作日，顺延期间不另计息；

本期债券10年期品种的兑付日为2024年7月14日，前述日期如遇法定节假日或休息日，则兑付顺延至下一个工作日，顺延期间不另计息。
11. 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登记机构的相关规定办理。
12. 担保情况：本期债券为无担保债券。
13. 发行时信用级别及资信评级机构：经中诚信证券评估有限公司评定，发行人的主体信用等级为AAA，本期债券信用等级为AAA。
14. 最新跟踪信用级别及评级机构：在本期公司债券的存续期内，中诚信证券评估有限公司每年将至少出具一次正式的定期跟踪评级报告。中诚信证券评估有限公司将在近期出具本期公司债券跟踪评级报告，详细情况敬请投资者关注跟踪评级报告。
15. 债券受托管理人：海通证券聘请中信证券股份有限公司作为本期债券的债

券受托管理人。

16. 登记机构：中国证券登记结算有限责任公司上海分公司。

## 第二节 发行人 2016 年度经营情况和财务状况

### 一、发行人基本情况

#### （一）发行人的设立和上市

海通证券股份有限公司前身为上海海通证券公司，成立于 1988 年，注册资本人民币 1,000 万元，由交通银行上海分行出资，注册地为上海。经营范围为主营经销和代理发行各类有价证券，兼营证券业务咨询，承办各类有价证券的代保管、过户、还本付息等业务，办理证券的代理投资业务及经中国人民银行批准的其他有关业务。

经中国人民银行《关于上海海通证券公司改制问题的批复》（银复[1994]5 号）的批准，1994 年 9 月 27 日，上海海通证券公司改制为海通证券有限公司，注册资本人民币 100,000 万元，经营范围变更为代理证券发行、还本付息业务；自营、代理证券买卖业务；办理证券的代保管和鉴证业务；接受委托代收证券本息和红利、办理证券的登记、过户和清算；证券投资咨询和投资基金业务；经人民银行批准经营的其它业务。

经中国证券监督管理委员会《关于同意海通证券有限公司与交通银行脱钩和增资扩股问题的批复》（证监机构字[2000]74 号）及《关于核准海通证券有限公司增资扩股方案和综合类证券公司的批复》（证监机构字[2000]296 号）核准，2000 年 12 月 29 日，海通证券有限公司完成增资扩股，公司资本金增至 374,692.80 万元，经营范围为：代理证券发行业务；自营、代理证券买卖业务；代理证券还本付息业务；办理证券的代保管和证券鉴证业务；接受委托代收证券本息和红利，接受委托办理证券的登记、过户和清算；证券投资咨询业务；证券投资基金业务。

经上海市人民政府于 2001 年 9 月 8 日出具的《关于同意设立海通证券股份有限公司的批复》（沪府体改审（2001）024 号）及中国证券监督管理委员会《关于海通证券有限公司整体变更为股份有限公司的批复》（证监机构字[2001]278 号）批准，2002 年 1 月 28 日，海通证券有限公司整体变更为股份有限公司，海通证券有限公司更名为“海通证券股份有限公司”（以下简称“原海通证券”），

注册资本为人民币 4,006,093,000 元。

经上海市人民政府经济体制改革办公室于 2002 年 11 月 13 日出具的《关于同意海通证券股份有限公司增资扩股的批复》（沪府体改批字（2002）049 号）及中国证券监督管理委员会《关于同意海通证券股份有限公司增资扩股的批复》（证监机构字[2002]329 号）批准，2002 年 11 月 11 日，海通证券注册资本金增至 8,734,438,870 元人民币。公司经营范围变更为：证券（含境内上市外资股）的代理买卖，代理证券的还本付息、分红派息，证券代保管、鉴证，代理登记开户，证券的自营买卖，证券（含境内上市外资股）的承销（含主承销），证券投资咨询（含财务顾问），受托投资管理，中国证监会批准的其他业务。

经中国证券监督管理委员会《关于上海市都市农商社股份有限公司重大资产出售暨吸收合并海通证券股份有限公司的批复》（证监公司字[2007]90 号文）核准，2007 年 6 月 7 日，都市股份将全部资产与负债出售予公司控股股东光明食品（集团）有限公司，同时吸收合并原海通证券的全部业务。吸收合并完成后，存续公司更名为海通证券股份有限公司，并承继了原海通证券的全部业务，原海通证券的职工、资产与负债由存续公司承接。2007 年 6 月 29 日，新增股份完成中国证券登记结算有限责任公司上海分公司网下登记工作；2007 年 7 月 6 日，存续公司在上海市工商行政管理局办理工商登记变更手续，注册资本变更为人民币 3,389,272,910 元。

2007 年 7 月 31 日，公司在上海证券交易所挂牌上市，股票简称为“海通证券”，股票代码为“600837”。

2012 年 4 月 27 日，公司在香港联合交易所挂牌上市，股票代码“6837”。

## （二）发行人股本变化情况

经中国证监会《关于核准海通证券股份有限公司非公开发行股票的通知》（证监发行字[2007]368 号文）核准，公司非公开发行股票的类型为境内上市人民币普通股（A 股），每股面值人民币 1 元，发行数量不超过 10 亿股。经过特定投资者的认购，本次非公开发行股票的发行价格最终确定为 35.88 元/股，发行数量确定为 724,637,680 股，发行对象共 8 名，募集资金总额为 25,999,999,958.40 元；公司于 2007 年 11 月 21 日完成工商变更，注册资本由人民币 3,389,272,910 元变更登记为人民币 4,113,910,590 元。



发行人于 2008 年 5 月 5 日召开了 2007 年度股东大会，审议通过了《关于公司 2007 年度进行利润分配的预案》，以 2007 年 12 月 31 日总股本 4,113,910,590 股为基数，向全体股东每 10 股派发现金股利 1.00 元（含税），派送股票股利 3 股（含税），以资本公积向全体股东每 10 股转增 7 股，发行人派送股票股利和资本公积转增股本后，总股本由 4,113,910,590 股变更为 8,227,821,180 股。该分配方案于 2008 年 5 月 28 日实施完毕。

发行人于 2012 年 4 月 27 日发行 1,229,400,000 股境外上市外资股(H 股)，并于 2012 年 5 月 19 日部分行使 H 股超额配售权(共配售 127,500,000 股 H 股，于 5 月 22 日上市)，以上合计发行 1,356,900,000 股 H 股。期间，发行人国有股东中包括上海上实(集团)有限公司等 25 家股东按公开发行时实际发行 H 股股份数量的 10%，将其持有的本公司部分国有股（A 股）划转给全国社会保障基金理事会并转为境外上市外资股 H 股，共计 135,690,000 股。至此，发行人 A 股为 8,092,131,180 股，H 股为 1,492,590,000 股，发行人 A+H 股份总数为 9,584,721,180 股。

发行人于 2015 年 2 月 9 日召开 2015 年第一次临时股东大会、2015 年第一次 A 股类别股东会议与 2015 年第一次 H 股类别股东会议，审议通过了《关于公司新增发行 H 股方案的议案》。2015 年 5 月，发行人收到中国证监会《关于核准海通证券股份有限公司增发境外上市外资股的批复》(证件许可【2015】811 号)，核准发行人增发不超过 1,916,978,820 股境外上市外资股，每股面值人民币 1 元，全部为普通股。2015 年 5 月 8 日，发行人获得香港联交所批准 H 股于香港联交所上市及买卖。发行人于 2015 年 5 月 29 日完成本次 H 股发行，发行股数为 1,916,978,820 股，其中，1,048,141,220 股新 H 股的交割于 2015 年 5 月 15 日完成，868,837,600 股新 H 股的交割于 2015 年 5 月 29 日完成。本次 H 股发行前，公司总股本为 9,584,721,180 股，全部股东为无限售条件股东，发行后，公司总股本为 11,501,700,000 股，其中 A 股为 8,092,131,180 股，H 股为 3,409,568,820 股，全部股东均为无限售条件股东。

## 二、发行人 2016 年度经营情况

2016 年，发行人克服了年初股市和年末债市大幅波动给经营工作带来的挑

战，抓住直接融资快速发展的市场机遇，稳步推进改革创新，保持了良好的发展势头，发行人总资产、净资产、营业收入和净利润等主要财务指标均处于历史较好水平，主要业务指标继续排名行业前列，集团化、国际化发展成为公司业绩保持稳定的重要保障。发行人集团化发展持续推进，多点布局取得成效；国际化大平台建设平稳推进，香港业务获得突破，主要业务指标位列在港投行前列；资产负债管理能力进一步提升，抓住利率下行的有利时机实现对前期较高成本负债的置换；融资类业务规模排名稳居行业前列，积极拓展股票质押融资业务；研究业务市场地位进一步巩固，在 2016 年新财富最佳分析师评选中再创佳绩；创新步伐稳健，获得多项业务资格。

截至 2016 年末，发行人总资产 5608.66 亿元，归属于母公司净资产 1101.30 亿元。2016 年，发行人实现营业收入 280.12 亿元，归属于母公司净利润 80.43 亿元；加权平均净资产收益率 7.39%。其中：子公司实现收入 161.74 亿元，占比 58%；创新业务实现收入 104.02 亿元，占比 37%；海外业务实现收入 39.53 亿元，占比 14%。

公司各项主营业务情况：

#### （1）证券及期货经纪业务

2016 年，发行人股票基金交易金额市场占比 4.47%，行业排名第六，略有下滑。发行人客户数量保持较快增长，新增客户数 196 万户。发行人依托互联网、渠道及营销团队，客户基础得到进一步夯实，增量效益贡献明显。

发行人积极拓展股票质押融资业务，业务规模继续领跑市场。2016 年末，发行人融资类业务规模达到 1406 亿元（含海通资管公司），排名行业第一。

发行人深港通业务准备及推进工作扎实有效，获得市场和客户高度认可，业务规模行业领先；以 O2O 思路为发展方向、移动互联为核心的零售战略集约价值显著，有力提升集团大规模零售客户服务和扩张能力；满足高净值客户和机构客户等业务需求，将财富管理、产品投顾和托管服务等业务整合，构建新的业务链条，形成新的利润增长点。

发行人期货业务保持快速增长势头。2016 年，海通期货代理成交金额的市场份额为 8.43%，同比增加 2.53%，其中上海期货交易所市场份额 11.9%，中国金融期货交易所市场份额 8%，均排名行业第一。

发行人研究所在 2016 年新财富最佳分析师评选中再创佳绩，其中，宏观分析和策略分析排名行业首位，并在十个行业和板块研究领域排名行业前三。

2016 年，证券及期货经纪业务实现利润总额 51.77 亿元，占比 46.38%。

## （2）投资银行业务

发行人加大投行加强团队建设、推进项目拓展、加快报会项目落地，收入创历史新高。通过加强业务创新，完成一批具有市场影响力的标志性项目，其中，“长城电脑换股吸收合并长城信息重大资产重组项目”被国务院国资委列为央企整合典型案例；“招商蛇口换股吸收合并招商地产项目”为国内首例 A+B 股转 A 股整体上市案例；“巨人网络借壳”项目作为游戏行业中概股回归的首单，债券（300 亿元“浦发绿色金融债”），首单绿色企业债券（25 亿元“京汽绿色债”）和首单区域集合企业债券（23 亿元“恒建债”）。发行人股权融资主承销金额、债券融资主承销金额和并购交易总金额继续排名行业前列，其中企业债券承销金额为 443.9 亿元，行业排名第一。

2016 年，发行人投资银行业务实现利润总额 12.07 亿元，占比 10.81%。

## （3）自营业务

权益类投资业务面对不利的市场环境，超越业绩比较基准，取得较好投资业绩；固定收益类投资业务有效规避了年末债市波动的影响，超越业绩比较基准，取得较好投资业绩。发行人加大国债期货套利、货币市场套利、黄金租赁、利率互换交易等业务的资源投入，获得信用风险缓释工具核心交易商资格，公司 FICC 业务平台不断完善。

2016 年，发行人自营业务实现利润总额 21.55 亿元，占比 19.31%。

## （4）直投业务

2016 年发行人完成投资项目 90 个，总计投资金额 40 亿元；多个重点项目顺利退出，获得较好收益。海通开元荣获“投中 2016 年最活跃与最佳回报中资私募股权投资机构”前十名。

2016 年，发行人直投业务实现利润总额 8.35 亿元，占比 7.48%。

## （5）资产管理业务

发行人资产管理业务的三个主要平台——海通资管公司、海富通基金和富国基金的资产管理总规模达到 1.48 万亿元，增长 57%。

发行人 PE 业务旗下基金管理规模达到 185 亿元，全年新成立 8 只基金，外部募集资金实际到位 28 亿元。

2016 年，发行人资产管理业务实现利润总额 9.23 亿元，占比 8.27%。

#### (6) 融资租赁业务

海通恒信总资产达到 485 亿元，总资产收益率 2%，依托集团优势，开展差异化竞争，业务创新成为租赁业务发展的重要驱动力。零售业务上，继互联网零售产品“车融宝”完成迭代优化后，互联网零售保理产品“运通保”成功上线；机构业务上，完成了首单 PPP 租赁业务，丰富了发行人租赁业务的产品种类；国际业务上，在东京成田机场交付了第一架民航客机，该笔交易为发行人首单海外租赁业务，成功迈出了国际化的第一步。

2016 年，发行人融资租赁业务实现利润总额 11.17 亿元，占比 10.01%。

#### (7) 境外业务

通过近七年的整合与发展，海通国际已经发展成为公司在海外成熟的国际化业务平台，并确立了在香港中资证券机构中的龙头地位。2016 年海通国际证券主要业务指标位列在港投行前列，其中：IPO 发行承销数量和融资金额均排名第一，在近两年全球最大的 IPO 项目——邮政储蓄银行上市中担任联席账簿管理人；股权融资家数和融资金额均排名第二；债券承销家数和承销金额分别排名第一和第三；并购交易家数排名第一；资产管理规模突破 560 亿港元，位列香港中资券商及基金管理公司第一。发行人稳步推进对海通银行的组织架构调整和整合，利用海通银行在欧洲、美洲的业务平台，加强业务协同，业务发展上取得一定的突破，但由于欧洲及巴西宏观经济环境不景气以及整合带来较大一次性成本，海通银行的经营仍面临较大挑战。

2016 年，发行人境外业务实现利润总额 6.79 亿元，占比 6.09%。

### 三、发行人 2016 年度财务状况

#### 1、合并资产负债表主要数据

金额单位：人民币元

	2016 年末	2015 年末	增减率(%)
货币资金	121,024,751,374.94	165,012,537,050.77	-26.66
结算备付金	12,191,899,273.79	15,747,115,792.65	-22.58

	2016 年末	2015 年末	增减率(%)
拆出资金	705,848,143.60	184,333,865.52	282.92
融出资金	63,212,919,802.15	76,324,967,255.75	-17.18
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	92,347,493,554.98	110,440,406,126.01	-16.38
衍生金融资产	3,935,071,348.81	3,428,166,390.44	14.79
买入返售金融资产	84,523,225,559.75	77,468,848,342.99	9.11
存出保证金	8,952,031,305.02	7,558,629,056.50	18.43
可供出售金融资产	58,028,837,828.19	44,490,351,065.42	30.43
持有至到期投资	83,508,859.69	82,732,751.13	0.94
<b>资产总计</b>	<b>560,865,846,150.32</b>	<b>576,448,892,328.27</b>	<b>-2.70</b>
应付短期融资款	19,864,117,000.00	22,336,951,000.00	-11.07
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	38,639,631,004.32	31,025,611,838.24	24.54
卖出回购金融资产款	43,731,726,557.56	98,576,535,904.41	-55.64
代理买卖证券款	104,059,286,700.58	129,026,336,374.79	-19.35
长期借款	22,583,788,217.83	16,360,983,264.63	38.03
应付债券	128,295,192,262.28	100,599,408,063.76	27.53
<b>负债合计</b>	<b>438,907,444,778.41</b>	<b>459,521,221,374.63</b>	<b>-4.49</b>
股本	11,501,700,000.00	11,501,700,000.00	0.00
资本公积金	56,338,469,573.57	56,375,748,807.13	-0.07
未分配利润	26,331,639,342.89	25,319,984,185.00	4.00
归属于母公司所有者权益合计	110,130,127,286.66	107,694,544,738.79	2.26
少数股东权益	11,828,274,085.25	9,233,126,214.85	28.11
<b>所有者权益合计</b>	<b>121,958,401,371.91</b>	<b>116,927,670,953.64</b>	<b>4.30</b>

2016 年末,发行人总资产 5,608.66 亿元,较年初(5,764.49 亿元)减少 155.83 亿元,减幅 2.70%,主要变动情况是:货币资金、结算备付金及存出保证金减少 461.50 亿元,融出资金减少 131.12 亿元,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、可供出售及持有至到期等金融资产减少 45.54 亿元;应收款项类投资、长期应收款等其它资产增加 373.02 亿元,买入返售金融资产增加 70.54 亿元,长期股权投资增加 36.13 亿元。

发行人货币资金、结算备付金及存出保证金占总资产的比率为 25%,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、可供出售及持有至到期等金融

资产占发行人总资产的 27%，融出资金占总资产的 11%，买入返售金融资产占总资产的 15%，固定资产、在建工程及投资性房地产占公司总资产不到 1%，大部分资产变现能力较强，发行人资产流动性较强，资产结构优良。

2016 年末，发行人负债总额 4,389.07 亿元，较年初（4,595.21 亿元）减少 206.14 亿元，减幅 4.49%，主要变动情况是：卖出回购金融资产及拆入资金净减少 532.96 亿元，代理买卖证券款减少 249.67 亿元；应付债券增加 276.96 亿元，短期借款及长期借款增加 180.61 亿元，吸收存款、长期应付款等其它负债增加 65.25 亿元，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债增加 76.14 亿元。

## 2、合并利润表主要数据

金额单位：人民币元

	2016 年度	2015 年度	增减率 (%)
<b>营业收入</b>	<b>28,011,665,306.32</b>	<b>38,086,267,720.37</b>	<b>-26.45</b>
手续费及佣金净收入	10,965,008,854.57	17,970,455,503.56	-38.98
其中：经纪业务手续费净收入	5,314,409,804.29	12,586,494,530.37	-57.78
投资银行业务手续费净收入	3,356,019,560.06	2,316,181,565.27	44.89
资产管理业务手续费净收入	589,726,513.36	1,350,691,694.67	-56.34
利息净收入	3,839,610,355.40	4,755,593,972.68	-19.26
投资净收益	6,539,692,047.35	13,462,102,007.52	-51.42
公允价值变动净收益	-231,333,741.19	-1,923,524,032.53	-87.97
汇兑净收益	58,149,350.76	172,965,806.71	-66.38
其他业务收入	6,840,538,439.43	3,648,674,462.43	87.48
<b>营业支出</b>	<b>17,362,648,883.48</b>	<b>17,133,790,317.17</b>	<b>1.34</b>
<b>营业利润</b>	<b>10,649,016,422.84</b>	<b>20,952,477,403.20</b>	<b>-49.18</b>
<b>利润总额</b>	<b>11,161,726,994.30</b>	<b>21,118,868,459.10</b>	<b>-47.15</b>
<b>净利润</b>	<b>8,930,518,254.41</b>	<b>16,841,315,655.08</b>	<b>-46.97</b>
归属于母公司所有者的净利润	8,043,334,519.30	15,838,850,897.61	-49.22

2016 年度，发行人实现营业收入 280.12 亿元，同比（380.86 亿元）减少 100.75 亿元，减幅 26.45%，主要是公司经纪、自营等业务受市场因素影响而下降，但公司的投资银行业务收入实现较大幅度增长，公司的集团化战略取得了

显著的成效，子公司收入首次超过母公司收入。

其中：1) 经纪业务手续费净收入 53.14 亿元，同比（125.86 亿元）减少 72.72 亿元，减幅 57.78%，主要是二级市场交易较不活跃，成交量同比减少；2) 投资银行业务手续费净收入 33.56 亿元，同比（23.16 亿元）增加 10.40 亿元，增幅 44.89%，主要是证券承销业务收入和财务顾问业务收入增加；3) 资产管理业务手续费净收入 5.90 亿元，同比（13.51 亿元）减少 7.61 亿元，减幅 56.34%，主要是受市场影响，业绩报酬减少；4) 投资收益及公允价值变动收益合计 63.08 亿元，同比（115.39 亿元）减少 52.30 亿元，减幅 45.33%，主要是以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产投资收益减少；5) 利息净收入 38.40 亿元，同比（47.56 亿元）减少 9.16 亿元，减幅 19.26%，主要是融资业务利息收入及买入返售金融资产利息收入减少；6) 其他业务收入 68.41 亿元，同比（36.49 亿元）增加 31.92 亿元，增幅 87.48%，主要是子公司销售收入增加。

2016 年度，发行人营业支出 173.63 亿元，同比（171.34 亿元）增加 2.29 亿元，增幅 1.34%，主要变动情况是：1) 税金及附加 4.91 亿元，同比（19.15 亿元）减少 14.24 亿元，减幅 74.38%，主要是 2016 年 5 月起金融行业“营改增”的影响及应税收入减少；2) 业务及管理费 95.64 亿元，同比（112.14 亿元）减少 16.51 亿元，减幅 14.72%，主要是职工薪酬减少；3) 资产减值损失 14.19 亿元，同比（10.91 亿元）增加 3.29 亿元，增幅 30.13%，主要是本期计提发放贷款和垫款减值损失增加；4) 其他业务成本 58.89 亿元，同比（29.14 亿元）增加 29.75 亿元，增幅 102.10%，主要是子公司销售成本增加。

### 3、合并现金流量表主要数据

金额单位：人民币元

	2016 年度	2015 年度	增减率 (%)
经营活动现金流入小计	79,683,449,490.81	98,492,299,387.09	-19.10
经营活动现金流出小计	129,861,130,959.31	82,909,301,087.01	56.63
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>	<b>-50,177,681,468.50</b>	<b>15,582,998,300.08</b>	<b>-422.00</b>
投资活动现金流入小计	61,502,727,135.13	42,310,778,934.10	45.36
投资活动现金流出小计	93,080,525,042.53	78,277,172,060.06	18.91
<b>投资活动产生的现金流量净额</b>	<b>-31,577,797,907.40</b>	<b>-35,966,393,125.96</b>	<b>12.20</b>
筹资活动现金流入小计	139,052,990,631.05	242,871,571,677.14	-42.75

	2016 年度	2015 年度	增减率 (%)
筹资活动现金流出小计	105,698,114,499.48	145,793,651,490.83	-27.50
筹资活动产生的现金流量净额	<b>33,354,876,131.57</b>	<b>97,077,920,186.31</b>	<b>-65.64</b>
现金及现金等价物净增加额	<b>-46,870,013,234.08</b>	<b>77,553,907,649.96</b>	<b>-160.44</b>

2016 年度，发行人经营活动产生的现金流量净额为-501.78 亿元，其中：现金流入 796.83 亿元，占现金流入总量的 28.43%，主要是收取利息、手续费及佣金的现金 219.67 亿元，处置以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产净增加额 281.98 亿元；现金流出 1298.61 亿元，占现金流出总量的 39.52%，主要是回购业务资金净减少 634.86 亿元，代理买卖证券支付的现金净额 249.67 亿元，支付融资租赁款项、保理及贷款款项 88.67 亿元，给职工及为职工支付的现金 66.06 亿元支付利息、手续费及佣金的现金 59.52 亿元。

2016 年度，发行人投资活动产生的现金流量净额为-315.78 亿元，其中：现金流入 615.03 亿元，占现金流入总量的 21.95%，主要是收回可供出售金融资产等收到现金 592.58 亿元；现金流出 930.81 亿元，占现金流出总量的 28.32%，主要是投资可供出售金融资产等支付现金 926.28 亿元。

2016 年度，发行人筹资活动产生的现金流量净额为 333.55 亿元，其中：现金流入 1,390.53 亿元，占现金流入总量的 49.62%，主要是公司发行债券收到现金 1,039.73 亿元；现金流出 1,056.98 亿元，占现金流出总量的 32.16%，主要是偿还债务支付现金 917.61 亿元。

2016 年度，发行人经营活动产生的现金流量由净流入转为净流出，主要是由回购业务资金净减少及代理买卖证券款减少导致。2016 年，发行人筹资活动产生的现金净流入大幅减少，主要是由吸收投资收到的现金大幅降低及发行债券金额大幅下降引起。



## 第三节 发行人募集资金使用情况

### 一、本期债券募集资金情况

发行人经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]1220 号文批准，于 2014 年 7 月 16 日公开发行了第二期人民币 110 亿元的公司债券。

本期公司债券募集资金总额已于 2014 年 7 月 16 日汇入发行人指定的银行账户。发行人聘请立信会计师事务所（特殊普通合伙）对网上发行认购资金情况出具编号为“信会师报字[2014]第 113875 号”的验资报告；对网下配售认购资金情况出具编号为“信会师报字[2014]第 113874 号”的验资报告；对募集资金到位情况出具编号为“信会师报字[2014]第 113873 号”的验资报告。

根据发行人 2014 年 7 月 10 日公告的本期公司债券募集说明书的相关内容，发行人对本期公司债券募集资金的使用计划为补充公司营运资金，改善公司财务结构。

### 二、本期债券募集资金实际使用情况

本期债券的募集资金净额于 2014 年 7 月 16 日汇入发行人指定银行账户，已用于补充公司营运资金，改善公司财务结构。

## 第四节 本期债券利息偿付情况

本期债券 3 年期品种的付息日为 2015 年至 2017 年每年的 7 月 14 日,前述日期如遇法定节假日或休息日,则兑付顺延至下一个工作日,顺延期间不另计息;本期债券 5 年期品种的付息日为 2015 年至 2019 年每年的 7 月 14 日,前述日期如遇法定节假日或休息日,则兑付顺延至下一个工作日,顺延期间不另计息;本期债券 10 年期品种的付息日为 2015 年至 2024 年每年的 7 月 14 日,前述日期如遇法定节假日或休息日,则兑付顺延至下一个工作日,顺延期间不另计息。

2016 年 7 月 14 日,发行人向截止 2016 年 7 月 13 日上海证券交易所收市后,在中证登上海分公司登记在册的全部“13 海通 04”、“13 海通 05”和“13 海通 06”公司债券持有人支付了自 2015 年 7 月 14 日至 2016 年 7 月 13 日期间的利息。

## 第五节 债券持有人会议召开情况

2016年，本期公司债未召开持有人会议。

## 第六节 公司债券担保人资信情况

本期债券为无担保债券。

## 第七节 本期公司债券的信用评级情况

“13 海通 04”、“13 海通 05”、“13 海通 06”的信用评级机构为中诚信证券评估有限公司（以下简称“中诚信证评”）。中诚信证评于 2014 年完成了对本期债券的初次评级。根据《海通证券股份有限公司 2013 年公司债券（第二期）信用评级报告》及《信用等级通知书》（信评委函字[2014]16 号），经中诚信证评综合评定，发行人的主体信用等级为 AAA，本期债券的信用等级为 AAA。

根据中国证监会相关规定、评级行业惯例以及中诚信证评评级制度相关规定，自首次评级报告出具之日（以评级报告上注明日期为准）起，中诚信证评将在本期债券信用级别有效期内或者本期债券存续期内，持续关注本期债券发行人外部经营环境变化、经营或财务状况变化以及本期债券偿债保障情况等因素，以对本期债券的信用风险进行持续跟踪。跟踪评级包括定期和不定期跟踪评级。

在跟踪评级期限内，中诚信证评将于发行主体年度报告公布后一个月内完成该年度的定期跟踪评级，并发布定期跟踪评级结果及报告；在此期限内，如发行主体发生可能影响本期债券信用级别的重大事件，应及时通知中诚信证评，并提供相关资料，中诚信证评将就该项进行调研、分析并发布不定期跟踪评级结果。

根据中诚信证评于 2016 年 4 月 27 日出具的《海通证券股份有限公司 2013 年公司债券（第二期）跟踪评级报告（2016）》（信评委函字[2016]跟踪 048 号），中诚信证评对“海通证券股份有限公司 2013 年公司债券(第二期)”的信用状况进行了跟踪分析。经中诚信证评信用评级委员会最后审定，维持公司主体信用等级为 AAA，评级展望稳定；维持本期债券的信用等级为 AAA。

中诚信证评将于近期根据发行人 2016 年年度报告，出具本期公司债券的跟踪评级报告，详细情况敬请投资者关注。

## 第八节 负责处理与公司债券相关事务专人的变动情况

报告期内，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 其他情况

### 一、担保情况

截至 2016 年 12 月 31 日，发行人担保情况如下：

单位：人民币元

公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）													
担保方	担保方与上市公司的关系	被担保方	担保金额	担保发生日期 (协议签署日)	担保起始日	担保到期日	担保类型	担保是否已经履行完毕	担保是否逾期	担保逾期金额	是否存在反担保	是否为关联方担保	关联关系
报告期内担保发生额合计（不包括对子公司的担保）													
报告期末担保余额合计（A）（不包括对子公司的担保）													
公司及其子公司对子公司的担保情况													
报告期内对子公司担保发生额合计							11,677,443,882						
报告期末对子公司担保余额合计（B）							30,042,027,872						
公司担保总额情况（包括对子公司的担保）													
担保总额（A+B）							30,042,027,872						
担保总额占公司净资产的比例(%)							27.3						
其中：													
为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（C）							-						
直接或间接为资产负债率超过 70%的被担保对象提供的债务担保金额（D）							19,279,354,000						
担保总额超过净资产 50%部分的金额（E）							-						
上述三项担保金额合计（C+D+E）							19,279,354,000						
未到期担保可能承担连带清偿责任说明													
担保情况说明													
<p>1.2016 年 8 月 29 日，公司第六届董事会十八次会议审议通过了《关于公司为海通资管追加净资本担保承诺及对其增加注册资本的议案》，同意公司对海通资管追加不超过人民币 40 亿元的净资本担保承诺。公司为海通资管提供最高额度为人民币 40 亿元的净资本担保承诺，并承诺当海通资管开展业务需要现金支持时，公司将无条件在上述额度内提供现金。净资本担保承诺期限自公司董事会审议通过之日起生效。就本次净资本担保事宜，海通资管已于近日获得中国证券监督管理委员会上海监管局出具的《关于对海通证券股份有限公司向上海海通证券资产管理有限公司出具净资本担保承诺书的无异议函》（沪证监机构字[2016]325 号）。</p> <p>2.2015 年 2 月 9 日，公司 2015 年第一次临时股东大会、2015 年度第一次 A 股/H 股类别股东大会审议通过了《关于新增对外担保额度的议案》，公司拟为公司在境外的全资附属公司一次或多次或多期公开或非公开发行的境外债务融资工具，且境外公司债务融资工具的规模合共不超过公司最近一期末公司净资产额的 50%，提供连带责任保证担保。2015 年 6 月 5 日，公司第六届董事会第六次会议审议通过了《关于为境外全资附属公司发行欧元债提供连带责任保证担保的议案》。鉴于本次发行的实际情况，本次发行将分两次交割，因此将分两次签署《担保协议》，公司于 2016 年 5 月 18 日签署第一份《担保协议》，为公司境外全资附属公司 Haitong International Finance Holdings 2015 Limited 发行金额为 1 亿欧元、于 2021 年到期、票面利率为 1.6% 的欧元债券（以下简称“本次发行”），提供连带责任保证担保。公司于 2016 年 5 月 26 日签署第二份《担保协议》，为公司境外全资附属公司 Haitong International Finance Holdings 2015 Limited 发行金额为 1.2 亿欧元、于 2021 年到期、票面利率为 1.6% 的欧元债券（以下简称“本次</p>													

发行”), 提供连带责任保证担保。

3.2016年3月30日,公司第六届董事会第十五次会议审议通过了《关于为子公司提供融资担保的议案》。2016年5月26日,公司2015年度股东大会审议通过了《关于提请股东大会授权董事会决定子公司担保事宜的议案》,公司拟为全资附属子公司(包括资产负债率超过70%的全资附属子公司)和控股子公司一次或多次或多期公开或非公开发行境内或境外的债务融资工具(包括但不限于债券、次级债券、超短期融资券、短期融资券、中期票据、票据、成立票据计划等)以及境内或境外银行贷款(包括但不限于银行授信、银行贷款、银团贷款等),且公司对外担保规模合计不超过公司最近一期末公司经审计净资产额的50%,以及单笔担保额不超过最近一期末公司经审计净资产10%,提供连带责任保证担保。公司于2016年5月31日签署《担保协议》,为境外间接全资附属公司Haitong Investment Ireland Public Limited Company向银团贷款提供7.5亿欧元的连带责任保证(以下简称“本次担保”)。本次新融资是为了替换此前Novo Banco, S.A.(以下简称“NB”)向发行人境外附属公司Banco Espírito Santo de Investimento, S.A.(现更名为Haitong Bank, S.A.,以下简称“海通银行”)提供的7.5亿欧元贷款(以下简称“NB贷款”)议案决定担保的新融资的本金金额不超过8亿欧元,担保期限不超过5年,并将撤销公司原来对NB贷款的担保。同时,海通银行将与被担保人签署双边贷款协议,并根据与NB达成的协议将所得资金提前偿还原NB贷款,公司原来对NB贷款的担保义务撤销。本次撤销的担保是公司为收购海通银行于2015年9月7日签署的担保协议,该笔担保的担保人为发行人,被担保人为Banco Espírito Santo de Investimento, S.A.(现更名为Haitong Bank, S.A.),债权人为Novo Banco, S.A.,担保金额为7.5亿欧元本金及利息,担保期限为3年。本次担保相关的《融资协议》签署于2016年5月31日,其中的担保条款规定,担保人为发行人,被担保人为HIIP,牵头行为中国建设银行股份有限公司伦敦分行,代理行为中国建设银行股份有限公司法兰克福分行,担保金额为7.5亿欧元贷款本金、利息、前端费、借款人应当承担的其他费用等,担保期限为5年。

4.2015年4月13日,公司第六届董事会第三次会议审议通过了《关于为境外全资附属公司发行美元债提供连带责任保证担保的议案》。公司就境外的全资附属公司Haitong International Finance Holdings 2015 Limited发行金额为6.7亿美元、于2020年到期、票面利率为3.5%的美元债券,提供连带责任保证担保。

5.公司于2013年10月发行首期境外债券(9亿美元),发行主体为间接全资附属公司Haitong International Finance Holdings Limited。为增强本次首期境外债券的偿债保障,降低发行利率,根据公司2013年度第一次临时股东大会的授权,公司获授权人士确定由中国银行新加坡分行以开立备用信用证方式为本次首期境外债券提供担保。同时,根据第五届董事会第二十一次会议决议,公司就发行的首期境外债券开立的备用信用证向中国银行出具反担保函,反担保金额为发行的首期境外债券本金、利息及其他相关费用。保证方式为连带责任保证,保证期结束日期为备用信用证有效期届满之日起六个月。

6.公司第五届董事会第十二次会议审议通过了《关于对上海海通证券资产管理有限公司提供净资本担保承诺的议案》,董事会同意发行人随时对资产管理子公司提供不超过十五亿元的净资本担保承诺,以保证其净资本保持充足。2013年6月9日,上海证监局下发《关于海通证券股份有限公司向上海海通证券资产管理有限公司出具净资本担保承诺书的无异议函》(沪证监机构字[2013]145号),同意发行人向资产管理子公司提供8亿元的担保承诺。发行人扣减了8亿元净资本,并相应增加资管子公司8亿元净资本。

注:2016年度子公司海通银行对外担保发生额合计(不包括对子公司的担保)为32,857,813欧元。按2016年12月30日银行间外汇市场人民币汇率中间价1欧元对人民币7.3068元,合计为240,085,468元人民币。2016年末对外担保余额合计(不包括对子公司的担保)为220,021,435欧元,按2016年12月30日银行间外汇市场人民币汇率中间价1欧元对人民币7.3068,合计为1,607,652,621元人民币。

2016年子公司海通国际证券由于借贷、发债或业务需要对其下属业务子公司或SPV提供担保,发生额为23,469,000,000港币。按2016年12月30日银行间外汇市场人民币汇率中间价1港币对人民币0.89451元,发生额合计为20,993,255,190元人民币。2016年末对内担保余额合计75,469,000,000港元。按2016年12月30日银行间外汇市场人民币汇率中间价1港币对人民币0.89451元,余额合计为67,507,775,190元人民币。

## 二、涉及的未决诉讼或仲裁事项

截至2016年12月31日,发行人不存在《上海证券交易所股票上市规则》中要求披露的涉案金额超过1000万元并且占发行人最近一期经审计净资产绝对值10%以上的重大诉讼、仲裁事项,不存在媒体普遍质疑的事项。

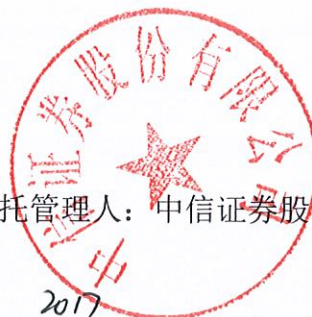


### 三、 相关当事人

2016 年度，本期公司债券的受托管理人和资信评级机构均未发生变动。

(本页无正文，为《海通证券股份有限公司 2013 年公司债券（第二期）受托管理事务报告（2016 年度）》之盖章页)

债券受托管理人：中信证券股份有限公司



2017 年 4 月 27 日