

股票简称：华泰证券
债券简称：15 华泰 02、15 华泰 03

股票代码：601688
债券代码：123099、123100



**华泰证券股份有限公司 2015 年第二期次级债券
受托管理事务报告
(2016 年度)**

债券受托管理人:光大证券股份有限公司



二〇一七年六月

重要声明

光大证券股份有限公司（简称“光大证券”）编制本报告的内容及信息均来源于发行人2017年3月对外公布的《华泰证券股份有限公司2016年年度报告》等相关公开信息披露文件、第三方中介机构出具的专业意见以及华泰证券股份有限公司出具的相关说明文件等。

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作出独立判断，而不应将本报告中的任何内容据以作为光大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，光大证券不承担任何责任。

目 录

第一章 发行人概况	3
第二章 本期债券基本情况.....	5
第三章 已发行债券情况.....	8
第四章 受托管理人履行职责情况.....	9
第五章 发行人的经营与财务状况.....	10
第六章 发行人募集资金使用情况.....	16
第七章 本期债券的本息偿付情况.....	17
第八章 发行人及其他相关当事人对募集说明书其他约定义务的执行情况.....	18
第九章 债券持有人会议召开的情况.....	20
第十章 本期次级债券担保人资信情况.....	21
第十一章 负责处理次级债券相关事务的专人变动情况.....	22
第十二章 其它事项	23

第一章 发行人概况

公司法定中文名称：华泰证券股份有限公司

公司法定英文名称：HUATAI SECURITIES CO.,LTD

境内股票简称：华泰证券

境内股票代码：601688

境内股票上市交易所：上海证券交易所（A股）

境外股票简称：HTSC

境外股票代码：6886

境外股票上市交易所：香港联合交易所有限公司（H股）

法定代表人：周易

成立时间：1991年4月9日

注册资本：人民币716,276.88万元

实缴资本：人民币716,276.88万元

住所：江苏省南京市江东中路228号

邮政编码：210019

信息披露事务负责人：张辉

联系电话：025-83387788

传真：025-83387784

所属行业：金融业

经营范围：证券经纪业务；证券自营；证券承销业务（限承销国债、非金融企业债务融资工具、金融债（含政策性金融债））；证券

投资咨询；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品业务；证券投资基金代销；证券投资基金托管；黄金等贵金属现货合约代理和黄金现货合约自营业务，股票期权做市业务；中国证监会批准的其他业务

统一社会信用代码：91320000704041011J

互联网网址：<http://www.htsc.com.cn>

第二章 本期债券基本情况

(一) **债券名称**: 华泰证券股份有限公司2015年第二期次级债券。

(二) **债券简称**: 分2年期、5年期两个品种, 其中2年期品种债券简称为“15华泰02”, 债券代码“123099”; 5年期品种债券简称为“15华泰03”, 债券代码“123100”。

(三) **发行主体**: 华泰证券股份有限公司。

(四) **债券类型**: 证券公司次级债券, 是由证券公司向机构投资者发行的、清偿顺序在普通债之后的有价证券。

(五) **发行规模**: 人民币120亿元。

(六) **债券期限**: 分2年期、5年期两个品种, 其中2年期品种70亿, 附第1年末发行人赎回选择权。5年期品种50亿, 附第3年末发行人赎回选择权。

(七) **票面利率及其确定方式**: 本期次级债券的票面年利率将由发行人根据询价情况确定, 票面年利率在债券存续期内保持不变。若发行人未行使赎回权利, 则本期次级债券在其存续期之后年度的票面利率为初始发行利率基础上提高300个基点。

(八) **债券面值**: 人民币壹佰元。

(九) **发行价格**: 按面值平价发行。

(十) **发行方式**: 由主承销商光大证券以非公开方式发行。

(十一) **发行对象**: 符合《证券公司次级债管理规定》及相关法律法规规定的证券公司次级债券机构投资者, 且每期债券的机构投资

者合计不超过200人。

(十二) 发行日：2015年4月20日。

(十三) 缴款日：2015年4月21日。

(十四) 本次次级债券的本息支付安排

1、起息日：2015年4月21日。

2、付息日：债券存续期内每年的4月21日，如遇法定节假日或休息日，则顺延至其后的第一个工作日，顺延期间付息款项不另计息。

3、兑付日：2年期品种的兑付日为2017年4月21日，若发行人行使赎回选择权，则兑付日为2016年4月21日；5年期品种的兑付日为2020年4月21日，若发行人行使赎回选择权，则兑付日为2018年4月21日。如遇法定节假日或休息日，则顺延至其后的第一个工作日，顺延期间兑付款项不另计息。

4、计息期限：2年期品种的计息期限自2015年4月21日至2017年4月20日，若发行人行使赎回选择权，则计息期限自2015年4月21日至2016年4月20日；5年期品种的计息期限自2015年4月21日至2020年4月20日，若发行人行使赎回选择权，则计息期限自2015年4月21日至2018年4月20日。

5、还本付息方式：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。年度付息款项自付息日起不另计利息，本金自本金兑付日起不另计利息。

(十五) 担保情况：无担保。

(十六) 募集资金用途：本次发行的次级债券募集资金扣除发行

等相关费用后，将主要用于补充营运资金。根据公司当前的业务发展需要，资金投向主要包括：①扩大融资融券业务规模；②扩大约定购回式证券交易和股票质押式回购交易业务规模；③扩大资产管理业务自有资金投入规模；④扩大其他创新业务规模。募集资金具体使用时将根据各项业务的实际需要进行调整。

（十七）债券转让：本次发行结束后，发行人将尽快向上交所提出关于本期次级债券在上交所固定收益证券综合电子平台进行挂牌转让的申请。本期次级债券的转让方和受让方须遵守上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的相关业务规范，受让方须具备《证券公司次级债管理规定》及相关法律法规规定的证券公司次级债券机构投资者条件。发行和转让后本期次级债券持有人不得超过200人。自本期次级债券到期偿付日前的第二个交易日起，上海证券交易所将终止本期次级债券的转让服务。

（十八）登记、托管机构：中国证券登记结算有限责任公司。

（十九）税务提示：根据国家有关税收法律、法规的规定，投资者投资本次次级债券所应缴纳的税款由投资者承担。

第三章 已发行债券情况

截至本报告出具日，发行人境内尚未到期债券余额为 696 亿元，

明细情况详见下表：

截至本报告出具日发行人公司债券余额明细表

债券代码	债券简称	债券余额 (亿元)	利率 (%)	起息日	到期日	结构
125978	15 华泰 04	180.00	5.50%	2015-6-26	2017-6-26	2
122261	13 华泰 01	40.00	4.68%	2013-6-05	2018-6-05	5
122388	15 华泰 G1	66.00	4.20%	2015-6-29	2018-6-29	3
145351	17 华泰 01	60.00	4.50%	2017-2-24	2018-8-24	1.5
145039	16 华泰 C2	30.00	3.12%	2016-10-21	2019-10-21	2+1
136851	16 华泰 G1	35.00	3.57%	2016-12-06	2019-12-06	3
136873	16 华泰 G3	50.00	3.79%	2016-12-14	2019-12-14	3
145352	17 华泰 02	20.00	4.65%	2017-2-24	2020-2-24	3
123100	15 华泰 03	50.00	5.80%	2015-4-21	2020-4-21	3+2
145029	16 华泰 C1	50.00	3.30%	2016-10-14	2021-10-14	3+2
136852	16 华泰 G2	25.00	3.78%	2016-12-06	2021-12-06	5
136874	16 华泰 G4	30.00	3.97%	2016-12-14	2021-12-14	5
122262	13 华泰 02	60.00	5.10%	2013-6-05	2023-6-05	10

第四章 受托管理人履行职责情况

光大证券股份有限公司作为本期债券受托管理人，已根据相关法律、法规和规则的规定以及《债券受托管理协议》的约定制定受托管理业务内部操作规则，明确履行受托管理事务的方式和程序，并于2016年4月出具了《华泰证券股份有限公司2015年第二期次级债券受托管理报告（2015年度）》，对发行人履行《募集说明书》及《债券受托管理协议》约定义务的情况进行了持续跟踪和监督。

2016年度，经受托管理人持续关注和调查了解，发行人的经营状况正常，财务状况稳健，资信状况良好，本期债券募集资金的使用与募集说明书的相关承诺一致，不存在可能影响债券持有人重大权益的事项。同时受托管理人持续督导发行人履行信息披露义务。综上所述，受托管理人较好的履行了职责，为保护本期债券投资者的利益发挥了积极作用。

第五章 发行人的经营与财务状况

（一）发行人 2016 年度经营情况

截至2016年12月31日，公司拥有证券营业部242家，旗下控股华泰联合证券有限责任公司、华泰期货有限公司、江苏股权交易中心有限责任公司；全资设立华泰金融控股（香港）有限公司、华泰紫金投资有限责任公司、华泰创新投资有限公司、华泰证券（上海）资产管理有限公司；参股南方基金管理有限公司、华泰柏瑞基金管理有限公司，已基本形成集证券、基金、期货、直接投资和海外业务等为一体的、国际化的证券控股集团架构，综合实力和盈利能力居全国券商前列。

公司主营业务主要分为经纪及财富管理业务、投资银行业务、资产管理业务、投资及交易业务、海外业务。2016年，公司各主要业务收入及成本占比情况如下：

单位：人民币 万元

业务类别	营业收入		营业成本	
	金额	占比(%)	金额	占比(%)
经纪及财富管理业务	1,019,762.99	60.28	467,914.53	54.93
投资银行业务	239,837.85	14.18	148,631.85	17.45
资产管理业务	279,440.88	16.52	74,442.40	8.74
投资与交易业务	170,768.06	10.09	27,201.01	3.19
海外业务及其他	-18,107.84	-1.07	133,717.06	15.70
合计	1,691,701.94	100.00	851,906.86	100.00

2016年，公司各主要业务毛利情况如下：

单位：人民币 万元

业务类别	毛利		毛利率(%)
	金额	占比(%)	
经纪及财富管理业务	551,848.46	65.71	54.12
投资银行业务	91,206.00	10.86	38.03

资产管理业务	204,998.48	24.41	73.36
投资与交易业务	143,567.05	17.10	84.07
海外业务及其他	-151,824.90	-18.08	-838.45
合计	839,795.08	100.00	49.64

1、经纪及财富管理业务

经纪及财富管理业务主要包括证券与期货经纪、金融产品销售、机构销售与研究、资本中介业务等。证券与期货经纪业务方面，公司主要代理客户买卖股票、基金、债券及期货，提供便捷交易服务。金融产品销售业务方面，公司主要向客户提供各种金融产品销售服务和资产配置服务，相关金融产品由公司及其他金融机构管理。机构销售与研究业务方面，公司向机构客户推广和销售证券产品及服务，并提供各种专业化研究服务，协助机构客户作出投资决策。资本中介业务方面，公司向客户提供融资融券、股票质押式回购等多样化融资服务。

经纪及财富管理业务主要业绩驱动因素包括手续费及佣金收入、利息收入等。报告期内，公司经纪及财富管理业务实现营业收入人民币1,019,762.99万元，同比减少43.30%；营业成本人民币467,914.53万元，同比减少20.15%；毛利率54.12%，同比减少13.30个百分点。

2、投资银行业务

投资银行业务主要包括股权承销、债券承销、财务顾问、场外业务等。股权承销业务方面，公司为国内企业客户提供IPO及股权再融资服务。债券承销业务方面，公司为国内企业客户提供各类债券融资服务。财务顾问业务方面，公司从产业布局与策略角度为国内企业客户提供以并购为主的财务顾问服务。场外业务方面，公司作为主办券商提供推荐服务，帮助非上市公司于新三板挂牌并进行股份转让，并

为挂牌企业提供后续融资服务；公司出资设立的江苏股权交易中心为公司其他业务提供交叉销售机会并帮助公司为私募股权基金探索及发掘更多投资机会。

投资银行业务主要业绩驱动因素包括顾问费、承销及保荐费等。报告期内，公司投资银行业务实现营业收入人民币239,837.85万元，同比增加29.18%；营业成本人民币148,631.85万元，同比增加22.32%；毛利率38.03%，同比增加3.48个百分点。

3、资产管理业务

资产管理业务主要包括证券公司资产管理、私募股权基金管理以及基金公司资产管理业务等。证券公司资产管理业务方面，公司通过全资子公司华泰资管公司参与经营证券公司资产管理业务，包括集合资产管理业务、定向资产管理业务、专项资产管理业务与公募基金管理业务（含大集合）。私募股权基金管理业务方面，公司通过全资子公司华泰紫金投资开展直接投资业务，包括私募股权基金的投资与管理。基金公司资产管理业务方面，公司持有两家公募基金管理公司南方基金和华泰柏瑞的非控股权益，通过其参与经营基金公司资产管理业务。

资产管理业务主要业绩驱动因素包括管理费及业绩表现费、投资收益等。报告期内，公司资产管理业务实现营业收入人民币279,440.88万元，同比增加29.03%；营业成本人民币74,442.40万元，同比增加41.50%；毛利率73.36%，同比减少2.35个百分点。

4、投资及交易业务

投资及交易业务主要包括权益证券投资及交易、固定收益投资及交易、OTC金融产品与交易业务等。权益证券投资及交易业务方面，公司以自有资金开展股票、ETF及衍生工具的投资与交易，并从事交易所买卖金融产品的做市服务等。固定收益投资及交易业务方面，公司在银行间债券市场及股票交易所开展各类固定收益类证券的交易业务及衍生工具的交易业务，并从事银行间债券市场的做市商业业务等。OTC金融产品与交易业务方面，公司为客户提供及交易OTC金融产品，主要包括权益类收益互换、收益凭证与资产管理计划等，并从事新三板做市报价服务等。

投资及交易业务主要业绩驱动因素包括投资收益等。报告期内，公司投资及交易业务实现营业收入人民币170,768.06万元，同比减少53.15%；营业成本人民币27,201.01万元，同比减少61.35%；毛利率84.07%，同比增加3.38个百分点。

5、海外业务及其他

公司通过全资子公司华泰金控（香港）参与经营海外业务，主要包括投资银行、销售及交易、资产管理业务等。投资银行业务方面，公司保荐中国及外国公司于香港联交所进行首次公开发售、股权及债券承销、跨境并购咨询并为客户提供融资方案。销售及交易业务方面，公司提供证券交易及做市服务以及固定收益类、信用、期货合约及结构产品，并为客户提供度身定制的产品，也向零售及机构客户提供全球证券、期货经纪服务及融资服务。资产管理业务方面，公司向机构客户、高净值及零售客户提供组合及基金管理服务，也利用香港离岸

人民币中心的领先地位开发各类人民币资产管理产品。

海外业务主要业绩驱动因素包括经纪佣金、承销保荐费、顾问费、利息收入及资产管理费等。报告期内，公司海外业务实现营业收入人民币22,150.13万元，同比减少39.07%；营业成本人民币57,583.66万元，同比增加101.95%；毛利率-159.97%，同比减少181.74个百分点。

（二）发行人 2016 年度财务情况

发行人2016年按照中国企业会计准则编制的财务报告已经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计，并出具了标准无保留意见的审计报告，主要财务数据如下：

1、合并资产负债表主要数据

单位：人民币 亿元

项目	2016-12-31	2015-12-31	增减率
资产合计	4,014.50	4,526.15	-11.30%
负债合计	3,157.90	3,710.86	-14.90%
归属于母公司所有者权益合计	843.57	807.85	4.42%
所有者权益合计	856.60	815.29	5.07%

2、合并利润表主要数据

单位：人民币 亿元

项目	2016年度	2015年度	增减率
营业收入	169.17	262.62	-35.58%
营业利润	83.98	142.70	-41.15%
利润总额	85.93	142.63	-39.75%
净利润	65.19	107.98	-39.63%
归属于母公司所有者的净利润	62.71	106.97	-41.38%

3、合并现金流量表

单位：人民币 亿元

项目	2016年度	2015年度	增减率
经营活动产生的现金流量净额	-153.56	148.20	-203.62%
投资活动产生的现金流量净额	-44.63	-211.22	不适用
筹资活动产生的现金流量净额	-50.10	538.33	-109.31%

现金及现金等价物净增加额	-243.20	479.50	-150.72%
--------------	---------	--------	----------

4、发行人主要财务指标

财务指标	2016年12月31日 /2016年度	2015年12月31日 /2015年度
资产负债率（%）	72.25%	74.85%
流动比率（倍）	3.54	3.53
速动比率（倍）	3.54	3.53

(1) 流动比率=流动资产/流动负债

(2) 速动比率=(流动资产-存货)/流动负债

(3) 资产负债率=负债合计/资产总计*100%

第六章 发行人募集资金使用情况

一、本期次级债券募集资金情况

本期次级债券合计发行人民币120亿元，其中15华泰02发行规模为人民币70亿元，15华泰03发行规模为人民币50亿元。上述认购金额人民币12,000,000,000.00元（大写壹佰贰拾亿元整）于2015年4月21日全部缴存于发行人指定的银行账户。

二、本期次级债券募集资金实际使用情况

根据发行人本期债券募集说明书的相关内容，本期债券的募集资金扣除发行等相关费用后，将主要用于补充营运资金。根据公司业务发展需要，资金投向主要包括：①扩大融资融券业务规模；②扩大大约定期购回式证券交易和股票质押式回购交易业务规模；③扩大资产管理业务自有资金投入规模；④扩大其他创新业务规模。截至本报告出具日，发行人已将本期债券募集资金按照募集说明书的有关约定全部补充营运资金，资金投向符合募集说明书的要求，截至本报告出具日，本期债券募集资金已使用完毕。

第七章 本期债券的本息偿付情况

本期次级债券于2015年4月21日正式起息。

2年期品种债券“15华泰02”第1个计息年度付息日为2016年4月21日。根据《募集说明书》的约定，华泰证券可于“15华泰02”第1个计息年度付息日前的第30个交易日，决定是否行使发行人赎回选择权。华泰证券经营管理层于2016年3月21日做出《关于华泰证券股份有限公司2015年第二期次级债券(2年期)行使赎回选择权的决定》，决定行使“15华泰02”次级债券发行人赎回选择权，对赎回登记日登记在册的“15华泰02”次级债券全部赎回。华泰证券已于2016年3月25日、2016年3月29日和2016年4月1日分别发布《华泰证券股份有限公司关于行使“15华泰02”次级债券发行人赎回选择权的提示性公告》，于2016年4月8日发布《华泰证券股份有限公司关于实施“15华泰02”次级债券赎回的公告》，于2016年4月14日发布《华泰证券股份有限公司2015年第二期次级债券兑付、兑息公告》，于2016年4月19日发布《华泰证券股份有限公司关于行使“15华泰02”次级债券赎回结果及摘牌公告》，于2016年4月21日发布《华泰证券股份有限公司关于2015年第二期次级债券(2年期)兑付完成的公告》。

5年期品种债券“15华泰03”第1个计息年度付息日为2016年4月21日，第2个计息年度付息日为2017年4月21日，截至本报告出具日，“15华泰03”已完成两次付息。

第八章 发行人及其他相关当事人对募集说明书其他约定 务的执行情况

（一）年度报告和审计报告披露情况

发行人作为上市公司，已按规定于2017年3月披露了《2016年年度报告》和《2016年度审计报告》，符合相关规定。

（二）本期次级债券的跟踪评级情况

1、跟踪评级安排

2016年4月，上海新世纪资信评估投资服务有限公司（以下简称“新世纪评级”）给予华泰证券主体评级AAA，评级展望为稳定，本期5年期次级债券（15华泰03）AA+评级；2017年5月，新世纪评级给予华泰证券主体评级AAA，评级展望为稳定，给予本期5年期次级债券（15华泰03）AA+评级。

2、跟踪评级观点

跟踪期内，受国内资本市场持续震荡影响，华泰证券经纪及财富管理业务、投资及交易业务营收及利润出现一定下滑，投资银行和资产管理业务保持增长，公司整体盈利结构持续优化。随着短期债务陆续到期，公司杠杆经营程度有所下降，但融资融券等资本中介业务的波动将持续挑战公司外部融资能力，公司仍需加强流动性风险管理能力，以应对突发性流动性风险事件。同时，公司创新业务的持续推进，将不断考验公司的风险管理能力。

（1）领先的市场地位。华泰证券特许经营资质较为齐全，主要

业务市场份额位居行业前列，业务综合竞争力处于行业领先水平。

（2）业务结构均衡。华泰证券各项业务发展逐步趋于均衡，业务结构有所优化。

（3）股东支持。华泰证券实际控制人为江苏省国资委，公司在业务发展过程中能够得到地方政府在政策与资源等方面的有力支持。

（4）宏观经济下行风险。当前我国经济正处在结构调整和增速换挡的阶段，经济下行压力较大，证券业运营风险较高。

（5）市场竞争风险。国内证券公司同质化竞争较严重，其他金融机构也在部分业务领域对证券公司构成竞争，同时，互联网金融发展对证券公司业务构成冲击，华泰证券将持续面临激烈的市场竞争压力。

第九章 债券持有人会议召开的情况

截至本报告出具之日，发行人未召开本期次级债券持有人会议。

第十章 本期次级债券担保人资信情况

本期次级债券无担保。

第十一章 负责处理次级债券相关事务的专人变动情况

2016年12月21日，公司第四届董事会第一次会议审议通过了《关于聘任公司董事会秘书等的议案》，根据公司董事长提名，公司董事会同意聘任罗毅为证券事务代表。罗毅先生已于2017年2月23日参加上交所组织的董事会秘书资格培训并取得了董事会秘书资格证书，正式出任公司新的证券事务代表。

目前，公司证券事务代表罗毅先生负责处理与本期债券的相关事务。

第十二章 其它事项

（一）担保情况

1、发行人对外担保（不包括子公司）情况

华泰金控(香港)公司下设的Huatai International Finance I Limited于2014年10月8日完成了首期境外债券发行。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年度股东大会的授权，公司获授权人士确定由中国银行澳门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，根据公司第三届董事会第九次会议决议，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，反担保金额不超过本次债券本金、利息及其他相关费用合计30亿元人民币等值美元。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。

2、发行人对子公司提供担保情况

2015年1月，华泰资管公司正式营业。为保证华泰资管公司各项风险控制指标持续符合监管要求，经公司第三届董事会第十六次会议和2014年度股东大会审议批准，公司为华泰资管公司提供最高额度为人民币12亿元的净资本担保，并承诺当华泰资管公司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。

经公司第三届董事会第三十五次会议及2016年第二次临时股东大会审议通过，公司为华泰资管公司提供最高额度为人民币50亿元的净资本担保，并承诺当华泰资管公司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。

（二）重大诉讼、仲裁事项

发行人及其子公司涉及的有关诉讼、仲裁事项如下：

1、诉讼、仲裁事项已在临时公告披露且无后续进展的

（1）华泰联合证券与四通集团、四通集团财务公司债权债务纠纷案：华泰联合证券原股东四通集团公司下属企业四通集团财务公司非法占用华泰联合证券资金引起了三单债权债务纠纷案。其中两案分别由深圳市中级人民法院作出（2001）深中法经一初第315号民事判决书和（2002）深中法经一初第430号民事调解书。根据上述判决书和调解书，四通集团应分别偿还华泰联合证券人民币7,345万元及其利息和人民币9,940万元及利息。上述民事判决书和民事调解书均已生效，两案正在执行中。对于另一案，华泰联合证券于2008年6月向北京市高级人民法院提起诉讼，请求法院判令四通集团公司向华泰联合证券支付欠款总额人民币23,775.36万元人民币、利息人民币2,187.72万元,合计标的人民币约2.60亿元。本案由北京市高级人民法院于2009年12月17号作出的（2008）高民初字第1080号民事判决书结案，对方没有上诉，该一审判决已经生效，该判决确认四通集团应付公司本金人民币17,553.40万元及利息。此案正在执行中。

（2）华泰联合证券与中国华诚集团财务有限责任公司（以下简称“华诚集团公司”）、华诚投资管理有限公司（以下简称“华诚投资公司”）债权债务纠纷案：因华诚集团公司无偿占用华泰联合证券营业部资金共人民币3,720余万元，以及因它与其他债权人的债务纠纷而被各地法院从华泰联合证券三家营业部及华泰联合证券本部扣

划现金共人民币1,738万元，华诚集团公司拒不履行偿债义务，华泰联合证券于2003年12月向深圳市中级人民法院提起诉讼，要求华诚投资公司和华诚集团公司承担连带清偿责任。立案后，由于最高人民法院已下文通知各地法院暂停受理、审理、执行对华诚投资公司及所属公司的诉讼案件，该案一直处于中止审理阶段。2009年5月，法院裁定华诚投资公司进入破产清算程序，华泰联合证券于2009年8月向破产清算组申报债权本息人民币12,598万元，但由于债权未经法院判决，债权待确认。2010年3月深圳中级人民法院恢复审理，一审判决结果支持华泰联合证券全部诉讼请求，要求华诚投资公司和华诚集团公司连带支付华泰联合证券人民币5,458.4万元，并承担诉讼费人民币28.2万元，华泰联合证券已就上述债权和诉讼费向华诚投资公司破产清算组申报破产债权，2012年12月21日，华泰联合证券收到了北京市第二中级人民法院（以下简称“二中院”）民事裁定书，裁定终结华诚投资公司破产程序，华诚投资公司破产程序期间华泰联合证券共获得276.44万股华纺股份股票及人民币182.40万元。2012年7月法院裁定华诚集团公司进入破产清算程序，2013年6月，破产清算管理人发出《关于审查申报债权的函》让华泰联合证券确认债权，2014年3月21日，二中院召开华诚财务债权人会议，破产管理人以“由于华泰联合证券有限责任公司否认华诚投资公司的股东身份，因此对贵公司享有的华诚集团公司的债权不予确认。”因此，华泰联合证券向北京市第二中级人民法院提起确认债权诉讼，二中院于2014年11月18日做出（2014）二中民初字第6794号判决，确认了华泰联合证券对华诚集团

公司享有债权金额人民币39,387,194.72元。双方股权纠纷，由二中院于2015年10月26日出具的（2015）二中民（商）初字第05326号民事判决书结案，驳回华诚股权确认诉讼请求。确认原登记在华诚投资公司名下的252万股减资注销有效。

（3）华泰期货公司客户张晓东期货账户于2013年4月16日发生重大穿仓事件，穿仓金额为人民币22,639,786.41元。由于张晓东未能偿还华泰期货代其垫付的穿仓损失款，华泰期货于2013年12月27日向上海市第一中级人民法院对张晓东提起民事诉讼，要求张晓东赔偿华泰期货代其垫付的穿仓损失并承担全部的诉讼费用。上海市第一中级人民法院于2014年5月29日开庭审理，并于6月25日下达判决书[（2014）沪一中民六（商）初字第1号]，依法判决被告张晓东应于本判决生效之日起十日内偿还原告华泰期货人民币22,639,786.41元，并支持了华泰期货要求张晓东负担案件受理费的请求。华泰期货于2014年11月11日向上海市第一中级人民法院申请强制执行客户张晓东穿仓欠款，目前该案正在执行过程中。关于该案件申请财产执行的情况，华泰期货于2015年6月底收到河南省三门峡市中级人民法院执行裁定书：因被执行人暂无履行债务能力，本案未能有效执结，法院终结本次执行程序。华泰期货如发现被执行人有可供执行的财产，可随时向法院申请恢复执行。根据相关财务制度规定，此笔客户穿仓已于2013年度计入“应收风险损失款”处理。华泰期货根据期货行业财务管理相关规定计提期货风险准备，此笔客户穿仓不需要再计提坏账准备。

2、临时公告未披露或有后续进展的诉讼、仲裁情况

(1) 华泰证券就质权项下存单提起执行异议：华泰证券作为“华泰证券金陵六号定向资产管理计划”（简称：金陵六号计划）管理人，根据委托人投资指令，于2014年4月22日以定向计划资金投资昆山凯虹汽车贸易有限公司（简称：昆山凯虹）持有的存单收益权，并与昆山凯虹约定2016年4月21日由昆山凯虹全额购回该存单。为确保回购条款的正常履行，昆山凯虹将该存单（人民币2,500万）质押给华泰证券。因昆山凯虹其他纠纷，其相关资产（包括为该笔业务所质押的2,500万存单）被昆山市人民法院冻结。依据相关合同约定，如存单转让人涉及纠纷，金陵六号计划管理人可提前行使质权。2015年10月，华泰证券向昆山市人民法院提出执行异议，请求法院解冻该企业质押给华泰证券的2,500万存单。昆山市人民法院已受理华泰证券执行异议（受理编号：（2016）苏0583执异9号），该案已于2016年5月作出裁定，支持华泰证券诉求，相关存单已解除冻结。由于昆山凯虹其他纠纷，苏州市吴江区人民法院轮候冻结该存单。华泰证券已于2016年5月向苏州市吴江区人民法院提交执行异议。之后因异议被驳回，2016年6月，华泰证券向苏州市吴江区人民法院提起执行异议之诉。苏州市吴江区人民法院已受理华泰证券执行异议之诉（受理编号：（2016）苏0509民初8451号），该案已于2016年11月22日开庭审理，苏州市吴江区人民法院于2017年1月18日出具判决，支持华泰证券对案涉存单依法享有质权。目前涉及存单已解除冻结。华泰证券为金陵六号计划管理人，接受该计划委托人委托进行诉讼，形成损益归入该计划资产。该计划资产与华泰证券资产相互独立，本次诉讼对公司本

期利润或期后利润没有不利影响。

(2) 华泰联合证券与北京华资银团集团债权债务纠纷案：因北京华资银团集团一直未按协议履行对华泰联合证券的还款义务，华泰联合证券于2011年1月向深圳市福田区人民法院起诉，要求其返还本金及利息共计人民币3,457.89万元，2011年2月，法院一审判决，要求北京华资银团集团支付华泰联合证券欠款人民币2,430万元及银行同期存款利息，对方不服该判决，提起上诉，2011年6月深圳市中级人民法院下达终审判决，驳回上诉，维持原判。目前，该案仍在执行过程中。华泰联合证券起诉黄祖祥、黄平、黄祖峰、北京华资银团集团与华泰联合证券有关的纠纷一案，北京市第三中级人民法院于2015年12月4日出具（2015）三中民（商）初字第03020号，确定黄祖祥、黄祖峰为华资银团股东代华资银团向华泰联合证券偿付债务本金人民币2,430万元、案件受理费人民币9.10万元。2016年至今，黄祖祥、黄祖峰未履行偿还义务，2016年5月31日，华泰联合证券向北京市第三中级人民法院申请执行。

(3) 中国原子能工业有限公司（以下简称“原子能公司”）诉华诚集团公司、华诚投资公司存单纠纷一案，二中院于1999年2月10日作出（1998）二中经初字第1218号民事判决。判决生效后，原子能公司于1999年7月12日向二中院申请执行。二中院依法查封了华诚投资公司持有的联合证券有限责任公司（以下简称“联合证券公司”）股权，此后，原子能公司通过拍卖竞买了华诚投资公司持有的联合证券公司3,660万股股权。后因联合证券公司认为华诚投资公司在出资入

股联合证券公司之初存在人民币1,498万元的不实出资（被法院执行扣划），通过向北京市高级人民法院、最高人民法院申诉、提出执行异议等措施，最后二中院、原子能公司将人民币1,498万元对应的联合证券公司股权1,348万股股权从原子能公司拍卖所得的联合证券公司3,660万股股权中扣除，其余的2,312万股股权过户至原子能公司名下，但上述1,348万股股权仍以原子能公司的名义申请二中院继续冻结。

2003年底，联合证券公司向法院起诉华诚集团公司和华诚投资公司，后因最高人民法院以明传电报的形式通知全国各地法院暂停受理所有针对华诚集团公司及其下属公司的案件。在这种背景下，联合证券公司主动与原子能公司协商，就上述仍以原子能公司名义申请二中院冻结的1,348万股股权的处置事宜，双方在互利互惠的基础上达成一致，上述1,348万股股权联合证券公司同意继续执行到原子能公司名下，但这1,348万股股权按照大致四六开的比例，原子能公司拿550万股，联合证券公司拿798万股以抵偿华诚投资公司对其的债务。2008年，华诚投资公司1,348万股股权过户到原子能公司名下，由此形成原子能公司代联合证券公司持有原华诚投资公司在联合证券公司的股权798万股的情况。

2009年，华泰证券重组联合证券公司，联合证券公司名称变更为华泰联合证券有限责任公司，缩股后原子能公司持有华泰联合证券股权1,098万股，其中自持858.6万股，代持239.4万股。之后华泰证券亦与原子能公司进行协商，最终达成原子能公司代持的239.4万股中的

200万股转让给华泰证券，转让款支付给华泰联合证券。剩余39.4万股与原子能公司的858.6万股合计898万股换成华泰证券股权。但原子能公司代持200万股的问题至今没有解决。

2014年12月23日，北京市西城区人民法院依法受理华泰联合证券诉原子能公司合同纠纷一案。2016年6月28日，北京市西城区人民法院出具（2015）西民（商）初字第1048号民事判决书判决华泰联合证券胜诉。法院判决被告继续履行《股权代持协议》、《代持股权挂牌转让协议》，并于判决生效之日起三十日内完成200万股股权的挂牌转让事宜，并将股权转让所得价款给付华泰联合证券。该判决已生效，正在执行中。（上表诉讼涉及金额以华泰联合证券报告期末净资产数据估算）

（4）华泰证券与四川圣达集团有限公司债权债务纠纷案：2012年四川圣达集团有限公司公司债券（简称：12圣达债，债券代码：1280443）未能按期足额向华泰证券付息及兑付回售债券本金。华泰证券根据债券持有人会议决定，与其他债权人共同委托天津银行股份有限公司成都分行于2016年6月7日向四川省高级人民法院提起诉讼，要求四川圣达集团有限公司返还本金和利息，总本金人民币3亿元，按照票面利率7.25%从2014年12月6日起至付清之日止，并按照年利率3.625%支付罚息从2015年12月6日起至付清之日止（其中华泰证券涉及本金人民币5,000万元）。截止2016年12月31日，华泰证券应收四川圣达集团有限公司本金人民币5,000万元，利息人民币750.82万元，罚息人民币194.16万元，案件正在审理中。

(5) 华泰证券华福厦门银行1号定向资产管理计划项下票据纠纷：华泰证券华福厦门银行1号定向资产管理计划（“华福厦门银行1号”）委托人厦门银行股份有限公司于2016年10月17日，就华福厦门银行1号项下相关票据纠纷，向福建省高级人民法院提起了以宁波银行股份有限公司深圳分行为被告的合同纠纷诉讼，诉讼金额暂计为人民币47,384.50万元（暂计至2016年10月17日）。被告宁波银行股份有限公司深圳分行接获福建省高级人民法院的应诉通知书等诉讼材料后，于2016年11月18日向福建省高级人民法院提交了《管辖权异议申请书》，提出管辖权异议。待本案件管辖权确定后，管辖法院将择期开庭审理。

华泰资管公司作为华福厦门银行1号定向资产管理计划管理人，被列为民事诉讼第三人，未被要求承担赔偿责任，本次诉讼对华泰资管公司本期利润或期后利润没有不利影响。

（本页无正文，为《华泰证券股份有限公司2015年第二期次级债券受托管理事务报告（2016年度）》之盖章页）

债券受托管理人：光大证券股份有限公司

二〇一七年六月二十三日

