

股票简称：中信证券
债券简称：17 中信 G3、17 中信 G4

股票代码：600030.SH/6030.HK
债券代码：143416、143417

中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行

2017 年公司债券（第二期）

受托管理事务报告

（2017 年度）

债券受托管理人



海通证券股份有限公司
HAITONG SECURITIES CO., LTD.

（上海市广东路 689 号）

二〇一八年六月

重要声明

海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）编制本报告的内容及信息均来源于中信证券股份有限公司（以下简称“发行人”、“公司”或“中信证券”）对外公布的《中信证券股份有限公司 2017 年年度报告》等相关公开信息披露文件、发行人提供的证明文件以及第三方中介机构出具的专业意见。

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海通证券所作的承诺或声明。

目 录

第一章 本期债券概况	4
第二章 发行人 2017 年度经营和财务状况	6
第三章 发行人募集资金使用情况及专项账户运作情况	14
第四章 发行人偿债保障措施的执行情况	15
第五章 本期债券利息的偿付情况	16
第六章 债券持有人会议召开情况	17
第七章 本期债券跟踪评级情况	18
第八章 负责处理与本期债券相关事务专人的变动情况	19
第九章 受托管理人履行职责情况	20
第十章 其他情况	21

第一章 本期债券概况

一、核准文件和核准规模

2017年9月28日，经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]1774号文核准，中信证券股份有限公司获准发行不超过人民币65亿元公司债券。

二、发行主体名称

中文名称：中信证券股份有限公司

英文名称：CITIC Securities Co., Ltd.

三、本期债券的主要条款

1、债券名称：中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行2017年公司债券(第二期)（简称“本期债券”）。

2、债券简称及代码：2年期品种简称为“17 中信 G3”，债券代码为“143416”；3年期品种简称“17 中信 G4”，债券代码为“143417”。

3、发行规模：人民币48亿元。

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、债券品种的期限及规模：本期债券分为2年期固定利率和3年期固定利率两个品种，其中2年期品种的最终发行规模为24亿元，3年期品种的最终发行规模为24亿元。

6、债券利率：本期债券2年期品种票面利率为5.25%，3年期品种票面利率为5.33%。

7、还本付息方式：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。年度付息款项自付息日起不另计利息，本金自兑付日起不另计利息。具体本息兑付工作按照主管部门的相关规定办理。

8、付息日：本期债券2年期品种的付息日为2018年至2019年每年的11月28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交易日，顺延期间不另计息；

本期债券3年期品种的付息日为2018年至2020年每年的11月28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交易日，顺延期间不另计息。

9、兑付日：本期债券2年期品种的兑付日为2019年11月28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交易日，顺延期间不另计息；

本期债券3年期品种的兑付日为2020年11月28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交易日，顺延期间不另计息。

10、担保方式：本次发行的公司债券无担保。

11、发行时信用级别：经中诚信证券评估有限公司综合评定，发行人的主体信用等级为AAA，本期债券的信用等级为AAA。

12、最新跟踪信用级别及评级机构：中诚信证券评估有限公司于2018年4月20日出具了《中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行2017年公司债券（第二期）、中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行2018年公司债券（第一期）跟踪评级报告》及《信用等级通知书》（信评委函字[2018]跟踪038号），经中诚信证评综合评定，维持发行人的主体信用等级为AAA，评级展望稳定，维持本期债券的信用等级为AAA。

13、债券受托管理人：海通证券股份有限公司。

14、登记机构：中国证券登记结算有限责任公司上海分公司。

第二章 发行人2017年度经营和财务状况

一、发行人基本情况

发行人名称 : 中信证券股份有限公司
英文名称 : CITIC Securities Company Limited
注册资本 : 1,211,690.84 万元
注册地址 : 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
法定代表人 : 张佑君
成立日期 : 1995 年 10 月 25 日
上市日期 : 2003 年 1 月 6 日
股票简称 : 中信证券
股票代码 : 600030.SH/6030.HK
股票上市地 : 上海证券交易所/香港联交所
董事会秘书 : 郑京
联系电话 : 0755-2383 5888、010-6083 8888
传真 : 0755-2383 5861、010-6083 6029
互联网址 : <http://www.cs.ecitic.com>
电子邮箱 : ir@citics.com
经营范围 : 证券经纪（限山东省、河南省、浙江省天台县、浙江省苍南县以外区域）；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；股票期权做市。

二、发行人 2017 年度经营情况

1、投资银行业务

境内股权融资方面，2017年，公司完成A股主承销项目87单，主承销金额人民币2,209.82亿元（含资产类定向增发），市场份额12.29%，主承销金额及单数

均排名市场第一。其中，IPO主承销项目30单，主承销金额人民币206.19亿元；再融资主承销项目57单，主承销金额人民币2,003.63亿元。

境内债券及结构化融资业务方面，2017年，公司主承销各类信用债券合计726支，主承销金额人民币5,116.28亿元，市场份额4.29%，债券承销金额、承销单数均排名同业第一。公司项目储备充足，继续保持在债券承销市场的领先优势。资产证券化业务继续保持行业领先，在个人汽车抵押贷款证券化、消费信贷证券化等细分市场上的优势明显。

财务顾问业务方面，2017年，公司完成的A股重大资产重组交易金额约为人民币1,398亿元，市场份额16.21%，排名行业第一，完成了宝钢股份换股吸收合并武钢股份、国网电科院及南瑞集团向国电南瑞注入集团主要资产、浙江东方收购国贸集团旗下金融牌照资产转型金控平台等多单具有影响力、创新性、能起到示范性作用的重组交易，进一步增加公司的市场影响力。同时，公司在并购多元化业务方面展开了新的尝试，完成了深圳地铁协议收购华润集团所持万科A股项目。

新三板业务方面，截至2017年12月31日，公司作为主办券商在持续督导的挂牌公司共59家，在2017年度股转公司主办券商执业质量评价中位列第一档。2017年，公司为159家挂牌公司提供了做市服务，其中116家公司进入了创新层。

2、经纪业务

2017年，经纪业务落实以客户为中心的经营思路，大力开拓机构业务、财富管理业务和个人业务，强化分支机构管理，完善客户开发服务体系，做大客户规模，构建信投顾投研服务品牌，逐步搭建最大、最全、最专业的金融产品超市，提升交易与配置服务能力，着力向财富管理转型。

2017年，公司经纪业务持续保持行业领先地位，代理股票基金交易总额人民币13.05万亿元（不含场内货币基金交易量），市场份额5.69%，排名保持行业第二。信投顾文章阅读量屡超10万人次，投研服务品牌影响力逐渐显现。公司及中信证券（山东）共代销金融产品超人民币7,011亿元，产品销售能力行业领先。新增客户105万户，新增客户资产人民币1万亿元。截至报告期末，经纪业务零售

客户超770万户，一般法人机构客户3.3万户（扣除已销户机构客户数量），托管客户资产合计人民币5万亿元，客户总数及资产规模分别同比提升15%和18%。QFII客户138家，占比45%；RQFII客户52家，占比23%；QFII与RQFII总客户数量稳居市场前列。

3、交易

（1）资本中介型业务

股权衍生品业务方面，公司为企业客户提供包括约定购回式证券交易、股票质押回购、市值管理等股权管理服务；面向机构客户开展结构性产品、股票收益互换、场外期权报价、股票挂钩收益凭证等柜台衍生品业务；克服不利市场环境继续发展做市交易类业务，包括交易所交易基金（ETF）的做市业务、上证50ETF期权做市业务、白糖期权做市业务。2017年，公司股权管理类业务规模位列同业前茅；柜台衍生品类业务处于市场领先水平；做市交易类业务向多品种、多元化策略发展，上证50ETF期权做市持续排名市场前列。基本形成服务客户群广泛、产品类型齐全、收益相对稳定的业务形态。

固定收益业务方面，公司充分发挥客户资源优势，提升服务客户的综合能力，2017年利率产品销售总规模保持同业第一。通过加强各业务板块之间的合作，丰富交易品种，涵盖各类固定收益产品、市场、客户。加强债券及衍生品做市，获得银行间市场优秀债券市场交易商等荣誉。加强市场研判及信用研究，提高风险管理能力。此外，公司积极推动对股份制银行、城商行等金融机构的投顾服务，满足客户的财富管理需求。

大宗商品业务方面，公司继续践行金融服务实体经济的理念，通过现货贸易业务深耕实体产业、提升现货做市贸易和供应链服务能力，为产业上、中、下游客户提供个性化服务。2017年继续保持上海清算所商品场外衍生交易规模市场第一。衍生品业务方面，针对境内外企业和机构投资者客户，继续开展交易服务，扩大商品互换交易、商品场外期权等业务的盈利能力和客户覆盖度。初步形成了现货贸易、衍生交易、报价做市等业务相互支撑发展的局面，期望进一步为境内外各类产业和机构客户提供大宗商品领域个性化、专业化的金融服务。

大宗经纪业务方面，坚持审慎发展的原则，在确保风险可测、可控、可承受的前提下，积极开展融资融券业务，规模与市场融资融券规模基本保持同步。截至2017年12月31日，中信证券融资融券规模约人民币709.75亿元，占全市场业务规模的6.92%，排名市场第一。其中，融资规模人民币708.15亿元，融券规模人民币1.60亿元。

（2）证券自营投资

2017年，公司继续推进股票自营战略转型，以风险收益比作为投资决策的重要参考指标，深入优化投研体系及流程，加大行业和公司研究深度，完善研究对投资的支撑作用，在积极抓住市场机会的同时，严格管理风险，实现一定程度盈利，成效良好。

2017年，另类投资业务方面，传统股票量化策略全年遭遇来自市场结构变迁的严峻挑战。另类投资业务在提升原有量化交易能力的基础上，强化了宏观基本面的研判，并不断丰富交易策略，将机器学习、人工智能的相关知识应用到投资交易之上。面对市场的挑战，业务线基于宏观研判，以量化交易为核心，灵活运用各种金融工具和衍生品进行风险管理，克服市场的不利影响。同时，积极开拓多市场、多元化的投资策略，有效地分散了投资风险，丰富了收益来源。目前已开展的业务或策略包括：股指期货现套利、境内宏观策略、统计套利、基本面量化、可转债套利、商品策略、期权策略、私募可交换债策略、组合对冲基金投资、全球多策略基金等。

4、资产管理

资产管理业务方面，截至报告期末，公司资产管理规模为人民币16,673.35亿元，市场份额10.10%，主动管理规模人民币5,890亿元，均排名市场第一。其中，集合理财产品规模、定向资产管理业务规模（含企业年金、全国社保基金）与专项资产管理业务的规模分别为人民币1,613.32亿元、15,041.40亿元和18.62亿元。公司资产管理规模及行业占比继续保持行业第一。

华夏基金业务方面，截至2017年12月31日，华夏基金本部管理资产规模为人民币8,696.15亿元。其中，公募基金管理规模人民币3,988.08亿元，非货币公募基

金规模行业排名第二；机构业务资产管理规模人民币4,708.07亿元（不含投资咨询等业务），机构业务规模保持行业前列。

5、托管

2017年，公司认真贯彻和落实资产管理行业监管规章，忠实履行资产托管和基金服务职责。通过优化客户服务流程，持续升级服务平台，积极探索基金运营服务创新，以提升客户服务体验为核心，实现了资产托管和基金服务规模的稳步增长。截至报告期末，由公司提供资产托管服务的证券投资基金、资产管理计划等共4,061支，提供基金服务的私募投资基金共4,444支。

6、投资

（1）中信证券投资

根据中国证券业协会于2016年12月30日颁布的《证券公司另类投资子公司管理规范》，自2017年起，公司自营投资品种清单以外的另类投资业务将由公司全资子公司中信证券投资全面承担，其中包括原由金石投资开展的自有资金直接投资业务。2017年，中信证券投资新增股权投资项目28项，总金额近人民币23亿元。当前，中信证券投资已形成了包括TMT、消费升级、先进制造、医疗健康、金融综合等在内的五大行业分类，投资项目广泛涉及国内和国际业务。

（2）金石投资

根据中国证券业协会于2016年12月30日颁布的《证券公司私募基金子公司管理规范》，自2017年起，公司全资子公司金石投资转型为私募股权投资基金管理平台公司，建立统一的募、投、管、退体系。在基金设立及募资工作方面，2017年金石投资与中国旅游集团公司、安徽省交通控股集团有限公司分别组建管理公司，分别设立中国旅游产业基金、安徽交控金石并购基金，以及多支专项行业基金，募资和投资工作按计划推进。金石投资管理存量基金和新设基金合计管理规模超过人民币600亿元。在投资及投后管理工作方面，2017年金石投资完成股权投资项目20多单；此外金石投资目前在管投后项目及基金超过100单。

7、研究

2017年,研究业务结合市场及客户需求,通过市场和校园招聘补充人员力量,目前共有34个专业研究团队,维持了研究领域的全覆盖。2017年,共外发研究报告7,021篇,为客户提供路演服务11,699次,新增港股覆盖至120余家;此外,还组织了“‘万物在线’主题论坛”、“中信证券国企改革专题研讨会”、“2017年中期策略会”、“新能源汽车投资策略会”、“2018年资本市场年会”等30场大中型投资者论坛,累计服务客户逾12,000人次。

8、国际业务

2017年,中信里昂证券有限公司完成了印度HDFC Life的13.4亿美元首次公开发行、印度YES Bank的7.5亿美元合格机构配售以及斯里兰卡民主社会主义共和国发行的15亿美元主权债等具有标志性的“一带一路”项目。

三、发行人 2017 年度财务状况

根据发行人2017年年度报告,截止2017年12月31日,发行人总资产为6,255.75亿元,较上年同期增长4.71%;所有者权益合计1,531.43亿元,较上年同期增长5.04%。2017年度,发行人实现营业收入432.92亿元,较上年同期增长13.92%;实现归属于母公司股东的净利润114.33亿元,较上年同期增长10.30%。

1、发行人盈利能力

2017年度,发行人合并利润表主要数据如下

单位:人民币元

项目	2017 年度	2016 年度	同比增减 (%)
营业收入	43,291,634,080.53	38,001,695,917.06	13.92
营业利润	16,248,330,667.20	14,201,931,140.48	14.41
利润总额	16,173,780,571.25	14,262,558,591.97	13.40
归属于母公司股东的净利润	11,433,264,545.60	10,365,168,588.41	10.30
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	11,449,551,584.40	10,342,364,843.01	10.71
其他综合收益	2,238,120,065.75	2,318,805,516.44	-3.48

2017年,公司经营业绩较2016年同期增长。公司实现营业收入432.92亿元,同比增长13.92%,主要因2017年度公司下属子公司大宗商品贸易销售收入增加,

导致其他业务收入同比增长 405.91 亿元，增幅 90.68%；公司营业支出为人民币 270.43 亿元，同比增长 13.63%，因为 2017 年度公司下属子公司大宗商品贸易成本上涨，导致其他业务成本较 2016 年度增加 39.78 亿元，增幅 97.13%；公司营业利润为人民币 162.48 亿元，同比增长 14.41%，为公司大宗商品贸易量增长迅速，其他业务收入较 2016 年度增加 90.68%所致；归属于母公司股东的净利润人民币 114.33 亿元，同比增长 10.30%；实现每股收益人民币 0.94 元，同比增长 9.30%；加权平均净资产收益率 7.82%，同比增加 0.46 个百分点。

2、发行人资产负债状况

截至 2017 年末，发行人合并资产负债表主要数据如下：

单位：人民币元

项目	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日	同比增减 (%)
资产总额	625,574,643,890.17	597,438,839,244.37	4.71
负债总额	472,432,085,067.12	451,650,169,507.47	4.60
归属于母公司股东的权益	149,799,046,146.90	142,695,945,757.73	4.98
所有者权益总额	153,142,558,823.05	145,788,669,736.90	5.04

2017 年末，发行人资产总额为人民币 6,255.75 亿元，同比增加人民币 281.36 亿元，主要因发行人买入返售业务规模增加，致使买入返售金融资产较 2016 年末增加 554.17 亿元，增幅 93.65%。2017 年末，发行人负债总额为 4,724.32 亿元，同比增加人民币 207.82 亿元，主要因发行人报告期内发行次级债、公司债及收益凭证，导致应付债券金额较 2016 年末增加 356.67 亿元，增幅 50.55%。

3、发行人现金流量状况

2017 年度，发行人合并现金流量表主要数据如下：

单位：人民币元

项目	2017 年度	2016 年度	同比增减 (%)
经营活动产生的现金流量净额	-104,193,054,144.87	-49,392,291,188.73	不适用
投资活动产生的现金流量净额	28,272,722,360.65	9,937,655,066.59	184.50
筹资活动产生的现金流量净额	37,485,182,828.69	-7,998,537,553.48	不适用
汇率变动对现金的影响	-1,346,692,415.73	1,335,654,281.34	-200.83

项目	2017 年度	2016 年度	同比增减 (%)
现金及现金等价物净增加额	-39,781,841,371.26	-46,117,519,394.28	不适用

2017年，公司现金及现金等价物的变动净额为人民币-397.82亿元，净流出同比减少人民币63.36亿元，主要是由于投资活动和筹资活动产生的现金流量净额增加所致。

从结构上看，2017年经营活动产生的现金流量净额为人民币-1,041.93亿元，2016年同期为人民币-493.92亿元，净流出同比增加人民币548.01亿元，主要是由于回购业务、代理买卖证券业务导致的净流出额同比增加所致。2017年投资活动产生的现金流量净额为人民币282.73亿元，2016年同期为人民币99.38亿元，主要是由于可供出售金融资产净流入同比增加所致。2017年筹资活动产生的现金流量净额为人民币374.85亿元，2016年同期为人民币-79.99亿元，主要是由于报告期内公司发行的债券及收益凭证增加所致。

第三章 发行人募集资金使用情况及专项账户运作情况

一、本期债券募集资金情况

发行人经中国证监会“证监许可[2017]1774号文”批准，于2017年11月27日至2017年11月28日公开发行人民币48亿元的公司债券。本期债券募集资金总额扣除承销费用后的募集资金净额已按约定汇入发行人指定的银行账户。

发行人2017年11月23日公告的《中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行2017年公司债券(第二期)募集说明书》相关内容约定，本期债券募集资金拟用于补充公司营运资金，保证经营活动的顺利进行。

二、本期债券募集资金实际使用情况及专项账户运作情况

截至2017年12月31日，本期债券募集资金已按计划使用完毕。

第四章 发行人偿债保障措施的执行情况

截止2017年12月31日，本期债券偿债计划及其他保障措施未发生变更，在报告期内按照募集说明书相关约定执行正常。

第五章 本期债券利息的偿付情况

本期债券2年期品种的付息日为2018年至2019年每年的11月28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交易日，顺延期间不另计息；本期债券3年期品种的付息日为2018年至2020年每年的11月28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交易日，顺延期间不另计息。

截至本报告出具之日，本期债券尚未到付息日。

第六章 债券持有人会议召开情况

本报告期内，本期债券及发行人未出现触发持有人会议的事项。

第七章 本期债券跟踪评级情况

“17中信G3”、“17中信G4”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2017年完成了对本期债券的初次评级。根据《中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行2017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[2017]G506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两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。

中诚信证券评估有限公司于2018年4月20日出具了《中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行2017年公司债券（第二期）、中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行2018年公司债券（第一期）跟踪评级报告》及《信用等级通知书》（信评委函字[2018]跟踪038号），经中诚信证评综合评定，维持发行人的主体信用等级为AAA，评级展望稳定，维持本期债券的信用等级为AAA。

第八章 负责处理与本期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。

第九章 受托管理人履行职责情况

报告期内，海通证券根据《公司债券受托管理人执业行为准则》等有关规定和本期债券《受托管理协议》等约定，通过舆情监测、业务提示及现场回访等方式对企业有关情况进行了跟进和督导，履行了受托管理工作职责。

第十章 其他情况

一、对外担保情况

1、公司的担保事项

2013年，公司根据第五届董事会第十二次会议决议，向中国银行出具了反担保函，承诺就中国银行澳门分行为公司附属公司中信证券财务 2013 发行的首期境外债券开立的备用信用证提供反担保，反担保金额为 9.02 亿美元（约合人民币 58.94 亿元），包括债券本金、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。

2014年，公司根据 2013 年度股东大会决议，经获授权小组同意，为间接全资附属公司 CITIC Securities Finance MTN 设立的境外中期票据计划内拟发行的每批票据项下的清偿义务提供无条件及不可撤销的连带责任保证担保，担保范围包括境外票据本金、利息及其他或有应付款。2014 年 10 月 30 日，CITIC Securities Finance MTN 对该次中期票据计划进行了首次提取并发行，发行规模 6.5 亿美元，由公司提供无条件及不可撤销的连带责任保证担保。2015 年，CITIC Securities Finance MTN 对该次中期票据计划进行了八次提取，发行规模共计 4.3968 亿美元，由公司提供无条件及不可撤销的连带责任保证担保。

2017 年 4 月 11 日，CITIC Securities Finance MTN 对该次中期票据计划进行提取，发行规模 8 亿美元，其中三年期品种发行规模 3 亿美元，五年期品种发行规模 5 亿美元。

2015 年，公司为间接全资子公司金石泽信申请固定资产贷款提供抵押担保，担保金额为人民币 50 亿元。

2、控股子公司的担保事项

报告期内，公司控股子公司中，中信证券国际及其全资子公司 CLSAB.V. 存在担保事项，相关担保均是对其下属子公司提供，且为满足下属子公司业务开展而进行的，主要为：贷款担保、中期票据担保、与交易对手方签署国际衍生品框架协议（ISDA 协议）、全球证券借贷主协议（GMSL 协议）涉及的交易担保

等；中信证券投资的全资子公司中信寰球商贸对其下属子公司提供了融资性担保。截至 2017 年 12 月 31 日，前述担保合计金额约合人民币 311.76 亿元。

二、涉及的未决诉讼或仲裁事项

1、报告期内，公司及子公司涉及诉讼事项如下：

(1) 公司与中城建债券交易纠纷案

a.“11 中城建 MTN1”债券交易纠纷案

公司于 2017 年 2 月 28 日向北京市第一中级人民法院(以下简称“一中院”)提起诉讼，要求中国城市建设控股集团有限公司(以下简称“中城建”)支付公司已到期的债券本金人民币 1 亿元以及相应利息人民币 568 万元；要求中城建赔偿本息所对应的违约金以及其他实现债权的费用。一中院于公司起诉当日受理本案，并于 2017 年 4 月 25 日做出财产保全裁定。后中城建提出管辖权异议，公司于 2017 年 6 月 29 日收到一中院寄送的管辖权异议裁定书，裁定将本案移送北京市第二中级人民法院(以下简称“二中院”)审理。二中院于 2017 年 11 月 6 日开庭审理本案，并于 2017 年 11 月 24 日作出一审判决，公司主要诉讼请求(本金、利息、违约金、案件受理费、保全申请费)全部得到支持。2017 年 12 月初，中城建向北京市高级人民法院(以下简称“北京高院”)提起上诉。2018 年 3 月 6 日，北京高院开庭审理本案，目前尚未作出判决。

b.“12 中城建 MTN1”债券交易纠纷案

公司于 2017 年 5 月 26 日向一中院提起诉讼，要求中城建提前偿还债券本金人民币 1.2 亿元以及相应利息人民币 3,266,137 元；要求中城建赔偿实现债权的其他费用。一中院于 2017 年 5 月 27 日受理本案，并于 2017 年 6 月 12 日做出财产保全裁定。因中城建提出管辖权异议，公司于 2017 年 6 月 29 日收到一中院寄送的管辖权异议裁定书，裁定将本案移送二中院审理。2018 年 3 月 14 日，二中院开庭审理本案，目前尚未作出判决。

c.“12 中城建 MTN2”债券交易纠纷案

公司于 2017 年 2 月 28 日向北京市海淀区人民法院(以下简称“海淀法院”)

提起诉讼，要求中城建支付应于 2016 年 12 月 19 日支付公司的利息人民币 1,110 万元；要求中城建赔偿对应的违约金以及其他实现债权的费用。海淀法院于公司起诉当日受理本案，并于 2017 年 6 月 23 日做出财产保全裁定。后中城建提出管辖权异议，海淀法院于 2017 年 10 月 20 日裁定予以驳回。中城建于 2017 年 10 月 27 日向一中院提出上诉，2018 年 2 月 1 日，一中院驳回中城建的管辖权异议申请。2018 年 3 月 9 日，海淀法院开庭审理本案，目前尚未作出判决。

同时，公司于 2017 年 5 月 26 日向一中院提起诉讼，要求中城建提前偿还债券本金人民币 2 亿元以及相应利息人民币 4,865,753 元；要求中城建赔偿实现债权的其他费用。一中院于 2017 年 5 月 27 日受理本案并于 2017 年 6 月 12 日出具财产保全裁定。因中城建提出管辖权异议，公司于 2017 年 6 月 29 日收到一中院寄送的管辖权异议裁定书，裁定将本案移送二中院审理。2018 年 3 月 14 日，北京二中院开庭审理本案，目前尚未作出判决。

公司已按规定对上述（1）至（3）项债券交易纠纷案计提了减值准备。

（2）公司与程宇证券交易代理合同纠纷案

程宇就其创业板股票大宗交易减持失败事宜，向深圳市福田区人民法院（以下简称“福田法院”）对公司提起诉讼，要求公司赔偿损失人民币 11,906,695 元及相应利息，并承担诉讼费用（相关背景情况请参见公司 2017 年半年度报告）。公司于 2017 年 6 月 22 日收到福田法院的传票，后公司提起管辖权异议，并于 2017 年 7 月 31 日收到福田法院裁定，案件移交北京市朝阳区人民法院（以下简称“朝阳法院”）审理。2017 年 11 月 21 日，本案在朝阳法院一审开庭，庭上对程宇方证据质证完毕，下次开庭时间有待另行通知。

（3）公司与杨辉劳动争议案

原公司员工杨辉因劳动合同争议于 2017 年 6 月 12 日向北京市朝阳区劳动人事争议仲裁委员会（以下简称“朝阳劳仲”）提起劳动仲裁申请，请求公司支付工资报酬、奖金、违法解除劳动关系赔偿金等共计人民币 1,457.26 万元（相关背景情况请参见公司 2017 年半年度报告）。朝阳劳仲于 2017 年 6 月 19 日受理本案，并于 2017 年 9 月 5 日第一次开庭，杨辉将请求金额从人民币 1,457.26 万元增加

到人民币 1,517.26 万元。2017 年 9 月 19 日，本案在朝阳劳仲第二次开庭。2017 年 11 月 13 日，朝阳劳仲作出仲裁裁决，驳回杨辉的全部仲裁请求，公司仲裁胜诉。

(4) 公司与致富皮业私募债违约纠纷案

因宿迁市致富皮业有限公司（以下简称“致富皮业”）私募债违约，公司于 2015 年 4 月 29 日向中国国际经济贸易仲裁委员会（以下简称“贸仲委”）提起仲裁，要求致富皮业偿付债券本金及尚未支付的利息共计人民币 4,609 万元，以及后续发生的利息、违约金、实现债权的费用（相关背景情况请参见公司 2015 年年度报告）。因担保人中海信达担保有限公司（以下简称“中海信达”）及致富皮业实际控制人周立康未依约履行担保责任，公司于 2015 年 8 月 3 日向北京市第三中级人民法院（以下简称“三中院”）提起诉讼，要求担保人中海信达、周立康承担连带保证责任，诉请偿付债券本金及利息共计人民币 4,609 万元以及后续发生的利息、违约金、实现债权的费用。2017 年 11 月 29 日三中院作出一审判决，公司胜诉。

(5) 公司与帅佳投资股票质押式回购交易纠纷案

2016 年 12 月、2017 年 3 月，公司与湖南帅佳投资股份有限公司（以下简称“帅佳投资”）签订了《股票质押式回购交易业务协议》（以下简称“业务协议”）及两份《交易协议书》，帅佳投资将其所持有的部分湖南尔康制药股份有限公司（以下简称“尔康制药”）限售流通股股票（证券代码：300267）质押给公司，与公司开展股票质押式回购交易。2017 年 8 月，尔康制药收到中国证监会《调查通知书》，称因尔康制药涉嫌信息披露违法违规，中国证监会决定对尔康制药进行立案稽查。为保障资金回款安全，公司与帅佳投资签署《补充协议》，约定并实施追保措施。2017 年 11 月 23 日尔康制药股票复牌，复牌后股票价格连续下跌，2017 年 12 月初跌破协议约定的平仓价，后帅佳投资未及时完成履约保障措施，构成实质违约。公司及时向帅佳投资发出回购通知，要求其限期支付应付的本金、利息、违约金等资金，但帅佳投资未能按期支付全部资金。因公司与帅佳投资签订的业务协议、交易协议书均办理公证并赋予强制执行效力，公司向公证处申请出具了执行证书，并于 2018 年 1 月初向湖南省高级人民法院申请强制

执行，要求帅佳投资支付欠付本金人民币 64,768 万元，以及相应的利息、违约金、债权实现费用等，湖南省高级人民法院于 2018 年 1 月 8 日已受理此案。公司已按规定对该案件计提了减值准备。

(6) 公司管理的定向资产管理计划与孟凯违约纠纷案

2015 年 5 月，因孟凯违约，公司向福田法院申请实现孟凯持有的 18,156 万股*ST 云网股票质押的担保物权（相关背景情况请参见公司 2015 年半年度报告）。2017 年 12 月 7 日，福田法院作出执行通知，将在福田法院淘宝网司法拍卖网络平台上公开拍卖被执行人孟凯名下的*ST 云网股票 18,156 万股。被执行人孟凯收到上述执行通知书后，针对本次拍卖行为向福田法院提出执行异议申请。2018 年 1 月 8 日，福田法院作出执行裁定书，裁定驳回异议人孟凯的执行异议。

(7) 金鼎信小贷公司与青鑫达纠纷案

2016 年 1 月 11 日，因借款合同违约事宜，中信证券（山东）的控股子公司金鼎信小贷公司对借款人青岛青鑫达贸易有限公司（以下简称“青鑫达”）以及连带责任担保人（山东省博兴县长虹钢板有限公司、王永青、王伟、王强、王忠）提起诉讼，诉请青鑫达偿还金额约为人民币 1,416.02 万元，青岛市市南区人民法院（以下简称“市南法院”）于当日受理本案（相关背景情况请参见公司 2016 年年度报告）。本案于 2017 年 2 月 21 日开庭审理，市南法院于 2017 年 6 月 2 日作出判决，金鼎信小贷公司胜诉。2017 年 10 月 11 日，金鼎信小贷公司向市南法院申请强制执行，并于 2017 年 11 月 21 日向市南法院提交了拍卖申请书。

(8) 华夏基金与圣达威、蓝博旺违约纠纷案

华夏基金与圣达威、蓝博旺违约纠纷案的背景情况请参见公司过往刊发的定期报告。

a. 华夏基金与圣达威违约纠纷案

2014 年 6 月 30 日，因圣达威服饰有限公司（以下简称“圣达威”）未按期支付其发行的私募债券：“13 圣达 01”利息，华夏基金对其担保人中海信达担保有限公司（以下简称“中海信达”）提起诉讼，要求中海信达承担连带保证责任，诉请赔偿金额约为人民币 3,040 万元（包括债券本金及两期利息）。2017 年 9 月

22 日，华夏基金收到朝阳法院下达的一审民事判决书，该判决支持华夏基金关于要求圣达威债券担保人中海信达承担保证责任的诉讼请求。目前本案已进入执行程序。

b. 华夏基金与蓝博旺违约纠纷案

因私募债“12 蓝博 01”、“12 蓝博 02”的发行人（安徽蓝博旺机械集团下属三家企业）未履行还本付息义务，华夏基金于 2015 年 4 月 28 日针对发行人、担保人（中海信达、安徽蓝博旺机械集团实际控制人吕青堂、安徽蓝博旺机械集团工程车辆有限公司）和承销商（首创证券有限责任公司）向华南国际经济贸易仲裁委员会提起仲裁，要求各责任方履行偿付义务并承担赔偿责任，提请赔偿金额约为人民币 5,804.81 万元。华夏基金于 2016 年 8 月 30 日向安徽省淮南市中级人民法院申请强制执行，2017 年 3 月 1 日，法院以无可供执行财产为由终结本次执行程序。

（9）中信证券国际与魏力劳资纠纷案

魏力于 2013 年 1 月加入公司，同年 5 月借调到中信证券国际，于 2015 年 1 月起成为中信证券国际正式员工，由于工作表现不理想及内部重组，中信证券国际于 2016 年 7 月 24 日正式解雇魏力并按香港劳工法例及合约规定发放所有应付款项。魏力向香港劳资审裁处提诉，向中信证券国际追讨港币 42,782,192.99 元，理由包括不当地终止雇佣合约、不合理地扣减工资、未支付医疗费用、奖金及退休金供款。案件于 2017 年 4 月 27 日初审，由于魏力已同时向香港平等机会委员会（以下简称“平机会”）对中信证券国际作出残疾歧视投诉，劳资审裁处将案件无限期押后至平机会调查结束。2017 年 7 月，平机会调查结束，决定不采取任何行动，其后，魏力向劳资审裁处申请续审。2018 年 1 月 24 日，劳资审裁处下令，由于魏力之申诉涉及残疾歧视的指控，案件已超出劳资审裁处之管辖权范围，故将案件转移到区域法院审理，暂未确定审理日期。

（10）张正超诉中信期货期货经纪合同纠纷案

张正超因期货经纪合同纠纷向青岛市中级人民法院提起诉讼，认为中信期货及中信期货青岛营业部承担全部赔偿责任，并赔偿人民币 11,485,320 元（相关

背景情况请参见公司 2016 年年度报告)。2016 年 9 月 12 日, 中信期货收到青岛市中级人民法院一审判决书, 判决驳回原告张正超的全部诉讼请求。张正超向山东省高级人民法院提起上诉, 山东省高级人民法院于 2017 年 3 月 20 日下达二审判决, 判决驳回上诉, 维持原判。后张正超向最高人民法院提出再审申请, 2017 年 10 月 23 日, 中信期货收到最高人民法院裁定书, 裁定依法驳回张正超的再审申请。

2、被中国证监会立案调查

2015 年, 公司曾公告收到中国证监会调查通知书(稽查总队调查通字 153121 号), 该次调查的范围是公司在融资融券业务开展过程中, 存在违反《证券公司监督管理条例》第八十四条“未按照规定与客户签订业务合同”规定之嫌(详情请参见公司于 2015 年 11 月 27 日、2015 年 11 月 30 日发布的公告)。2017 年 5 月 24 日, 就前述调查, 公司收到中国证监会《行政处罚事先告知书》(处罚字[2017]57 号)。截至本报告披露日, 就该事项公司暂未收到其他告知书或通知书。

三、相关当事人

2017 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。

(本页以下无正文)

（本页无正文，为《中信证券股份有限公司面向合格投资者公开发行2017年公司
债券（第二期）受托管理事务报告（2017年度）》之盖章页）

债券受托管理人：海通证券股份有限公司



2018年6月19日