境内股票简称：华泰证券　　境内股票代码：601688

境外股票简称：HTSC　　境外股票代码：6886

债券简称：16 华泰 G1、16 华泰 G2　　债券代码：136851、136852

华泰证券股份有限公司 2016 年公司债券（第一期）

受托管理事务报告

（2016 年度）

债券受托管理人：申万宏源证券有限公司

（北京市西城区太平桥大街 19 号）

申万宏源证券有限公司（以下简称 “申万宏源证券”）作为华泰证券股份有限公司（以下简称“发行人”、“公司”、“华泰证券”）2016 年公开发行的“16 华泰 G1”和“16 华泰 G2”债券受托管理人，代表本次债券全体持有人，在公司债券存续期间，持续关注“16 华泰 G1”和“16 华泰 G2”的进展情况以及对“16 华泰 G1”和“16 华泰 G2”持有人权益有重大影响的事项。根据《公司债券发行与交易管理办法》、《上海证券交易所公司债券上市规则》、《华泰证券股份有限公司公开发行2016年公司债券（第一期）募集说明书（面向合格投资者）》（以下简称《募集说明书》）及《华泰证券股份有限公司 2016 年公司债券受托管理协议》（以下简称《债券受托管理协议》），现就“16华泰G1”和“16华泰G2”2016年受托管理事务报告公告如下：

重要声明

申万宏源证券有限公司编制本报告的内容及信息均来源于发行人对外公布的《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以及第三方中介机构出具的专业意见。申万宏源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、准确性和完整性作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作出独立判断，而不应将本报告中的任何内容据以作为申万宏源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，申万宏源证券不承担任何责任。

目 录

第一章 本期公司债券概要.....1
第二章 受托管理人履职情况.....3
第三章 发行人 2016 年度经营和财务状况.....4
第四章 发行人募集资金使用情况及专项账户运作情况.....17
第五章 本期债券担保人资信情况.....19
第六章 内外部增信措施、偿债保障措施重大变化情况.....20
第七章 债券持有人会议召开情况.....21
第八章 本期公司债券本息偿付情况.....22
第九章 本期公司债券跟踪评级情况.....23
第十章 负责处理与本期债券相关事务专人变动情况.....24
第十一章 对债券持有人权益有重大影响的其他事项.....25

第一章 本期公司债券概要

一、 **核准文件及核准规模**：经中国证券监督管理委员会“证监许可【2016】2577号”文核准，华泰证券股份有限公司获准发行面值不超过140亿元的公司债券。

二、 **债券名称**：华泰证券股份有限公司2016年公司债券（第一期）（简称“本期债券”）。

三、 **债券简称及代码**：品种一为3年期固定利率品种，简称“16华泰G1”，代码为136851；品种二为5年期固定利率品种，简称“16华泰G2”，代码为136852。

四、 **发行主体**：华泰证券股份有限公司。

五、 **发行规模**：本期债券发行规模为人民币60亿元。其中，“16华泰G1”的初始发行规模为40亿元，“16华泰G2”的初始发行规模为20亿元。本期债券引入品种间回拨选择权，回拨比例不受限制，公司将根据本期债券发行申购情况，在发行规模总额内，决定是否行使品种间回拨选择权。行使回拨选择权后，“16华泰G1”的最终发行规模为35亿元，“16华泰G2”的最终发行规模为25亿元。

六、 **债券利率**：本期债券票面利率在债券存续期内固定不变，采取单利按年计息，不计复利。“16华泰G1”的票面利率为3.57%，“16华泰G2”的票面利率为3.78%。

七、 **票面金额和发行价格**：本期债券票面金额为100元，按面值平价发行。

八、 **还本付息期限及方式**：本期公司债券按年付息、到期一次还本。利息每年支付一次，最后一期利息随本金一起支付。本期债券本息支付将按照债券登记机构的有关规定来统计债券持有人名单，本息支付的具体事项按照债券登记机构的相关规定办理。

九、 **起息日**：本期债券的起息日为2016年12月6日。

十、 **利息登记日**：付息日之前的第 1 个交易日为上一个计息周期的利息登记日。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周期的利息（最后一个计息周期的利息随本金一起支付）。

十一、 **付息日**：“16华泰G1”的付息日为2017年至2019年每年的12月6日，“16华泰G2”的付息日为2017年至2021年每年的12月6日；如遇法定节假日或休息日，则顺延至其后的第1个交易日。

十二、 兑付日：“16 华泰 G1”的兑付日为 2019 年 12 月 6 日，“16 华泰 G2”的兑付日为 2021 年 12 月 6 日；前述日期如遇法定节假日或休息日，则顺延至其后的第 1 个工作日。在兑付登记日次日至兑付日期间，本期债券停止交易。

十三、 计息期限：本期债券品种一的计息期限自 2016 年 12 月 6 日起至 2019 年 12 月 5 日止；品种二的计息期限自 2016 年 12 月 6 日起至 2021 年 12 月 5 日止。

十四、 支付金额：本期债券于每个付息日向投资者支付的利息为投资者截至利息登记日收市时各自所持有的本期债券票面总额、票面年利率及本计息周期内实际存续天数/当年实际天数的乘积，于兑付日向投资者支付的本息为投资者截至兑付登记日收市时持有的本期债券最后一期利息及等于票面总额的本金。

十五、 支付方式：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。

十六、 向公司股东配售的安排：本期债券不向公司原股东配售。

十七、 担保情况：本期债券为无担保债券。

十八、 信用等级及资信评级机构：经上海新世纪综合评定，本公司的主体信用等级为 AAA，本期债券的信用等级为 AAA。

十九、 募集资金用途：本期债券募集资金在扣除发行费用后将用于补充公司运营资金。

二十、 新质押式回购：本公司将向上交所申请本期债券上市后新质押式回购交易事宜，具体折算率等事宜按登记机构的相关规定执行。

二十一、 债券受托管理人：申万宏源证券有限公司。

第二章 受托管理人履职情况

申万宏源证券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，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，募集资金专项账户运作规范。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，受托管理人较好地履行了职责，为保护本期债券投资者的利益发挥了积极作用。

第三章 发行人 2016 年度经营和财务状况

一、发行人基本情况

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

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

二、发行人 2016 年度经营情况

公司所从事的主要业务包括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、海外业务及其他。公司坚持“以投资银行业务为龙头、以经纪及财富管理业务为基础、以资产管理业务和投资及交易业务为两翼”的全业务链发展战略，形成了差异化的核心竞争力。公司将基于证券业务优势积极拓展综合经营，致力于成为兼具本土优势和全球视野的一流综合金融集团。

2016 年发行人实现营业收入 1,691,701.94 万元，同比减少 35.58%，营业成本为 851,906.86 万元，同比减少 28.96%。各业务板块的情况如下表：

单位：万元；币种：人民币

业务	营业收入			营业成本			毛利率
	数额	占比	增减变动	数额	占比	增减变动	
经纪及财富管理业务	1,019,762.99	60.28%	-43.30%	467,914.53	54.93%	-20.15%	54.12%
投资银行业务	239,837.85	14.18%	29.18%	148,631.85	17.45%	22.32%	38.03%
资产管理业务	279,440.88	16.52%	29.03%	74,442.40	8.74%	41.50%	73.36%
投资及交易业务	170,768.06	10.09%	-53.15%	27,201.01	3.19%	-61.35%	84.07%
海外业务及其他	-18,107.84	-1.07%	-129.70%	133,717.06	15.70%	-63.73%	-838.45%
合计	1,691,701.94	100.00%	-35.58%	851,906.86	100.00%	-28.96%	49.64%

数据来源：《华泰证券股份有限公司 2016 年年度报告》

（一）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。2016 年，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。

1、证券与期货经纪业务方面

2016 年，股票市场先抑后扬，呈现震荡格局，股票成交金额明显下降，根据沪深交易所统计数据，2016 年两市股基交易量人民币 277.83 万亿元，较 2015 年同比减少 48.71%。随着互联网金融的持续发展、一人多户政策的放开以及市场化进程的显著提速，券商经纪业务竞争更趋激烈，行业平均佣金率或将进一步下滑，但后续下滑空间有限。2016 年，受股票市场宽幅震荡、监管部门杠杆管理日趋严格及市场流动性宽裕带来资金供求失衡等多重因素影响，市场融资融券业务整体规模进一步萎缩。

代理交易金额及市场份额数据如下：

单位：亿元；币种：人民币

2016 年			2015 年		
证券品种	代理交易金额	市场份额（%）	证券品种	代理交易金额	市场份额（%）
股票	200,008.38	7.85	股票	373,621.36	7.34
基金	45,194.72	20.33	基金	77,954.04	25.59
债券	136,541.20	2.88	债券	104,943.26	4.03
合计	381,744.30	5.08	合计	556,518.66	6.95

数据来源：《华泰证券股份有限公司 2016 年年度报告》

2016 年，公司持续优化完善移动终端“涨乐财富通”功能内容，“涨乐财富通”移动终端客户开户数 185.89 万，占公司全部开户数的 91.18%；公司 81.92%的交易客户通过“涨乐财富通”进行交易。2016 年，公司沪港通下港股通业务稳定运行，累计开通权限客户数 139,822 户，累计交易金额人民币 846.67 亿元，市场占比为 6.26%。2016 年，公司股票期权经纪业务稳步增长，总成交量 1,086.62 万张，市场份额为 10.40%，截至 2016 年末累计保有期权投资者账户 9,967 户。

在期货经纪业务领域，截至 2016 年末，共有 5 家分公司、32 家期货营业部，遍及国内 4 个直辖市和 14 个省份，代理交易期货品种 51 个。2016 年，华泰期货有限公司（以下简称“华泰期货”）（不含结算会员）实现代理成交量 22,174.79 万手，成交金额人民币 107,957.99 亿元，同比分别增加 20.25%和减少 67.75%，市场份额分别为 2.68%和 2.76%。2016 年，公司期货 IB 业务稳步提升，净新增期货 IB 业务客户 8,797 户，总客户数达 28,276 户，截至 2016 年末，公司获准从事期货 IB 业务的证券营业部共 196 家，期货 IB 业务客户日均权益人民币 27.04 亿元。

2、金融产品销售方面

公司代理销售金融产品的销售总金额及代理销售总收入如下表：

单位：万元；币种：人民币

代销金融产品业务	2016年		2015年	
	销售总金额	销售总收入	销售总金额	销售总收入
基金	1,834,062.16	19,326.70	3,083,846.78	32,813.72
信托	194,300.00	374.11	218,301.00	1,392.74
其他	401,247,916.98	953.54	479,464,476.43	668.99
合计	403,276,279.15	20,654.36	482,766,624.21	34,875.46

数据来源：《华泰证券股份有限公司2016年年度报告》

3、机构销售与研究业务方面

2016年，公司机构销售业务持续加大各类机构投资者的开发和需求挖掘，推进建立机构销售与交易平台，加大向机构客户推广和销售各种证券交易服务和金融产品力度，不断提高客户服务质量与服务效率。研究业务持续加强队伍基础建设，加大引进业内领军人物的力度，强化研究和销售业务一体化服务体系，研究业务影响力和定价权能力进一步提升。深入推进大陆香港机构销售与研究业务一体化战略，构建完善一体化的境内外客户服务网络，客户跨区域资产配置的服务支持能力不断提升。2016年，公司研究业务客户覆盖及合作类型更加全面，全年发布研究报告4,716篇、组织内外部路演6,102场、电话会议170场、行业投资沙龙53场、大型策略及专题研讨会议15场。截至2016年末，公司公募基金分仓交易量人民币5,456.16亿元，市场份额为5.35%。

2016年，公司大力发展主经纪商业务，不断提升业务体系化运作水平，持续推进基金托管及外包业务开展，优化完善业务体系与流程，深入挖掘核心客户资源与合作潜力，不断拓宽业务发展空间和边界，以标准化的基础服务和个性化的增值服务满足各类客户需求。截至2016年末，公司基金托管业务上线产品934只，托管业务规模人民币497.21亿元；私募基金外包业务上线产品1,589只（含资管子公司产品714只），外包业务规模人民币9,241.03亿元（含资管子公司业务规模人民币8,833.89亿元）。

4、资本中介业务方面

截至2016年末，母公司融资融券业务余额人民币551.43亿元，市场份额为5.87%，排名位居行业第二，整体维持担保比例为337.76%。2016年，公司股票质押式回购业务呈持续增长态势，截至2016年末，业务待购回余额合计人民币690.26亿元，规模位居行业第三，平均履约保障比例为245.28%。2016年，公司积极推进行权融资与限制性股票融资业务，截至2016年末，行权融资业务待购回余额人民币0.25亿元、平均履约保障比例为276.03%，限制性股票融资业务待购回余额人民币13.45亿元、平均履约保障比例为423.97%。

（二）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。2016 年，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。

1、股权承销、债券承销与财务顾问业务方面

2016 年市场情况如下：股权融资市场呈现结构性变化趋势，前三季度 IPO 发行节奏放缓，再融资保持活跃；四季度 IPO 发行提速，再融资审批趋缓趋严；债券市场仍处于发展快车道，市场增量和存量规模继续扩大，创新品种不断丰富，制度建设日益完善，债券市场发展的广度和深度不断加强；在供给侧结构性改革、国企改革及并购重组市场化改革持续推进背景下，并购重组市场规模再创新高。在此背景下，2016 年，公司主动调整并优化业务布局，强化内部协作效率和外部响应速度，不断完善全业务链服务体系和大投行一体化运作模式，坚持“行业为导向，客户为中心”战略，持续打造业务发展长效机制，业务整体运行效率不断提升，客户粘性持续增强。

币种：人民币

发行类别	主承销次数（次）		主承销金额（万元）		主承销收入（万元）	
	本期	历年累计	本期	历年累计	本期	历年累计
新股发行	6	141	1,085,495.73	9,245,066.66	34,486.26	386,191.14
增发新股	39	124	6,854,957.26	17,897,181.35	51,968.80	163,803.99
配股	-	30	-	1,002,136.78	-	19,236.96
债券发行	128	407	17,163,467.45	40,312,122.53	58,966.71	204,576.16
合计	173	702	25,103,920.44	68,456,507.32	145,421.77	773,808.25

数据来源：《华泰证券股份有限公司 2016 年年度报告》

2016 年，并购重组、财务顾问业务情况（合并数据）如下表：

币种：人民币

	净收入（万元）	家数	
	2016 年	2016 年	历年累计
并购重组、财务顾问业务	63,753.03	191	1,013

数据来源：《华泰证券股份有限公司 2016 年年度报告》

2、场外业务方面

2016 年，新三板市场快速扩容，挂牌企业数量及市场规模呈持续增长态势，随着新三板分层的落地实施及配套制度的持续完善，新三板市场持续健康发展的基础进一步夯实。根据全国股份转让系统统计数据，截至 2016 年末，新三板市场挂牌公司 10,163 家、总市值人民币 40,558.11 亿元，较 2015 年增加 98.15%与 64.97%。

2016 年，公司抓住市场机遇，适时调整业务结构，持续跟进挂牌企业融资需求，全面推进各项业务，坚持为客户提供高质量的全方位综合金融服务。2016 年，公司共完成推荐挂牌项目 29 家、获同意挂牌函项目 2 家、在审项目 1 家，完成 25 家挂牌企业的 29 次股权私募合计人民币 24.28 亿元，完成 2 单股权收购独立财务顾问业务合计交易金额人民币 11.47 亿元，并完成多家挂牌企业股权质押融资及债权融资业务。2016 年，公司控股子公司江苏股权交易中心积极整合业务资源，持续加强金融产品创新，为挂牌企业提供全方位综合性金融服务，截至 2016 年末，累计发展会员单位 233 家、各类投资者共计 5,903 户；累计挂牌企业 1,139 家；累计为挂牌企业股权融资人民币 1.84 亿元，股权质押融资人民币 0.78 亿元；私募债券、定向融资工具、金融资产收益权产品与资产管理计划分别累计发行人民币 216.93 亿元、人民币 41.65 亿元、人民币 8.82 亿元与人民币 132.79 亿元。

（三）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证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“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有限责任公司开展直接投资业务，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管理有限公司（以下简称“南方基金”）和华

泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“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。2016 年，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。

1、证券公司资产管理业务方面

2016 年，华泰资管公司在严控风险基础上加大业务创新力度，深入引导与创造客户需求，以多样化的金融产品满足客户多元化的投融资需求。在集合资管业务方面，业务产品线更加均衡，固定收益投资保持优势，综合金融服务水平不断提升，截至 2016 年末，合计管理集合资管计划 92 只，合计管理规模人民币 1,294.74 亿元。在定向资管业务方面，积极提升主动管理能力，在银证业务稳步发展的基础上，委外投资业务发展迅速，规模良性扩张，截至 2016 年末，合计管理定向资管计划 588 只，合计管理规模人民币 7,187.05 亿元。在专项资管业务方面，消费金融、票据、租赁、保障房、类信贷金融资产、绿色产业资产等领域形成业务优势，截至 2016 年末，合计管理专项资管计划 34 只，合计管理规模人民币 351.41 亿元。此外，华泰资管公司获得了公募基金管理业务资格，并积极筹备公募产品的申报及发行工作。

2016 年，公司资产管理业务规模和收入情况如下表所示：

币种：人民币

项目	2016 年度		2015 年度	
	受托规模（亿元）	净收入（万元）	受托规模（亿元）	净收入（万元）
集合资产管理业务	1,294.74	125,559.51	1,013.21	94,371.97
定向资产管理业务	7,187.05	28,935.95	4,997.44	24,066.95
专项资产管理业务	351.41	4,714.15	133.21	1,274.00

数据来源：《华泰证券股份有限公司 2016 年年度报告》

2、私募股权基金管理业务方面

2016 年，公司积极开展私募股权投资基金的设立及募资工作，进一步扩大基金管理规模。截至 2016 年末，公司合计设立私募股权投资基金 17 只，合计认缴规模人民币 421.766 亿元，合计实缴规模人民币 310.066 亿元。

2016 年，公司设立的私募股权投资基金实施投资项目情况如下：

币种：人民币

	合计投资项目数量（家）	其中：股权投资类项目（家）	债权投资类项目（家）	合计投资金额（万元）	其中：股权投资类项目（万元）	债权投资类项目（万元）
华泰紫金（江苏）股权投资基金（有限合伙）	2	2	0	6,950	6,950	0
江苏华泰瑞联并购基金（有限合伙）	7	7	0	273,304.81	273,304.81	0
北京华泰新产业成长投资基金（有限合伙）	1	1	0	10,000	10,000	0
华泰招商（江苏）资本市场投资母基金（有限合伙）	7	7	0	45,860.71	45,860.71	0
深圳市华泰瑞麟股权投资基金合伙企业（有限合伙）	5	5	0	16,420	16,420	0
北京华泰瑞合医疗产业投资中心（有限合伙）	4	4	0	23,935.02	23,935.02	0
江苏华泰互联网产业投资基金（有限合伙）	1	1	0	9,970.09	9,970.09	0
江苏华泰战略新兴产业投资基金（有限合伙）	3	3	0	43,006.50	43,006.50	0
伊犁苏新投资基金合伙企业（有限合伙）	3	3	0	62,582.15	62,582.15	0

数据来源：《华泰证券股份有限公司 2016 年年度报告》

3、基金公司资产管理业务方面

2016 年，面对激烈的竞争和复杂的市场环境，公司旗下基金公司持续推进合规风控建设，加强内部精细化管理，不断提升为客户创造价值的能力、提升开拓市场和服务客户的能力、提升后台支持和运营保障的能力，保证业务平稳健康发展，资产管理业务水平增长明显，产品结构进一步优化。在南方基金资产管理业务领域，截至 2016 年末，南方基金管理资产规模合计人民币 6,452.17 亿元，较 2015 年底增加 26.47%，其中，公募业务管理基金数量合计 116 只，公募业务管理资产规模合计人民币 3,914.86 亿元，较 2015 年底增加 17.14%；非公募业务管理账户数量合计 194 只，非公募业务管理资产规模合计人民币 2,537.31 亿元，较 2015 年底增加 44.18%。在华泰柏瑞资产管理业务领域，截至 2016 年末，华泰柏瑞管理资产规模合计人民币 1,071.97 亿元，较 2015 年底减少 19.19%，其中，公募业务管理基金数量合计 46 只，公募业务管理资产规模合计

人民币 974.88 亿元，较 2015 年底减少 24.96%；非公募业务管理账户数量合计 30 只，非公募业务管理资产规模合计人民币 97.09 亿元，较 2015 年底增加 255.90%。

4、期货公司资产管理业务方面

2016 年，华泰期货持续丰富资金渠道，不断拓展合作范围，构建完善合规与风险控制体系及投顾测评体系，全面提升内部管理水平及业务拓展能力，大力推进主动管理业务，截至 2016 年末，存续期内资产管理计划合计 90 只，资产管理总规模人民币 1,385,341.90 万元，同比增加 90.02%，期货端权益规模人民币 439,668.81 万元，同比增加 132.99%。

（四）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。2016 年，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。

1、权益证券投资及交易业务方面

2016 年，股票市场波幅较大，沪深两市主要指数整体表现为下跌。截至 2016 年末，沪深 300 指数报收 3,310.08 点，下跌 11.28%；上证综指报收 3,103.64 点，下跌 12.31%；深证成指报收 10,177.14 点，下跌 19.64%；创业板指报收 1,962.06 点，下跌 27.71%。

2016 年，公司以“追求风险可控前提下的合理回报”为投资目标，强化长期价值投资的绝对收益理念，坚持业务多元化和去方向化发展，构建完善以股票池为核心的科学投研体系，不断推进投研一体化管理平台建设，有效运用各类金融工具和交易技术，积极挖掘安全边际高的投资品种；场内量化对冲投资业务逐步实现由原有配置型对冲投资模式向多元化交易型模式转变，不断完善 Alpha 量化投资体系，积极拓展策略研究的深度和广度，以数据分析为基础完善市场检测体系，结合仓位管理和策略管

理，开展多元化策略投资交易。截至 2016 年末，权益证券投资及交易业务实现正收益。公司积极开展新三板做市业务，加强新三板做市品种研究，截至 2016 年末，公司合计为 76 家挂牌公司提供做市报价服务，做市总市值人民币 58,757.03 万元。

2、固定收益投资及交易业务方面

2016 年，债券市场跌宕起伏，前三季度延续牛市行情，在宏观经济疲软、监管去杠杆、债券违约、海外加息落地等因素作用下，四季度出现大幅调整，债券收益率曲线整体波动上行。截至 2016 年末，中证全债指数报收 175.59 点，上涨 2.00%；中债综合全价指数报收 116.09 点，下跌 1.64%。

2016 年，公司积极推进传统自营业务转型和新型业务创设，推动业务体系内的深度合作，着力布局 FICC 业务，打造差异化竞争优势。固定收益业务坚持去方向化交易策略，及时根据市场走势适时调整持仓结构，积极构建完善利率债和衍生品套利模式，持续丰富对冲策略，全面加强持仓风险管理；销售交易业务准确把握银行系理财规模高速扩张的介入良机，实现投资顾问业务规模跨越式增长；大宗商品业务着重拓展交易品种并优化交易模式，积极开展黄金租借业务，2016 年，黄金租借业务合计开展 57 笔，融资规模合计人民币 162.30 亿元，黄金租借利率 2.90%；外汇业务积极推进结售汇业务资格申请及外币债券投资业务、外币投资委外业务与外币拆借业务准备工作。截至 2016 年末，固定收益投资及交易业务实现正收益。

3、OTC 金融产品与交易业务方面

2016 年，公司持续完善场外柜台市场交易系统功能，细化工作机制与业务流程，强化投资者适当性管理，规范推动私募业务、场外金融衍生品业务及场外融资业务等发展。目前，公司柜台市场取得了投资类、代理交易类、创设类、推荐类、展示类等全部业务权限。2016 年，公司发行私募产品 79 只，合计规模人民币 163.51 亿元，其中：收益凭证发行 65 只，规模人民币 116.15 亿元；资管计划发行 8 只，规模人民币 25.93 亿元；私募基金发行 2 只，规模人民币 2.00 亿元；信托计划发行 4 只，规模人民币 19.43 亿元。2016 年，公司净减少 29 笔权益类收益互换交易业务，截至 2016 年末的业务存量为 8 笔，存量名义本金人民币 15.84 亿元。2016 年，公司场外期权业务净增加 25 笔交易，净增加名义本金人民币 273.01 亿元；截至 2016 年末的存续场外期权交易 65 笔，存量名义本金人民币 425.34 亿元。

4、另类投资业务方面

2016 年，公司通过全资子公司华泰创新投资有限公司开展另类投资业务。2016 年，新增投资项目 5 个，投资规模人民币 3.15 亿元，结束投资项目 5 个，目前存续项目 4 个，投资品种包括合格境内有限合伙人、资管计划、大宗商品跨期套利、上海黄金交易所延期交收合约项目等。

合并数据：

单位：万元；币种：人民币

项目	2016 年	2015 年
证券投资收益	431,581.92	747,323.20
其中：出售以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的收益	11,255.54	369,352.68
出售以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债收益	-131,106.02	22.50
出售可供出售金融资产投资收益	145,989.29	113,011.17
金融资产持有期间收益	266,336.43	297,364.32
衍生金融工具的投资收益	139,106.68	-32,427.47
公允价值变动损益	-33,970.41	-71,603.37
其中：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-96,086.45	-4,808.51
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	-79,348.46	78,067.37
衍生金融工具	141,464.50	-144,862.22
合计	**397,611.52**	**675,719.83**

数据来源：《华泰证券股份有限公司 2016 年年度报告》

（五）海外业务及其他

公司通过全资子公司华泰金融控股（香港）有限公司（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。2016 年，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。

2016 年，全球经济形势动荡，世界经济仍处于国际金融危机后的深度调整期，主要发达国家经济复苏缓慢，新兴国家经济增速放缓，全球经济整体呈弱复苏态势。在资本市场双向开放的深度和广度日益深化的背景下，跨境财富管理及投融资需求日益增加，拥有深厚客户基础的中资券商将迎来新的机遇。

2016 年，华泰金控（香港）持续推进海外业务发展，不断深化业务条线管理与资源整合，实现了业务转型和升级，从以零售经纪业务为主的业务模式转变为拥有多业务条线的金融服务平台。截至 2016 年末，证券交易方面，华泰金控（香港）客户数 15,695 户、托管资产总量港币 63.27 亿元、股票交易总量港币 268.69 亿元；期货合约交易方面，客户数 1,092 户、托管资金量港币 1.10 亿元、期货交易总量 7.44 万手；就证券提供意见方面，为约 3,500 个客户提供研究报告及咨询；就机构融资提供意见方面，参与完成 IPO 项目 3 个、股票配售项目 1 个、债券发行项目 6 个，合计承销家数 10 个，总交易发行规模约 35.45 亿美元；提供证券保证金融资方面，信用资金账户数 4,723 户，累计授信金额港币 9,126.15 万元；提供资产管理方面，受托资金总额港币 2,606.98 亿元（含 AssetMark Financial Holdings, Inc. （以下简称“AssetMark”）受托资金规模）。同时，2016 年，华泰金控（香港）还完成财务顾问项目 13 个、结构性投融资项目 7 个。

2016 年，公司完成美国 AssetMark 公司收购事宜。AssetMark 公司是美国市场领先的统包资产管理平台，作为第三方金融服务机构，为投资顾问提供投资策略及资产组合管理、客户关系管理、资产托管等一系列服务和先进便捷的技术平台。截至 2016 年末，AssetMark 公司平台资产管理规模达 322.51 亿美元，服务投资顾问数量超过 7,200 名。

除此之外，总部还有一些其他业务，包括公司总部一般营运资本用途产生的利息收入与开支，总部中后台部门的费用支出以及对联营企业的投资收益等。其他业务本期营业收入较 2015 年同期大幅减少，主要是因流动性管理利息收入及投资收益下降；成本大幅下降是因为营业收入下降总部计提人工费用减少。

三、发行人 2016 年度财务状况

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对发行人 2016 年财务报告进行了审计，并出具了毕马威华振审字第 1700988 号审计报告。

发行人 2016 年主要财务数据如下：

1、合并资产负债表主要数据

单位：万元；币种：人民币

项目	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日	增减幅度
资产总额	40,145,039.76	45,261,461.53	-11.30%
负债总额	31,579,020.11	37,108,584.46	-14.90%
归属于母公司所有者权益	8,435,745.64	8,078,492.49	4.42%
所有者权益	8,566,019.65	8,152,877.07	5.07%

2、合并利润表主要数据

单位：万元；币种：人民币

项目	2016 年度	2015 年度	增减幅度
营业收入	1,691,701.94	2,626,193.99	-35.58%
营业利润	839,795.08	1,427,007.44	-41.15%
利润总额	859,342.80	1,426,349.68	-39.75%
净利润	651,948.79	1,079,790.82	-39.62%
归属于母公司所有者的净利润	627,061.15	1,069,687.09	-41.38%

3、合并现金流量表主要数据

单位：万元；币种：人民币

项目	2016 年度	2015 年度	增减幅度
经营活动产生的现金流量净额	-1,535,572.88	1,482,039.85	-203.61%
投资活动产生的现金流量净额	-446,265.12	-2,112,233.99	-
筹资活动产生的现金流量净额	-500,966.27	5,383,308.82	-109.31%
现金及现金等价物净增加额	-2,431,973.59	4,795,000.49	-150.72%
期末现金及现金等价物余额	12,622,054.79	15,054,028.38	-16.15%

第四章 发行人募集资金使用情况及专项账户运作情况

一、本期公司债券募集资金情况

经中国证券监督管理委员会“证监许可【2016】2577号”文核准，华泰证券获准发行面值不超过140亿元的公司债券。本次债券分两期发行，第一期发行规模为60亿元，第二期发行规模为80亿元，核准额度已全部使用完毕。

本期公司债券于2016年12月5日至2016年12月6日公开发行，分为两个品种，分别为“”品种一“16华泰G1”和品种二“16华泰G2”。募集资金总额为人民币600,000万元（大写陆拾亿元整）。2016年12月6日，发行人募集资金专户（320006669018010136657）收到该笔资金人民币600,000万元（大写陆拾亿元整）。

二、本期公司债券募集资金实际使用情况

根据发行人2016年11月25日签署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具体如下：

本期债券的募集资金扣除发行费用后将用于补充公司运营资金，满足公司业务运营需求，调整优化负债结构，降低财务风险。公司将根据未来证券市场走势和公司业务发展需求灵活、审慎地运用资金，具体用途包括但不限于支持融资融券、股票质押等资本中介业务的发展、扩大FICC等创新业务的投资规模，优化负债结构，降低财务风险，进一步增强公司的盈利能力和市场竞争力。

发行人根据募集资金使用约定，陆续将募集资金投入使用，主要用于固定收益业务交收、融资融券与股票质押业务等。截至2016年末，本期公司债券募集资金已全部使用完毕，符合募集说明书中披露的使用用途。

三、本期公司债券募集资金专项账户运作情况

本期债券在交通银行股份有限公司江苏省分行开设募集资金专户，账号为320006669018010136657。

自本期债券发行以来，此账户运作正常，公司按照募集说明书的约定安排使用募集资金，专门用于存放本期债券所募集的资金，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用于补充营运资金及偿还到期债务，资金投向符合募集说明书的要求。

第五章 本期债券担保人资信情况

本期债券为无担保债券。

第六章 内外部增信措施、偿债保障措施重大变化情况

2016 年度，本期债券内外部增信措施、偿债保障措施未发生重大变化，且发行人偿债保障措施执行情况良好。

根据本期债券募集说明书约定，本期债券偿债保障措施包括：1、制定《债券持有人会议规则》；2、聘请债券受托管理人；3、设立专门的偿付工作小组；4、严格的信息披露；5、其他保障措施。

截至本受托管理报告出具日，发行人已制定《债券持有人会议规则》并聘请申万宏源证券有限公司为本期债券受托管理人；发行人将于本期债券每年的利息偿付日之前和/或本金兑付日之前的十五个工作日内，专门成立偿付工作小组，负责本金和利息的偿付及与之相关的工作；发行人在本期债券存续期内并未发生可能影响公司偿债能力或债券价格的重大事项；且并未出现预计不能按期偿付债券本息或者到期未能按期偿付债券本息的情形，未触发其他保障措施的执行条件。因此，截至本报告出具日，发行人偿债保障措施未发生重大变化，且偿债保障措施执行情况良好。

第七章 债券持有人会议召开情况

截至本报告书出具之日，未召开债券持有人会议。

第八章 本期公司债券本息偿付情况

本期公司债券起息日为2016年12月6日，债券利息自起息日起每年支付一次。截止到本报告书出具之日，债券存续期尚不足一年，无付息事宜。

第九章 本期公司债券跟踪评级情况

本期公司债券的信用评级机构上海新世纪资信评估投资服务有限公司完成了对本期公司债券的跟踪评级，并于 2017 年 5 月 8 日出具了《华泰证券股份有限公司 2013 年、2015 年、2016 年公司债券跟踪评级报告》（新世纪跟踪[2017]100087），跟踪评级结果如下：

1、16 华泰 G1 债项信用评级：AAA 级

2、16 华泰 G2 债项信用评级：AAA 级

3、发行人主体信用评级：AAA 级

4、评级展望：稳定

本次跟踪评级情况与《华泰证券股份有限公司公开发行 2016 年公司债券（第一期）信用评级报告》的评级情况一致，没有出现对债券持有人利益有重大实质性影响的情形。

第十章 负责处理与本期债券相关事务专人变动情况

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。

第十一章 对债券持有人权益有重大影响的其他事项

一、对外担保情况

截至 2016 年末，发行人对外担保（不包括子公司）余额为 30 亿元，对发行人子公司提供担保余额为 62 亿元，担保总额合计 92 亿元，占发行人净资产的 10.92%。但 2016 年发行人对外担保（不包括子公司）发生额为 0 亿元，发行人对子公司提供担保发生金额为 50 亿元。因此，2016 年度不存在发行人当年累计新增对外提供担保超过上年末净资产的百分之二十 的情形，不属于《公司债券受托管理人执业行为准则》第十一条所规定的重大事项，不会对本期债券的本息偿付构成重大不利影响。

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，经公司第二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、未决诉讼、仲裁事项和行政处罚

截至 2016 年末，发行人存在的未决诉讼或仲裁情况如下：

1、诉讼、仲裁事项已在发行人的临时公告披露且无后续进展的

（1）华泰联合证券有限责任公司（以下简称“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用的请求。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、发行人的临时公告未披露或有后续进展的诉讼、仲裁情况

单位：元；币种：人民币

起诉方	应诉方	诉讼仲裁类型	涉案金额
华泰证券	昆山凯虹汽车贸易有限公司	执行异议	25,000,000.00
华泰联合证券	北京华资银团集团	债权债务纠纷	24,391,031.00
华泰联合证券	中国原子能工业有限公司	合同纠纷	12,703,686.88
(委托)天津银行股份有限公司成都分行	四川圣达集团有限公司	债权债务纠纷	59,449,800.00
厦门银行股份有限公司	宁波银行股份有限公司深圳分行	票据纠纷	-

（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 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 2016 年末净资产数据估算）

（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。

综上，与发行人资产规模相比，上述未决诉讼或仲裁金额相对较小，不属于重大诉讼或仲裁事项，不属于《公司债券受托管理人执业行为准则》第十一条所规定的重大事项，不会对本期债券的本息偿付构成重大不利影响。

3、行政处罚

华泰证券股份有限公司于 2016 年 11 月 28 日收到中国证监会[2016]126 号《行政处罚决定书》（以下简称“《[2016]126 号行政处罚决定书》”），认定发行人存在以下违法事实：

“华泰证券对于杭州恒生网络技术服务有限公司和浙江核新同花顺网络信息股份有限公司外部接入的第三方交易终端软件，或者未进行软件认证许可，或者缺乏有效控制，未对外部系统接入实施有效管理，对相关客户身份情况缺乏了解。截至调查日，华泰证券有 455 个使用杭州恒生网络技术服务有限公司 HOMS 系统（以下简称 HOMS 系统）、61 个使用浙江核新同花顺网络信息股份有限公司系统（以下简称同花顺系统）接入违规交易的主账户。对上述客户，华泰证券未按要求采集客户交易终端信息，未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性，未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息。”

该《[2016]126 号行政处罚决定书》认定发行人未按照《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条，《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解，违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（四）项所述的行为，获利 18,235,275.00 元。并且发行人在 2015 年 7 月 12 日中国证监会发布《关于清理整顿违法从事证券业务活动的意见》（证监会公告[2015]19 号）之后，仍未采取有效措施严格审查客户身份的真实性，未切实防范客户借用证券交易通道违规从事交易活动，新增下挂子账户 102 个，性质恶劣、情节严重。根据当事人违法行为的事实、性质、情节和社会危害程度，依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定，决定对发行人责令改正，给予警告，没收违法所得 18,235,275.00 元，并处以 54,705,825.00 元罚款。

发行人于 2016 年 11 月 28 日收到该行政处罚决定书，早于本期债券的发行日，该事项预计不会对本期债券的本息偿付构成重大不利影响。

2016 年，发行人进一步规范了外部信息系统有关接入、评估、测试、接口及线路等申请流程，实现对外接信息系统的规范化管理。为及时掌握可能新增的非法接入行为，发行人建立了客户交易行为监控系统，对已接入客户的交易行为、交易终端码的报送情况、疑似非授权接入等行为进行逐月监控和分析。开展并完成了存量外接系统等有关特征码的专项改造，建立特征码数据核查机制，逐月汇总形成异常数据报表，

分析特征码异常原因，落实系统改进。2016 年，发行人继续推进交易终端特征码的规范工作，持续监测，每月排查，及时完善系统。

三、其他事项

2017年5月26日，发行人第四届董事会第六次会议审议通过非公开发行A股股票的相关议案，具体内容详见公司刊载于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）的相关公告。近日，公司第一大股东江苏省国信资产管理集团有限公司收到江苏省人民政府国有资产监督管理委员会（以下简称“江苏省国资委”）《关于同意华泰证券股份有限公司非公开发行A股股票有关事项的批复》（苏国资复[2017]33号），江苏省国资委同意发行人非公开发行不超过1,088,731,200股A股股票的方案。关于非公开发行股票的事项，已于6月21日股东大会审议通过，在获得中国证券监督管理委员会核准后方可实施。

四、相关当事人

截至本报告书出具之日，本期债券的受托管理人为申万宏源证券有限公司，资信评级机构为上海新世纪资信评估投资服务有限公司，均未发生变动。

（以下无正文）

（本页无正文，为《华泰证券股份有限公司 2016 年公司债券（第一期）受托管理事务报告（2016 年度）》之签署页）

债券受托管理人：申万宏源证券有限公司

2017 年 6 月 26 日