东吴证券股份有限公司
SOOCHOW SECURITIES CO.,LTD.

（住所：苏州工业园区星阳街 5 号）

2013 年公司债券
受托管理事务报告

（2016年度）

债券受托管理人

CREDIT SUISSE FOUNDER
瑞信方正

瑞信方正证券有限责任公司

（办公地址：北京市西城区金融大街甲 9 号金融街中心南楼 15 层）

声明

瑞信方正证券有限责任公司（以下简称“瑞信方正”）编制本报告的内容及信息均来源于发行人对外公布的《东吴证券股份有限公司 2016 年年度报告》等相关公开信息披露文件、东吴证券股份有限公司（以下简称“东吴证券”、“公司”或“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。瑞信方正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。

瑞信方正编制本报告仅对本期债券受托管理事务进行专项说明，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瑞信方正所作的承诺或声明。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，瑞信方正不承担任何责任。

目录

第一章 本期债券基本情况 1
第二章 发行人 2016 年度经营和财务情况 3
第三章 发行人募集资金使用情况 7
第四章 债券持有人会议召开情况 8
第五章 本期债券利息的偿付情况 9
第六章 本期债券跟踪评级情况 10
第七章 负责处理公司债券相关事务的专人变动情况 11
第八章 其他事项 12

第一章 本期债券基本情况

一、发行人名称

中文名称：东吴证券股份有限公司

英文名称：Soochow Securities Co., Ltd.

二、核准文件及核准规模

东吴证券公开发行不超过人民币 30 亿元公司债券已获得中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2013〕1286 号文核准，东吴证券股份有限公司 2013 年公司债券（以下简称“本期债券”）发行总额为人民币 30 亿元。

三、本期债券的主要条款

1、债券名称：东吴证券股份有限公司 2013 年公司债券。

2、发行规模：人民币 30 亿元。

3、票面金额：本期债券每张票面金额为 100 元。

4、发行价格：本期债券按面值发行。

5、债券期限及品种：本期债券为 5 年期单一期限品种，债券简称为“13 东吴债”，债券代码为“122288”。

6、债券形式：实名制记账式公司债券。投资者认购的本期债券在登记机构开立的托管账户托管记载。本期债券发行结束后，债券持有人可按照有关主管机构的规定进行债券的转让、质押等操作。

7、债券利率：本期债券的票面利率为 6.18%。

8、还本付息的期限和方式：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。

9、担保情况：本期债券无担保。

10、信用等级：根据鹏元资信评估有限公司出具的《东吴证券股份有限公司2013 年 30 亿元公司债券信用评级报告》（鹏信评【2013】第 Z【497】号），公司的主体信用等级为 AA+，债券信用等级为 AA+。

11、起息日：2013 年 11 月 18 日。

12、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。

13、付息日期：本期债券的付息日期为 2014 年至 2018 年每年的 11 月 18 日，如遇法定节假日或休息日，则顺延至下一个工作日，顺延期间不另计息。

14、计息期限：本期债券的计息期限自 2013 年 11 月 18 日起至 2018 年 11 月 17 日止。

15、兑付日期：本期债券的兑付日期为 2018 年 11 月 18 日，如遇法定节假日或休息日，则顺延至下一个工作日，顺延期间不另计息。

16、债券受托管理人：瑞信方正证券有限责任公司。

第二章 发行人2016年度经营和财务情况

一、发行人基本情况

1、发行人设立情况

东吴证券系由东吴证券有限责任公司整体变更设立，东吴证券有限责任公司的前身为苏州证券公司。1992年9月4日，中国人民银行以“银复[1992]361号”文批准设立苏州证券公司。1993年4月10日，苏州证券公司取得了苏州市工商行政管理局核发的《企业法人营业执照》，注册号为13772051-9，注册资金3,000万元。

2、发行人设立后的历次股本变化情况

1997年2月14日，中国人民银行以“非银证[1997]11号”文同意苏州证券公司与中国人民银行脱钩改制并增资扩股；公司名称变更为“苏州证券有限责任公司”，注册资本增至10,400万元。1998年4月16日，公司完成了工商变更登记手续，注册号变更为3205001103389。

2001年12月18日，中国证监会以“证监机构字[2001]308号”文核准苏州证券增资扩股至10亿元，并更名为“东吴证券有限责任公司”。2002年4月12日，公司完成了工商变更登记手续。

2008年6月23日，中国证监会以“证监许可[2008]831号”文核准东吴证券有限责任公司增资扩股至15亿元。2008年8月8日，公司完成了工商变更登记手续，注册号变更为320500000004432。

2010年3月17日，中国证监会以“证监许可[2010]310号”文核准东吴证券有限责任公司整体变更为东吴证券。2010年5月28日，公司完成了工商变更登记手续，并取得了江苏省工商行政管理局核发的《企业法人营业执照》。

2011年11月23日，经中国证监会“证监许可[2011]1887号”《关于核准东吴证券股份有限公司首次公开发行股票的批复》核准，公司以6.50元/股的价格首次公开发行了50,000万股A股。经上交所“上证发字[2011]48号”文核准，公司股票于2011年12月12日起上市交易。公司注册资本增加至20亿元，并于

2012 年 2 月 21 日完成了工商变更登记手续。

2014 年 2 月 13 日，经中国证监会“证监许可[2014]200 号”《关于核准东吴证券股份有限公司非公开发行股票的批复》核准，公司非公开发行不超过 70,000 万股新股。2014 年 8 月 5 日，公司完成非公开发行股票事宜，发行数量 7 亿股，公司注册资本增加至 27 亿元，并于 2014 年 8 月 12 日完成了工商变更登记手续。

2015 年 12 月 23 日，经中国证监会“证监许可[2015]3035 号”《关于核准东吴证券股份有限公司非公开发行股票的批复》，核准公司非公开发行不超过 3 亿股（含 3 亿股）新股。2016 年 1 月 20 日，公司完成非公开发行股票事宜，发行数量为 3 亿股，公司注册资本增加至 30 亿元，并于 2016 年 2 月 5 日完成了工商变更登记手续。

二、发行人 2016 年度经营情况

2016 年，中国经济面对增长内生动力不足，部分行业产能过剩等问题，通过推进供给侧改革，保持了平稳健康发展。经济结构继续优化，质量和效益提高；创新对发展的支撑作用增强；发展新动能不断显现；改革开放取得新突破，对外开放布局进一步完善；经济运行保持在合理区间，实现了“十三五”良好开局。

2016 年，国内资本市场在“依法监管、从严监管、全面监管”的理念下，坚持市场化、法治化、国际化的改革方向，呈现稳中有进、稳中有新的特点，多层次资本市场体系日趋完善，对实体经济特别是供给侧改革的支持力度不断增强。2016 年，二级市场在经历年初较大波动后，呈现震荡企稳的格局。2016 年全年上证综指下跌 12.31%，深证成指下跌 19.65%，根据 WIND 资讯统计，沪深两市股票日均成交额为 5,184.95 亿元，同比下降 50%。

面对机遇和挑战并存的市场形势，公司加快创新转型、优化管理机制、布局国际业务、有效推进证券控股集团建设。报告期内，公司顺利完成股票非公开发行工作，资本实力进一步增强，有效支撑公司各项业务的发展。公司积极创新，抢抓先行先试机遇，成功发行全国首批创新创业公司债券，联手大型央企成功设立规模达 100 亿元的国寿东吴（苏州）城市发展基金。国际业务方面，香港子公司获批成立，新加坡子公司已获得新加坡金融管理局颁发资产管理业务牌照和投

资顾问业务资格以及中国证监会核准的 RQFII 资格。此外，公司参与发起设立了苏州资产管理有限公司，并达成入股东吴人寿意向，证券控股集团的版图更加清晰。

三、发行人 2016 年度财务情况

2016 年度发行人主要财务数据如下：

1、主要会计数据

单位： 元 币种： 人民币

主要会计数据	2016年	2015年	本期比上年同期增减(%)	2014年
营业收入	4,645,225,993.82	6,830,161,925.32	-31.99	3,240,982,527.87
归属于母公司股东的净利润	1,498,288,506.38	2,708,494,901.88	-44.68	1,115,452,050.88
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	1,484,123,247.13	2,698,193,970.77	-45.00	952,793,505.61
经营活动产生的现金流量净额	-6,186,597,944.70	-1,806,012,545.99	-	1,006,467,334.46
其他综合收益	-409,702,768.09	90,185,067.40	-554.29	255,447,836.03
	2016年末	2015年末	本期末比上年同期末增减（%）	2014年末
资产总额	89,476,701,728.74	80,589,136,533.56	11.03	57,461,111,012.63
负债总额	68,987,482,764.44	63,836,767,667.55	8.07	43,227,729,598.61
归属于母公司股东的权益	20,227,169,545.73	16,539,917,099.39	22.29	14,078,857,196.50
所有者权益总额	20,489,218,964.30	16,752,368,866.01	22.31	14,233,381,414.02

2、主要财务指标

主要财务指标	2016年	2015年	本期比上年同期增减(%)	2014年
基本每股收益（元／股）	0.50	1.00	-50.00	0.49
稀释每股收益（元／股）	0.50	1.00	-50.00	0.49
扣除非经常性损益后的基本每股收益（元／股）	0.50	1.00	-50.00	0.42
加权平均净资产收益率（%）	7.58	17.69	减少10.11个百分点	10.60
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率（%）	7.50	17.62	减少10.12个百分点	9.05

3、母公司的净资本及风险控制指标

单位： 元 币种： 人民币

项目	本报告期末	上年度末
净资本	19,466,092,527.16	17,561,589,687.38
净资产	19,794,490,089.42	16,238,764,267.81
风险覆盖率(%)	227.04	236.62
资本杠杆率(%)	27.32	24.07
流动性覆盖率(%)	250.73	217.85
净稳定资金率(%)	149.92	157.05
净资本/净资产(%)	98.34	108.15
净资本/负债(%)	60.89	55.46
净资产/负债(%)	61.91	51.29
自营权益类证券及证券衍生品/净资本(%)	30.52	42.36
自营非权益类证券及其衍生品/净资本(%)	106.43	100.36
融资（含融券）的金额/净资本(%)	79.34	80.64

近三年主要会计数据和财务指标的说明：

1、净资产收益率和每股收益按照《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 9 号——净资产收益率和每股收益的计算及披露》（2010 年修订）的规定计算,计算过程详见财务报表附注补充资料中的 16.02 每股收益及净资产收益率。2016 年 1 月 20 日，公司完成非公开发行股票事宜，发行数量 3 亿股，总股本由 27 亿股变更为 30 亿股。上表计算报告期每股收益时按照增发后的股数进行了计算。

2、上年度末的净资本及相关比例已根据《证券公司风险控制指标管理办法》(2016 年修订版)进行重述。

第三章 发行人募集资金使用情况

一、本期债券募集资金情况

本期债券合计发行人民币 30 亿元，网上公开发行 0.3 亿元，网下发行 29.7 亿元。本期债券扣除承销费用、保荐费用和受托管理费用之后的募集资金已于 2013 年 11 月 20 日汇入发行人指定的银行账户。天衡会计师事务所有限公司对本期债券网上、网下发行及资金划至发行人账户后均进行了验资，并分别出具了编号为天衡验字（2013）00088 号、天衡验字（2013）00090 号及天衡验字（2013）00089 号的验资报告，本期发行的资金准时全额到账。

二、本期债券募集资金实际使用情况

根据发行人公告的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费用后，全部用于补充公司营运资金。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。

第四章 债券持有人会议召开情况

2016 年度，发行人未发生需召开债券持有人会议的事项，未召开债券持有人会议。

第五章 本期债券利息的偿付情况

根据本期债券募集说明书的约定，“13 东吴债”的起息日为 2013 年 11 月 18 日，本期债券付息日期为 2014 年至 2018 年每年的 11 月 18 日。

2016 年 11 月 18 日，发行人按时足额付息，完成了 2016 年度付息事宜。

第六章 本期债券跟踪评级情况

本期债券的信用评级机构鹏元资信评估有限公司于 2017 年 5 月出具了《东吴证券股份有限公司 2013 年公司债券 2017 年跟踪信用评级报告》，跟踪评级结果为：本期债券信用等级维持为 AAA，发行主体长期信用等级维持为 AAA，评级展望维持为稳定。

第七章 负责处理公司债券相关事务的专人变动情况

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。

第八章 其他事项

一、对外担保情况

报告期内，发行人无违反规定决策程序对外提供担保的情况。

二、涉及的未决诉讼或仲裁事项

报告期内，发行人未决诉讼如下：

起诉(申请)方	应诉(被申请)方	承担连带责任方	诉讼仲裁类型	诉讼(仲裁)基本情况	诉讼(仲裁)涉及金额	诉讼(仲裁)是否形成预计负债及金额	诉讼(仲裁)进展情况	诉讼(仲裁)审理结果及影响	诉讼(仲裁)判决执行情况
公司	张跃飞	无	民事诉讼	张跃飞股票质押式回购业务违约，公司在苏州中院提起诉讼	本金5000万元及相应利息、罚息、费用等	-	未开庭	-	-

三、相关当事人

截至本报告出具日，本期债券的受托管理人和资信评级机构均未发生变动。

四、受托管理人履职情况

瑞信方正作为本期债券的受托管理人，以维护全体债券持有人的最大利益为行事原则；持续关注公司的经营情祝、财务状况及资信状况，根据受托管理协议的有关约定及监管要求履行受托管理人职责，维护债券持有人的合法权益。

根据发行人《东吴证券股份有限公司2016年年度报告》，2016年度发行人累计新增发行债券15亿元，均为短期融资券；其他累计新增借款94.33亿元，包括公司及子公司的短期借款、收益凭证、资产收益权转让融入资金及同业拆借等方式，公司新增借款累计超过上年末净资产的20%。

上述新增借款是依据公司业务开展需要发生的，公司保持了合理的资产负债率水平，未对公司的经营情况和偿债能力产生重大不利影响。

根据发行人公告的《东吴证券股份有限公司关于 2017 年 1-4 月累计新增借款的公告》，截至 2017 年 4 月 30 日，发行人 2017 年 1-4 月累计新增借款 82.10 亿元，超过 2016 年末净资产人民币 204.89 亿元的 40%。

2017 年 1-4 月公司通过发行公司债券、次级债，累计新增债务融资 82.10 亿元，占 2016 年末净资产的比例为 40.07%，其中公司债券 25.00 亿元，次级债券 57.10 亿元。

发行人上述新增借款属公司日常经营和业务发展所需的融资行为，新增借款不会对公司的经营产生不良影响，对公司偿债能力无重大不利影响。发行人将根据债务融资到期支付安排制定运用计划，合理调度分配资金，保证按期支付到期利息和本金。

瑞信方正作为 13 东吴债的受托管理人，根据《公司债券发行与交易管理办法》、《公司债券受托管理人执业行为准则》等相关规定，就上述事项于 2017 年 5 月 23 日出具了《东吴证券股份有限公司 2013 年公开发行公司债券 2017 年重大事项受托管理事务临时报告》。

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

债券受托管理人：瑞信方正证券有限责任公司

2017 年 6 月 6 日