

股票简称：中信证券  
债券简称：15 中信 01、15 中信 02

股票代码：600030  
债券代码：122384、122385



## 中信证券股份有限公司

CITIC Securities Co., Ltd.

(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)

### 中信证券股份有限公司 2015 年公司债券

#### 受托管理事务报告

(2016 年度)

#### 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)

二〇一七年六月

## 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 2016 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。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，海通证券不承担任何责任。

## 目 录

第一章 本期债券概况 .....	4
第二章 发行人 2016 年度经营和财务状况 .....	6
第三章 发行人募集资金使用情况 .....	15
第四章 发行人偿债保障措施的执行情况 .....	16
第五章 本期债券利息的偿付情况 .....	17
第六章 债券持有人会议召开情况 .....	18
第七章 本期债券跟踪评级情况 .....	19
第八章 负责处理与本期债券相关事务专人的变动情况 .....	20
第九章 受托管理人履行职责情况 .....	21
第十章 其他情况 .....	22

# 第一章 本期债券概况

## 一、核准文件和核准规模

2015年6月10日，经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]1215号文核准，中信证券股份有限公司获准发行不超过人民币80亿元公司债券。

## 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 2015 年公司债券（简称“本期债券”）。
- 2、债券简称及代码：5 年期品种简称为“15 中信 01”，债券代码为“122384”；10 年期品种简称“15 中信 02”，债券代码为“122385”。
- 3、发行规模：人民币80亿元。
- 4、票面金额及发行价格：本期债券面值人民币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5年期固定利率和10年期固定利率两个品种，其中5年期品种的最终发行规模为人民币55亿元，10年期品种的最终发行规模为人民币25亿元。
- 6、债券利率：本期债券5年期品种票面利率为4.60%，10年期品种票面利率为5.10%。
- 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5年期品种的付息日为2016年至2020年每年的6月25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10年期品种的付息日为2016年至2025年每年的6月25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5年期品种的兑付日为2020年6月25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10年期品种的兑付日为2025年6月25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：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于2017年4月18日出具了本期债券2016年度跟踪评级报告，维持本期债券信用级别AAA，维持公司主体信用级别AAA，评级展望为稳定。

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2016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  
股票上市地 : 上海证券交易所  
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](mailto: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。

2015 年 6 月 23 日，公司向科威特投资局等 10 位投资者非公开发行的 11 亿股 H 股于香港联交所上市交易，发行价格 24.60 港元/股，公司总股数由 1,101,690.84 万股变更至 1,211,690.84 万股，其中，A 股 983,858.07 万股，H 股 227,832.77 万股。发行完成后，中国中信有限公司（以下简称“中信有限”）的直接持股比例变更为 15.59%。2016 年 2 月 26 日、2016 年 2 月 29 日，中信有限通过自身股票账户增持发行人股份合计 110,936,871 股 A 股。本次增持完成后，

中信有限持有发行人股份总数由 1,888,758,875 股增至 1,999,695,746 股，直接持股比例由 15.59% 增至 16.50%。

公司于上交所上市后，先后被纳入上证 180 指数、上证 50 指数、沪深 300 指数、上证公司治理指数、新华富时 A50 指数、道琼斯中国 88 指数、上证社会责任指数等；公司于香港联交所上市后，先后被纳入恒生中国 H 股金融行业指数、恒生 AH 指数系列、恒生环球综合指数、恒生综合指数、恒生综合行业指数——金融业、恒生综合中型股指数、恒生中国企业指数、恒生中国内地 100 指数、中证恒生沪港通 AH 股精明指数、上证沪股通指数、富时中国 25 指数、MSCI 中国指数等成份股，极大提升了公司的形象。2014 年 11 月 17 日沪港通开通后，公司股票分别成为沪股通和港股通的标的股票。2016 年 12 月 5 日深港通开通后，公司 H 股股票为深港通标的股票。

## 二、发行人 2016 年度经营情况

### 1、投资银行业务

境内股权融资业务方面，2016 年，公司完成 A 股主承销项目 79 单，主承销金额人民币 2,407.66 亿元（含资产类定向增发），市场份额 11.76%，主承销单数和主承销金额均排名市场第一。其中，IPO 主承销项目 19 单，主承销金额人民币 119.02 亿元；再融资主承销项目 60 单，主承销金额人民币 2,288.64 亿元。

境内债券及结构化融资业务方面，2016 年，公司主承销各类信用债券合计 320 只，主承销金额人民币 3,797.14 亿元，市场份额 2.55%，债券承销金额排名同业第二，承销只数排名同业第三。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 REITs、个人汽车抵押贷款证券化等细分市场上的优势明显。

财务顾问业务方面，2016 年，公司完成的 A 股重大资产重组交易规模人民币 1,197 亿元，市场份额 14.15%，排名行业第一，完成了长江电力收购川云公司、中国动力整合中船重工集团旗下动力资产、天利高新通过重组打造中石油工程建设业务上市平台、顺丰快递和韵达快递通过重组上市等多单并购重组交易，在市场上形成显著影响力。

新三板业务方面，公司作为主办券商持续督导挂牌公司共计174家，所督导挂牌公司融资金额约人民币141亿元，市场份额10.15%，市场排名第一。2016年，公司为188家挂牌公司提供做市服务（其中121家公司进入创新层），做市服务总成交金额约人民币51亿元。

国际业务方面，2016年，中信证券国际和中信里昂证券在香港市场共参与了11单IPO项目、13单再融资项目、16单债券融资项目、13单财务顾问项目。公司在除日本以外的亚太地区（包括中国）股权项目金额排名第一，债券项目金额排名第二。此外，公司完成菲律宾信安银行与日本三菱的重大并购项目，KKR向新加坡国新基金出售持有的中信环境技术有限公司股权等标志性的“一带一路”项目；获得《亚洲货币》亚洲研究销售团队第二名。

## 2、经纪业务

2016年，经纪业务推进“以客户为中心”的组织架构变革，构建差异化、专业化的服务体系，深化个人客户、财富管理客户、机构客户的开发及经营，为客户提供多样化的综合金融服务。

2016年，发行人及其子公司经纪业务继续保持市场第一梯队，关键性市场指标有所提升。其中，代理股票基金交易总额人民币14.92万亿元，市场份额5.72%，排名维持第二；代理买卖手续费净收入市场份额5.31%，较2015年增长4%，排名提升三位至市场第二。托管客户资产维持市场第一，流通市值的市场份额上升17%。公司及中信证券（山东）共代销金融产品人民币2,424亿元。

2016年，发行人及其子公司重视加速客户积累，多种方式开发客户。针对个人客户，建立起统一规划、统一管理、统一推动、统一运营的渠道经营管理体系，重点开发银行、企业和线上渠道，全面开展客户批量化开发工作。针对财富管理客户，通过多元化高起点金融产品实现客户资产配置，并精进会议营销，举办“中信财富指数”、“财富管理论坛”等会议路演活动。针对机构客户，增加上市公司客户覆盖，以自建系统与专业服务开发资产管理机构，并加强开发农商行、城商行等金融同业客户。2016年，新增客户108万户，新增客户资产人民币8,216亿元，托管客户资产总计人民币4.3万亿元，较2015年增加人民币4,500亿元。截至报告期末，零售客户超过660万户；一般法人机构客户2.9万户（扣除已销户机构客户



数量)；QFII客户140家，RQFII客户49家，QFII与RQFII总客户数量和交易量均居市场前列。

发行人及其子公司通过加强网点新设力度、优化网点布局，促进新网点在开户引资方面发挥作用。2016年发行人及中信证券（山东）新设证券营业部36家，境内证券分支机构数量上升至310家，其中证券营业部284家，网点逐渐向发达地区集中，并加强空白市场覆盖。其中，广东、深圳、天津等省（市）网点数量较2014年实现翻番，重庆、内蒙、甘肃等空白区域实现首次入驻。与此同时，为加强区域监管、银行渠道对接，发挥区域综合IBS作用，吸引高素质人才，发行人及其子公司2016年大力推动分公司建设进程，发行人所辖分公司由13家上升至22家。

### 3、交易

资本中介型业务方面，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；继续大力发展做市交易类业务，持续扩大交易所交易基金（ETF）的做市业务、上证50ETF期权做市业务规模。股权管理类业务规模排名同业前列；柜台衍生品类业务处于市场领先水平；做市交易类业务稳定发展，上证50ETF期权做市排名市场第一。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。报告期内，公司上述业务均居市场领先水平。

固定收益业务方面，2016年债券市场发行规模继续增加，公司充分发挥客户资源优势，提升服务客户能力，利率产品销售总规模保持同业第一。同时，通过加强各业务板块之间的合作，丰富交易品种，加强市场研判及信用研究，提高债券做市服务能力，公司银行间市场做市商成交量进一步提升。此外，公司积极推动股份制银行、城商行等金融机构的投顾服务，满足客户的财富管理需求。

在海外固定收益业务方面，2016年，在市场波动影响下仍有不俗表现，海外固定收益平台年化收益率达12%。发行人及其子公司人民币债券做市业务继续在香港市场名列三甲，并在美元债市场上牢牢占据中资证券公司首位。

大宗商品业务方面，公司坚持金融服务实体经济的原则，继续加强在大宗商品市场方面的业务探索力度。公司继续扩大金属、贵金属交易业务的规模；在上海清算所开展航运指数、动力煤、铁矿石及铜溢价、铜全价等场外掉期交易，场外大宗商品做市交易量市场排名第一；开展境内外商品场外期权业务，继续开展碳排放权交易业务。公司积极拓展现货相关业务的布局，期望通过多种方式为境内外各类产业客户提供大宗商品相关的、全面的金融服务。

大宗经纪业务方面，2016年上半年受到市场影响，融资余额大幅下降；同时由于对冲手段的缺乏，融券业务一度暂停后缓慢恢复。发行人及其子公司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，融资余额稳步增长。截至报告期末，发行人及其子公司融资融券规模约人民币626.76亿元，占全市场业务规模的6.67%，排名市场第一。其中，融资规模人民币626.44亿元，融券规模人民币0.32亿元。

证券自营投资业务方面，2016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，积极抓住市场机会的同时严格管理风险，加强基本面研究力度，继续摸索多策略的自营模式，成效良好。

2016年，另类投资业务面对市场的挑战，基于宏观分析和判断，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，克服了市场的不利影响。同时，积极开拓多市场、多元化的投资策略，有效的分散了投资风险，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、组合对冲基金投资、全球多策略基金、全球统计套利等。全年境内外投资超越沪深300指数约15%。

#### **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18,151.80亿元，市场份额10.5%，较2015年末增加了人民币7,393.26亿元。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1,815.97亿元、15,900.82亿元和435.01亿元。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，截至报告期末，华夏基金本部管理资产规模人民币10,058.46亿元，较2015年底增长16.37%。其中，机构业务资产管理规模人民币5,918.57亿元（未包括投资咨询等业务），较2015年底增长115.89%。

## 5、托管

报告期内，公司加大了面向专业机构客户的销售和服务力度，通过优化服务流程、加强服务体系建设等措施，保持了业务规模的持续增长。公司全资子公司中信中证投资服务有限责任公司于报告期内开始提供份额登记外包服务和估值核算外包服务。截至报告期末，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2,970支，提供基金业务外包服务的证券投资基金、资产管理计划等共2,715支。

## 6、投资

截至报告期末，金石投资设立的直投资基金——青岛金石泓信投资中心（有限合伙）累计投资项目6笔，总投资金额人民币15.35亿元。其中已完全退出项目1个，退出收益人民币12亿元。

2016年，金石投资下设的另一支子基金中信金石基金（以下简称“金石基金”）继续保持在不不动产金融业务领域的国内领先地位，在REITs、私募基金等创新业务中取得了良好的业绩。

报告期内，金石基金致力于不动产金融业务拓展，积极构建投资平台，拓展投资业务，挖掘市场上的优质资产，保持公司在不动产金融业务领域的领先地位。为实现对持有型物业全产品链的覆盖，公司2015年发起设立的持有型物业孵化投资基金，完成了首单业务落地，未来将为REITs储备更多的优质资产，保持公司在REITs业务领域的领先优势。

2016年2月，金石投资与三峡资本控股有限责任公司共同发起设立了三峡金石投资管理有限公司（“三峡金石”）。作为金石投资与产业资本的股权投资合作平台，三峡金石发起募集了三峡金石基金，该基金于2016年5月首次交割，基金规模为人民币50亿元。报告期内，该基金累计投资项目6笔，总投资金额人民币6.807亿元。

### 三、发行人 2016 年度财务状况

根据发行人2016年年度报告，截至2016年12月31日，发行人总资产为人民币5,974.39亿元，比上年同期减少3.03%；所有者权益合计为人民币1,457.89亿元，比上年同期增长2.86%。2016年度，发行人实现营业收入人民币380.02亿元，比上年同期下降32.16%；实现归属于母公司股东的净利润人民币103.65亿元，比上年同期下降47.65%。

发行人2016年按照中国企业会计准则编制的财务报告已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，主要财务数据如下：

#### （一）发行人盈利能力

2016 年度，发行人合并利润表主要数据如下

单位：人民币元

项目	2016 年度	2015 年度	同比增减 (%)
营业收入	38,001,923,489.02	56,013,436,032.55	-32.16
营业利润	14,202,158,712.44	27,654,186,365.48	-48.64
利润总额	14,262,558,591.97	27,287,144,291.36	-47.73
归属于母公司股东的净利润	10,365,168,588.41	19,799,793,374.33	-47.65
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	10,342,364,843.01	20,076,797,281.24	-48.49
其他综合收益	2,318,805,516.44	3,084,447,405.34	-24.82

2016 年，发行人经营业绩较 2015 年同期下降。发行人及其子公司实现营业收入人民币 380.02 亿元，同比下降 32.16%，营业支出人民币 238.00 亿元，同比下降 16.08%；归属于母公司股东的净利润人民币 103.65 亿元，同比下降 47.65%。下降的主要原因是受市场环境整体情况变化影响，各证券公司营业收入能力整体下降。

#### （二）发行人资产负债状况

截至 2016 年 12 月 31 日，发行人合并资产负债表主要数据如下：

单位：人民币元

项目	2016年12月31日	2015年12月31日	同比增减 (%)
资产总额	597,438,839,244.37	616,108,242,188.09	-3.03
负债总额	451,650,169,507.47	474,371,143,708.19	-4.79
归属于母公司股东的权益	142,695,945,757.73	139,137,786,996.38	2.56
所有者权益总额	145,788,669,736.90	141,737,098,479.90	2.86

截至2016年12月31日，发行人及其子公司资产总额为人民币5,974.39亿元，同比减少人民币186.69亿元，下降3.03%；扣除代理买卖证券款后，发行人及其子公司资产总额为人民币4,630.41亿元，同比减少人民币26.10亿元，下降0.56%。截至2016年12月31日，发行人及其子公司负债总额为人民币4,516.50亿元，同比减少人民币227.21亿元，下降4.79%；扣除代理买卖证券款后，发行人及其子公司负债总额为人民币3,172.52亿元，同比减少人民币66.62亿元，下降2.06%。截至2016年12月31日，发行人及其子公司归属于母公司股东的权益为人民币1,426.96亿元，同比增加人民币35.58亿元，增长2.56%。

## (二) 发行人现金流量状况

2016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	2016年度	2015年度	同比增减 (%)
经营活动产生的现金流量净额	-49,392,291,188.73	86,246,226,820.54	-157.27%
投资活动产生的现金流量净额	9,937,655,066.59	-37,910,255,626.78	126.21%
筹资活动产生的现金流量净额	-7,998,537,553.48	27,309,156,894.45	-129.29%
汇率变动对现金的影响	1,335,654,281.34	1,170,325,593.17	14.13%
现金及现金等价物净增加额	-46,117,519,394.28	76,815,453,681.38	-160.04%

2016年度，发行人经营活动产生的现金流量净额下降明显，主要是因为回购业务、代理买卖证券款及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具净流出额同比增加；可供出售金融资产净流入同比增加明显使得投资活动产生的现金流量净额增长明显；筹资活动产生的现金流量净额为人民币-79.99亿元，净流入同比减少人民币353.08亿元，主要是由于报告期内公司债券发行规模及吸收投资收到的现金减少；现金及现金等价物的变动净额为人民币-461.18亿元，净流出同比增加人民币1,229.33亿元，主要是由于经营活动产生的现金流量净额流出同比

增加所致。

## 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

发行人经中国证监会“证监许可[2015]1215号文”批准，于2015年6月24日至2015年6月25日公开发行人民币80亿元的公司债券。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2015年6月19日公告的《中信证券股份有限公司公开发行2015年公司债券募集说明书》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

截至2015年12月31日，募集资金已全部使用完毕，本报告期不涉及募集资金使用情况。

## 第四章 发行人偿债保障措施的执行情况

截止2016年12月31日，公司经营稳健，公司债券增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施未发生变更。公司债券增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施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5年期品种的付息日为2016年至2020年每年的6月25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10年期品种的付息日为2016年至2025年每年的6月25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。根据2016年6月20日公告的《中信证券股份有限公司2015年公司债券2016年付息公告》，发行人已于2016年6月27日支付了本期债券自2015年6月25日至2016年6月24日期间的利息。

截至本报告出具之日，本期债券未出现延迟兑付利息或本金的情况。

## **第六章 债券持有人会议召开情况**

截止本受托管理事务报告出具之日，本期债券未召开债券持有人会议。

## 第七章 本期债券跟踪评级情况

“15中信01”、“15中信02”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2015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2015年公司债券信用评级报告》及《信用等级通知书》（信评委函字[2015]033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，中诚信证评将于本期债券发行主体及担保主体（如有）年度报告公布后一个月内完成该年度的定期跟踪评级。此外，自本次评级报告出具之日起，中诚信证评将密切关注与发行主体、担保主体（如有）以及本期债券有关的信息，如发生可能影响本期债券信用级别的重大事件，发行主体应及时通知中诚信证评并提供相关资料，中诚信证评将在认为必要时及时启动不定期跟踪评级，就该事项进行调研、分析并发布不定期跟踪评级结果。

中诚信证评的定期和不定期跟踪评级结果等相关信息将在中诚信证评网站（[www.ccxr.com.cn](http://www.ccxr.com.cn)）和交易所网站予以公告，且交易所网站公告披露时间应早于在其他交易场所、媒体或者其他场合公开披露的时间。

如发行主体、担保主体（如有）未能及时或拒绝提供相关信息，中诚信证评将根据有关情况进行分析，据此确认或调整主体、债券信用级别或公告信用级别暂时失效。

中诚信证评于2017年4月18日公布了《中信证券股份有限公司2015年公司债券跟踪评级报告（2017）》，维持本期债券信用级别AAA；维持公司主体信用等级AAA，评级展望稳定。

## **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，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) 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 58.57 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，经获授权小组审议，为间接全资附属公司 CITICSecuritiesFinanceMTN 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，CITICSecuritiesFinanceMTN 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，CITICSecuritiesFinanceMTN 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。报告期内，CITICSecuritiesFinanceMTN 未对该次中期票据计划进行提取。

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，仅中信证券国际及其全资子公司中信里昂证券存在担保事项，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、房屋租赁担保、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，截至报告期末，担保金额约合人民币 156.63 亿元。

### 二、涉及的未决诉讼或仲裁事项

#### (一) 有后续进展的诉讼、仲裁情况

报告期内，公司及子公司重大诉讼事项如下：

#### 1、华夏基金与蓝博旺违约纠纷案

华夏基金为公司控股子公司，其管理的中小企业私募债资产管理计划于2013年6月认购了安徽蓝博旺机械集团下属三家企业发行的私募债券第一期（债券简称“12蓝博01”）和第二期（债券简称“12蓝博02”）。因私募债发行人未按期履行还本付息义务，为维护资产管理计划及委托人的合法权益，华夏基金于2015年4月28日针对“12蓝博01”、“12蓝博02”的发行人、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。华南国际经济贸易仲裁委员会已于2015年4月28日受理本案，于2015年8月21日开庭审理，并于2016年6月30日作出仲裁裁决，支持华夏基金关于要求债券发行人、担保人支付安徽蓝博旺机械集团下属三家企业发行的两期私募债券“12蓝博01”、“12蓝博02”本金、利息、违约金的仲裁请求。目前本案已进入执行程序，执行程序尚未完结。

#### 2、金石投资与宝华集团股权转让合同纠纷案

金石投资为公司全资子公司，其于2014年8月11日与山东宝华国际集团有限公司（以下简称“宝华集团”）签订了《股权转让协议》，约定金石投资将持有的山东远东国际生物化工股份有限公司的全部股权转让给宝华集团，宝华集团应当在2014年9月30日前向金石投资支付股权转让价款人民币30,000,000元加上相应的资金成本。2016年8月19日，宝华集团法定代表人金宝华向金石投资出具《保证书》，承诺为宝华集团应向金石投资支付的全部款项提供无限连带保证责任。因宝华集团未足额支付股权转让价款，为维护金石投资的合法权益，金石投资于2016年9月23日向北京市第三中级人民法院（以下简称“法院”）提起民事诉讼，要求宝华集团向金石投资支付股权转让价款，金宝华承担连带支付责任。2016年12月31日，诉讼双方在法院主持下达成调解并签署《调解协议》，约定宝华集团向金石投资支付股权转让款、诉讼费等合计人民币36,220,912.5元。截至报告期末，宝华集团已向金石投资足额支付前述人民币36,220,912.5元款项。

### 3、中证资本合同纠纷案

公司控股子公司中信期货的全资子公司中证资本管理（深圳）有限公司（以下简称“中证资本”）因动力煤代采购合同对手方陆续违约，于 2015 年 4 月 9 日向深圳市前海合作区人民法院（以下简称“前海法院”）提起诉讼并获立案。本案的背景情况请参见发行人 2015 年年度报告、2016 年第一季度报告及 2016 年半年度报告。

诉讼分两案进行，其中诉讼一已于 2016 年 7 月 26 日收到深圳市中级人民法院（以下简称“深圳中院”）二审（终审）判决书，判决支持中证资本的诉讼请求，目前正在执行过程中，截至报告日，中证资本已收到部分执行款人民币 12,010,407.57 元；诉讼二已于 2016 年 8 月 22 日收到深圳中院二审（终审）判决书，判决支持中证资本的诉讼请求，执行程序已于 2016 年 9 月 8 日启动，目前正在执行过程中。2016 年 10 月 13 日，中证资本收到法院下达的解封诉讼二被告之一沈鹏名下财产的裁定书，中证资本对裁定不服，提出复议。2016 年 10 月 27 日，前海法院裁定驳回复议，解除对沈鹏名下财产的冻结。

诉讼二的被告之一沈鹏于 2016 年 3 月 24 日，以诉讼中财产保全损害为由起诉中证资本，要求赔偿人民币 11,715,913.86 元。本案将于 2017 年 8 月 31 日开庭审理。

### 4、张正超诉中信期货期货经纪合同纠纷案

2015 年 5 月 15 日，张正超与中信期货签署《期货经纪合同》，其于 2015 年 7 月 8 日持 IH1509 合约多单共 84 手。因 2015 年 7 月市场出现较大波动，中信期货先后通过系统及电话方式通知张正超追加保证金或及时减仓，在张正超不履行合同义务未自行处理风险的情况下，中信期货于 2015 年 7 月 9 日依据合同约定强行平仓 77 手，且该强行平仓只平出客户在期货交易所可用不足部分。强行平仓后，张正超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应承担全部赔偿责任，并以强平后的上涨价格计算高低点差额主张赔偿人民币 11,485,320 元。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。原告张正超不服一审判决并向山东省高级人民法院提起了上诉。经审理，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。

## 5、金鼎信小贷与公务机公司、青鑫达纠纷案

### (1) 金鼎信小贷公司与公务机公司纠纷案

青岛金鼎信小额贷款股份有限公司（以下简称“金鼎信小贷公司”）系发行人全资子公司中信证券（山东）的控股子公司。2014年3月27日，金鼎信小贷公司与青岛航空公务机有限公司（以下简称“公务机公司”）签订《借款合同》（金鼎信2014年借字第00041号），向公务机公司发放了人民币1,500万元的贷款（贷款期限为2014年3月28日至2015年2月27日），因公务机公司无法于原定还款日2015年2月27日按期偿还贷款本息，为维护自身合法权益，金鼎信小贷公司于2015年3月4日依法对借款人公务机公司以及连带责任担保人滨州市平太投资管理有限公司、山东华昌新能源股份有限公司、滨州大高置业有限公司、于滨提起诉讼，诉请偿还金额约为人民币1,467.99万元（被告于2015年3月2日-3日累计偿还本金人民币32.01万元），青岛市中级人民法院于2015年3月4日受理本案，于2015年3月11日依法申请查封了山东华昌新能源股份公司、于滨名下相关房产。本案现已审理终结，已于2015年8月24日开庭审理，青岛市中级人民法院于2015年11月12日作出判决，判决金鼎信小贷公司胜诉，但因判决未支持金鼎信小贷公司主张的逾期利息，金鼎信小贷公司已于2015年11月20日上诉至山东省高级人民法院。2016年10月28日在山东省高级人民法院主持下双方达成调解。

金鼎信小贷公司已将公务机公司的五级分类等级下调至次级，并足额计提减值拨备。

### (2) 金鼎信小贷公司与青鑫达纠纷案

2014年4月14日，金鼎信小贷公司与青岛青鑫达贸易有限公司（以下简称“青鑫达”）签订《借款合同》（金鼎信2014年借字第00056号），向青鑫达发放了人民币1,500万元的贷款（贷款期限为2014年4月16日至2014年10月15日）。因青鑫达无法于原定还款日2014年10月15日按期偿还贷款本息，金鼎信小贷公司于2016年1月11日依法对借款人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、王忠向青岛市市南区人民法院提起诉讼，诉请偿还金额约为人民币 1,416.02 万元（青鑫达于 2014 年 11 月 26 日至 2015 年 8 月 13 日累计偿还本金人民币 135.7 万元），法院于 2016 年 1 月 11 日受理本案，并于 2016 年 2 月 19 日查封了山东省博兴县长虹钢板有限公司名下土地及房产。2016 年 8 月 19 日，金鼎信小贷与青鑫达协商变更部分担保措施。2016 年 9 月 8 日，金鼎信小贷公司向青岛市市南区人民法院提交了追加被告及诉讼请求申请书，本案已于 2017 年 2 月 21 日开庭审理。

金鼎信小贷公司已将青鑫达的五级分类等级下调至次级，并足额计提减值拨备。

#### 6、SOM 与公司及金石泽信投资管理有限公司设计合同争议仲裁案

2014 年 10 月 8 日，公司及公司子公司金石投资之子公司金石泽信投资管理有限公司（以下简称“金石泽信”）与 Skidmore,Owings&MerrillLLP（以下简称“SOM”）签署《中信金融中心大楼设计合同》等合同。2016 年 12 月，公司及金石泽信收到中国国际经济贸易仲裁委员会（以下简称“贸仲”）《仲裁通知》和相关仲裁材料。因前述设计合同争议，SOM 将公司列为第一被申请人、金石泽信列为第二被申请人向贸仲提起仲裁。其中，针对第一被申请人的仲裁请求包括支付设计费、差旅费和逾期付款利息等合计约 163 万美元（约人民币 1,130 万元）；针对第二被申请人的仲裁请求包括支付设计费、差旅费和逾期付款利息等合计约 120 万美元（约人民币 832 万元）。公司及金石泽信积极进行仲裁准备，按照仲裁通知及仲裁规则，向贸仲提交了《延期选定仲裁员、提交答辩及反请求的申请》并已按仲裁庭要求提交书面答辩意见。

#### （二）公司本年度被处罚的情况

##### 1、被监管部门采取行政监督管理措施

报告期内，公司个别营业部存在以下被监管部门采取行政监督管理措施的事项：

2016 年 3 月 16 日，因公司泉州宝洲路营业部存在员工违反监管规定和公司内部制度为客户融资提供便利的问题，证监会福建监管局对公司泉州宝洲路营业

部出具《关于对中信证券股份有限公司泉州宝洲路证券营业部采取出具警示函措施的决定》（中国证监会福建监管局行政监管措施决定书[2016]3号）。

公司收到上述监管函件后，高度重视并立即进行整改，公司依据事实情形、后果并根据《中信证券股份有限公司合规考核制度》、《中信证券股份有限公司违规问责管理规定》进行内部追责，拟定并落实整改措施，后续将按时向深圳证监局提交增加内部合规检查次数的具体方案。

## 2、被中国证监会立案调查

2015年11月26日，公司收到中国证监会调查通知书（稽查总队调查通字153121号），提及：因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，中国证监会决定对公司进行立案调查。经核实，本次调查的范围是发行人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。公司高度重视，全面积极配合相关调查工作（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）。

截至本报告披露日，发行人已收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2017]57号），主要内容如下：

2011年2月23日，司度（上海）贸易有限公司（以下简称“司度”）在中信证券开立普通证券账户，一直未从事证券交易。根据《中信证券股份有限公司融资融券业务客户征信授信实施细则》（2010年3月发布，沿用至2013年3月25日，以下简称“《实施细则》”）的规定，“在公司开户满半年（试点期间，开户满18个月）”为开立信用账户的条件之一，中信证券在司度从事证券交易时间连续计算不足半年的情况下，为司度提供融资融券服务，于2012年3月12日为其开立了信用证券账户。2012年3月19日，中信证券与司度签订《融资融券业务合同》，致使司度得以开展融券交易。《实施细则》由当时中信证券信用交易管理部负责人宋成牵头制定，由分管副总经理笪新亚签批实施。

截至2015年10月22日，中信证券向司度收取融券收益人民币52,886,294.80元，融券成本人民币47,263,484.17元，净融券收益人民币5,622,810.63元；截至2015年10月10日，中信证券向司度收取交易佣金人民币89,428,768.96元，扣

除交易所规费人民币 33,395,729.81 元，净佣金收益人民币 56,033,039.15 元；共计收益人民币 61,655,849.78 元。

上述行为违反了《证券公司融资融券业务管理办法》（证监会公告[2011]31号）第十一条“对未按照要求提供有关情况、在本公司及与本公司具有控制关系的其他证券公司从事证券交易的时间连续计算不足半年……证券公司不得向其融资、融券”的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（七）项“未按照规定与客户签订业务合同”所述行为。对上述行为直接负责的主管人员为笪新亚、其他直接责任人员为宋成。

依据《证券公司监督管理条例》第八十四条第（七）项的规定，中国证监会拟决定：

一、责令中信证券改正，给予警告，没收违法所得人民币 61,655,849.78 元，并处人民币 308,279,248.90 元罚款；

二、对笪新亚、宋成给予警告，并分别处以人民币 10 万元罚款。

### **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。

（本页以下无正文）

(本页无正文，为《中信证券股份有限公司2015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：海通证券股份有限公司



2017年6月28日