



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



二〇一六年四月

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2016年3月对外公布的《华泰证券股份有限公司2015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。光大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光大证券所作的承诺或声明。在任何情况下，未经光大证券书面许可，不得用作其他任何用途，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 本期次级债券概况.....	3
第二章 发行人 2015 年度经营和财务状况.....	7
第三章 发行人募集资金使用情况.....	14
第四章 本期次级债券担保人资信情况.....	15
第五章 债券持有人会议召开的情况.....	16
第六章 本期次级债券本息偿付情况.....	17
第七章 本期次级债券的跟踪评级情况.....	18
第八章 负责处理公司债券相关事务的专人变动情况.....	19
第九章 其它事项.....	20

第一章 本期次级债券概况

一、内部批准情况

2014年11月25日，华泰证券股份有限公司第三届董事会第十三次会议审议通过了《关于公司发行次级债券的议案》。

2014年12月11日，华泰证券股份有限公司2014年第四次临时股东大会审议通过了《关于公司发行次级债券的议案》。

二、债券名称

华泰证券股份有限公司2015年第二期次级债券。

三、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”。

四、发行主体

华泰证券股份有限公司。

五、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。

六、发行规模

人民币120亿元。

七、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。

八、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。

九、债券面值

人民币壹佰元。

十、发行价格

按面值平价发行。

十一、发行方式

由主承销商光大证券以非公开方式发行。

十二、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。

十三、发行日

2015年4月20日。

十四、缴款日

2015年4月21日。

十五、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。

十六、担保情况

无担保。

十七、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。

十八、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。

十九、登记、托管机构

中国证券登记结算有限责任公司。

二十、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。

第二章 发行人 2015 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（代为履行）：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：赵远宽

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

组织机构代码：70404101-1

互联网网址：<http://www.htsc.com.cn>

二、发行人 2015 年度经营情况

截至2015年12月31日，公司拥有证券营业部245家（其中含3家正在撤销的营业部），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。2015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	1,798,523.79	68.48	586,018.38	48.87
投资银行业务	185,663.16	7.07	121,511.55	10.13
资产管理业务	216,563.44	8.25	52,609.46	4.39

投资与交易业务	364,481.43	13.88	70,371.31	5.87
海外业务及其他	60,962.17	2.32	368,675.85	30.74
合计	2,626,193.99	100.00	1,199,186.55	100.00

2015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	1,212,505.41	84.97	67.42
投资银行业务	64,151.61	4.50	34.55
资产管理业务	163,953.98	11.49	75.71
投资与交易业务	294,110.12	20.61	80.69
海外业务及其他	-307,713.68	-21.56	-504.76
合计	1,427,007.44	100.00	54.34

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。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，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、股票质押式回购及约定购回业务。

2015年，公司经纪及财富管理业务实现营业收入1,798,523.79万元，同比增长128.33%；营业成本586,018.38万元，同比增长74.28%；毛利率67.42%，同比增加10.11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股权承销服务，

包括私募配售、供股等后续再融资以及可转债发行及首次公开发售。债券承销业务方面，公司的全牌照债券承销业务包括企业债券、公司债券、中小企业私募债券、非金融企业债务融资工具、其他各种金融债券及资产证券化等承销服务。财务顾问业务方面，公司从产业布局与策略的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，公司获准作为主办券商提供推荐服务，帮助非上市公司于全国中小企业股份转让系统挂牌并进行股份转让，并积极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也能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。

2015年，公司投资银行业务实现营业收入185,663.16万元，同比增长37.87%；营业成本121,511.55万元，同比增长31.06%；毛利率34.55%，同比增加3.40个百分点。

3、资产管理业务

公司根据客户的资产规模及需求开发资产管理产品和服务，公司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、定向资产管理业务与专项资产管理业务，集合资产管理业务指公司设立资管计划，与客户签订资管合同，将客户资产交由托管机构托管，通过专门账户为客户提供资产管理服务；定向资产管理业务指公司与客户签订定向资产管理合同，接受单一客户委托，通过该客

户账户，为客户提供资产管理服务；专项资产管理业务指公司为客户办理特定目的的专项资产管理业务。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。

2015年，公司资产管理业务实现营业收入216,563.44万元，同比增长66.85%；营业成本52,609.46万元，同比增长131.31%；毛利率75.71%，同比减少6.77个百分点。

4、投资及交易业务

公司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，并积极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，并积极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，公司获准为客户提供及交易OTC金融产品，公司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，并积极从事全国中小企业股份转让系统做市报价服务等。

2015年，公司投资及交易业务实现营业收入364,481.43万元，同比增长102.35%；营业成本70,371.31万元，同比增长60.38%；毛利率

80.69%，同比增加5.05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，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，公司提供投资银行业务，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，公司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，公司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。2015年，公司海外业务实现营业收入3.72亿元，同比增长279.59%；营业成本2.92亿元，同比增长85.99%；毛利率21.77%，同比增加81.97个百分点。除此之外，总部还有一些其他业务，包括一般运营资本产生的利息收入及利息支出。

三、发行人 2015 年度财务情况

发行人2015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：

（一）合并资产负债表主要数据

单位：人民币 元

项目	2015-12-31	2014-12-31	增减率（%）
资产合计	452,614,615,317.16	272,226,035,504.69	66.26
负债合计	371,085,844,614.99	230,281,627,782.69	61.14

归属于母公司所有者权益合计	80,784,924,864.91	41,298,556,412.04	95.61
所有者权益合计	81,528,770,702.17	41,944,407,722.00	94.37

(二) 合并利润表主要数据

单位：人民币 元

项目	2015年度	2014年度	增减率(%)
营业收入	26,261,939,871.49	12,062,303,844.09	117.72
营业利润	14,270,074,421.49	5,849,520,326.60	143.95
利润总额	14,263,496,806.01	5,914,815,469.75	141.15
净利润	10,797,908,235.33	4,539,786,762.08	137.85
归属于母公司所有者的净利润	10,696,870,875.92	4,486,276,132.08	138.44

(三) 合并现金流量表

单位：人民币 元

项目	2015年度	2014年度	增减率(%)
经营活动产生的现金流量净额	14,820,398,504.17	30,402,931,451.43	-51.25
投资活动产生的现金流量净额	-21,122,339,858.82	2,324,757,030.67	-1008.58
筹资活动产生的现金流量净额	53,833,088,155.45	26,459,626,586.37	103.45
现金及现金等价物净增加额	47,950,004,898.58	59,187,194,049.64	-18.99

第三章 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。根据公司业务发展的需要，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。

第四章 本期次级债券担保人资信情况

本期次级债券无担保。

第五章 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。

第六章 本期次级债券本息偿付情况

本期次级债券于2015年4月21日正式起息。截至本报告出具日，本期次级债券尚未到付息时点。

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》，并于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》，后续华泰证券将根据相关业务规则，做好“15华泰02”次级债券赎回事宜的后续信息披露及本息兑付工作。截至本报告出具日，“15华泰02”尚未付息并赎回。

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，截至本报告出具日，“15华泰03”尚未付息。

第七章 本期次级债券的跟踪评级情况

一、跟踪评级安排

本期次级债券未评级，无跟踪评级安排。

二、跟踪评级观点

本期次级债券未评级，无跟踪评级观点。

第八章 负责处理公司债券相关事务的专人变动情况

本期次级债券存续期内，发行人负责处理本期次级债券相关事务的专人未发生变动。

第九章 其它事项

一、对外担保情况

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。

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。

除上述担保事项外,截至2015年12月31日,华泰证券及控股子公司无其他对外担保,也无逾期对外担保。

二、资产抵押和质押情况

截至2015年12月31日,华泰证券以土地使用权抵押向中国工商银行南京新街口支行进行项目借款,最高额度500,000,000.00元。此块土

地使用权原值为353,732,401.40元，累计摊销54,397,855.55元，账面价值为299,334,545.85元。

截至2015年12月31日，华泰证券不存在其他资产抵押、质押、被查封、冻结、必须具备一定的条件才能变现、无法变现、无法用于抵偿债务的情况和其他权利受限制的情况和安排，以及其他具有可对抗第三人的优先偿付负债情况。

三、涉及的未决诉讼或仲裁事项

截至2015年12月31日，华泰证券及控股子公司涉及尚未了结的诉讼与仲裁事项的具体情况如下：

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7,345万元及其利息和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23775.36万元人民币、利息人民币2187.72万元，合计标的人民币约2.6亿元。2014年未发生新的资产与现金收回。截止2015年12月31日，应收四通集团账面金额15442.8万元，已全部计提减值准备。

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3457.89万元，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2430万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。

3、华泰联合证券与中国华诚集团财务有限责任公司、华诚投资管理有限公司债权债务纠纷案：因中国华诚集团财务有限责任公司无偿占用华泰联合证券营业部资金共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1,738万元，中国华诚集团财务有限责任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，要求华诚投资管理有限公司和华诚集团财务有限责任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、执行对华诚投资管理有限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，法院裁定华诚投资管理有限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12598万元，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，要求华诚投资管理有限公司和华诚集团财务有限责任公司连带支付华泰联合证券5458.4万元，并承担诉讼费

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管理有限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民事裁定书，裁定终结华诚投资管理有限公司破产程序，华诚投资管理有限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182.3979万元。2012年7月法院裁定华诚集团财务有限责任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，北京市第二中级人民法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财务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，北京市第二中级人民法院于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财务有限责任公司享有债权金额39387194.72元，后续对方未上诉，判决已生效，等待破产分配中。

4、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。

5、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(2500万)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2500万存单)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2500万存单。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2月25日进行听证,等待

法院裁决。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。

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。

（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



2016年4月14日