

香港交易及結算所有限公司、香港聯合交易所有限公司及香港中央結算有限公司對本公告之內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示概不就因本公告全部或任何部分內容而產生或因倚賴該等內容而引致的任何損失承擔任何責任。



(於中華人民共和國註冊成立的股份有限公司，
中文公司名稱為华泰證券股份有限公司，在香港以 HTSC 名義開展業務)
(股份代號：6886)

海外監管公告

本公告乃根據上市規則第 13.10B 條規則作出。

茲載列本公司在上海證券交易所網站刊登之《华泰證券股份有限公司 2016 年第二次臨時股東大會文件》，僅供參閱。

釋義

於本公告，除文義另有所指外，下列詞彙具有以下涵義。

「本公司」	指	於中華人民共和國以华泰證券股份有限公司的公司名稱註冊成立的股份有限公司，於 2007 年 12 月 7 日由前身华泰證券有限責任公司改制而成，在香港以「HTSC」名義開展業務，根據公司條例第 16 部以中文獲准名稱「華泰六八八六股份有限公司」及英文公司名稱「Huatai Securities Co., Ltd.」註冊為註冊非香港公司，其 H 股於 2015 年 6 月 1 日在香港聯合交易所有限公司主板上市(股票代碼：6886)，其 A 股於 2010 年 2 月 26 日在上海證券交易所上市(股票代碼：601688)
-------	---	--

承本公司董事會命
公司秘書
姜健

中國江蘇，2016 年 7 月 28 日

於本公告日期，董事會成員包括執行董事周易先生；非執行董事浦寶英女士、孫宏寧先生、周勇先生、蔡標先生、高旭先生、陳寧先生及徐清先生；以及獨立非執行董事白維先生、劉紅忠先生、李志明先生、陳傳明先生及楊雄勝先生。

**华泰证券股份有限公司
2016年第二次临时股东大会文件**

2016年9月13日·南京

华泰证券股份有限公司

2016年第二次临时股东大会会议议程

现场会议开始时间：2016年9月13日（星期二）14点

现场会议召开地点：南京市建邺区奥体大街139号南京华泰万丽酒店二楼会议室2

会议召集人：华泰证券股份有限公司董事会

现场会议日程：

- 一、宣布会议开始
- 二、宣布会议出席情况，推选计票人和监票人
- 三、介绍会议基本情况
- 四、审议议案（含股东发言提问环节）
- 五、填写现场表决票并投票
- 六、休会（汇总现场及网络投票结果）
- 七、宣布投票结果

目 录

议案：关于公司为全资子公司华泰证券（上海）资产管理有限公司提供净资本担保的议案1

议案：

关于公司为全资子公司华泰证券（上海）资产管理有限公司提供净资本担保的议案

各位股东：

2015年1月，公司全资子公司华泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称：资管子公司）成立。2015年3月30日，公司2014年度股东大会审议通过了《关于公司为全资子公司华泰证券（上海）资产管理有限公司提供净资本担保的议案》，批准公司为全资子公司华泰证券（上海）资产管理有限公司提供最高额度为人民币12亿元的净资本担保，并承诺当华泰证券（上海）资产管理有限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，同时批准授权公司经营管理层办理履行该担保承诺所涉及各项手续。

2016年6月16日，中国证监会公布了最新修订的《证券公司风险控制指标管理办法》和《关于证券公司风险资本准备计算标准的规定》，资管子公司需为其结构化集合资管计划、投资非标资产的定向计划、其他定向计划分别按照其业务资产净值计提1.0%、0.9%、0.5%的风险资本准备（系数根据中国证监会分类评价标准进行调整，其中连续三年A类或以上为0.7，A类为0.8，B类为0.9，C类为1.0，D类为2.0），计提标准对比原规定均有大幅提高。上述新规将于2016年10月1日起正式执行。2016年7月15日，中国证监会公布了2016年证券公司分类结果，公司从2015年的AA级下降到BBB级。根据监管规定，公司与经营证券业务子公司进行合并评价，BBB级也适用于资管子公司。据此以新规估算，截至2016年6月底，资管子公司风控指标中风

险覆盖率已经低于中国证监会要求的120%的预警标准。

综上所述，为确保资管子公司各项风控指标符合监管要求，公司近期向资管子公司增资了16亿元，并提请审议以下事项：

1、公司为全资子公司华泰证券(上海)资产管理有限公司新增提供最高额度为人民币 50 亿元的净资本担保，并承诺当华泰证券（上海）资产管理有限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。

2、授权公司经营管理层办理履行该担保承诺所涉及各项手续。

本议案已经公司第三届董事会第三十五次会议审议通过，现提请各位股东审议。

附件：关于公司为全资子公司华泰证券（上海）资产管理有限公司提供净资本担保的可行性分析报告

2016 年 9 月 13 日

附件：

关于公司为全资子公司华泰证券（上海）资产管理有限公司提供净资本担保的可行性分析报告

为保证公司全资子公司华泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“资管子公司”）各项风险控制指标符合监管要求，公司拟为资管子公司新增提供最高额度为人民币 50 亿元的净资本担保，并承诺当资管子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。现将有关情况分析如下：

一、华泰证券（上海）资产管理有限公司基本情况

资管子公司前身为公司资产管理总部，系经中国证券监督管理委员会证监许可〔2014〕679 号《关于核准华泰证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》核准，于 2014 年 10 月 16 日由公司出资人民币 3 亿元设立的一人有限责任公司。2015 年 9 月 16 日，公司向资管子公司增资人民币 7 亿元，至此，资管子公司实收资本变更为人民币 10 亿元。

自正式营业以来，资管子公司以全业务链战略方针为指导，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，实现客户价值深度变现。以资产管理方和资产供给方的双重角色，持续提升主动管理能力和产品创设能力，不断锻造核心竞争力，在多个业务领域取得了突破。

为科学应对不断变化的外部环境，资管子公司稳步推进集合、定向、专项资产管理计划三项核心业务，持续提升主动管理能力和产品

创设能力，不断锻造核心竞争力，在多个业务领域取得了突破，资产管理总规模持续增长。集合资管业务全面发力，涵盖固定收益类、权益类、融资类、跨境类、另类投资类等领域，囊括了低、中、高风险等级的各类产品，集合产品线日益丰富。核心产品“天天发”规模不断提升，2015 年日均保有规模创历史新高，创新综合型理财业务“天天财”的上线，标志着客户流动性支持服务能力持续优化。定向资管业务稳步提升，与银行合作的通道业务规模增长迅速，转型推进卓有成效，面向机构定制的理财服务得到不断推进；委外业务快速发展，客户结构不断丰富，与银行、保险等机构的合作得到进一步强化。专项资管业务增长势头强劲，资产证券化业务在两融债权、租赁债权、互联网消费金融、票据资产、保单质押、保理业务等领域形成特色业务，相继推出多款具有行业里程碑意义的资产支持专项计划。

截至 2015 年底，资管子公司资产管理受托规模 6,143.86 亿元，行业排名第三。2015 年，资管子公司实现营业收入 120,955.30 万元，利润总额 93,585.16 万元，净利润 70,171.72 万元，规模及收入均位居行业领先地位。

二、本次担保概况

2016 年 6 月 16 日，中国证监会公布了最新修订的《证券公司风险控制指标管理办法》和《关于证券公司风险资本准备计算标准的规定》(以下简称“新办法”)，并将于 2016 年 10 月 1 日正式施行。按新规估算，截至 2016 年 6 月底，资管子公司风控指标中风险覆盖率远低于中国证监会要求的 120%的预警标准，因此须由公司为其启动净资本补充机制以满足监管要求。公司近期向资管子公司增资了 16 亿元，并拟新增提供额度最高不超过人民币 50 亿元的净资本担保。

三、本次净资本担保的必要性和可行性分析

根据中国证监会最新颁布的《关于证券公司风险资本准备计算标准的规定》，资管子公司需为其结构化集合资管计划、投资非标资产的定向计划、其他定向计划分别按照其业务资产净值计提 1.0%、0.9%、0.5%的风险资本准备，系数根据分类评价标准进行调整，其中连续三年 A 类或以上为 0.7，A 类为 0.8，B 类为 0.9，C 类为 1.0，D 类为 2.0，对比原规定均有大幅提高。上述新规将于 2016 年 10 月 1 日起正式执行。2016 年 7 月 15 日，中国证监会公布了 2016 年证券公司分类评价结果，公司从 2015 年的 AA 级下降到 BBB 级。根据监管规定，公司与经营证券业务子公司进行合并评价，BBB 级也适用于资管子公司。以新规估算，截至 2016 年 6 月底，资管子公司风控指标中风险覆盖率已经低于中国证监会要求的 120%的预警标准。

综合考虑解决方案，需由公司向资管子公司启动净资本补充机制，即公司对资管子公司进行增资 16 亿元，并增加担保承诺 50 亿元，以满足资管子公司风控指标持续符合监管要求。当公司对资管子公司增资 16 亿元并追加担保承诺 50 亿元后，以 2016 年 6 月 30 日的数据测算，资管子公司风控指标中“风险覆盖率”为 155.13%，所有风控指标均能够符合监管的要求，并为后续资管业务开展预留了一定空间。另外，经过净资本压力测试，为资管子公司增资 16 亿元并提供净资本担保 50 亿元后，公司各项监管指标仍可满足监管要求。

综上所述，公司本次对资管子公司的净资本担保将可满足其风控及业务发展需求，同时公司自身各项指标仍将符合监管规定。因此，公司本次为资管子公司提供净资本担保必要且可行。