

香港交易及結算所有限公司及香港聯合交易所有限公司對本公告的內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示，概不對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。



海通證券股份有限公司
HAITONG SECURITIES CO., LTD.*

(在中華人民共和國註冊成立之股份有限公司)

(股份代號：6837)

關於收到中國證監會行政處罰事先告知書的公告

茲提述，海通證券股份有限公司（「本公司」或「海通證券」）日期為2024年4月12日的關於收到中國證券監督管理委員會（「中國證監會」）《立案告知書》（證監立案字03720240050號）的公告。

2024年4月19日，本公司收到了中國證監會《行政處罰事先告知書》（處罰字[2024]56號），原文內容如下：

王澤龍、洪浩煒、中信中證資本管理有限公司（「中信中證」）、中信証券股份有限公司（「中信証券」）、海通證券、韓雨辰涉嫌違反限制性規定轉讓股票一案，已由我會調查完畢，我會依法擬對你們作出行政處罰。現將所根據的違法事實、理由、依據及你們享有的相關權利予以告知。

經查明，2022年7月，中核華原鈦白股份有限公司（「中核鈦白」或「上市公司」）非公開發行A股股票申請獲得中國證監會發審委審核通過。2022年7月至8月，中信中證向中核鈦白實際控制人王澤龍推薦定增多空方案。根據方案，「客戶通過場外衍生品交易台直接實現定增多空套利，提前結算收益，無需等待六個月的鎖定期，通常一個多月時間即可回籠資金和收益」。

2022年9月，王澤龍決定實施定增套利，通過中核鈦白員工持股計劃定向出借券源，並以某投資發展有限公司（「某投資公司」）名義與中信中證開展場外衍生品交易。韓雨辰具體執行套利方案，負責對接中信中證和中信証券。

2022年9月至2023年2月，王澤龍、韓雨辰與中信中證、中信証券商議定增融券套利業務，約定由中核鈦白員工持股計劃轉融通出借8,800萬股「中核鈦白」股票，中信中證指定四個私募基金產品賬戶進行「中核鈦白」股票融券對沖交易，中信証券制定融券出借計劃。

2022年11月，中信中證就掛鈎「中核鈦白」非公開發行股票的收益互換業務與海通証券進行初步溝通。

2022年12月，中信中證合規部門及風險管理委員會審議通過掛鈎約8,800萬股「中核鈦白」非公開發行股份的場外衍生品交易申請。當月，上報「關於某投資發展有限公司與中證資本開展掛鈎中核鈦白限售股場外期權人民幣6億元名義本金的請示」至中信証券風險管理部及風險管理委員會審議通過。

2023年2月，因某投資公司認購資金不足，為了將融券額度用滿，王澤龍建議朋友洪浩煒加入中核鈦白定增融券套利交易，洪浩煒參與並以某1號私募証券投資基金（「1號基金」）名義與中信中證開展場外衍生品交易。

2023年2月8日至2月10日，海通証券衍生產品與交易部經部門內部審批，將「中核鈦白」股票納入衍生品業務備選庫，並履行了中核鈦白非公開發行認購文件的公司用印審批流程。2023年2月10日，海通証券按照中信中證指令價格及認購金額參與中核鈦白非公開發行首輪報價，當日確定發行價格為人民幣5.92元／股。

2023年2月16日，海通証券簽署中核鈦白非公開發行股票之股份認購協議，並與中信中證達成掛鈎標的為「中核鈦白」股票的多頭收益互換，名義本金為人民幣5.32億元，對應股數為8,986.49萬股，由中信中證提供全額保證金。同日，某投資公司與中信中證達成香草期權組合合約，掛鈎標的為「中核鈦白」股票，名義本金為人民幣4.26億元，對應股數為7,195.95萬股；1號基金與中信中證達成香草期權組合合約，掛鈎標的為「中核鈦白」股票，名義本金為人民幣8,903.98萬元，對應股數為1,504.05萬股。

2023年2月6日至2月20日，某投資公司與中信中證達成掛鈎標的為「中核鈦白」股票的空頭收益互換，合計開倉股數為7,195.95萬股，對應名義本金為人民幣5.48億元。2023年2月10日至2月20日，1號基金與中信中證達成多筆空頭收益互換，合計開倉股數為1,504.05萬股，對應名義本金為人民幣1.14億元。

2023年2月6日至2月14日，中核鈦白員工持股計劃所持8,800萬股「中核鈦白」股票按照中信中證指定路徑分配到四個私募基金產品賬戶，出借期限通過展期和借新還舊續期至2023年9月。

2023年2月13日至2月21日，四個私募基金產品賬戶融券賣出8,800萬股「中核鈦白」股票，賣出均價約人民幣7.63元／股，成交金額約人民幣6.71億元。

王澤龍未將自己通過上述交易安排實際參與非公開發行的信息告知上市公司。2023年2月24日、3月3日，中核鈦白公告非公開發行A股股票相關發行情況報告書，稱本次非公開發行對象不存在發行人實際控制人通過直接或間接形式參與本次發行認購的情形。

2023年3月9日，中核鈦白公告本次非公開發行股票上市，股票限售期為2023年3月9日至9月8日。2023年3月17日至4月6日，某投資公司、1號基金向中信中證申請提前終止所有多頭香草期權合約與空頭收益互換合約，中信中證了結相應頭寸並進行結算。最終，王澤龍通過某投資公司實際獲利人民幣58,161,993.37元，洪浩煒、王澤龍通過1號基金分別實際獲利人民幣14,193,879.43元、2,475,961元，中信中證未有實際獲利，中信証券融券業務收入為人民幣1,910,680.83元，海通証券收益互換業務收入為人民幣789,445.21元。

上述違法事實，有詢問筆錄、交易記錄、交易確認書、情況說明、銀行賬戶流水、上市公司公告等證據證明。

我會認為：一是王澤龍和洪浩煒上述行為，通過衍生品交易安排，實質參與非公開發行，並以市價融券賣出，提前鎖定與非公開發行股票折扣價之間的價差收益，變相規避限售期規定，違反《中華人民共和國證券法》(《證券法》)第三十六條、《上市公司證券發行管理辦法》(2020年修訂)第三十八條第二項等規定，構成《證券法》第一百八十六條所述違法情形。

二是中信中證為王澤龍、洪浩煒違反限制性規定轉讓股票行為制定套利方案、搭建交易架構、提供槓桿資金支持等；中信証券知悉客戶融券目的是定增套利，配合其提供融券服務；海通証券以自己名義按照中信中證的報價指令認購中核鈦白非公開發行股票，客觀上幫助中信中證及其客戶取得股票收益，使得定增套利行為得以實現；韓雨辰替王澤龍等人出面執行定增套利方案。中信中證、中信証券、海通証券、韓雨辰上述行為，與王澤龍、洪浩煒共同構成《證券法》第一百八十六條所述違法情形。

三是王澤龍在洪浩煒違反限制性規定轉讓股票過程中，參與商議定增融券套利方案，聯繫並建議洪浩煒加入套利，與洪浩煒共同構成《證券法》第一百八十六條所述違法情形。

四是王澤龍作為中核鈦白實際控制人，在中核鈦白2023年非公開發行股票過程中，隱瞞其通過一系列交易安排實際參與非公開發行的情況，導致中核鈦白非公開發行A股股票相關發行情況報告書存在虛假記載，違反《證券法》第七十八條第二款、《上市公司信息披露管理辦法》(2021年修訂)第四十條等規定，構成《證券法》第一百九十七條第二款所述違法情形。

根據當事人違法行為的事實、性質、情節與社會危害程度，我會擬決定：

一、依據《證券法》第一百八十六條的規定，對王澤龍、洪浩煒、中信中證資本管理有限公司、中信証券股份有限公司、海通証券股份有限公司、韓雨辰違反限制性規定轉讓股票的違法行為，責令改正，給予警告，沒收違法所得人民幣77,531,959.84元，其中沒收王澤龍違法所得人民幣60,637,954.37元，沒收洪浩煒違法所得人民幣14,193,879.43元，沒收中信証券股份有限公司違法所得人民幣1,910,680.83元，沒收海通証券股份有限公司違法所得人民幣789,445.21元；

對王澤龍與中信中證資本管理有限公司、中信証券股份有限公司、海通証券股份有限公司、韓雨辰違反限制性規定轉讓股票的共同違法行為處以罰款人民幣120,000,000元，其中由王澤龍承擔50%（即人民幣60,000,000元），中信中證資本管理有限公司承擔30%（即人民幣36,000,000元），中信証券股份有限公司承擔15%（即人民幣18,000,000元），海通証券股份有限公司承擔4.5%即人民幣5,400,000元，韓雨辰承擔0.5%（即人民幣600,000元）；

對洪浩煒與王澤龍、中信中證資本管理有限公司、中信証券股份有限公司、海通証券股份有限公司、韓雨辰違反限制性規定轉讓股票的共同違法行為處以罰款人民幣35,000,000元，其中由王澤龍承擔30%（即人民幣10,500,000元），中信中證資本管理有限公司承擔30%（即人民幣10,500,000元），洪浩煒承擔20%（即人民幣7,000,000元），中信証券股份有限公司承擔15%（即人民幣5,250,000元），海通証券股份有限公司承擔4.5%（即人民幣1,575,000元），韓雨辰承擔0.5%（即人民幣175,000元）。

二、依據《證券法》第一百九十七條第二款的規定，對王澤龍信息披露違法行為處以人民幣2,000,000元罰款。

根據《中華人民共和國行政處罰法》第四十五條、第六十三條、第六十四條及《中國證券監督管理委員會行政處罰聽證規則》相關規定，就我會擬對你們實施行政處罰，你們享有陳述、申辯及要求聽證的權利。

請你們在收到本事先告知書之日起5個工作日內將《事先告知書回執》傳真至我會指定聯繫人，並於當日將回執原件遞交中國證監會稽查總隊，逾期則視為放棄上述權利。

本公司誠懇接受處罰，並將深刻反思，汲取教訓，認真落實各項整改要求，進一步優化合規內控機制，不斷提高規範運作意識和水平，堅持舉一反三，依法合規、穩慎推進公司各項業務。本公司將嚴格按照法律法規要求履行信息披露義務，目前本公司的經營情況正常。

香港聯合交易所披露易網站(www.hkexnews.hk)及本公司網站(www.htsec.com)為本公司H股指定信息披露媒體，本公司相關信息以本公司在上述媒體刊登或發布的公告為準，敬請廣大投資者理性投資，注意投資風險。

承董事會命
海通證券股份有限公司
董事長
周杰

中國•上海
2024年4月19日

於本公告日期，本公司執行董事為周杰先生及李軍先生；本公司非執行董事為屠旋旋先生、石磊先生、肖荷花女士及許建國先生；本公司獨立非執行董事為周宇先生、范仁達先生、毛付根先生及毛惠剛先生。