



海通证券  
HAITONG

2022

# INTERIM REPORT

A股股票代码 600837

半年报

# 2022

---

半年度报告

海通证券股份有限公司



## 重要提示

- 一、本公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证半年度报告内容的真实性、准确性、完整性，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并承担个别和连带的法律责任。
- 二、公司全体董事出席董事会会议。
- 三、本半年度报告未经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和罗兵咸永道会计师事务所分别根据中国和国际审阅准则出具了审阅意见。
- 四、公司负责人周杰、主管会计工作负责人张信军及会计机构负责人（会计主管人员）马中声明：保证半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。除特别说明外，本报告所列数据以人民币为单位。
- 五、董事会决议通过的本报告期利润分配预案或公积金转增股本预案  
本公司 2022 年上半年度未拟定利润分配预案和公积金转增股本预案。
- 六、前瞻性陈述的风险声明  
本报告中所涉及的未来计划、发展战略等前瞻性描述不构成公司对投资者的承诺，敬请投资者注意投资风险。
- 七、是否存在被控股股东及其关联方非经营性占用资金情况  
否
- 八、是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况？  
否



## 九、是否存在半数以上董事无法保证公司所披露半年度报告的真实性和完整性

否

## 十、重大风险提示

本集团的业务高度依赖于中国及其他业务所处国家或地区的整体经济及市场状况，宏观经济环境、行业周期特征、市场发展程度、投资者行为以及国际经济形势等诸多因素都将对本集团经营业绩产生重大影响。

本集团面临的主要风险包括：因违反法律法规和准则而使证券公司被依法追究法律责任、采取监管措施、给予纪律处分等情形的法律及合规风险；因借款人、交易对手方或债务发行人无法履行其约定的财务义务而可能对经营造成损失的信用风险；因市场价格的不利变动而使自有资金投资业务发生损失的市场风险；由于内部流程不完善、员工操作失误及不当行为、信息系统故障缺陷以及外部事件导致的操作风险；无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展所需资金的流动性风险；因经营、管理及其他行为或外部事件导致利益相关方进行负面评价的声誉风险。以上各类风险将给本集团的经营和收益带来直接影响，同时由于风险之间存在一定的关联性，这种影响还可能产生叠加效应。

针对上述风险的具体分析及采取的具体措施，请投资者认真阅读半年度报告“管理层讨论与分析”中关于“可能面对的风险及风险应对措施”相关内容，并特别注意上述风险因素。

## 十一、其他

适用 不适用



# 目录

第一节 释义	1
第二节 公司简介和主要财务指标	4
第三节 管理层讨论与分析	13
第四节 公司治理	35
第五节 环境与社会责任	43
第六节 重要事项	48
第七节 股份变动及股东情况	59
第八节 债券相关情况	65
第九节 财务报告	72
第十节 证券公司信息披露	180

## 备查文件目录

载有本公司法定代表人签名的半年度报告文本

载有本公司法定代表人、主管会计工作负责人兼会计机构负责人签名盖章的财务报告文本

报告期内在符合国务院证券监督管理机构规定条件的媒体上公开披露过的所有本公司文件的正本及公告原稿

其他有关资料

## 第一节 释义



在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

**常用词语释义**

本公司、公司或海通证券	指	海通证券股份有限公司
集团或本集团	指	本公司及其子公司
董事会	指	海通证券董事会
监事会	指	海通证券监事会
董事	指	海通证券董事
监事	指	海通证券监事
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
上海证监局	指	中国证券监督管理委员会上海监管局
上交所	指	上海证券交易所
深交所	指	深圳证券交易所
北交所	指	北京证券交易所
香港联交所	指	香港联合交易所有限公司
全国社保基金	指	中国社会保障基金理事会
《上交所上市规则》	指	《上海证券交易所股票上市规则》
香港上市规则	指	香港联交所证券上市规则
标准守则	指	香港上市规则附录十所载之《上市发行人董事进行证券交易的标准守则》
守则	指	香港上市规则附录十四《企业管治守则》及《企业管治报告》
证券及期货条例	指	香港法例第 571 章证券及期货条例（经不时修订、补充或以其他方式修改）
公司章程或章程	指	海通证券的公司章程
公司法	指	中华人民共和国公司法
人民币	指	中国法定货币
港元或港币	指	香港法定货币
欧元	指	欧元区法定货币
美元	指	美利坚合众国法定货币
A 股	指	本公司每股面值人民币 1.00 元的内资股，于上海证券交易所上市并进行交易
H 股	指	本公司每股面值人民币 1.00 元的普通股，于香港联交所上市及以港元买卖
ETF	指	交易型开放式指数基金
WIND	指	万得信息技术股份有限公司
QFII	指	合格境外机构投资者
RQFII	指	人民币合格境外机构投资者
IPO	指	首次公开发售
FICC	指	固定收益、外汇及大宗商品
新三板	指	全国中小企业股份转让系统
报告期	指	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
富国基金	指	富国基金管理有限公司
海通银行	指	海通银行（Haitong Bank, S.A.）

#### 常用词语释义

海通开元	指	海通开元投资有限公司
海通期货	指	海通期货股份有限公司
海通创新证券	指	海通创新证券投资有限公司
海通国际控股	指	海通国际控股有限公司
海通国际	指	海通国际证券集团有限公司，于香港联交所上市，股份代号：665
海通恒信	指	海通恒信国际融资租赁股份有限公司，于香港联交所上市，股份代号：1905
海富产业	指	海富产业投资基金管理有限公司
海富通基金	指	海富通基金管理有限公司
海通资管公司	指	上海海通证券资产管理有限公司
上海泽春	指	上海泽春投资发展有限公司
上海惟泰置业	指	上海惟泰置业管理有限公司
上海国盛集团	指	上海国盛（集团）有限公司



## 第二节 公司简介和主要财务指标



## 一、公司信息

公司的中文名称	海通证券股份有限公司
公司的中文简称	海通证券
公司的外文名称	Haitong Securities Co.,Ltd.
公司的外文名称缩写	Haitong Securities
公司的法定代表人	周杰
公司总经理	李军
公司授权代表	周杰、姜诚君
联席公司秘书	姜诚君、黄慧玲
合规总监	李海超

### 注册资本和净资本

	本报告期末	上年度末
注册资本	13,064,200,000.00	13,064,200,000.00
净资本	90,947,668,475.75	85,222,467,669.07

## 公司经营范围

证券经纪；证券自营；证券承销与保荐；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；直接投资业务；证券投资基金代销；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；股票期权做市业务；中国证监会批准的其他业务，公司可以对外投资设立子公司从事金融产品等投资业务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

### 公司的各单项业务资格情况

1. 网上证券委托业务资格（证监信息字〔2001〕3号）
2. 全国银行间同业拆借市场和债券市场从事拆借、购买债券、债券现券交易和债券回购业务资格（银办函〔2001〕819号）
3. 全国银行间同业拆借中心组织的拆借交易和债券交易资格（中汇交发〔2001〕306号）
4. 收购证券营业部资格（沪证机便〔2002〕090号）
5. 开放式证券投资基金代销业务资格（证监基金〔2002〕076号）
6. 从事相关创新活动试点证券公司（中证协函〔2005〕079号）
7. 从事短期融资券承销业务资格（银发〔2005〕173号）
8. 报价转让业务资格（中证协函〔2006〕3号）
9. 上海证券交易所固定收益证券综合电子平台交易商资格（上证会函〔2007〕86号）
10. 中国银行间市场交易商协会资格（2007.08）
11. 作为合格境内机构投资者从事境外证券投资管理业务资格（证监许可〔2008〕146号）
12. 中国证券登记结算有限责任公司甲类结算参与人资格（中国结算函字〔2008〕22号）
13. 为期货公司提供中间介绍业务资格（沪证监机构字〔2010〕122号）

- 14.开展直接投资业务试点资格（机构部部函〔2008〕421号）
- 15.实施经纪人制度资格（沪证监机构字〔2009〕302号）
- 16.向保险机构投资者提供交易单元的资格（保监资金审证〔2009〕1号）
- 17.融资融券业务资格（证监许可〔2010〕315号）
- 18.公司自营业务参与股指期货套期保值交易业务资格（沪证监机构字〔2010〕372号）
- 19.基金评价业务资格（中证协发〔2010〕070号）
- 20.全国社保基金理事会签约券商资格（2011.08）
- 21.资产管理业务参与股指期货交易资格（沪证监机构字〔2011〕237号）
- 22.约定购回式证券交易业务试点（机构部部函〔2011〕512号）（上证交字〔2011〕37号）
- 23.发行境外上市外资股资格（证监许可〔2011〕1821号）（H股）
- 24.债券质押式报价回购业务试点（机构部部函〔2011〕585号）
- 25.合伙企业独立托管业务试点（机构部部函〔2012〕686号）
- 26.柜台市场交易业务（中证协函〔2012〕825号）
- 27.转融通业务试点资格（中证金函〔2012〕113号）
- 28.中小企业私募债券承销业务试点资格（中证协函〔2012〕561号）
- 29.证券业务外汇经营（SC201307）
- 30.新三板推荐业务和经纪业务（股转系统函〔2013〕61号）
- 31.代销金融产品业务资格（沪证监机构字〔2013〕180号）
- 32.权益类收益互换业务和场外期权交易业务（中证协函〔2013〕996号）
- 33.开展客户证券资金消费支付服务试点资格（机构部部函〔2013〕741号）
- 34.2013年第十一批保险兼业代理人资格（沪保监许可〔2013〕204号）
- 35.开展黄金等贵金属现货合约代理和黄金现货合约自营业务资格（机构部部函〔2013〕959号）
- 36.证券投资基金托管资格（证监许可〔2013〕1643号）
- 37.代理证券质押登记业务资格（2014.02）
- 38.互联网证券业务试点（中证协函〔2014〕358号）
- 39.黄金交易所会员资格（证书编号:T004）
- 40.上市公司股权激励行权融资业务试点（深圳函〔2014〕321号）
- 41.股票期权做市业务资格（证监许可〔2015〕153号）
- 42.上证50ETF期权合约品种的主做市商（上证函〔2015〕214号）
- 43.期权结算业务资格（中国结算函字〔2015〕20号）

- 44.期货会员证书（证书编号：NO.G02008）
- 45.中国证券投资基金业协会会员证书（证书编号：00000147）
- 46.境外自营业务资格（机构部函〔2015〕1204号）
- 47.单向视频开户创新方案的无异议函（中国结算办字〔2015〕461号）
- 48.银行间黄金询价业务资格（上金交发〔2015〕120号）
- 49.非金融企业债务融资工具主承销业务资质（2016.08）
- 50.票据交易资质（2016年11月）
- 51.信用风险缓释工具相关业务资格（2017.01）
- 52.场外期权业务二级交易商资格（中证协发〔2018〕386号）
- 53.信用衍生品业务资质（机构部函〔2019〕469号）
- 54.军工涉密业务咨询服务安全保密条件备案证书（2019.10）
- 55.股指期货做市业务（机构部函〔2019〕3073号）
- 56.利率互换实时承接业务资格（中国外汇交易中心公告）
- 57.受信用保护债券质押式回购业务合格创设机构资格（中国结算函字〔2021〕201号）
- 58.中证1000股指期货主做市商（2022.07）
- 59.商品互换业务一级交易商（2022.07）

公司具备上交所、深交所和北交所的会员资格,中国证券登记结算有限责任公司权证结算业务资格。公司附属子公司均依法, 或经相关监管部门批准获得相应的业务资格后开展经营业务活动。

## 二、联系人和联系方式

	董事会秘书	证券事务代表
姓名	姜诚君	孙涛
联系地址	中国上海市广东路 689 号海通证券大厦 12 层 (邮政编码: 200001)	中国上海市广东路 689 号海通证券大厦 12 层 (邮政编码: 200001)
电话	8621-23219000	8621-23219000
传真	8621-63410627	8621-63410627
电子信箱	jiangcj@htsec.com	sunt@htsec.com

### 三、基本情况变更简介

公司注册地址	中国上海市广东路 689 号
	中国上海市江西中路 200 号 (1988 年)
	中国上海市四川中路 480 号 (1990 年)
公司注册地址的历史变更情况	中国上海市北海宁路 30 号 (1994 年)
	中国上海市唐山路 218 号 (1998 年)
	中国上海市淮海中路 98 号 (2001 年)
	中国上海市广东路 689 号海通证券大厦 (2012 年)
公司办公地址	中国上海市广东路 689 号
公司办公地址的邮政编码	200001
公司网址	<a href="http://www.htsec.com">http://www.htsec.com</a>
电子信箱	haitong@htsec.com
报告期内变更情况查询索引	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>
香港主要营业地址	香港黄竹坑香叶道 2 号 One Island South 15 楼
营业执照统一社会信用代码	9131000013220921X6

### 四、信息披露及备置地点变更情况简介

公司选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载半年度报告的网站地址	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>
	<a href="http://www.hkexnews.hk">http://www.hkexnews.hk</a>
公司半年度报告备置地点	中国上海市广东路 689 号海通证券大厦 12 层董事会办公室
报告期内变更情况查询索引	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>
	<a href="http://www.hkexnews.hk">http://www.hkexnews.hk</a>

### 五、公司股票简况

股票种类	股票上市交易所	股票简称	股票代码	变更前股票简称	股份登记处
A 股	上交所	海通证券	600837	/	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司
H 股	香港联交所	海通证券	6837	/	香港中央证券登记有限公司

### 六、其他有关资料

适用 不适用

## 七、公司主要会计数据和财务指标

### (一) 主要会计数据

单位：元 币种：人民币

主要会计数据	本报告期（1-6月）	上年同期	本报告期比上年同期增减（%）
营业收入	12,104,350,296.48	23,471,241,587.14	-48.43
归属于母公司股东的净利润	4,757,725,335.07	8,170,194,923.98	-41.77
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	4,234,681,202.48	7,897,352,076.35	-46.38
经营活动产生的现金流量净额	17,313,673,713.22	34,758,418,207.39	-50.19
其他综合收益的税后净额	58,198,289.07	-346,786,150.51	-
	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减（%）
资产总额	749,565,861,117.80	744,925,149,407.62	0.62
负债总额	572,083,285,938.74	567,170,363,313.90	0.87
归属于母公司股东的权益	163,080,741,136.12	163,137,963,718.18	-0.04
所有者权益总额	177,482,575,179.06	177,754,786,093.72	-0.15

### (二) 主要财务指标

主要财务指标	本报告期（1-6月）	上年同期	本报告期比上年同期增减（%）
基本每股收益（元/股）	0.36	0.63	-42.86
稀释每股收益（元/股）	0.36	0.63	-42.86
扣除非经常性损益后的基本每股收益（元/股）	0.32	0.60	-46.67
加权平均净资产收益率（%）	2.88	5.10	减少 2.22 个百分点
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率（%）	2.57	4.93	减少 2.36 个百分点

公司主要会计数据和财务指标的说明

适用 不适用

### (三) 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	90,947,668,475.75	85,222,467,669.07
净资产	144,484,498,519.25	144,509,229,830.85
风险覆盖率 (%)	203.98	200.25
资本杠杆率 (%)	21.35	22.28
流动性覆盖率 (%)	244.45	259.39
净稳定资金率 (%)	162.18	157.72
净资本 / 净资产 (%)	62.95	58.97
净资本 / 负债 (%)	37.16	34.48
净资产 / 负债 (%)	59.04	58.47
自营权益类证券及其衍生品 / 净资本 (%)	17.15	24.03
自营非权益类证券及其衍生品 / 净资本 (%)	178.64	201.85

## 八、境内外会计准则下会计数据差异

适用 不适用

## 九、非经常性损益项目和金额

单位：元 币种：人民币

非经常性损益项目	金额	附注（如适用）
非流动资产处置损益	-39,077,965.89	
计入当期损益的政府补助，但与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外	677,311,826.43	主要是政府补助
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益	-	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	86,408,364.08	
减：所得税影响额	178,720,773.76	
少数股东权益影响额（税后）	22,877,318.27	
合计	523,044,132.59	

将《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益项目的情况说明

适用 不适用

## 十、财务报表主要项目

### 1. 合并财务报表主要项目会计数据

单位：元 币种：人民币

项目	2022年6月30日	2021年12月31日	增减幅度
货币资金	186,275,510,234.59	161,482,162,662.33	15.35%
融出资金	69,668,200,894.61	75,223,404,481.86	-7.38%
衍生金融资产	2,277,485,754.74	1,084,731,024.74	109.96%
买入返售金融资产	42,099,456,966.02	39,761,016,348.21	5.88%
交易性金融资产	201,866,236,662.53	220,409,748,990.56	-8.41%
其他债权投资	42,055,227,212.50	37,052,945,367.77	13.50%
其他权益工具投资	6,612,455,737.01	10,246,870,931.21	-35.47%
长期应收款	68,201,416,679.15	55,088,023,010.62	23.80%
投资性房地产	2,310,228,778.07	57,595,407.36	3911.13%
拆入资金	10,655,383,836.51	15,664,657,697.33	-31.98%
卖出回购金融资产款	81,567,484,109.38	91,911,952,065.34	-11.25%
代理买卖证券款	129,589,377,718.71	123,202,200,376.21	5.18%
代理承销证券款	-	1,601,399,997.46	-100.00%
应交税费	1,748,496,834.82	4,200,007,273.89	-58.37%
长期借款	54,429,268,328.65	49,579,028,216.06	9.78%
应付债券	173,470,980,662.80	163,586,069,656.61	6.04%
资本公积	74,906,579,079.23	74,913,916,184.14	-0.01%
未分配利润	47,985,706,026.37	47,504,315,755.70	1.01%

项目	2022年1-6月	2021年1-6月	增减幅度
手续费及佣金净收入	6,140,680,386.57	7,165,176,960.88	-14.30%
利息净收入	3,088,087,983.84	3,361,957,910.21	-8.15%
投资收益	-362,282,684.28	6,089,788,843.43	-105.95%
其他收益	721,755,618.98	561,491,888.57	28.54%
公允价值变动收益	1,358,310,150.74	1,324,130,957.42	2.58%
汇兑收益	-297,909,682.71	80,349,420.96	-470.77%
其他业务收入	1,494,134,804.58	4,918,695,749.61	-69.62%
业务及管理费	5,256,123,649.22	6,439,255,745.70	-18.37%
信用减值损失	178,662,978.58	1,024,765,121.75	-82.57%
其他业务成本	642,206,662.65	4,177,371,538.58	-84.63%
所得税费用	1,420,703,701.27	2,772,210,076.66	-48.75%
净利润	4,465,360,883.37	8,888,739,650.98	-49.76%
其他综合收益的税后净额	58,198,289.07	-346,786,150.51	-
综合收益总额	4,523,559,172.44	8,541,953,500.47	-47.04%



## 2. 母公司财务报表主要项目会计数据

单位：元 币种：人民币

项目	2022年6月30日	2021年12月31日	增减幅度
货币资金	112,543,102,444.14	93,457,408,323.97	20.42%
融出资金	60,327,098,666.65	67,692,375,195.87	-10.88%
衍生金融资产	1,517,182,188.65	354,429,554.46	328.06%
买入返售金融资产	32,487,623,238.09	29,337,912,589.23	10.74%
交易性金融资产	130,536,451,210.79	147,034,775,156.00	-11.22%
其他债权投资	40,510,087,199.40	35,177,490,466.24	15.16%
其他权益工具投资	5,833,774,220.05	10,183,589,167.34	-42.71%
长期股权投资	39,071,433,089.37	38,855,455,864.40	0.56%
递延所得税资产	1,552,407,034.91	2,307,574,317.95	-32.73%
其他资产	5,707,462,711.57	3,683,966,742.96	54.93%
交易性金融负债	11,948,114,554.85	6,116,583,145.85	95.34%
卖出回购金融资产款	76,840,114,012.82	89,332,830,556.70	-13.98%
代理买卖证券款	78,624,734,955.55	72,910,211,706.45	7.84%
代理承销证券款	-	2,061,399,997.46	-100.00%
应交税费	244,313,343.41	1,504,640,375.31	-83.76%
长期借款	2,812,666,694.45	2,094,237,277.76	34.31%
应付债券	118,016,645,241.67	113,233,660,700.54	4.22%
其他负债	4,537,020,264.97	864,903,182.79	424.57%
资本公积	74,708,985,006.20	74,772,635,006.20	-0.09%
其他综合收益	151,932,340.12	411,799,777.79	-63.11%
未分配利润	30,478,564,078.30	30,179,777,952.23	0.99%

项目	2022年1-6月	2021年1-6月	增减幅度
手续费及佣金净收入	4,335,306,867.71	3,990,032,781.63	8.65%
利息净收入	1,265,789,633.60	1,517,745,007.44	-16.60%
投资收益	-778,809,826.56	3,082,048,927.81	-125.27%
其他收益	463,248,025.00	280,614,259.08	65.08%
公允价值变动收益	2,724,051,391.96	573,817,040.48	374.72%
业务及管理费	3,028,928,171.11	3,391,463,157.17	-10.69%
信用减值损失	-678,701,091.05	-75,034,174.19	-
所得税费用	1,027,303,243.47	1,440,643,943.84	-28.69%
净利润	4,509,685,814.32	4,687,971,315.60	-3.80%
其他综合收益的税后净额	-551,507,125.92	-230,598,394.45	-
综合收益总额	3,958,178,688.40	4,457,372,921.15	-11.20%

### 第三节 管理层讨论与分析



## 一、报告期内公司所属行业及主营业务情况说明

报告期内，本集团所属行业情况请参见本节“三、经营情况讨论与分析”。

集团主要业务有财富管理、投资银行、资产管理、交易及机构、融资租赁等，所从事的业务情况请参见本节“三、经营情况讨论与分析”。

报告期内，集团实现营业收入 121.04 亿元、归属于母公司股东的净利润 47.58 亿元、总资产 7,495.66 亿元、归属于母公司股东的净资产 1,630.81 亿元，主要财务指标多年来一直保持行业前列。

## 二、报告期内核心竞争力分析

在长期经营过程中，公司逐步形成了具有自身特色的六大核心竞争力。

### 1. 雄厚的资本实力

公司通过 A+H 股上市、增发等多次战略性股权融资和债券融资，迅速增强并持续保持了雄厚的资本实力。2022 年上半年，公司抓住市场机遇，完成多次债务融资，通过发行公司债、次级债、收益凭证等方式完成境内融资超过 300 亿元，增强了公司流动性管理能力与风险防控能力。另外，公司还积极拓展境外融资渠道，确保了境外业务的健康有序发展。充足的资本为公司业务转型升级、满足境内外客户的多元化金融服务需求、持续提升实体经济服务能力夯实了基础。

### 2. 卓越的综合金融服务平台

以母公司业务出发，通过设立、收购专业子公司，集团不断扩充金融产品服务范围，延伸金融服务边界，已基本建成涵盖证券期货经纪、投行、自营、资产管理、私募股权投资、另类投资、融资租赁、境外银行等多个业务领域的金融服务集团。集团经纪业务客户基础雄厚；投资银行业务排名行业前列；资产管理业务主动管理规模持续提升；私募股权投资业务规模及品牌影响力行业领先；在港业务多项数据排名行业首位；融资租赁业务已确立并持续保持行业领先地位；研究服务市场影响力强。集团综合化的金融平台具有强大的规模效应和交叉销售潜力，为业务发展提供了有力支撑，为客户综合金融服务创造条件。

### 3. 广泛的营业网点以及扎实的客户基础

集团营业网点覆盖“纽、伦、港、沪、新、东”六大国际金融中心。截至报告期末，集团在中国境内拥有 338 家证券及期货营业部（其中证券营业部 301 家，期货营业部 37 家），遍布 30 个省、直辖市和自治区；境外方面，在亚洲、欧洲、北美洲、南美洲、大洋洲等全球 5 大洲 15 个国家和地区设有分行、代表处或子公司。凭借遍布全国的营业网点和极具战略性的国际化布局，集团得以建立庞大且稳定的客户群，截至报告期末，集团在境内外拥有超 2,000 万名客户。

#### 4. 业内领先的国际跨境服务平台

通过收购整合海通国际、海通银行，设立上海自贸区分公司，集团建立了业内领先的国际业务平台，获得了亚太地区先发优势以及欧美地区前瞻性的战略储备。

海通国际持续保持在香港投行中的领先地位。股权融资方面，海通国际 IPO 及股权融资业务按完成项目数量位居香港所有投行前列，并不断加强海外市场的项目执行能力及品牌影响力；环球债券融资方面，海通国际按债券发行项目数量位列全球金融机构前列。同时，海通国际努力践行 ESG 理念，在绿色及可持续发展债券发行领域成为中资金融机构的领头羊；此外，海通国际已形成一个面向全球机构客户的全方位交易、研究与销售平台。资产管理业务方面，海通国际主动优化资产管理规模和产品结构，着力打造特色投研平台，资产管理规模保持稳定；财富管理业务方面，海通国际持续打造面向企业家客户的私人财富管理模式，升级产品及服务并布局环球家族办公室业务。

海通银行是深化集团国际化战略的重要储备，也是集团践行国家“一带一路”战略的重要承载平台。海通银行拥有在欧盟及南美市场上的专业知识以及长达 20 多年的经验，具有全银行牌照，围绕企业银行、投资银行以及资产管理三大重点业务领域，在深耕本土业务的基础上，致力于开拓中国与欧洲、中国与拉丁美洲间的跨境业务合作。2022 年，海通银行巴黎代表处完成注册，标志着集团国际化战略又向纵深推进了重要的一步。

自贸区跨境业务方面，上海自贸区分公司是首批加入自贸区 FTU（自贸区分账核算单元）体系的证券机构，成功实施了国内券商首单 FT（自由贸易账户）项下跨境融资项目。2022 年上半年，自贸区分公司在抓好疫情防控的同时，持续推动 FTU 业务的拓展和集团范围跨境业务的联动。

业内领先、全方位多地区的国际业务平台有利于集团把握日益增长的跨境业务机会，满足客户的跨境业务需求，提升集团的国际影响力。

#### 5. 稳健的经营理念、有效的合规与风险管理和内部控制体系

公司始终坚持“务实、开拓、稳健、卓越”的经营理念与“稳健乃至保守”的风险控制理念，在三十多年的经营中，成功渡过了多个市场和业务周期、监管改革和行业转型发展。公司基本建立了覆盖全集团的风险管理体系，落实全面风险管理要求，较为有效地管理市场风险、信用风险、流动性风险和操作风险等各类风险。公司依照监管规定，建立健全合规管理制度和组织体系，不断夯实合规审查、合规监测及合规检查等职能履行，保障与促进公司持续合规稳健发展。同时，公司始终坚持以风险为本的工作原则，严格按照反洗钱法律法规，采取相关措施，控制洗钱及恐怖融资风险。

#### 6. 科技引领，数字化转型进入加速期

公司秉承“科技引领”发展战略，科技投入持续保持行业前列，已成为行业数字化转型的探索者、先行者之一，也是行业首家同时拥有运维服务体系、信息安全体系、软件研发体系、软件测试体系四大领域国际权威认证的证券公司。围绕公司“十四五”科技发展规划，“数字海通 2.0”建设提档加速。一是有力支持财富管理数字化转型，自研的一站式互联网金融平台“e 海通财”APP 和 PC 端，总安装用户超 4,200 万，月均平台活跃数近 550 万，继续保持行业第一梯队。二是持续完善机构客户服务体系，一站式场外衍生品业务平台“e 海通行”集管理、估值、交易、清算、报送等功能于一体，联通公司内部各衍生品业务链，为客户提供多样化、专业化的衍生品业务服务；一体化智能交易平台“e 海方舟”整合极速交易和极速行情，为专业投资者量身打造，上半年股基交易量 1.07 万亿元，同比增长 17%。三是全面赋能中后台管理，在行业内首家探索分支机构印章物联管理，完善业务办理流程，

有效防范操作风险；全面风险管理平台的智能风险预警、风险数据集市和风控指标管理持续优化，有效提升风险管控覆盖范围与纵深。四是不断深化数据中台建设，数据资产管理与服务系统“e海智数”正式上线，构建了近1,200项经纪业务数据分类分级清单，具有行业特色的数据分类分级管理体系逐渐建立。五是科技创新能力持续增强，引领行业多项科技创新工作，累计获得11项国家专利和55项软件著作权，先后荣获上海市国资委企业十佳优秀课题成果，证券期货业金融科技研究发展中心（深圳）优秀课题一、二、三等奖，证券期货业金融科技研究发展中心（上海）优秀课题一、二、三等奖等多个金融科技奖项。

## 三、经营情况的讨论与分析

### （一）总体经营情况

2022年上半年，公司紧抓服务国家战略和实体经济主线，通过“投、融、保、研”和财富管理业务紧密联动，以客户为中心的业务体系建设不断完善，业务发展保持良好态势，各项财务指标保持稳健，为实现全年经营目标打下良好基础。

公司大力推动财富管理转型，完善组织架构体系，金融产品销售体系逐级完善，加快推动分支机构发展；公司投资银行业务始终把握产业链的关键环节和价值链的核心地位，IPO发行数量、承销金额、申报数量等关键指标继续排名市场前列；集团资产管理主动管理能力持续提升，管理规模进一步增加；公司国际化战略优势持续巩固，海通国际保持香港市场领先地位，海通银行跨境业务与本地业务齐头并进，积极践行国家“一带一路”倡议，提供跨境金融服务支持。

### （二）主营业务分析

#### 1. 财富管理业务

##### 市场环境：

2022年上半年，面对市场持续震荡，境内股票市场成交依旧保持活跃。根据WIND数据，2022年上半年沪深两市股票、基金日均成交额1.06万亿元，同比增长8.5%。资本市场机构化、产品化趋势不断深化，企业、机构及高净值客户对金融服务需求的广度、深度进一步扩大，对券商专业化和资源整合能力提出更高的要求。在市场整体调整的背景下，产品销售市场承受压力，据基金业协会统计，截至2022年6月末，全市场权益类公募基金规模达7.89万亿元，较上年末下降8.6%；根据WIND数据，2022年上半年新发基金规模约6,850亿份，同比减少约58%。

2022年上半年，受市场行情影响，融资融券业务的市场规模有所下降。截至2022年6月末，市场融资融券余额为1.60万亿元，较上年末下降12.5%；其中融资余额1.51万亿元，较上年末下降11.8%，融券余额935.62亿元，较上年末下降22.1%。报告期内，股票质押业务的经营环境更趋规范化，市场规模稳中有降。

### 经营举措及业绩：

公司坚持以客户为中心，通过组织架构调整，强化财富管理的“交易服务、投资顾问及基于资产配置的产品销售”等三大核心能力，进一步优化客户分级分类服务体系搭建。报告期内，公司客户实现高质量增长，财富管理基础进一步夯实；金融产品销量及保有规模稳步增长。公司继续以金融科技为手段提升服务质量、拓宽服务边界，通过线上线下协同，打造更加开放的财富管理平台。截至 2022 年 6 月末，公司财富管理客户数量（剔除已销户账户）1,483.75 万户，较上年末增长 4.0%；期末客户总资产 2.66 万亿元。

### 2022 年上半年公司交易额变化

	本报告期	上年同期
股票交易量（亿元）	70,940	76,297
基金交易量（亿元） <sup>1</sup>	10,227	14,166
合计（亿元）	81,167	90,462

<sup>1</sup> 不含场内货币基金交易量，与市场交易口径不同

#### （1）零售经纪业务

2022 年上半年，公司深耕客户需求，构建以客户为中心，以财富管理转型为方向，以资讯、产品、投研、投顾及工具为抓手的多层次客户服务体系，提升服务能级；打造“e 海通聚”交易服务品牌，为客户多样化的交易需求提供一站式解决方案，重点强化为量化私募客户提供定制化交易系统服务和为企业客户提供综合交易服务；正式推出“盈投顾”特色服务品牌，聚焦配置策略、主题投资、基金定投、中低风险交易等方向推出六大类服务，全面覆盖股票、债券、基金、ETF 等投资研究与服务，实现在内容体系、品牌度、专业度、体验度、推广渠道等多维度的全面升级；推动上海和苏州地区网点创新试点，建设具有特色业务属性的创新网点；成立投资者权益保护工作领导小组，强化投资者保护的主体责任和担当，坚持“以客户为中心”，多维度落实投资者教育工作，构筑全方位投资者权益保护体系。

海通国际财富管理团队坚定私人财富管理业务转型方向，加强与投行、资产管理及研究等业务团队的协同，为集团高净值及超高净值客户群体提供更加多样化的财富管理及投资选择。2022 年上半年，员工持股计划（ESOP）业务正式落地，配合家族办公室及信托业务，积极引入企业家客户。

#### （2）互联网金融

公司以“e 海通财”和“e 海方舟”两大品牌为基础，针对零售、财富、机构及量化交易客户不断完善分级交易终端建设。其中，“e 海通财 APP”月均活跃人数 530 万，排名始终保持行业前五；“e 海方舟”月均交易资产同比增长超 40%，月均活跃客户数同比增长 30%，上半年股票、基金交易量同比增长 17%。围绕“通享会员”打造分级线上客户服务体系，持续优化智能定投等特色工具，以通财号、直播等内容服务为抓手，联合内外部机构为客户提供陪伴式服务。

#### （3）金融产品销售

公司以完成有效产品保有量为核心目标，通过强化销售组织、完善销售政策、厘清销售职能、优化系统平台，稳步推进重点产品销售。2022 年上半年，公司产品日均保有量在市场整体下滑的背景下，实现同比增长 9.7%。其中，非货币基金产品日均保有量同比增长 27.2%；公募产品日均保有量同比增长 12.1%。持续拓展定投业务，新增定投有效户近 1.5 万户，新增客户资产近 4 亿元。同时，公司以券结模式公募及头部量化私募为主要销售抓手，持续提升客户对公司金融产品认可度和品牌影响力。

#### (4) 融资类业务

2022年上半年，公司融资融券业务继续以增量拓展、结构优化为导向，提升征授信、担保品、集中度等业务管控质量，强化券源筹集能力，积极探索创新策略，加强高净值客户服务能力，业务整体市占率稳中有升。股票质押式回购交易业务以服务实体为己任，在保持规模稳定的同时持续改善结构，提升全方位风险管控能力。截至报告期末，公司融资类业务规模 945.67 亿元，较上年末减少 108.07 亿元，其中融资融券业务规模 657.08 亿元，较上年末减少 82.18 亿元；股票质押业务规模 287.09 亿元，较上年末减少 25.15 亿元。

#### 2022年6月末公司融资类业务规模变化

	本报告期末	上年度末
融资融券余额（亿元）	657.08	739.26
股票质押余额（亿元） <sup>2</sup>	287.09	312.24
约定购回余额（亿元）	1.50	2.24
合计（亿元）	945.67	1,053.74

<sup>2</sup> 上表不含表外资管股票质押式回购业务，本报告期末表外资管股票质押式回购业务规模 45.17 亿元

## 2. 投资银行业务

### 市场环境：

2022年上半年，随着注册制改革的不断推进，资本市场融资效率持续提高，进一步发挥服务实体经济的作用。上半年全市场 384 单股权项目共融资 7,378 亿元；IPO 保持常态化但节奏有所放缓，上半年挂牌 171 家，融资金额 3,119 亿，其中，科创板挂牌 54 家，融资金额 1,155 亿元，规模占比达 37%。再融资方面，上半年增发 134 家，融资金额 1,929 亿元。上半年北交所公开发行保持常态化，新增上市企业 19 家，完成股权融资 28.62 亿元。

2022年上半年，境内债券发行整体规模较往年增速趋缓，各类债券发行合计 31.37 万亿元，同比增长 6%。利率债发行达到 11.50 万亿元，同比增长 24%，其中国债同比增长 21%，地方政府债同比增长 57%，政策性银行债同比下降 8%。信用债发行 9.04 万亿元，同比下降 3%。

### 经营举措及业绩：

#### (1) 股权融资

在境内股权融资方面，公司继续巩固行业优势，市场排名保持行业前列。上半年完成 IPO 项目 14 单，市场排名第三；实现融资金额 247 亿元，市场排名第四。完成科创板 IPO 项目 9 单，市场排名第二；实现融资金额 213 亿元，市场排名第二。公司克服疫情不利影响，加大项目推进力度，2022 年上半年申报 IPO 项目 39 单，创历史新高；截至报告期末，在审及待发 IPO 项目 68 单，排名市场前列。公司持续推进北交所业务，积极拓展“专精特新”企业，在审项目 3 单，储备项目 5 单。资本市场团队进一步强化询价定价能力，在多个大型项目中展现销售实力。公司深度践行“投、融、保、研”一体化的展业方向，2022 年上半年通过发行人 IPO 员工计划战略配售为公司带来超百位高净值客户，计划净值逾 6.6 亿元；IPO 共协调原始股东客户托管原始股份约 26 亿股，约合发行市值 904 亿元。

## 境内股权融资项目发行及项目储备情况

		本报告期	上年同期
首次公开发行	承销金额 (亿元)	246.6	165.3
	承销家数	14	22
再融资发行	承销金额 (亿元)	71.9	237.4
	承销家数	5	13
在审及待发项目数量	首次公开发行	68	53
	再融资发行	13	22

数据来源: WIND、中国证监会、上海证券交易所、深圳证券交易所

在境外股权融资业务方面,海通国际继续保持市场领先地位。投行团队秉承 3.0 转型规划,在进一步深耕传统产品优势领域、加强联动、打造新产品的的基础上,加强项目的早期介入能力和执行能力,积极提升有影响力的项目占比。截至报告期末,海通国际在香港资本市场共完成 11 单股权融资项目,位列香港中资投行第三。2022 年 5 月,海通国际凭借丰富的资本市场经验、深厚的市场根基及卓越的投行业务能力,在激烈的竞争中脱颖而出,获国际权威金融媒体《亚洲金融》(FinanceAsia)颁发香港地区 - “最佳股权融资机构”大奖。

### (2) 债券融资

2022 年上半年,公司完成 573 只债券发行,承销金额 1,918 亿元,其中企业债券承销金额 159 亿元,市场排名第二。在国家发改委公布的 2021 年度企业债券主承销商和信用评级机构信用评级结果中连续第七次获得 A 类称号。公司以创新驱动业务发展,成功发行深交所首单蓝色债券、市场首单融资租赁行业科技创新公司债券、市场首单“保障性租赁住房”主体标识公司债券。

### 境内主承销债券项目承销规模变化

		本报告期	上年同期
企业债	承销金额 (亿元)	159.40	260.05
	承销只数	28	32
公司债	承销金额 (亿元)	619.89	767.04
	承销只数	161	173
其他	承销金额 (亿元)	1,138.40	1,398.10
	承销只数	384	382

注:其他包括非政策性金融债、短期融资券、中期票据、定向工具、资产支持证券、可转债、可交换债、地方政府债。

数据来源: WIND

在境外债券融资业务方面,海通国际继续保持在香港债券资本市场上的领先地位,截至 6 月末,在中国风险 G3+CNY 债券发行市场中,发行数量位列全球投行第四;努力践行 ESG 和可持续金融理念,共完成了 14 笔绿色债券及可持续债券承销,融资规模达 60 亿美元。海通国际在 ESG 范畴上表现杰出,更获纳入富时社会责任指数,位列全球金融行业管治类评分前五名。



### 3. 资产管理业务

#### 市场环境：

后资管新规时代，各家资产管理机构已逐步完成了去通道、净值化管理等要求，促使券商资管步入向公募基金业务转型的新阶段。为了加快推进公募基金行业高质量发展，中国证监会于5月20日发布了《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》，调整优化公募基金牌照制度，适度放宽同一主体下公募牌照数量限制，支持证券资管子公司、保险资管公司、银行理财子公司等专业资产管理机构依法申请公募基金牌照，从事公募基金管理业务。

面对资本市场波动，2022年上半年资管行业整体业绩表现欠佳。据基金业协会统计，截至2022年6月末，公募基金业务规模26.79万亿元，较期初增长4.79%；证券公司及其子公司私募资产管理业务规模7.68万亿元，较期初下降6.74%。

#### 经营举措及业绩：

公司贯彻落实证监会《关于加快推进公募基金行业高质量发展的意见》要求，积极谋划资管业务转型并布局公募市场，持续提升主动管理能力，推进资产管理业务高质量发展。截至报告期末，全集团资产管理总规模达2.1万亿元，较期初增长10.5%。

#### (1) 海通资管公司

2022年上半年，海通资管公司一方面积极谋划资管业务转型并布局公募市场，另一方面持续提升主动管理能力，构建产品组合和投资策略，建立不同风险偏好的私募产品体系，满足客户个性化的综合金融服务需求，在发展过程中寻求特色化、差异化发展的路径和规划。上半年，海通资管公司在公募固收、公募权益、私募固收、私募FOF领域持续营销，净申购明显。截至报告期末，海通资管公司管理规模962.87亿元，其中主动管理规模950.71亿元，占比提升至98.74%。海通资管公司积极推进大集合公募改造工作，截至报告期末，全部17只产品中有15只已取得证监会批文，2只审批中。2022年上半年，海通资管公司管理的集合产品投资业绩市场相对排名为市场同类产品的前23.23%，整体表现优异。

#### 海通资管公司业务规模及净收入变化

	本报告期		上年同期	
	资产管理规模 (亿元)	净收入 (万元)	资产管理规模 (亿元)	净收入 (万元)
集合资产管理	353	15,162	616	75,852
定向资产管理	261	2,573	920	9,796
专项资产管理	349	544	346	752
合计	963	18,279	1,882	86,400

#### (2) 基金管理公司

截至报告期末，海富通基金资产管理规模3,993亿元，较报告期初减少4.0%；其中公募基金管理规模1,473亿元。养老金业务规模2,167亿元，较期初增长7.4%；职业年金规模719亿元，较期初增长19.7%。海富通中证短融ETF规模从年初65亿元增长至148亿元，成为国内债券ETF市场规模最大产品。

2022 年上半年，富国基金秉持高质量发展理念，保持了良好的业务发展态势。截至报告期末，富国基金管理资产总规模超 1.4 万亿元，再创历史新高，其中公募基金管理规模 9,329 亿元；养老金业务及专户业务均保持稳健增长，管理规模双双创下新高；持续推进产品创新，创新储备充分。

### (3) 私募投资基金

私募股权投资基金积极推进基金募集设立工作，顺利完成长三角 G60 科创走廊基金、海富半导体专项基金备案，已正式投入运营；有序推进中小企业发展基金、吉林海创长新基金、海通临沂股权投资基金出资缴款工作。截至报告期末，公司私募股权投资基金管理规模 268 亿元，新增实缴资本 27.4 亿元，完成投资项目 20 个，投资金额 7.8 亿元；新增上市（含过会）项目 16 个，在会项目 27 个，累计实现退出收益 18.8 亿元。

#### 私募投资基金业务规模变化

	本报告期末	上年度末
管理基金数量	52	49
管理规模余额（亿元）	268	271
累计投资项目数量	16	42
累计投资项目金额（亿元）	6.4	28
项目退出（含部分退出）数量	39	67

### (4) 境外资产管理

海通国际资产管理团队协同联动海通国际投行、私人财富管理等业务团队，建设具有买方投研实力、践行 ESG 投资理念的的特色投资平台，组建富有市场经验及前瞻视野的投研团队，持续优化资产管理业务结构，提升资产质量，强化核心竞争力，坚持不懈地做好投资管理。报告期内，海通国际获得《投资洞见与委托》《路孚特理柏基金香港年奖》《彭博 2021 年度离岸中资基金大奖》等多项业界大奖。

## 4. 交易与机构服务业务

### 市场环境：

2022 年上半年，A 股市场先抑后扬，走出触底反弹的“V”字行情，沪深 300 指数下跌 9.22%，创业板指数下跌 15.41%。固定收益市场方面，利率维持低位震荡，信用利差持续收窄，中债总净价指数下跌 0.08%；其中，中债国债总净价指数上涨 0.02%，中债企业债总净价指数上涨 0.16%。

### 经营举措及业绩：

#### (1) 交易业务

2022 年上半年，公司境内权益投资交易不断拓展服务品类，夯实服务能力。股指期货做市业务荣获 2021 年度中金所股指期货优秀做市商银奖，考核得分位列上海地区第一；跨境收益互换业务取得实质突破，打通与海通国际的交易通道，收益互换业务累计新增名义本金数百亿元；积极开发双碳 ESG 创新产品，成功发行挂钩碳中和 ETF 的结构化收益凭证；完成中证海通证券大类资产动态配置指数的开发与发布，为市场提供了具备较低波动率特征的业绩基准和投资标的；坚持科技赋能，集管理、估值、交易、清算、报送为一体的场外衍生品业务一站式平台和对客终端“e 海通衍”系统初步建成。公司权益类场外衍生品业务将重回部分交易对手方的白名单池，交易品种更丰富，结构更优化。

公司固定收益业务充分发挥专业优势，精准把握固定收益市场走势，强化交易能力建设，不断提高信用研究能力和风险定价能力，获取了较好的投资收益。FICC 创新业务稳步推进，大宗商品量化投资业务全面覆盖国内四大期货交易所流动性较好品种；场外衍生品业务实现突破，成功落地挂钩黄金场外期权、债券指数收益互换及收益凭证、跨境债券收益互换。

海通国际环球市场交易实力持续提升，已形成面向全球机构客户的全方位交易、研究与销售平台，提供综合产品解决方案，助力海外机构投资者把握中国的投资机遇；现金股票业务保持稳定发展，客户结构渐趋多元化，前十大客户覆盖国际长线投资者、对冲基金、中资基金，体现了海通国际各类产品在机构客户中的影响力和销售能力。

## (2) 机构业务

公司致力于打造一支强大的专业化机构销售服务团队，通过组织架构调整，加快提升面向机构客户的综合服务能力。坚持打造业内一流的研究品牌，以研究驱动机构业务发展、投行业务拓展以及零售客户服务，创新工作方法，以客户为导向，提升线上服务的质量和效率，通过建立白名单应急响应通道解决客户应急需求，品牌优势得到进一步巩固和发挥。2022 年上半年共外发报告 2,922 篇，举办线上电话会议 391 场，为机构客户组织路演、反路演等线下拜访活动共 9,500 余场。海通国际股票研究团队打通境内外研究平台，覆盖大中华、日本、美国、印度、韩国等多个地区逾 1,500 只股票，为客户提供专业、深入、及时且具备国际视野的研究咨询服务，不断夯实研究能力和质量。

公司继续保持 QFII/RQFII 机构客户服务的市场领先地位，签约客户总数达 147 家，交易量 846 亿元。公司继续围绕着与头部基金公司的合作，优化托管外包运营流程，深入研究和挖掘产品线，在资管品牌系列产品打造、公募券结基金合作、ETF 基金研究、私募基金筛选等方面取得较好成绩。2022 年上半年，公司新增托管外包产品 1,268 个，托管外包总规模 5,860 亿元，PB 系统成交量 5,357 亿元。

## 5. 融资租赁业务

### 市场环境：

近年来，随着监管层面对融资租赁行业监管力度的加强，融资租赁行业迎来统一监管、统一登记、加速出清、转型优化的关键时期。报告期内，融资租赁企业数量与租赁合同余额均有所下降，中国融资租赁行业尽管短期内面临一定的挑战，但从中长期来看仍处于富有活力的良性发展阶段：一方面，融资租赁凭借自身“融资 + 融物”、紧密贴近实体经济的特点，有效发挥产融结合优势助力经济高质量发展；另一方面，随着银保监会及各地方金融监管部门陆续发布融资租赁行业监管规定及落地具体监管措施，行业环境得到大幅净化，减量提质效应明显，空壳、失联的融资租赁企业被大量清退，专注主业、治理完善且实力雄厚的大型融资租赁公司优势凸显，行业集中度愈加清晰。

### 经营举措及业绩：

2022 年上半年，海通恒信积极应对疫情冲击，强化企业责任担当，精准统筹疫情防控和经营发展“两手抓、两促进”，紧跟国家战略及政策导向，切实立足租赁本源，充分运用金融科技手段，全力保障公司业务运转不间断，为打赢疫情防控攻坚战和助力实体经济稳步发展贡献金融力量，持续推动公司高质量发展，实现规模与收益的双增长。2022 年上半年，海通恒信生息资产平均收益率为 6.88%；截至报告期末，海通恒信资产总额达到 1,161.92 亿元，较上年末增长 1.3%；不良资产率 1.07%，不良资产拨备覆盖率 257.49%。

报告期内公司经营情况的重大变化，以及报告期内发生的对公司经营情况有重大影响和预计未来会有重大影响的事项

适用 不适用

## 四、报告期内主要经营情况

截至 2022 年 6 月 30 日，集团总资产 7,495.66 亿元，归属于母公司净资产 1,630.81 亿元。2022 年上半年，集团实现营业收入 121.04 亿元，归属于母公司净利润 47.58 亿元；加权平均净资产收益率 2.88%。其中，子公司实现收入 47.78 亿元，占比 37%；境外业务实现收入 19.63 亿元，占比 16%。

### (一) 主营业务分析

#### 1. 财务报表相关科目变动分析表

单位：元 币种：人民币

科目	本期数	上年同期数	变动比例 (%)
营业收入	12,104,350,296.48	23,471,241,587.14	-48.43
营业成本	6,259,598,598.71	11,837,101,306.29	-47.12
经营活动产生的现金流量净额	17,313,673,713.22	34,758,418,207.39	-50.19
投资活动产生的现金流量净额	-2,445,574,232.88	-116,433,695.31	-
筹资活动产生的现金流量净额	7,702,384,711.14	-7,659,631,253.41	-

#### (1) 营业收入

单位：元 币种：人民币

项目	本期金额	上年同期	本期金额较上年同期变动比例 (%)	主要原因
手续费及佣金净收入	6,140,680,386.57	7,165,176,960.88	-14.30	主要是资产管理业务、经纪业务手续费净收入减少
其中：经纪业务手续费净收入	2,474,007,654.92	2,624,722,675.27	-5.74	主要是证券经纪业务净收入减少
投资银行业务手续费净收入	2,434,751,965.24	2,524,747,356.00	-3.56	/
资产管理业务手续费净收入	1,086,471,873.13	1,832,908,069.19	-40.72	主要是资产管理业务净收入减少
利息净收入	3,088,087,983.84	3,361,957,910.21	-8.15	主要是卖出回购金融资产款利息支出增加
投资收益和公允价值变动收益	996,027,466.46	7,413,919,800.85	-86.57	主要是金融工具投资收益减少
其他业务收入	1,494,134,804.58	4,918,695,749.61	-69.62	主要是子公司销售收入减少
其他	385,419,655.03	611,491,165.59	-36.97	/
合计	12,104,350,296.48	23,471,241,587.14	-48.43	/

## (2) 主营业务分行业、分产品、分地区情况

单位：元 币种：人民币

主营业务分行业情况						
分行业	营业收入	营业支出	毛利率 (%)	营业收入比上年增减 (%)	营业支出比上年增减 (%)	毛利率比上年增减 (%)
财富管理	4,851,698,113.48	1,411,050,067.57	70.92	-6.51	-27.14	增加 8.23 个百分点
投资银行	2,471,305,202.59	1,482,523,150.87	40.01	-17.83	8.45	减少 14.54 个百分点
资产管理	1,639,739,944.55	653,217,052.67	60.16	-32.12	-27.67	减少 2.45 个百分点
交易及机构	334,375,483.58	679,321,669.92	-103.16	-94.83	-66.20	减少 172.11 个百分点
融资租赁	2,309,981,502.96	1,493,913,399.59	35.33	-4.62	-8.06	增加 2.42 个百分点
其他	497,250,049.32	539,573,258.09	-8.51	-87.46	-86.50	减少 7.71 个百分点
主营业务分地区情况						
分地区	营业收入	营业支出	毛利率 (%)	营业收入比上年增减 (%)	营业支出比上年增减 (%)	毛利率比上年增减 (%)
上海	358,229,205.88	157,224,174.34	56.11	0.14	3.41	减少 1.39 个百分点
浙江	200,559,725.98	69,272,480.15	65.46	-4.92	-1.96	减少 1.04 个百分点
黑龙江	177,911,462.11	81,553,126.23	54.16	-1.61	-3.36	增加 0.83 个百分点
江苏	156,457,997.06	77,404,574.67	50.53	1.58	-0.15	增加 0.86 个百分点
山东	116,324,094.75	50,650,466.28	56.46	2.84	0.75	增加 0.90 个百分点
其他地区分支机构	871,217,481.52	429,113,441.40	50.75	2.47	-1.54	增加 2.01 个百分点
公司总部及境内子公司	8,260,979,582.53	2,715,928,195.39	67.12	-49.40	-64.45	增加 13.91 个百分点
境内小计	10,141,679,549.83	3,581,146,458.46	64.69	-44.26	-57.92	增加 11.47 个百分点
境外业务	1,962,670,746.65	2,678,452,140.25	-36.47	-62.81	-19.49	减少 73.43 个百分点
合计	12,104,350,296.48	6,259,598,598.71	48.29	-48.43	-47.12	减少 1.28 个百分点

2022 年上半年，集团财富管理业务营业收入 48.52 亿元，同比（51.89 亿元）减少 3.37 亿元，减幅 6.51%，公司持续推动财富管理转型，以客户为中心，加快推动分支机构发展，稳步推进金融产品销售；投资银行业务营业收入 24.71 亿元，同比（30.08 亿元）减少 5.37 亿元，减幅 17.83%，主要是承销收入减少；资产管理业务营业收入 16.40 亿元，同比（24.16 亿元）减少 7.76 亿元，减幅 32.12%，主要是管理费收入减少；交易及机构业务营业收入 3.34 亿元，同比（64.73 亿元）减少 61.39 亿元，减幅 94.83%，主要是资本市场震荡调整导致投资收益减少；融资租赁业务营业收入 23.10 亿元，同比（24.22 亿元）减少 1.12 亿元，减幅 4.62%，公司紧跟国家战略及政策导向，持续完善区域布局，加大绿色租赁支持力度，资产结构不断优化；其他业务营业收入 4.97 亿元，同比（39.64 亿元）减少 34.67 亿元，减幅 87.46%，主要是子公司销售收入减少。公司坚持稳中求进，做深价值服务链，积极服务实体经济，深化“投、融、保、研”和财富管理联动，着力推动各项改革，有序推进业务发展，同时做好成本管控，促进降本增效。

## (3) 营业支出

单位：元 币种：人民币

成本构成项目	本期金额	上年同期	本期金额较上年同期变动比例 (%)	主要原因
税金及附加	156,694,507.48	151,625,754.50	3.34	/
业务及管理费	5,256,123,649.22	6,439,255,745.70	-18.37	主要是职工薪酬减少
信用减值损失	178,662,978.58	1,024,765,121.75	-82.57	主要是买入返售金融资产减值损失减少
其他资产减值损失	25,910,800.78	44,083,145.76	-41.22	/
其他业务成本	642,206,662.65	4,177,371,538.58	-84.63	主要是子公司销售成本减少
合计	6,259,598,598.71	11,837,101,306.29	-47.12	/

#### (4) 现金流

经营活动产生的现金流量净额为 173.14 亿元，其中：现金流入 559.58 亿元，占现金流入总量的 32.16%，主要是为交易目的而持有的金融资产净减少额 202.76 亿元，收取利息、手续费及佣金的现金 141.95 亿元，收到其他与经营活动有关的现金 100.01 亿元；现金流出 386.45 亿元，占现金流出总量的 25.52%，主要是回购业务资金净减少额 130.12 亿元，支付其他与经营活动有关的现金 84.13 亿元。

投资活动产生的现金流量净额为 -24.46 亿元，其中：现金流入 177.05 亿元，占现金流入总量的 10.18%，主要是收回投资收到的现金 165.36 亿元；现金流出 201.50 亿元，占现金流出总量的 13.31%，主要是投资支付的现金 182.97 亿元。

筹资活动产生的现金流量净额为 77.02 亿元，其中：现金流入 1,003.18 亿元，占现金流入总量的 57.66%，主要是发行债券收到的现金 568.51 亿元，取得借款收到的现金 434.67 亿元；现金流出 926.16 亿元，占现金流出总量的 61.17%，主要是偿还债务支付的现金 875.30 亿元。

#### 2. 本期公司业务类型、利润构成或利润来源发生重大变动的详细说明

适用 不适用

### (二) 非主营业务导致利润重大变化的说明

适用 不适用

### (三) 资产、负债情况分析

#### 1. 资产及负债状况

单位：元

项目名称	本期期末数	本期期末数 占总资产的 比例 (%)	上年期末数	上年期末数 占总资产的 比例 (%)	本期期末金额 较上年期末变 动比例 (%)	情况说明
衍生金融资产	2,277,485,754.74	0.30	1,084,731,024.74	0.15	109.96	主要是权益衍生工具投资规模增加
其他权益工具投资	6,612,455,737.01	0.88	10,246,870,931.21	1.38	-35.47	主要是其他权益工具投资规模减少
投资性房地产	2,310,228,778.07	0.31	57,595,407.36	0.01	3,911.13	主要是投资性房地产规模增加
拆入资金	10,655,383,836.51	1.42	15,664,657,697.33	2.10	-31.98	主要是拆入资金规模减少
代理承销证券款	-	-	1,601,399,997.46	0.21	-100.00	主要是代理承销规模减少
应交税费	1,748,496,834.82	0.23	4,200,007,273.89	0.56	-58.37	主要是企业所得税减少

其他说明

##### (1) 资产状况

2022 年 6 月末，集团总资产 7,495.66 亿元，较上年末 (7,449.25 亿元) 增加 46.41 亿元，增幅 0.62%。主要变动情况是：货币资金、结算备付金及存出保证金增加 255.22 亿元，交易性金融资产、其他债权投资、其他权益工具投资等金融资产减少 166.10 亿元，融出资金减少 55.55 亿元。

集团交易性金融资产、其他债权投资、其他权益工具投资等金融资产占集团总资产的 34%，货币资金、结算备付金及存出保证金占总资产的 30%，长期应收款及应收融资租赁款占总资产的 12%，融出资金占总资产的 9%，买入返售金融资产占总资产的 6%，固定资产、使用权资产、在建工程及投

资性房地产占集团总资产的 2%，大部分资产变现能力较强，集团资产流动性较强，资产结构优良。

## (2) 负债状况

2022 年 6 月末，集团负债总额 5,720.83 亿元，较上年末 (5,671.70 亿元) 增加 49.13 亿元，增幅 0.87%。主要变动情况是：短期借款及长期借款增加 78.75 亿元，应付短期融资款及应付债券增加 75.58 亿元，代理买卖证券款增加 63.87 亿元，卖出回购金融资产款减少 103.44 亿元，拆入资金减少 50.09 亿元。

## 2. 境外资产情况

### (1) 资产规模

其中：境外资产 2,743.95 亿港币，折合人民币为 2,346.60 亿元，占总资产的比例为 31.31%。

### (2) 境外资产占比较高的相关说明

集团通过海通国际控股开展境外业务，具体参见本报告“第三节 管理层讨论与分析 四、报告期内主要经营情况 (六) 主要控股参股公司分析”的相关内容。

## 3. 截至报告期末主要资产受限情况

所有权或使用权受到限制的资产，具体参见本报告“第九节 财务报告”中“四、合并财务报表项目附注 1 货币资金，7 买入返售金融资产，8 交易性金融资产，9 债权投资，10 其他债权投资，11 其他权益工具投资，12 应收融资租赁款及长期应收款，以及 15 固定资产。”

## 4. 其他说明

适用 不适用

## (四) 投资状况分析

### 1、对外股权投资总体分析

报告期末，集团长期股权投资 63.28 亿元，较上年末 (64.54 亿元) 减少 1.26 亿元，减幅 1.96%。子公司投资参见本报告“第九节 财务报告”中“四、合并财务报表项目附注 13、长期股权投资”。

#### (1) 重大的股权投资

适用 不适用

#### (2) 重大的非股权投资

适用 不适用

#### (3) 以公允价值计量的金融资产

以公允价值计量的金融资产参见本报告“第九节 财务报告”中“十三、其他重要事项 2、金融工具计量基础分类表”。

## (五) 重大资产和股权出售

适用 不适用

## (六) 主要控股参股公司分析

1. 海通创新证券, 注册资本115亿元人民币, 海通证券持有100%的股权。截至2022年6月30日, 海通创新证券总资产为206.05亿元, 净资产200.60亿元; 2022年上半年, 实现营业收入2.63亿元, 净利润2.77亿元。

2. 海通国际控股, 注册资本111.80亿港元, 海通证券持有100%的股权。截至2022年6月30日, 海通国际控股总资产为2,743.95亿港元, 净资产362.50亿港元; 2022年上半年, 实现收入23.63亿港元, 净利润-11.55亿港元。

3. 海通开元, 注册资本75亿元人民币, 海通证券持有100%的股权。截至2022年6月30日, 海通开元总资产为134.18亿元, 净资产116.64亿元; 2022年上半年, 实现营业收入4.46亿元, 净利润4.47亿元。

4. 海通资管公司, 注册资本22亿元人民币, 海通证券持有100%的股权。截至2022年6月30日, 海通资管公司的总资产为71.97亿元, 净资产53.05亿元; 2022年上半年, 实现营业收入3.81亿元, 净利润2.52亿元。

5. 上海泽春, 注册资本1亿元人民币, 海通证券持有100%的股权。截至2022年6月30日, 上海泽春的总资产为4.66亿元, 净资产2.07亿元; 2022年上半年, 实现营业收入0.36亿元, 净利润0.18亿元。

6. 上海惟泰置业, 注册资本1,000万元人民币, 海通证券持有100%的股权。截至2022年6月30日, 上海惟泰置业的总资产为2.09亿元, 净资产0.01亿元; 2022年上半年, 实现营业收入0.19亿元, 净利润-0.09亿元。

7. 海通期货, 注册资本13.015亿元人民币, 海通证券持有73.83%的股权。截至2022年6月30日, 海通期货总资产为598.02亿元, 净资产34.10亿元; 2022年上半年, 实现营业收入10.02亿元, 净利润1.69亿元。

8. 海富通基金, 注册资本3亿元人民币, 海通证券持有51%的股权。截至2022年6月30日, 海富通基金总资产为37.87亿元, 净资产22.56亿元; 2022年上半年, 实现营业收入6.68亿元, 净利润2.09亿元。

9. 富国基金, 注册资本5.2亿元人民币, 海通证券持有27.775%的股权。截至2022年6月30日, 富国基金总资产为122.44亿元, 净资产67.87亿元; 2022年上半年, 实现营业收入37.73亿元, 净利润11.22亿元。

## (七) 公司控制的结构化主体情况

公司对由子公司作为管理人的结构化主体, 综合考虑合并报表范围内的公司合计享有这些结构化主体的可变回报, 或承担的风险敞口等因素, 认定将66个结构化主体纳入合并报表范围。



## 五、其他披露事项

### (一) 可能面对的风险及风险应对措施

#### 1. 风险管理概述

公司一直以来注重对风险的防范与控制,确立了“务实、开拓、稳健、卓越”的经营理念,树立了“稳健乃至保守”的风险控制理念,经营管理实行合规优先、风险管理优先的原则。

公司根据《证券公司全面风险管理规范》等监管要求及内部制度,从全覆盖、可监测、能计量、有分析、能应对等方面持续完善全面风险管理体系建设,强化风控指标并表管理,健全集团 T+1 风险数据集市,推进集团风险管理向纵深发展:搭建了层级分明的风险管理组织架构,覆盖各风险类别、各业务条线、各部门/分支机构/子公司,不断完善风险识别、评估、计量、监控、报告和应对等风险管理流程,规范各类业务开展,加强风险的事前防范、事中监控和事后检查处置;建立了监管指标、风险容忍度和风险限额指标、业务风控指标等三层风险控制指标体系,通过系统实现动态监控和自动预警,开展压力测试以评估极端风险,同时以同一业务、同一客户管理为框架,建立集团风险限额体系,向部门、子公司进行拆解,并开展日常监控工作;开展市场风险、信用风险、流动性风险计量,建立模型管理机制和流程,并持续对模型开展评估和验证;将子公司风险纳入报告范围,定期编制集团风险日报、月报、季报、半年/年报,针对重大风险事件编制专项报告;根据风险评估和预警的结果,选择合适的应对策略,建立了有效的应对机制以及具有可操作性的应急预案。此外,公司从文化宣导、制度建设、数据和系统、人才队伍建设、风控投入等方面为全面风险管理提供保障和支持。

#### 2. 风险管理架构

公司依据《公司法》《证券法》《证券公司内部控制指引》《证券公司全面风险管理规范》等法规及公司规章制度要求,搭建了多层次的风险管理组织架构,明确了董事会、监事会、经营层、首席风险官、风险管理部门、业务及管理部门、分支机构、子公司等各层级在风险管理工作中的具体职责。

公司董事会是公司风险管理战略目标的制定者和授权人,负责审议批准公司风险管理的总体目标、基本政策和重要制度、公司整体风险偏好和风险容忍度、重大风险的解决方案、定期风险评估报告监督公司风险管理政策的实施,任免考核首席风险官,建立与首席风险官的直接沟通机制,及公司章程规定的其他职责。公司董事会设合规与风险管理委员会,具体履行董事会风险管理职责。

公司监事会是公司风险管理和内部控制体系的监督者,负责对董事会、经理层建立和实施风险管理及内部控制的情况进行监督,并履行公司章程规定的其他职责。

公司经营层根据董事会的授权,负责建立责任明确、程序清晰的组织结构,制定公司风险管理的政策、规章和制度,贯彻执行公司整体风险偏好和风险容忍度政策,组织实施各类风险的识别、评估及应对工作,建立健全和有效执行风险管理制度和机制,及时处理或者改正存在的问题缺陷,审议处理公司重大风险事件,建立涵盖风险管理有效性的全员绩效考核体系,建立完备的信息技术系统和数据质量控制机制,及董事会授予的其他风险管理职责。

公司设首席风险官,由董事会聘任。首席风险官是负责公司全面风险管理工作的高级管理人员,负责组织实施董事会、经营层确定的风险管理政策、规章和制度,组织对公司建立健全各项业务风险管理制度进行督导、审查和评估,组织对公司风险管理政策和流程的执行情况进行监督和检查,对风

险管理中存在的问题提出处理意见并督促整改，组织评估和完善风险管理的工具和方法，定期组织对公司面临主要风险水平及其管理状况进行评估，并向经营层、董事会及监管部门提交评估报告，组织对子公司风险管理工作负责人的提名和考核等。

公司设立风险管理部，在首席风险官的领导下履行风险管理职责，负责拟定公司风险管理的政策、规章和制度，督导公司各单位制定业务风险管理制度和流程，对相关业务的主要风险进行识别和评估，组织对各项业务风险管理制度执行情况的监督、检查，定期对公司整体风险水平及其风险管理状况进行评估和报告，对重大风险隐患或风险事件，及时报告并提出风险处置建议等。此外，公司合规法务部负责管理公司合规风险、洗钱及恐怖融资风险，公司资金管理总部负责管理公司流动性风险，公司总经理办公室负责管理公司声誉风险，公司信息技术管理部门负责管理公司信息技术风险。

公司各部门、分支机构和子公司负责其经营管理范围内的风险管理工作，建立健全相应的风险管理制度和流程，落实公司风险管理政策，组织实施相应的风险管理工作。公司各部门、各分支机构和子公司负责人承担本单位风险管理有效性的直接责任。公司各部门、各分支机构和子公司指定专人负责本单位的风险管理工作，对风险管理政策和制度的执行情况进行监督、检查和报告，履行一线风险管理职责。

公司稽核部负责定期对公司风险管理工作进行稽核检查，定期评估风险管理体系的有效性，并根据评估结果提出改进建议。

各子公司规范运作，依法经营。公司通过各项机制将子公司风险管理纳入全面风险管理体系，从子公司风险管理负责人提名、风险限额与报告、重大事项审批、数据对接、风控指标并表、督导与检查、评价考核等方面落实对子公司的垂直风险管理。

### 3. 各类风险的应对措施及其报告期内表现

公司业务经营活动面临的风险主要有：合规风险、洗钱及恐怖融资风险、信用风险、市场风险、操作风险、流动性风险、声誉风险具体情况如下：

#### (1) 合规风险

《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》中所称的“合规风险”，是指因证券基金经营机构或其工作人员的经营管理或执业行为违反法律法规和准则而使证券基金经营机构被依法追究法律责任、采取监管措施、给予纪律处分、出现财产损失或商业信誉损失的风险。

公司按照合规管理监管要求，并结合公司的实际情况，建立科学合理、职责分明的合规管理架构体系，明确董事会、监事会、经营管理主要负责人、合规总监、其他高级管理人员的合规管理职责定位，合规部门、其他内控部门、公司下属单位（包括各部门、各分支机构、各子公司）分工明确，协调互动。公司已制定《海通证券股份有限公司合规管理办法》及相关配套合规管理制度，并配置合规管理人员队伍体系，严格对各业务条线进行合规管理，通过合规事前审查、事中监测、事后检查、考核及问责，努力提高各项制度、机制及流程的执行力度，同时，公司加大政策传导及合规宣导工作力度，积极培育“人人合规、主动合规”的经营环境。

报告期内，公司进一步加强合规审查、合规检查、合规监测、合规考核与问责等合规管理基础工作。同时，公司确定2022年为“合规内控文化建设年”，在集团范围内全面推进合规内控文化建设，贯彻“全员合规、合规从管理层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础”的合规理念，遵循“人员为抓手、问题为导向、长效机制为保障”的原则，重点抓好培训宣导、反洗钱工作、队伍建设、问题查摆、制

度执行等五大核心工作，推动公司建立健全合规内控长效机制，逐步实现公司合规内控体系提档升级。

### （2）洗钱及恐怖融资风险

《法人金融机构洗钱和恐怖融资风险管理指引（试行）》中包含了洗钱、恐怖融资和扩散融资风险管理的具体要求。公司面临的洗钱、恐怖融资和扩散融资风险是指公司的产品或服务被不法分子利用从事洗钱、恐怖融资、扩散融资等活动的可能性。公司已建立健全董事会负责下的反洗钱组织架构，形成公司反洗钱领导小组统筹协调、合规部门牵头组织实施、相关业务部门和分支机构落实执行的反洗钱管理体系。公司建立了包括集团洗钱风险管理制度、公司反洗钱基本制度及其他配套制度和操作规程等在内的反洗钱管理制度体系。

报告期内，公司全面推进洗钱和恐怖融资风险管理文化宣导，提升公司洗钱和恐怖融资风险管理水平。一是开展公司反洗钱工作自查，全面审视公司各条线洗钱风险管理情况。二是加强洗钱风险管理文化建设，开展洗钱风险管理系列培训，努力提升一线洗钱风险管理履职能力。三是积极履行反洗钱宣导义务，通过公司微信公众号发布洗钱宣传材料，提高投资者洗钱和恐怖融资风险防范意识。

### （3）信用风险

信用风险是指因融资人、交易对手方或债务发行人无法履行其约定的财务义务或信用资质发生不利变化而可能对本集团经营造成损失的风险。

#### A、存放在其他金融机构的自有货币资金、经纪业务相关风险

货币资金主要存放在国有商业银行或信誉良好的股份制商业银行，结算备付金存放在中国证券登记结算有限责任公司，此类现金及现金等价物面临的信用风险相对较低。经纪业务采取全额保证金结算，切实规避相关信用风险。

#### B、交易性融资业务相关风险

本集团开展的交易性融资业务主要包括：融资融券、股票质押式回购、孖展交易、约定购回式证券交易等。相关主体通过制定和实施各项严格的制度和措施，主要从尽职调查、内部评级、项目评审、授信管理、逐日盯市、限额监控、贷后跟踪、补充增信、平仓处置、司法追索和拨备计提等环节实施管控。

#### C、信用债券交易与投资业务相关风险

本集团注重通过分散投资控制集中度风险，投资标的主要倾向于高信用评级资产，在信用风险管理中密切跟踪投资标的的经营情况和信用评级变化，落实内部评级和统一授信管理机制，建立健全债务发行人、行业和地域集中度等信用风险监控指标，在投后跟踪中及时根据财务指标变动、重大风险事件和负面舆情等信息更新债务发行人内部评级和授信限额指标，动态调整交易策略。

#### D、融资租赁业务相关风险

本集团在开展融资租赁业务、支持实体经济发展时，坚持以行业与客户并重的策略确定信用风险管理政策。行业信用风险管理方面，本集团就融资租赁客户所处行业的景气程度施行动态跟踪和评估，以此为基础制定相应的行业投放政策、管控行业集中度风险。客户信用风险管控方面，本集团主要通过开展尽职调查、内部评级、授信审核、贷后资产巡检、风险预警与监测、集中度限额控制等措施对客户信用风险实施管控。

#### E、债券回购等同业短期拆借、场外衍生品业务相关风险

针对债券回购等同业短期拆借业务，本集团以交易对手准入和授信管理为抓手，审慎筛选信用资

质良好的交易对手和信用等级较高的担保证券，从源头上控制信用风险水平。针对场外衍生品业务，本集团从交易对手准入和授信管理、标的证券管理、风险应对与处置等方面建立了完善的管理制度与流程，对存续期内的场外衍生品交易进行逐日盯市，并通过严格履行净额结算和履约保障等措施管理交易对手信用风险。本集团同业短期拆借和场外衍生品业务的交易对手主要是商业银行、证券公司、资产管理计划等主体，在开展此类业务的过程中，合理选择业务模式、严格控制业务规模并采取合理的风控措施。同时，本集团关注信用风险和市场风险之间的相关性，对市场波动背景下的信用风险采取必要的监控和应对措施，包括但不限于交易保证金安排、交易对手内部评级与授信管理、未来潜在风险暴露计量、错向风险识别等。

本集团根据行业监管政策、资本市场环境和集团业务发展战略，持续完善信用风险管理体系。报告期内，本集团以信用风险管理办法等制度为依据，全面落实以同一客户、同一业务为核心的信用风险识别、评估、计量、监控、报告及应对工作，包括以集团 T+1 风险数据集市为依托，对可覆盖母子公司业务的信用风险管理信息系统进行持续升级，通过提升风险识别、计量与压力测试能力持续完善资产质量、风险抵补和集中度风险等维度的信用风险限额体系，持续强化统一评级与集中授信管理机制，对信用评级和授信限额模型进行动态优化，搭建以云计算、区块链、大数据、人工智能等金融科技为支撑的客户关系图谱集团智能预警中心、舆情异动监控、违约预警监控、财报风险监控分析及高风险客户管控工具，强化信用类业务风险资产系统化管理程序，以此实现对集团整体信用风险状况和风险限额执行情况的有效跟踪和监控。本集团以 ESG 风险管理办法等制度为依据，建立健全客户 ESG 风险准入及跟踪监控机制，积极落实客户 ESG 尽职调查和 ESG 风险评估等工作。报告期内，本集团核心信用风险监控指标运行平稳，整体信用风险可控。

针对融资类三项业务，公司主动优化业务结构，审慎评估新做项目，加强存续项目的跟踪、监控和管理，加大存量风险项目追偿力度并审慎、前瞻地计提信用减值准备，确保风险拨备计提充分。截至报告期末，公司融资融券存量负债客户的平均维持担保比例为 275.58%，约定购回式证券交易客户的平均履约保障比例为 273.64%，股票质押式回购业务客户的平均履约保障比例为 265.77%，融资人提供的担保品较为充足，信用风险整体可控。

#### (4) 市场风险

市场风险主要指在本集团的经营活动中，因市场价格（股票价格、利率、汇率及商品价格等）的不利变动而使自有资金投资的相关业务发生损失的风险。

**A、股票价格风险。**股票价格风险主要指集团所投资的权益类证券市场价格发生变化致使本集团承受损失的风险。承担此类风险的业务主要包括权益类证券自营业务、做市业务和场外衍生品业务等。股票价格风险具有较大的不确定性，是本集团主要面对的市场风险类型之一。集团密切关注相关资产价格波动，并采取相应措施予以防范，通过每日跟踪证券持仓的投资规模和风险价值（VaR）变化情况进行监测和管控。集团通过实施多元化投资策略，对各类证券品种的投资规模进行适当控制和适时调整，并结合各类套期保值工具，较为有效地控制了市场风险。

**B、利率风险。**利率风险是指因市场收益率曲线或信用价差等因素变动导致的风险，承担此类风险的业务主要包括债券投资业务和利率衍生品业务等。本集团对利率风险的控制，主要采用规模控制和投资组合等方法，合理配置资产，匹配负债与资产的期限结构，并通过定期测算投资组合久期、凸性、DV01 等指标衡量利率风险。

**C、汇率风险。**汇率风险是指因外汇汇率变动而导致的风险。报告期内，本集团国际化布局不断完善，

面对复杂多变的境外市场，主动降低境外资产杠杆水平，整体外币资产规模有所减少，汇率风险敞口也相应降低。集团持续跟踪研究外汇市场，不断完善制度建设和内部管理，通过套保等一系列措施对冲、缓释汇率风险。集团注重外币资产和负债的匹配，以缩小外汇风险的敞口，还采用境外经营净投资套期等方法平滑外汇敞口对集团经营成果的影响。截至报告期末，本集团的汇率风险对财务报表无重大影响。

D、商品价格风险。商品价格风险是由各类商品价格发生不利变动引起。报告期内，本集团商品类市场风险敞口相对较低，主要通过商品期货、期权等商品衍生工具进行对冲，有效管理商品风险。

除上述风险因素之外，本集团所从事的境外投资交易业务也承担着相关市场风险，全球范围内各种市场风险因子的波动都可能对集团的整体损益带来影响。报告期内，根据集团市场风险管理方法的有关要求，公司不断推进落实集团层面市场风险的识别、评估、计量、监测、应对和报告等程序，将子公司投资交易业务纳入整体市场风险管理体系内。对于集团下属子公司进行的投资交易业务，通过制定并分配风险价值限额、止损限额等市场风险限额指标进行管控，要求子公司在日常经营活动中严格落实执行，并按要求向母公司提交风险报告。本集团基于T+1风险数据集市、集团市场风险管理系统、风险报告等工具或手段，对子公司市场风险状况和风险限额执行情况进行跟踪和监督。

本集团通过以风险价值为主的市场风险量化指标体系对各项投资交易类业务承担的市场风险情况进行计量和管控。风险价值指在一定的置信水平下，投资组合在未来特定前瞻期内因市场波动而产生的最大可能损失，是衡量市场风险的主要指标。本集团风险价值模型的具体计量参数为95%置信水平、1日前瞻期，模型计量的覆盖范围包括集团层面持有的权益、利率、外汇等各类金融资产和衍生品。本集团通过返回检验等手段，持续监控和评估风险价值模型的有效性，并随着业务发展和风险管理的需要持续完善风险价值模型。此外，本集团建立压力测试管理机制作为风险价值模型的重要补充，通过构建各类历史情景和模拟情景以及相应的压力测试传导机制，衡量投资交易业务可能面临的极端损失情况，并评估损失是否在可承受范围内。报告期内，本公司各月月末风险价值占本公司净资产的比例、以及本集团风险价值占本集团净资产的比例均保持在0.3%以内，市场风险可控可承受。

#### (5) 操作风险

操作风险指由内部流程缺陷、人员失误或不当行为、信息系统缺陷或故障，以及外部因素等原因给公司造成损失的风险。操作风险贯穿于公司业务开展与日常运营过程中的各个环节，并可能导致法律风险、合规风险、声誉风险等其他风险。公司根据操作风险管理方法，利用风险与控制自我评估、关键风险指标、损失数据收集等工具，开展操作风险识别、评估、监测、报告等工作。公司在集团范围内开展年度风险与控制自我评估，并根据监管要求及新业务开展情况等开展专项风险与控制自我评估；建立覆盖集团主要部门、单位的关键风险指标体系，对关键风险指标开展定期收集监测工作；在集团范围内开展操作风险损失数据收集监测工作，汇总分析相关信息并跟进风险缓释措施的进展。报告期内，公司面临的操作风险性质和程度未发生重大变化，已建立的各项操作风险管理工具持续有效运行，未发生对公司运营有实质性影响的重大操作风险事件。

信息技术风险方面，公司持续加强信息技术管理的制度建设，不断完善网络与信息安全事故应急预案，定期进行应急演练，并采用定期或不定期的监测、专项检查等多种手段对系统运行、系统建设、信息安全、科技管理等方面的信息技术相关情况进行监控和管理，防范信息技术风险。公司持续加强信息技术系统的建设和运维，严格按照操作程序进行定期和不定期的检查和维护，以保证系统的可靠、稳定和安全运转，报告期内未发生重大信息技术风险事件。

## (6) 流动性风险

流动性风险是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。由于公司自营业务规模及融资类业务规模较大，公司经营过程中易受宏观政策、市场变化、经营状况、客户信用等因素影响，并可能因资产负债结构不匹配而引发流动性风险。

在日间流动性风险管理方面，公司按照制定的流动性风险偏好及风险指标限额的要求，通过合理的监测机制和调控手段，始终确保流动性风险可测、可控和可承受，同时按照管理要求，储备了充足的优质流动性资产，保障了公司业务的顺利开展和到期负债的顺利偿付。公司持续开展日间流动性和风险指标管理，结合资产端和负债端，构建资金、指标联动体系，完善了包括日间指标头寸跟进、月度指标前瞻分析和部门指标拆解在内的流动性风险分析框架，丰富了不同期限内流动性风险管理的工具，提升了公司流动性风险管理和预判的效率。

在中长期流动性风险管理方面，公司不断优化资产配置结构，强化对资产负债发展趋势的分析，从源头上把控流动性风险。一方面，公司成立资产负债配置委员会，积极开展资产负债管理工作，通过及时分析业务发展趋势、潜在中长期资金需求，调整负债期限结构，保持资产负债的期限、规模的合理匹配；另一方面，公司持续提升流动性精细化管理水平，负债端结构和到期日分布更趋合理，也保证资产端在安全性、流动性、收益性之间的平衡。报告期内，公司重视与各大商业银行保持良好的合作关系，注重规范经营，维系良好信誉，保持融资渠道畅通。

此外，公司稳步推进对集团和子公司流动性风险管理的要求，以集团流动性风险管理办法为指引，根据各子公司业务特点制定了较为科学有效的流动性风险管理策略，基本实现集团层面流动性风险的统一管理。首先，公司以流动性风险管理为基础，从风险和资产负债管理等方面持续对子公司实行分类管理，并从组织制度保障、风险管控框架、风险应对手段三个维度提出不同要求，指导子公司完善其流动性风险管理体系；其次，以流动性风险并表指标为基础，根据各子公司所处行业、地域和风险特征的差异，下发各子公司的限额管理要求，以更有效地监测各子公司的流动性风险实质情况；最后，为强化集团流动性风险处置能力，公司以集团流动性支持管理办法作为整体管理方针，持续完善集团流动性支持体系，牢牢守住集团不发生流动性风险的底线。

报告期内，面对市场环境的变化和公司内部资金需求的转化，公司积极筹划，从多个方面着手，通过事前风险识别、事中风险缓释、事后改进等措施，不断强化对流动性风险的管控。公司通过市场研判，抓住利率低位时点及时通过发债增加资金储备并续作各项到期负债，降低了流动性风险发生的可能，并保证了公司在复杂市场环境下的平稳运营能力。报告期内，公司核心流动性监管指标流动性覆盖率日均 286.48%，净稳定资金率日均 165.97%，均高于监管要求及预警标准。

## (7) 声誉风险

声誉风险是指由于公司行为或外部事件，以及工作人员违反廉洁规定、职业道德、业务规范、行规行约等相关行为，导致投资者、发行人、监管机构、自律组织、社会公众、媒体等对公司形成负面评价，从而损害公司品牌价值，不利于公司正常经营，甚至影响到市场稳定和社会稳定的风险。公司高度重视声誉风险管理的前瞻性和主动性，持续满足监管部门关于声誉风险系统化管理的要求，加强境内外声誉风险监测，在中国内地和中国香港建立传播渠道，围绕公司经营业绩和业务亮点，强化主动宣传，为公司发展营造良好的舆论环境。针对少数负面舆情，能够科学研判、快速反应、主动应对，及时把握舆情走势，与主流媒体保持良好沟通，做好舆论引导，维护公司品牌形象。公司根据中国证券业协

会发布的《证券公司声誉风险管理指引》有关要求，及时修订完成《海通证券股份有限公司声誉风险管理办法》并在公司内部进行全员宣传和贯彻。报告期内，集团总体舆论环境良好。

## (二) 其他披露事项

### 经营计划进展说明

2022年上半年，面对新冠肺炎疫情带来的严峻考验和复杂多变的外部环境，在总体战略的指引下，公司统一思想，明确任务，坚持疫情防控和经营发展“两手抓、两手硬、两手赢”，以“一个海通”理念总揽“投、融、保、研”和财富管理五个关键领域，发挥专业力量积极服务实体经济，着力推动改革发展，各项工作稳步推进，为实现全年经营目标打下良好基础。

在投资银行业务条线，公司股权融资业务加大项目推进力度，积极拓展“专精特新”企业，巩固了行业优势，市场排名保持行业前列；债券融资业务在发挥专业优势全面助力复工复产复市的同时，积极以创新驱动业务发展，成功完成多个首单债券的发行。在财富管理业务条线，公司经纪业务通过加大在重点区域的投入和强化集团范围的业务协同，加快推动分支机构发展；金融产品业务持续强化销售组织、完善销售政策、厘清销售职能、优化系统平台；融资类业务稳中有进，资产质量保持较好水平，融券业务规模持续增长；期货业务总体继续保持行业前列，期货子公司成功获批成为广州期货交易会员。在交易及机构业务条线，公司 QFII、RQFII 业务继续保持行业前列，WFOE 业务保持行业优势，对银行理财子公司的服务转向提供交易服务；权益投资交易不断拓展服务品类，夯实服务能力；固定收益投资稳步推进 FICC 创新业务，并在场外衍生品业务领域实现突破；研究服务创新工作方法，强化线上服务，深化客户服务力度。在资产管理业务条线，资管子公司按照“做大单品、做优产品、做实收益、做专投研、做好服务”的要求，加快推进高质量发展；公募基金子公司积极把握市场机遇，继续保持良好的发展态势；私募股权投资基金子公司积极推进基金募集设立工作，并稳步推进基金“募投管退”全流程管理。在国际业务与租赁业务条线，海通国际继续保持香港市场领先地位；海通银行跨境和本地业务齐头并进，澳门分行业务取得开门红；海通恒信持续完善区域布局，并加大绿色租赁支持力度，不断优化资产结构。报告期内，公司各个业务条线均取得稳健业绩的同时，在管理工作方面，公司进一步强化合规风控能力建设，加快数字化转型步伐，深化人力资源组织保障，优化财资管理能力，通过管理赋能持续强化精耕细作助力公司在“一个海通”理念下的健康发展。

2022 年下半年，公司将坚持稳中求进工作总基调，统筹疫情防控和经营发展，全面推进各项经营管理工作的开展，具体的业务重点包括：投资银行业务条线，将聚焦服务国家战略，继续深化投行一体化建设，并带动“投、融、保、研”和财富管理业务全面发展；财富管理条线，将进一步完善产品销售体系，深耕高净值客户的财富管理需求；交易及机构业务条线，将继续加快提升主动投资管理能力，强化持牌机构服务能力，并推动打造交易、结算、托管、投研、代销一站式的机构主经纪商服务；资产管理业务条线，将加强投研体系建设，加大投研队伍的培养，引进优秀投研人才，提升产品获客能力；私募股权投资及直投业务线，将围绕重点区域产业发展和头部产业资本，发起设立新基金，并进一步加大对战略新兴产业的研究和投资力度；海外业务条线，将继续强化集团间各业务线协同联动，并积极投身粤港澳大湾区、珠三角地区发展建设；融资租赁业务条线，将立足租赁主业，持续优化资产结构。与此同时，公司下半年还将围绕高质量的合规风控、科技运营、党建和文化建设、人力资源管理体系建设，提升管理工作效能，护航公司高质量发展。

## 第四节 公司治理





## 一、股东大会情况简介

会议届次	召开日期	决议刊登的指定网站的查询索引	决议刊登的披露日期	会议决议
2021 年度股东大会	2022 年 6 月 21 日	<a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>	2022 年 6 月 22 日	详见下文“股东大会情况说明”

注：上述会议决议公告请参阅会议当日的香港联交所披露易网站，次日的上交所网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》和《证券日报》及本公司网站。

### 表决权恢复的优先股股东请求召开临时股东大会

适用 不适用

#### 股东大会情况说明

本报告期内，公司于 2022 年 6 月 21 日在海通证券大厦召开了 2021 年度股东大会，审议并通过 11 项议案：1. 公司 2021 年度董事会工作报告，2. 公司 2021 年度监事会工作报告，3. 公司 2021 年年度报告，4. 公司 2021 年度财务决算报告，5. 公司 2021 年度利润分配预案，6. 公司关于续聘会计师事务所的议案，7. 关于预计公司 2022 年度自营投资业务配置规模的议案，8. 关于预计公司 2022 年度日常关联 / 连交易的议案，9. 关于公司发行境内外债务融资工具一般性授权的议案，10. 关于修订《公司章程》及其附件的议案，11. 关于提请股东大会给予董事会认可、分配或发行 A 股及 / 或 H 股股份的一般性授权的议案。其中议案 1 至议案 8 为普通决议案，议案 9 至议案 11 为特别决议案。相关决议公告于会议当日刊登在香港联交所披露易网站（<http://www.hkexnews.hk>），于会议次日刊登于上交所网站（<http://www.sse.com.cn>）、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》和《证券日报》。

## 二、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

姓名	担任的职务	变动情形
王建业	合规总监	离任
李海超	副总经理、合规总监	聘任

#### 公司董事、监事、高级管理人员变动的情况说明

2022 年 3 月 3 日，公司召开的第七届董事会第二十四次会议（临时会议）审议通过了《关于聘任公司副总经理及合规总监的议案》，同意聘任李海超先生担任公司副总经理及合规总监职务，公司原合规总监王建业先生因年龄原因不再担任合规总监职务。李海超先生担任公司副总经理及合规总监的任期自 2022 年 3 月 3 日起至第七届董事会任期届满之日止。

## 三、公司董事、监事、高级管理人员及员工其他情况说明

### （一）董事、监事及有关雇员之证券交易

本公司已采纳《标准守则》所订标准作为本公司董事、监事及相关雇员进行证券交易的行为准则。本公司经查询全体董事及监事后，已确认他们于本公司 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日期间一直遵守上述《标准守则》的要求。本公司没有发现有关雇员违反指引。

### （二）董事、监事相关信息的重大变更

董事屠旋旋先生自 2022 年 1 月起担任上海隧道工程股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为 600820）董事。

独立董事林家礼先生自 2022 年 6 月起不再担任麦格里集团亚洲区高级顾问。林先生自 2021 年 5 月起担任香港航天科技集团有限公司（该公司于香港联交所上市，股份代号：1725）之非执行董事，并于 2022 年 1 月起调任为执行董事；自 2022 年 6 月起担任仁恒实业控股有限公司（该公司于香港联交所上市，股份代号：3628）独立非执行董事。

董事许建国先生自 2022 年 6 月不再担任上海亥雅实业有限公司董事长、上海开亥实业有限公司董事长、上海电气集团置业有限公司监事。许先生自 2022 年 1 月起不再担任上海电气控股集团有限公司（原称：上海电气（集团）总公司）财务预算部部长，调任上海电气控股集团有限公司董事、副总裁、财务总监；自 2022 年 6 月起担任上海电气香港有限公司董事长。

职工代表监事武向阳先生自 2022 年 5 月起担任海通恒信国际融资租赁股份有限公司监事会主席。

除上述披露者外，概无其他本公司之董事及监事的资料须根据香港上市规则第 13.51B（1）条予以披露。

### （三）董事、监事服务合约的说明

根据香港上市规则第 19A.54 及 19A.55 条，本公司已与各董事及监事就（其中包括）遵守相关法律及法规和遵从公司章程及仲裁条文订立合约。除上述披露者外，本公司与本公司任何董事或监事以其各自作为董事／监事的身份而言，并无订立亦不拟订立任何服务合约（于一年内届满或可由雇主于一年内终止而毋须支付赔偿（不包括法定赔偿）的合约除外）。

### （四）员工及薪酬政策

截至报告期末，本集团雇员人数 11,852 人。其中本公司雇员人数 6,292 人，子公司雇员人数 5,560 人。

本公司重视人才的吸引、激励、培养和保留，不断检视和优化公司薪酬体系，坚持市场化分配、绩效导向、兼顾公平的激励原则。本公司雇员薪酬由固定薪酬、绩效薪酬和福利三部分构成。依据适用的中国法律法规，本公司为雇员建立各项社会保险（养老保险、医疗保险、失业保险、工伤保险及生育保险）、住房公积金，并依据法规足额缴纳上述各项社会保险费和住房公积金。本公司建立企业

年金计划，为雇员提供补充养老保障，并为雇员投保补充医疗保险和人身意外保险。

根据适用的中国法律法规，本公司与每位雇员签订劳动合同，建立劳动关系。劳动合同包含关于合同期限、工作时间和休息休假、劳动报酬和保险福利、劳动保护和劳动条件、合同的变更及解除等条款。

## （五）员工培训

2022年上半年，公司员工培训工作坚持统筹管理、共建共享，依托海通财富研修院，持续推进数字化学习，构建学习型组织，助力公司人才发展。持续优化培训项目，强化新员工文化认同和合规理念，完善学习形式，推动新员工实现“公司融入、文化融合、团队融洽、职业融通”的学习目标；不断完善课程体系，通过快闪课程、认证课程等新模式，加强课程体系精准化、定制化，实现应学尽学、按需随学；积极强化部门协同，开通直播课堂频道，协同各部门推出业务热点、智慧运营、合规内控等系列直播，紧扣监管政策，紧跟市场热点，赋能业务发展；高效发挥平台效应，借助海通财富研修院，推出“培”伴系列模块，通过财富讲堂、主题活动、课程上新、好书共读、直播互动等形式，助力海通员工持续成长。

## 四、利润分配或资本公积金转增预案

### （一）报告期实施的利润分配方案的执行或调整情况

公司于2022年6月21日召开2021年度股东大会，审议通过了公司2021年度利润分配预案：以截至2021年12月31日本公司A股和H股总股本共计13,064,200,000股为基数，向全体股东每股派发现金红利人民币0.30元（含税），共计派发现金红利人民币3,919,260,000.00元（含税）；其中A股股本为9,654,631,180股，本次共计派发A股现金红利人民币2,896,389,354.00元；H股股本为3,409,568,820股，本次共计派发H股现金红利港币1,194,322,859.85元。

公司在《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》、上交所网站、香港联交所披露易网站及本公司网站刊登了2021年度利润分配实施的有关公告，并于2022年7月28日实施完毕。

### （二）半年度拟定的利润分配预案、公积金转增股本预案

是否分配或转增

否

## 五、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响

### （一）相关股权激励事项已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的

适用 不适用

## (二) 临时公告未披露或有后续进展的激励情况

股权激励情况

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

员工持股计划情况

适用 不适用

其他激励措施

### 海通国际购股权计划

海通国际于 2015 年 6 月 8 日召开的股东特别大会审议批准采纳新购股权计划（以下简称“2015 年购股权计划”），该购股权计划于采纳日期起 10 年内有效及生效。根据 2015 年购股权计划，购股权可授予海通国际或其任何附属（子）公司的任何董事（包括执行董事、非执行董事、独立董事）或雇员（不论全职或兼职）。购股权行使价由海通国际董事确定，不得低于下列各项的最高值：（1）海通国际股票于要约日期在香港联交所的收盘价的 110% 的价格；（2）海通国际股票于要约日期前 5 个交易日在香港联交所的平均收盘价；（3）海通国际股票面值。

于截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间，海通国际在 2015 年购股权计划下共有 732,151 份购股权于期内因员工辞职等原因失效。

于 2022 年 6 月 30 日，海通国际已发行但未获行使的购股权情况如下：

购股权计划	已发行但未获行使购股权数量（注）	每股行使价（注）	行权期限
2015 年购股权计划	6,923,743 份	4.547 港元	2018 年 6 月 7 日至 2022 年 11 月 9 日
	12,138,769 份	2.635 港元	2019 年 5 月 28 日至 2023 年 10 月 31 日
	6,890,766 份	2.322 港元	2019 年 12 月 27 日至 2024 年 5 月 30 日
	7,859,500 份	1.57 港元	2020 年 12 月 25 日至 2025 年 5 月 28 日
	10,004,500 份	2.18 港元	2022 年 2 月 17 日至 2026 年 7 月 20 日
合计	43,817,278 份		

注：购股权数量及购股权行使价格可因供股、以股代息、红股发行或海通国际股本的其他类似变动而进行调整。

根据 2015 年购股权计划尚未行使的购股权约占海通国际 2022 年 6 月 30 日已发行股份约 0.66%，若余下购股权获悉数行使，在海通国际目前的资本结构下，将须额外发行 43,817,278 股海通国际普通股，而海通国际的股本将额外增加约 4,382,000 港元，股本溢价约为 109,236,000 港元（未扣除发行开支）。详情请参阅海通国际（股份代号：665）于香港联交所披露易网站刊发的 2022 年中期报告。

## 六、公司治理的其他情况

报告期内，本公司经营和管理规范有序，符合《上市公司治理准则》《证券公司治理准则》《证券公司监督管理条例》以及中国证监会相关法律法规的要求，同时，于报告期内及截至本报告日期，本公司遵守《守则》，全面遵循《守则》中的所有守则条文（如适用），并符合其中所列明的绝大多数建议最佳常规条文的要求。

报告期内，本公司召开股东大会 1 次，董事会 6 次，监事会 2 次，审计委员会 3 次，独立董事年报工作会议 2 次，提名与薪酬考核委员会 1 次，发展战略与 ESG 管理委员会 4 次，合规与风险管理委员会 2 次，共计 21 次会议。

报告期内，公司根据中共上海市国有资产监督管理委员会、上海市国有资产监督管理委员会联合印发的《关于印发〈市国资委监管企业主要负责人履行推进法治建设第一责任人职责规定〉的通知》（沪国资委〔2021〕121 号），中国证券监督管理委员会公布的《上市公司章程指引（2022 年修订）》《上市公司股东大会规则（2022 年修订）》，上海证券交易所发布的《上海证券交易所股票上市规则（2022 年 1 月修订）》《上海证券交易所上市公司自律监管指引第 1 号——规范运作》，中国证券监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会联合公布的《证券投资基金托管业务管理办法》等相关规定，结合公司的实际情况对现行《公司章程》中的相关条款进行修订，同时对应修订了章程的附件《海通证券股份有限公司股东大会议事规则》《海通证券股份有限公司董事会议事规则》《海通证券股份有限公司监事会议事规则》。本次修订主要涉及公司的经营宗旨、股东大会及董监事会职责和审议程序、定期报告的报送规定等内容。上述章程修订的议案已经 2022 年 6 月 21 日召开的公司 2021 年度股东大会审议通过，具体修订情况详见公司于 2022 年 5 月 20 日在上交所网站披露的《海通证券股份有限公司 2021 年度股东大会会议资料》。所修订的《公司章程》自公司 2021 年度股东大会决议之日起生效。

### （一）关于股东和股东大会

本公司严格按照《公司章程》和《公司股东大会议事规则》的要求召集、召开股东大会，确保所有股东享有平等地位，能够充分行使自己的权利。

### （二）关于董事和董事会

本公司严格按照《公司章程》的规定聘任和变更董事，董事人数构成和任职资格符合法律、法规的要求。截至 2022 年 6 月 30 日，公司董事会由 11 名董事组成，其中执行董事 3 名，分别为：周杰先生，李军先生及任澎先生；非执行董事 4 名，分别为屠旋旋先生，周东辉先生，余莉萍女士及许建国先生；独立非执行董事 4 名，分别为张鸣先生，林家礼先生，朱洪超先生及周宇先生。各位董事能够勤勉尽责地履行职责，维护本公司和全体股东的利益。董事会下设发展战略与 ESG 管理委员会、审计委员会、合规与风险管理委员会、提名与薪酬考核委员会，各委员会分工明确，权责分明，有效运作，四个委员会中，发展战略与 ESG 管理委员会主任委员由董事长周杰担任，合规与风险管理委员会主任委员由执行董事李军担任，另两个委员会的主任委员均由独立非执行董事担任。

公司董事会设有审计委员会，符合中国证监会、上交所的有关规定及香港上市规则第三章的规定，成员有 5 名，包括张鸣先生（主任委员）、余莉萍女士、许建国先生、林家礼先生和周宇先生。审计委员会主要负责本公司内、外部审计的沟通、监督及核查等工作，并向董事会提供专业意见。审计委员会已审阅并确认本集团截至 2022 年 6 月 30 日六个月的中期业绩及半年度财务报告，未对本集团所采用的会计政策及常规提出异议。

### （三）关于监事和监事会

截至 2022 年 6 月 30 日，公司监事会由 8 名监事组成，其中职工代表监事 3 名，非职工代表监事 5 名，人员任职资格和构成符合法律、法规的要求。本公司监事能够勤勉尽责地履行职责，本着对股东负责的精神，对本公司财务、董事会成员以及高级管理人员履行职责的合法合规性进行监督，并就有关事项向董事会和高级管理层提出建议和改进意见。

### （四）关于高级管理层

本公司高级管理层产生的程序符合《公司法》和《公司章程》的规定，本公司高级管理层能够依照法律、法规和董事会的授权，依法合规经营，努力实现股东利益和社会效益的最大化。

### （五）关于相关利益者

本公司充分尊重和维护相关利益者的合法权益，共同推进本公司持续健康发展。

### （六）关于信息披露和投资者关系管理

报告期内，本公司能够严格按照中国大陆和香港两个上市地的法律、法规及相关规范性文件的要求，真实、准确、完整、及时、公平地披露本公司的信息，能够严格按照《公司内幕信息知情人登记制度》的有关规定，加强对公司内幕信息的管理，做好内幕信息知情人登记工作。

2022 年上半年，在疫情防控的特殊时期，公司积极响应监管部门号召，以“网络直播+电话会议”的形式组织 2021 年度业绩发布会，会议面向全市场投资者，进一步提升了投资者的参会体验、扩大了发布会的覆盖面及影响力，公司提前发布业绩说明会公告并征集投资者关注问题，公司董事长、总经理等高级管理人员出席会议，对投资者提问予以详细解答。公司日常通过电话、网络平台等线上方式，及时有效地向资本市场传导公司发展战略和经营业绩，并多次受邀参加境内外投行、券商举办的策略会。公司高度重视中小投资者沟通和维护工作，耐心回复投资者问询，回答上交所 e 互动平台 153 个问题，接听投资者热线近 500 起。同时，公司积极发挥投资者关系工作双向传导作用，及时将投资者建议反馈至经营层及相关部门，推动公司形成更加关注市场表现、更加注重价值创造的氛围。

报告期内参加境内外投行策略会、投资论坛、电话会议情况如下：

会议	接待时间	接待方式	调研对象	沟通内容
申万宏源 2022 夏季策略会	2022 年 6 月 2 日	电话	申万宏源、景顺长城基金、泰康养老、工银瑞信基金等（24 人）	
花旗大中华金融会议	2022 年 1 月 11 日	电话	花旗银行等（5 人）	公司发展战略、业务开展情况、财务指标解读
天风证券 2022 春季策略会	2022 年 2 月 24 日	电话	天风证券、鹏华基金等（15 人）	
国泰君安电话调研会	2022 年 4 月 21 日	电话	国泰君安（3 人）	
美银美林金融论坛	2022 年 5 月 12 日	电话	美银美林等（8 人）	

## （七）合规体系建设

报告期内，本公司严格按照中国证监会的要求，结合自身实际情况，不断完善本公司合规管理。本公司合规总监严格依法履行合规管理职责。本公司股东、董事和高级管理人员未发生违反规定的职责和程序直接向合规总监下达指令或者干涉其工作的情形。本公司为合规总监全面履职和合规管理提供了人力、物力、财力和技术支持，为合规管理提供了保障。报告期内，本公司加强合规审查、合规检查、合规监测等基础职能履行，稳步有序开展合规管理基础工作。同时，公司确定 2022 年为“合规内控文化建设年”，在集团范围内全面推进合规内控文化建设，贯彻“全员合规、合规从管理层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础”的合规理念，遵循“人员为抓手、问题为导向、长效机制为保障”的原则，重点抓好培训宣导、反洗钱工作、队伍建设、问题查摆、制度执行等五大核心工作，推动公司建立健全合规内控长效机制，逐步实现公司合规内控体系提档升级。

## 第五节 环境与社会





## 一、环境信息情况

### (一) 属于环境保护部门公布的重点排污单位的公司及其主要子公司的环保情况说明

适用 不适用

### (二) 重点排污单位之外的公司的环保情况说明

#### 1. 因环境问题受到行政处罚的情况

适用 不适用

经核查，本公司及子公司不属于环境保护部门公布的重点排污单位。

本集团严格遵守《中华人民共和国环境保护法》《中华人民共和国水污染防治法》《中华人民共和国大气污染防治法》等环保方面的法律法规，报告期内未出现因违反环保相关法规而受到处罚的情况。

#### 2. 参照重点排污单位披露其他环境信息

适用 不适用

#### 3. 未披露其他环境信息的原因

适用 不适用

### (三) 报告期内披露环境信息内容的后续进展或变化情况的说明

适用 不适用

### (四) 有利于保护生态、防治污染、履行环境责任的相关信息

公司持续推进 ESG 管理体系建设，成立 ESG 建设领导小组及工作小组，逐步建立起由公司董事会、管理层及相关部门共同参与的 ESG 工作模式；研究制定《海通证券“十四五”期间助力碳达峰碳中和行动方案》，夯实绿色发展的能力。公司严格遵守《中华人民共和国环境保护法》《中华人民共和国水污染防治法》《中华人民共和国大气污染防治法》等法律法规，通过系列举措提升全体员工节约环保意识，倡导绿色生活方式，践行可持续发展理念。

公司鼓励员工节约用水，优先采购节水器具，发现跑冒滴漏后及时维修，下班后由巡视员检查关闭水龙头，避免水资源浪费；同时，公司严格按照《上海市生活垃圾管理条例》对废弃物进行分类处理，对于办公及生活垃圾，由公司物业统一收集后进行清运；对于电子废弃物、硒鼓墨盒、碳粉盒等有害废弃物，公司设置定点存放，定期委托有资质的公司进行回收处置；合理做好公司餐厅食材及设备管理，减少冷库发动机启动次数，降低能源消耗。

此外，随着信息技术水平的不断提升，公司借助协同办公系统、RPA 智能流程自动化机器人、投

行类业务工作底稿管理系统、场外衍生品管理系统、智能审核系统等，营造信息化、无纸化的办公模式，在提升工作效率的同时，减少纸张等的使用。

报告期内，公司推进企业数字化办公服务，启用电子印章，实现全程网办，助力实现电子化审批，全面保障公司公文流转报送及各业务条线工作的高效推进。办公系统日均在线超过 3,000 人，其中移动端日均在线超过 400 人；视频会议总共召开约 2,000 场，总共线上会议时长约 6,300 小时；在线总计处理各类流程业务单 140 万余次。公司智能审核系统于报告期累计完成 2,600 余篇文档审核、90 余万项数据检查，节省人工近 60% 的复核时间，同时将传统的线下审核场景线上化，每个项目减少近 1,000 张打印文档。

## (五) 在报告期内为减少其碳排放所采取的措施及效果

作为金融服务企业，公司碳排放的主要来源为日常运营过程中耗电、天然气以及公务用车耗油产生的碳排放。报告期内，公司大力推行节能减排措施，以实际行动践行环保理念。

在办公过程中，公司倡导合理用电，夏天空调温度不低于 26℃，冬天不高于 20℃；办公设备未使用时设置休眠，避免灯光及办公设备的无效运作；定期保养自有车辆，以保障车辆性能，提高汽油利用率，逐步更新购买新能源汽车，减少废气排放；合理利用视频会议系统，减少差旅出行频次，降低因差旅产生的温室气体排放；合理摆放办公区域绿色植被，根据不同植物属性实现净化空气、吸收有害气体、减少电子产品产生的电磁辐射等效果；制作“以俭修身 低碳生活从我做起”主题海报，并摆放于员工办公区域，将可持续发展理念根植于员工心中。

与此同时，公司积极响应《关于加强绿色数据中心建设的指导意见》，加快绿色数据中心建设。数据中心充分利用云计算、虚拟化技术的优势，将规模化和智能化有序结合，建设的混合金融云平台具有智能按需配置、动态管控资源的特点，可以最大化利用硬件平台的各类资源，进一步降低设备能耗。

截至报告期末，混合金融云平台桌面云使用了 82 台计算资源主机节点，运行桌面虚拟机 5,000 个，半年实现节约约 56.1 万度；测试云和生产云平台共使用宿主机约 600 台，运行虚拟机 5,500 余台，半年节约用电约 247.5 万度。

此外，公司张江数据中心采用水冷系统供冷，并配置制冷量大小不等的 1 台螺杆式冷水机组及 2 台离心式冷水机组，在不同 IT 负载情况下，可选择最优方式开启对应的冷水机组节能运行。系统配置了 2 台换热量为 5,800KW 的板式热交换器，冬季低温环境下，可充分利用自然冷源节能运行。同时，系统中冷却塔、冷却水泵、冷冻水泵均配置了变频器，可根据 IT 负载，通过水冷群控系统，实时调整运行频率，节能用电约 24.1 万度。

## 二、巩固拓展脱贫攻坚成果、乡村振兴等工作具体情况

2022 年上半年，在中国证监会、上海市委、市政府的正确领导下，海通证券克服疫情困难，持续开展“一司一县”“百企帮百村”结对帮扶工作，助力安徽利辛、安徽舒城、江西宁都、云南西畴、新疆叶城等五个脱贫县巩固脱贫攻坚成果，积极开展援藏援疆工作，扎实做好上海市农村综合帮扶和城乡党组织结对帮扶工作。公司结合“3.5 学雷锋”日，开展“喜迎二十大 海通志愿行”系列活动，努力解决帮扶地区群众实际问题，助力区域经济提升，推动结对乡村地区实现高质量发展。

## （一）多措并举，深入开展结对帮扶支援工作

### 1. 项目导向，持续做好帮扶支援工作

公司以项目建设为导向，依托分支机构，持续加强与安徽利辛、安徽舒城、江西宁都、云南西畴、新疆叶城等结对县的沟通交流，继续投入帮扶资金助力结对帮扶县产业项目建设。云南分公司党总支与西畴县鸡街乡、董马乡党组织达成党建联建签约意向，并支持两县建设党建活动阵地。江西分公司党总支组织志愿者赴宁都县面向县属国有企业、乡镇单位开展金融培训。子公司海通期货党委开展“共期美好”乡村振兴项目，与黑龙江省大庆市林甸县人民政府签订乡村振兴框架协议，投入专项帮扶资金助力黑龙江省佳木斯市汤原县太平川乡文化广场建设及路灯安装，并积极谋划推动当地农林种养、乡村旅游、光伏项目、农村小水电建设等乡村振兴项目。

### 2. 金融赋能，为帮扶县注入发展动力

2022年，公司作为主承销商成功发行2022年第一期宁都县城市发展投资有限公司公司债券，发行规模4亿元，募集资金主要用于宁都县现代农业的重点项目——高标准大棚蔬菜产业基地建设，助力宁都县三农产业结构升级。

### 3. 消费助力，将帮扶工作融入企业文化建设

2022年以来，公司通过上海市消费帮扶渠道采购云南省特色滇红茶作为公司礼品，传递“爱在海通”公益品牌理念，累计投入106.74万元。子公司海通期货充分发挥工会优势，自2019年起，每年采购结对帮扶地区黑龙江桦川县星火大米。2022年1月，海通期货采购该地特色农产品星火大米13.25万元，助力当地农户增收。

### 4. 播撒爱心，认真落实“爱在海通”公益清单

2022年3月，公司启动“喜迎二十大 海通志愿行”系列公益项目，充分利用组织覆盖“点多面广”的特点，组织公司系统全体党工团组织认真落实“爱在海通”公益清单项目。依托海通证券国家级投资者教育基地平台优势，公司各级党团组织走进帮扶地区开展投教活动，帮助结对帮扶地区干部群众提升金融素养、增强防范金融风险意识。持续推进“海通·爱朗读”第三季推普助力乡村振兴公益项目，该项目于2021年10月启动，受疫情影响，500套“海通·爱朗读”爱心盲盒和1,100个普通话魔法盒终于在2022年5月陆续运抵海拔近4,000米的西藏日喀则市，全部赠送给日喀则市上海实验学校小学部的学生；近3万册爱心图书及红色音频课堂在2022年6月陆续运抵新疆喀什地区叶城县、麦盖提县、西藏日喀则市的幼儿园和中小学，累计覆盖约22,000名学生。此外，公司持续在新疆莎车县和麦盖提县开展“爱在海通·美丽新疆”助学助教项目。公司连续第四年在西藏日喀则市开展“爱在海通·美丽西藏”项目，累计结对70名藏族大学生，支持他们完成大学四年本科学业。公司各级党团组织主动关心学生，定期回访，帮助他们更好融入大学生活。首批资助的30名学生已于今年6月大学毕业。

## （二）携手共进，积极参与农村综合帮扶、城乡党组织结对帮扶工作

### 1. 聚焦重点产业，助力崇明区新一轮发展振兴

公司立足专业优势，有效配置工作力量和帮扶资金，扎实开展综合帮扶和城乡党组织结对帮扶工作。自2013年以来，公司每年向崇明区投入500万元帮扶资金，2022年上半年完成拨付专项资金500

万元。10年来累计投入帮扶资金5,000万元,支持崇明区推进实施长兴海洋科技港一期、二期等重点“造血”项目建设。

## 2. 入户慰问, 志愿送暖, 传递结对帮扶真情真意

公司党委始终关心关注结对地区人民生活、帮助困难群众解决难题。2022年2月,公司党委领导带队赴崇明开展走访慰问活动,为结对帮扶的富安村困难家庭送去慰问金和慰问品,并向长期合作的阳光中心社工代表、结对青少年送上慰问礼包和关心祝福。公司党委下属8家党团组织也定期前往结对村镇党组织开展入户慰问。疫情期间,公司还将“一个海通 青春战疫”系列线上活动与帮扶工作有机结合,邀请金山区、崇明区的100名困难青少年参加线上心理健康讲座、“彩虹课堂”财商课等,帮助孩子们舒缓压力、应对疫情、增长知识。

## (三) 全力抗疫, 彰显金融国企社会责任与担当

2022年上半年,新一轮新冠疫情先后在全国多地高位流行,公司各级党组织和全体党员干部职工,积极投身疫情防控,累计捐赠抗疫资金及物资1,352.8万元。面对严峻的疫情防控形势,海通证券党委第一时间向各级党组织和党员干部员工发出抗疫倡议,并组建了2,000余人的抗疫志愿服务队。在公司党团组织的号召下,全体员工积极投身抗疫志愿服务,截至2022年6月底,累计参与抗疫志愿服务近7,500人次。

下一步,海通证券将继续深入贯彻党中央关于巩固脱贫成果和乡村振兴的指示精神,认真履行金融国企职责使命,为助力乡村振兴战略贡献更大力量。同时,以“爱在海通”党建公益品牌为引领,重点关注结对帮扶地区和边疆民族地区,持续在教育帮扶领域发力,为促进民族团结、维护边疆地区稳定发展贡献力量。

## 第六节 重要事项



## 一、承诺事项履行情况

### (一) 公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及公司等承诺相关方在报告期内或持续到报告期内的承诺事项

承诺背景	承诺类型	承诺方	承诺内容	承诺时间及期限	是否有履行期限	是否及时严格履行	如未能及时履行应说明未完成履行的具体原因	如未能及时履行应说明下一步计划
	股份限售	上海国盛（集团）有限公司	再融资认购的股份自发行结束之日起 48 个月内不得转让	自 2020 年 8 月 5 日起 48 个月	是	是	-	-
	股份限售	上海海烟投资管理有限公司	再融资认购的股份自发行结束之日起 18 个月内不得转让	自 2020 年 8 月 5 日起 18 个月	是	是	-	-
	股份限售	光明食品（集团）有限公司	再融资认购的股份自发行结束之日起 18 个月内不得转让	自 2020 年 8 月 5 日起 18 个月	是	是	-	-
	股份限售	上海电气控股集团有限公司	再融资认购的股份自发行结束之日起 18 个月内不得转让	自 2020 年 8 月 5 日起 18 个月	是	是	-	-
与再融资相关的承诺	其他	董事、高级管理人员	1. 承诺不无偿或以不公平条件向其它单位或者个人输送利益，也不采用其他方式损害公司利益；2. 承诺对职务消费行为进行约束；3. 承诺不动用公司资产从事与其履行职责无关的投资、消费活动；4. 承诺由董事会或提名与薪酬考核委员会制定的薪酬制度与公司填补回报措施的执行情况相挂钩；5. 若公司后续推出公司重要交易和事项政策，承诺拟公布的公司股权激励的行权条件与公司填补回报措施的执行情况相挂钩	作为公司董事、高级管理人员期间	是	是	-	-

## 二、报告期内控股股东及其他关联方非经营性占用资金情况

适用 不适用

## 三、违规担保情况

适用 不适用

## 四、半年报审计情况

适用 不适用

## 五、上年年度报告非标准审计意见涉及事项的变化及处理情况

适用 不适用

## 六、破产重整相关事项

适用 不适用

## 七、重大诉讼、仲裁事项

本报告期公司有重大诉讼、仲裁事项 本报告期公司无重大诉讼、仲裁事项

报告期内，公司不存在《上交所上市规则》中要求披露的涉案金额超过 1,000 万元并且占公司最近一期经审计净资产绝对值 10% 以上的重大诉讼、仲裁事项。

自报告期初至本报告披露日，本集团尚未披露的新增（金额超过人民币 1 亿元）或已披露且有新进展的诉讼、仲裁事项如下：

### 公司与泰元担保合同纠纷案

因案外人侯建芳未依约回购其质押股票，保证人河南泰元投资担保有限公司（简称泰元担保）应承担保证责任，公司向上海金融法院起诉，要求泰元担保承担本金人民币 10,691.08 万元以及相应的利息、违约金、债权实现费用等保证责任，2021 年 11 月 29 日，上海金融法院正式受理本案，并于 2022 年 2 月 23 日开庭。2022 年 6 月 30 日，上海金融法院作出一审判决，支持公司诉讼请求。

### 公司与南一农公司、红太阳集团、南京世界村质押式证券回购纠纷案

因南京第一农药集团有限公司（简称南一农公司）拒绝依约履行股票质押购回义务，公司向上海金融法院起诉，要求融资人南一农公司支付本金人民币 30,000 万元以及相应的利息、违约金、债权实现费用等，要求担保人红太阳集团有限公司（简称红太阳集团）、南京世界村汽车动力有限公司（简称南京世界村）承担保证责任。2020 年 5 月 19 日，上海金融法院正式受理本案，并于 2020 年 11 月 12 日开庭，2021 年 4 月上海金融法院作出一审判决，支持公司诉讼请求。2021 年 6 月南一农公司已被南京高淳区法院裁定破产重整，公司已向南一农破产重整项目管理人申报债权，并参加了第一次债权人会议。2022 年 6 月 1 日，南京高淳区法院出具《民事裁定书》，裁定对南一农公司、江苏国星投资有限公司、南京苏皖现代农业有限公司、江苏苏农农资连锁集团股份有限公司进行实质合并重整。

### 公司与红太阳集团、南一农公司、杨寿海、杨柳、南京振邦、江苏振邦融资融券交易纠纷案

因红太阳集团融资融券期限到期后未能按照《融资融券合同》约定按时归还融资本金、证券及利息等相关费用，构成违约。公司向上海金融法院起诉，要求融资人红太阳集团支付融资负债本金人民币 25,771.18 万元以及相应的利息、违约金、债权实现费用等，并要求南一农公司、杨寿海、杨柳、南京振邦投资发展有限公司（简称南京振邦）、江苏振邦农作物科技有限公司（简称江苏振邦）承担

相应担保责任。2021年1月13日，上海金融法院正式受理本案，并于2022年1月25日开庭审理。2022年1月30日，上海金融法院作出一审判决，支持公司诉讼请求。

#### 四川信托与海通资管、公司等金融委托理财合同纠纷案

因金融委托理财合同纠纷，四川信托有限公司（简称四川信托）向四川省成都市中级人民法院起诉，要求海通资管公司、公司等13个被告返还或赔偿原告委托财产51,455万元及相应利息。2021年9月13日，四川省成都市中级人民法院正式受理本案，目前尚未开庭。

#### 邮储银行与富诚海富通等证券虚假陈述责任纠纷案

因“华泰美吉特灯都资产支持专项计划”发生实质性违约，专项计划持有人之一中国邮政储蓄银行股份有限公司（简称邮储银行）向上海金融法院起诉，要求原始权益人昆山美吉特灯都管理有限公司及包括上海富诚海富通资产管理有限公司（简称富诚海富通）在内的相关中介机构对其全部损失承担连带赔偿责任，其诉讼请求为本金人民币52,657.98万元以及相应的利息等。2020年11月12日，法院正式受理本案并进行了多次开庭，目前法院尚未作出一审判决。

#### 海通开元、西安航天新能源及上海文化与ChinaEdu Corporation及北京弘成股权转让协议争议案

因ChinaEdu Corporation及北京弘成立业科技股份有限公司（简称北京弘成）拒绝依约履行股权回购义务，海通开元、西安航天新能源产业基金投资有限公司（简称西安航天新能源）及上海文化产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）（简称上海文化）共同向中国国际贸易仲裁委员会提交仲裁申请，要求ChinaEdu Corporation及北京弘成履行回购义务并支付股权回购价款，涉及本金金额合计2.5亿元。2022年6月20日，中国国际经济贸易仲裁委员会正式受理本案，目前尚未开庭。

上述案件中涉及的潜在损失已根据相关规定进行了充分计提。

#### 海通资管与南一农公司质押式证券回购纠纷案

因南一农公司质押其持有的红太阳（证券代码：000525）股票并向海通资管管理的资管计划融入资金，质押交易违约，海通资管向上海金融法院起诉，要求债务人支付本金人民币32,000万元以及相应的利息、违约金、债权实现费用等。2020年1月2日，法院正式受理该案件，2020年8月7日一审开庭，2020年12月31日，法院作出一审判决，支持海通资管诉讼请求。南一农公司后上诉至上海市高级人民法院，上海市高级人民法院已于2021年6月23日维持原判。南京市高淳区人民法院已于2021年6月3日受理南一农公司破产重整申请，法院已指定管理人。海通资管已代表资管计划向管理人申报债权。2022年6月1日，南京高淳区法院出具《民事裁定书》，裁定对南一农公司、江苏国星投资有限公司、南京苏皖现代农业有限公司、江苏苏农农资连锁集团股份有限公司进行实质合并重整。该案件涉及的潜在损失已在交易之前予以充分考虑，未来对本公司及海通资管的潜在损失风险较小。

除上述案件外，集团内（除境外上市子公司）尚处于执行阶段的案件共3起，涉及案件金额63,082.25万元。公司境外上市子公司的重大诉讼、仲裁事宜由其按照相关上市规则自行履行信息披露义务。



## 八、上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人涉嫌违法违规、受到处罚及整改情况

1. 截至报告期末，本公司无控股股东且无实际控制人。

2. 报告期内，公司及公司董事、监事、高级管理人员、第一大股东不存在被有权机关调查、被司法机关或纪检监察机关采取强制措施、被移送司法机关或追究刑事责任、被中国证监会立案调查或行政处罚、被采取市场禁入、被认定为不适当人选、被其他行政管理部门给予重大行政处罚以及被证券交易所公开谴责等情形。公司董事、监事、高级管理人员不存在违反相关规定买卖公司股票的情形。

3. 报告期内，公司存在以下被中国证监会或其派出机构采取行政监管措施、被交易所采取纪律处分的情况：

2022年1月，全国股转公司出具《关于给予海通证券股份有限公司及相关责任主体纪律处分的决定》（〔2022〕1号），给予公司通报批评的纪律处分。该监管函件认定公司未按规定建立健全并有效执行持续督导工作制度。公司收到该监管函件后，高度重视，中小企业融资部优化了持续督导流程，加固持续督导业务防线，在原有的复核制度基础上，设立独立的督导复核专岗，提高督导和信息披露质量。

2022年6月，中国证监会出具《关于对海通证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（〔2022〕25号）、《关于对任澎、王建业采取监管谈话措施的决定》（〔2022〕26号），对公司采取责令改正措施，对高级管理人员采取监管谈话措施。该监管函认定公司在境外子公司规范整改过程中，存在境外子公司未按规定履行备案程序、境外经营机构股权架构梳理及整改方案制定存在重大错漏等情况。公司收到该监管函后，高度重视，第一时间召开专题会议，统一思想、提高认识，对监管措施所提出的问题逐条研究与整改，严格遵循监管要求，优化完善子公司管理专项制度，建立健全子公司长效管控机制，加强对子公司的督导与综合管理，强化子公司管理的责任约束与责任追究。

## 九、报告期内公司及其控股股东、实际控制人诚信状况的说明

截至报告期末，本公司无控股股东且无实际控制人。报告期内，公司及第一大股东不存在未履行法院生效判决、不存在所负数额较大的债务到期未清偿等情况。

## 十、重大关联交易

### (一) 与日常经营相关的关联交易

#### 1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

#### 2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

#### 3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

#### 4、日常关联 / 连交易

公司建立了基本完整的关联 / 连交易制度体系，构建了较为科学完善的关联 / 连交易组织管理框架，相关内部控制总体有效。公司按照《公司法》《证券法》《上海证券交易所上市公司自律监管指引第 5 号——交易与关联交易》《香港上市规则》《上交所上市规则》等相关法律和监管规则，依据《公司章程》《关联交易管理办法》《关联（连）交易管理实施细则（试行）》等内部规章，严格履行关联 / 连交易审议流程及信息披露要求，对各项业务的关联 / 连交易形成了恰当的约束机制。

报告期内，公司严格按照 2021 年度股东大会审议通过的《关于预计公司 2022 年度日常关联 / 连交易的议案》，开展日常关联 / 连交易。

本章节所载关联 / 连交易的披露系依据《上交所上市规则》与香港上市规则确定，与财务报表附注中的关联交易数额（依据企业会计准则编制）可能存在差异。

相关执行情况如下：

##### ● 香港上市规则项下的持续性关连交易

截至报告期末，上海国盛集团及其全资子公司上海国盛集团资产管理有限公司合计持有公司 10.38% 的股份。根据《上交所上市规则》第 10.1.3 条第（四）款，上海国盛集团及其全资子公司上海国盛集团资产管理有限公司为公司关联人；根据香港上市规则第 14A.07 条上海国盛集团及其联系人为公司关连人。

公司于 2020 年 8 月 6 日与上海国盛集团签署《证券和金融产品交易及服务框架协议》（以下简称框架协议）。框架协议明确关连交易及相关服务的范围、定价基准、管控流程等内容，并对 2020 至 2022 年持续关连交易的年度上限进行预计。

上述框架协议经公司第七届董事会第十次会议（临时会议）审议通过。关联董事屠旋旋先生已根据有关法律法规及公司内部规定回避表决，公司独立董事已针对框架协议的签署发表事前认可意见和独立意见。相关董事会审议结果及框架协议签署公告均按照上海证券交易所及香港联合交易所的相关要求进行披露。

报告期内集团与上海国盛集团及其联系人之间涉及证券和金融产品交易及证券和金融服务相关的持续关联交易执行情况如下：

单位：万元

交易内容	2022 年度预计交易上限	2022 年 1-6 月实际发生金额
证券及金融产品交易		
流入 <sup>(1)</sup>	290,000.00	6,154.66
流出 <sup>(2)</sup>	540,000.00	2,788.94
证券及金融服务		
本集团向国盛集团及其联系人提供证券和金融服务收取的收入总额	7,000.00	100.89
本集团接受国盛集团及其联系人提供证券和金融服务产生的支出总额	2,000.00	

(1) “流入”是指本集团从证券和金融产品交易产生的现金流入总额，包括固定收益产品和权益类产品销售、固定收益产品相关的衍生产品所得利息及通过融资交易的借入 / 购回所产生的现金流入总额。

(2) “流出”是指本集团从证券和金融产品交易产生的现金流出总额，包括固定收益产品及权益类产品购买、固定收益产品相关的衍生产品所付利息及通过融资交易的借出 / 买入返售所产生的现金流出总额。

### ● 上交所上市规则项下的日常关联交易

#### (1) 与上海国盛（集团）有限公司及上海国盛集团资产有限公司的关联交易

单位：万元

交易内容	2022 年 1-6 月发生金额	占同类交易金额的比例 (%)	备注
手续费及佣金收入	8.63	0.00%	向关联人收取的证券交易手续费及佣金收入
利息净收入	53.53	0.02%	关联人保证金产生的利息净收入
衍生金融工具交易净损益（注）	240.20	0.24%	报告期内名义本金发生金额 0.571 亿元，期末名义本金余额 0.571 亿元。

注：关联人作为交易对手方与公司进行衍生品交易产生的已实现及未实现投资收益。

单位：万元

往来项目	2022 年 6 月 30 日余额	占同类交易金额的比例 (%)	备注
应收款项	40.50	0.00%	应向关联人收取的债券承销服务费余额
代理买卖证券款	0.01	0.00%	关联人存放公司的客户保证金余额
应付款项	5,851.11	0.54%	公司应付关联人衍生金融工具保证金余额
衍生金融负债	155.40	0.07%	与关联人进行衍生品交易产生的衍生金融资产余额

(2) 与本公司董事、监事、高级管理人员担任董事、高级管理人员的除本公司及其控股子公司以外的企业等其它关联法人的关联交易

单位：万元

交易内容	2022 年 1-6 月发生金额	占同类交易金额的比例 (%)	备注
手续费及佣金净收入	15,478.07	2.52%	向关联人收取的资产管理业务收入、销售服务费收入、投资咨询服务费收入等
手续费及佣金净收入	44.04	0.01%	向关联人收取的证券交易手续费及佣金收入
利息净收入	24.16	0.01%	关联人保证金产生的利息净收入
业务及管理费	0.10	0.00%	向关联人支付的基金销售服务费支出
衍生金融工具交易净损益（注）	6,941.79	6.97%	报告期内，名义本金发生额 65.60 亿元，期末名义本金余额 100 亿元

注：关联人作为交易对手方与公司进行衍生品交易产生的已实现及未实现投资收益。

单位：万元

往来项目	2022年6月30日余额	占同类交易金额的比例(%)	备注
应收款项	5,462.64	0.64%	应收关联人各项业务报酬余额
应付款项	0.05	0.00%	应付关联人各项业务服务费余额
代理买卖证券款	11,965.90	0.09%	关联人存放公司的客户保证金余额
衍生金融资产	5,999.87	2.63%	与关联人进行衍生品交易产生的衍生金融资产余额
衍生金融负债	284.17	0.22%	与关联人进行衍生品交易产生的衍生金融负债余额

另外，部分证券公司关联法人作为合格交易对手方与公司开展现券买卖交易，报告期内累计成交金额 35.44 亿元。

## (二) 资产收购或股权收购、出售发生的关联交易

### 1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

### 2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

### 3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

### 4、涉及业绩约定的，应当披露报告期内的业绩实现情况

适用 不适用

## (三) 共同对外投资的重大关联交易

### 1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

### 2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

### 3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

## (四) 关联债权债务往来

### 1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

### 2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

### 3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

### (五) 公司与存在关联关系的财务公司、公司控股财务公司与关联方之间的金融业务

适用 不适用

### (六) 其他重大关联交易

适用 不适用

### (七) 其他

适用 不适用

## 十一、重大合同及其履行情况

### (一) 托管、承包、租赁事项

适用 不适用

### (二) 报告期内履行的及尚未履行完毕的重大担保情况

单位：元 币种：人民币

公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）	
报告期内担保发生额合计（不包括对子公司的担保）	
报告期末担保余额合计（A）（不包括对子公司的担保）	
公司对子公司的担保情况	
报告期内对子公司担保发生额合计	3,976,430,455
报告期末对子公司担保余额合计（B）	20,080,054,730
公司担保总额情况（包括对子公司的担保）	
担保总额（A+B）	20,080,054,730
担保总额占公司净资产的比例（%）	11.31
其中：	
为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（C）	
直接或间接为资产负债率超过70%的被担保对象提供的债务担保金额（D）	16,910,271,781
担保总额超过净资产50%部分的金额（E）	
上述三项担保金额合计（C+D+E）	16,910,271,781
未到期担保可能承担连带清偿责任说明	

担保情况说明

1. 2021年3月30日,公司召开第七届董事会第十五次会议,审议通过了《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》,同意公司为在境外的全资子公司海通银行 Haitong Bank,S.A. 或其附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保,担保金额不超过 7.5 亿欧元债券本金(含 7.5 亿欧元或等值其他币种)、利息、借款人应当承担的其他费用等,担保期限不超过 9 年(含 9 年)。  
公司于 2022 年 2 月 8 日签署《担保函》,为公司境外全资附属公司海通银行发行金额为 2.3 亿欧元、于 2025 年到期的欧元债券提供连带责任保证担保。  
公司于 2022 年 5 月 31 日签署《担保协议》,为境外全资附属公司海通银行发行金额为 1.5 亿美元、于 2027 年到期的债券提供连带责任保证担保,担保期限 66 个月。

2. 2020 年 8 月 28 日,公司召开第七届董事会第十一次会议,审议通过了《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》。同意公司为在境外的全资附属公司海通银行或其附属公司境外债务融资(包括但不限于发行境外债券、中长期商业借款及其他符合监管要求的融资方式)提供连带责任保证担保,担保金额不超过 3.75 亿欧元债务融资本金(含 3.75 亿欧元或等值其他币种)、利息、借款人应当承担的其他费用等,担保期限不超过 6 年(含 6 年)。  
公司于 2021 年 5 月 17 日作为担保人签署《贷款协议》,为境外全资附属公司海通银行 3.75 亿欧元(含 3.75 亿欧元或等值其他货币)银团贷款提供连带责任保证担保。

3. 公司全资子公司海通开元将所持有的海通恒信 2,440,846,824 股内资股划转给公司全资子公司海通创新证券。海通开元将注册资本从人民币 106.50 亿元减至人民币 75 亿元,减资人民币 31.50 亿元。公司为海通开元减资过程中未清偿债务 105,502.08 万元提供一般保证担保。此担保事项经过公司于 2021 年 1 月 29 日召开的第七届董事会第十四次会议(临时会议)审议通过。  
截止 2022 年 6 月 30 日,公司的该项担保责任余额为 16,978.29 万元。

4. 2019 年 4 月 25 日,公司召开第六届董事会第三十七次会议,审议通过了《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》,同意公司为在境外的全资子公司海通国际控股及其全资附属公司境外债务融资(包括但不限于发行境外债券、中长期商业借款及其他符合监管要求的融资方式)提供连带责任保证担保,担保金额不超过 6.7 亿美元债务融资本金(含 6.7 亿美元或等值其他币种)、利息、借款人应当承担的其他费用等,担保期限不超过 10 年(含 10 年)。  
公司于 2020 年 3 月 12 日签署《担保协议》,为公司境外全资附属公司 Haitong International Finance Holdings 2015 Limited 发行金额为 6.7 亿美元、于 2025 年到期、票面利率为 2.107% 的美元债券,提供连带责任保证担保。

5. 2017 年 8 月 29 日,公司召开第六届董事会第二十五次会议,审议通过了《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》。公司于 2018 年 5 月 14 日作为担保人签署了《贷款协议》,为境外全资附属公司海通国际控股的银团贷款提供 6 亿美元连带责任保证担保。

6. 公司第五届董事会第十二次会议审议通过了《关于对上海海通证券资产管理有限公司提供净资产担保承诺的议案》,董事会同意本公司随时对海通资管公司提供不超过十五亿元的净资产担保承诺,以保证其净资产保持充足。2013 年 6 月 9 日,上海证监局下发《关于海通证券股份有限公司向上海海通证券资产管理有限公司出具净资产担保承诺书的无异议函》(沪证监机构字[2013]145 号),同意本公司向海通资管公司提供 8 亿元的担保承诺。本公司扣减了 8 亿元净资产,并相应增加海通资管公司 8 亿元净资产。  
2016 年 8 月 29 日,公司第六届董事会第十八次会议审议通过了《关于公司为海通资管追加净资产担保承诺及对其增加注册资本的议案》,同意公司对海通资管公司追加不超过人民币 40 亿元的净资产担保承诺。公司为海通资管公司提供最高额度为人民币 40 亿元的净资产担保承诺,并承诺当海通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。净资产担保承诺期限自公司董事会审议通过之日起生效。就本次净资产担保事宜,海通资管公司已获得中国证监会上海监管局出具的《关于对海通证券股份有限公司向上海海通证券资产管理有限公司出具净资产担保承诺书的无异议函》(沪证监机构字[2016]325 号)。  
2021 年 12 月,公司对海通资管公司减少提供净资产担保承诺金额 18 亿元。就本次净资产担保减少事宜,海通资管公司已收到中国证监会上海监管局《关于对海通证券股份有限公司向上海海通证券资产管理有限公司减少提供部分净资产担保承诺事项的无异议函》(沪证监机构字[2021]532 号)。截止 2022 年 6 月 30 日,公司对海通资管公司提供净资产担保承诺金额为人民币 30 亿元。

注:报告期内子公司海通银行对外担保发生额合计(不包括对子公司的担保)为 12,019,438 欧元,按 2022 年 6 月 30 日银行间外汇市场人民币汇率中间价 1 欧元对人民币 7.0084 元换算,合计为 84,237,031 元人民币。报告期末对外担保余额合计(不包括对子公司的担保)为 131,401,101 欧元,按 2022 年 6 月 30 日银行间外汇市场人民币汇率中间价 1 欧元对人民币 7.0084 元换算,合计为 920,911,475 元人民币。

报告期内子公司海通国际对内担保无新增。按 2022 年 6 月 30 日中国外汇交易中心公布的人民币汇率中间价公告 1 港元对人民币 0.85519 元、1 美元对人民币 6.7114 元、1 新加坡元对人民币 4.817 元换算,报告期末海通国际对内担保余额合计 8,428,110,960 元人民币。

### (三) 其他重大合同

适用 不适用

## 十二、其他重大事项的说明

### 划转对海富产业的股权至海通开元

2022年6月23日，公司第七届董事会第二十八次会议（临时会议）审议通过了《关于公司划转海富产业投资基金管理有限公司股份的议案》，同意公司将所持有的海富产业67%的股份划转至海通开元。上述工商变更工作已于2022年6月28日完成。

## 第七节 股份变动及股东情况





## 一、股本变动情况

### (一) 股份变动情况表

#### 1、股份变动情况表

报告期内，公司股份总数及股本结构未发生变化。公司的股份总数为 13,064,200,000 股，其中，A 股为 9,654,631,180 股，H 股为 3,409,568,820 股。

#### 2、股份变动情况说明

适用 不适用

报告期内，公司无股份变动情况。

#### 3、报告期后到半年报披露日期间发生股份变动对每股收益、每股净资产等财务指标的影响（如有）

适用 不适用

#### 4、公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容

适用 不适用

### (二) 限售股份变动情况

单位：股

股东名称	期初限售股数	报告期解除限售股数	报告期增加限售股数	报告期末限售股数	限售原因	解除限售日期
上海国盛（集团）有限公司	781,250,000	0	0	781,250,000	非公开发行股份限售	2024年8月5日
上海海烟投资管理有限公司	234,375,000	234,375,000	0	0	非公开发行股份限售	2022年2月7日
上海电气控股集团有限公司	78,203,125	78,203,125	0	0	非公开发行股份限售	2022年2月7日
光明食品（集团）有限公司	78,125,000	78,125,000	0	0	非公开发行股份限售	2022年2月7日
合计	1,171,953,125	390,703,125	0	781,250,000	/	/

## 二、股东情况

### (一) 股东总数：

截至报告期末普通股股东总数（户）

288,907

（其中 A 股 288,758；H 股 149）

## (二) 截至报告期末前十名股东、前十名流通股东（或无限售条件股东）持股情况表

单位：股

前十名股东持股情况							
股东名称（全称）	报告期内增减	期末持股数量	比例（%）	持有有限售条件股份数量	质押、标记或冻结情况		股东性质
					股份状态	数量	
香港中央结算（代理人）有限公司	-42,800	3,408,741,495	26.09	0	未知	-	境外法人
上海国盛（集团）有限公司	0	862,489,059	6.60	781,250,000	无	0	国有法人
上海海烟投资管理有限公司	0	635,084,623	4.86	0	无	0	国有法人
光明食品（集团）有限公司	8,124,400	480,275,000	3.68	0	无	0	国有法人
上海电气控股集团股份有限公司	38,924,400	340,192,818	2.60	0	无	0	国家
申能（集团）有限公司	6,373,000	322,162,086	2.47	0	无	0	国有法人
中国证券金融股份有限公司	0	258,104,024	1.98	0	无	0	其他
上海国盛集团资产有限公司	0	238,382,008	1.82	0	无	0	国有法人
上海久事（集团）有限公司	0	235,247,280	1.80	0	无	0	国有法人
上海百联集团股份有限公司	0	214,471,652	1.64	0	无	0	国有法人

  

前十名无限售条件股东持股情况			
股东名称	持有无限售条件流通股的数量	股份种类及数量	
		种类	数量
香港中央结算（代理人）有限公司	3,408,741,495	境外上市外资股	3,408,741,495
上海海烟投资管理有限公司	635,084,623	人民币普通股	635,084,623
光明食品（集团）有限公司	480,275,000	人民币普通股	480,275,000
上海电气控股集团股份有限公司	340,192,818	人民币普通股	340,192,818
申能（集团）有限公司	322,162,086	人民币普通股	322,162,086
中国证券金融股份有限公司	258,104,024	人民币普通股	258,104,024
上海国盛集团资产有限公司	238,382,008	人民币普通股	238,382,008
上海久事（集团）有限公司	235,247,280	人民币普通股	235,247,280
上海百联集团股份有限公司	214,471,652	人民币普通股	214,471,652
中国建设银行股份有限公司 - 国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	199,500,348	人民币普通股	199,500,348
前十名股东中回购专户情况说明	-		
上述股东委托表决权、受托表决权、放弃表决权的说明	-		
上述股东关联关系或一致行动的说明		上海国盛集团资产有限公司为上海国盛（集团）有限公司的全资子公司，此外，未知其他股东之间是否存在关联关系，也未知是否属于《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人。	
表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明	-		

注：

1. 人民币普通股（A股）股东性质为股东在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记的账户性质。
2. 上表中，境外上市外资股为H股。本公司H股股东中，非登记股东的股份由香港中央结算（代理人）有限公司代为持有。
3. 上海国盛集团及其全资子公司上海国盛集团资产有限公司持有本公司A股和H股共计135,632.75万股，占公司总股本的10.38%；上海电气控股集团股份有限公司持有本公司A股和H股共计60,334.64万股，占公司总股本的4.62%。
4. 因公司股票为融资融券标的证券，股东持股数量按照其通过普通证券账户、信用证券账户持有的股票及权益数量合并计算。

## 前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

单位：股

序号	有限售条件股东名称	持有的有限售条件股份数量	有限售条件股份可上市交易情况		限售条件
			可上市交易时间	新增可上市交易股份数量	
1	上海国盛（集团）有限公司	781,250,000	2024年8月5日	-	限售期48个月
上述股东关联关系或一致行动的说明		无			

2020年8月5日，公司向上海国盛集团等13家特定对象非公开发行人民币普通股（A股）1,562,500,000股完成后，公司的股份总数由11,501,700,000股增加至13,064,200,000股，其中，H股仍为3,409,568,820股，A股从8,092,131,180股增加到9,654,631,180股。增发完成后，公司无限售条件流通股为11,501,700,000股，有限售条件流通股为1,562,500,000股（均为本次公开发行的A股股票）。公司非公开发行的部分限售股已分别于2021年2月5日、2022年2月7日限售期届满并解禁，具体内容详见2021年1月30日、2022年1月22日公司于上交所网站披露的《非公开发行限售股上市流通公告》（公告编号分别为：临2021-004、临2022-001）。截至报告期末，公司股份总数中无限售条件的流通股为12,282,950,000，有限售条件的流通股为781,250,000股。

### （三）主要股东及其他人士于股份及相关股份拥有的权益及淡仓

于2022年6月30日，据本公司董事合理查询所知，以下人士（并非本公司董事、监事或最高行政人员）于股份及相关股份中，拥有根据《证券及期货条例》第XV部第2及第3分部须向本公司披露并根据《证券及期货条例》第336条已记录于本公司须存置的登记册内的权益或淡仓：

序号	主要股东名称	股份类别	权益性质	持有的股份数目（股）	占本公司已发行股份总数的比例（%）	占本公司已发行A股/H股总数的比例（%）	好仓（注3）/淡仓（注4）/可供借出的股份
1	Maunakai Capital Partners (Hong Kong) Limited	H股	投资经理	272,590,000	2.09	7.99	好仓
2	BSA Strategic Fund I	H股	实益拥有人	272,590,000	2.09	7.99	好仓
3	史静	H股	酌情信托的成立人	228,000,000	1.75	6.69	好仓
4	Wickhams Cay Trust Company Limited	H股	受托人（注1）	228,000,000	1.75	6.69	好仓
5	Abhaya Limited	H股	受控制的法团的权益（注1）	228,000,000	1.75	6.69	好仓
6	Heyday Trend Limited	H股	实益拥有人（注1）	228,000,000	1.75	6.69	好仓
7	上海国盛（集团）有限公司（注5）	H股	实益拥有人	241,206,000	1.85	7.07	好仓
		A股	实益拥有人	1,100,871,067	8.43	11.40	
8	上海电气控股集团有限公司	H股	实益拥有人及受控制的法团的权益（注2）	239,300,400	1.83	7.02	好仓
9	中国烟草总公司	A股	实益拥有人	635,084,623	4.86	6.58	好仓

注1：Heyday Trend Limited持有本公司228,000,000股H股。Abhaya Limited透过其全资拥有的Heyday Trend Limited持有本公司228,000,000股H股。Abhaya Limited由Wickhams Cay Trust Company Limited全资拥有，史玉柱为Abhaya Limited的董事，而Abhaya Limited的董事惯于按照史玉柱的指令行事，故Wickhams Cay Trust Company Limited及史玉柱均被视为于Abhaya Limited持有的228,000,000股H股中拥有权益。

注2：上海电气集团香港有限公司持有本公司4,746,800股H股。上海电气集团香港有限公司由上海电气控股集团有限公司全资拥有，故上海电气控股集团有限公司被视为于上海电气集团香港有限公司持有的4,746,800股H股中拥有权益。

注3：如股东对股份本身持有权益，包括透过持有、沽出或发行金融文书（包括衍生工具）而持有权益，并因而具有如下的权利与责任，该股东便属于持有「好仓」：(i) 其有权购入相关股份；(ii) 其有责任购入相关股份；(iii) 如相关股份价格上升，其有权收取款项；或(iv) 如相关股份价格上升，其有权避免或减低损失。

注 4：如股东根据证券借贷协议借入股份，或如股东因持有、沽出或发行金融文书（包括衍生工具）而具有以下的权利与责任，该股东便属于持有「淡仓」：(i) 其有权要求另一人购入相关股份；(ii) 其有责任交付相关股份；(iii) 如相关股份价格下降，其有权收取款项；或 (iv) 如相关股份价格下降，其有权避免或减低损失。

注 5：为免疑议，因上述权益披露的范围不限于有关股东实际持有的股份，本表格中显示的有关股东持有权益的股份数目及比例与中期报告其他部分所披露的有关股东实质持有的股份数目和比例可能存在差异。

除上述披露外，于 2022 年 6 月 30 日，本公司并不知悉任何其他人士（本公司董事、监事及最高行政人员除外）于本公司股份或相关股份中拥有根据《证券及期货条例》第 336 条规定须记录于登记册内之权益或淡仓。

#### 董事、监事及最高行政人员于本公司及相联法团的股份、相关股份或债券之权益及淡仓

于 2022 年 6 月 30 日，就本公司所获得的资料及据董事所知，概无本公司董事、监事或最高行政人员在本公司或其相关法团（定义见《证券及期货条例》第 XV 部）的股份、相关股份或债权证中拥有根据《证券及期货条例》第 XV 部第 7 及 8 分部须通知本公司及香港联交所的权益及淡仓（包括根据《证券及期货条例》的该等条文被当作或视为拥有的权益或淡仓），或根据《证券及期货条例》第 352 条规定须在存置之权益登记册中记录，或根据《标准守则》的规定需要通知本公司和香港联交所之权益或淡仓。

### （四）战略投资者或一般法人因配售新股成为前 10 名股东

适用 不适用

## 三、董事、监事和高级管理人员情况

### （一）现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员持股变动情况

适用 不适用

### （二）董事、监事、高级管理人员报告期内被授予的股权激励情况

适用 不适用

### （三）其他说明

适用 不适用

## 四、控股股东或实际控制人变更情况

适用 不适用

公司无控股股东且无实际控制人，公司第一大股东上海国盛集团及其全资子公司上海国盛集团资产管理有限公司持有本公司股份比例为 10.38%，公司第一大股东情况如下：

名称	上海国盛（集团）有限公司
单位负责人或法定代表人	寿伟光
成立日期	2007 年 9 月 26 日
主要经营业务	开展以非金融为主，金融为辅的投资，资本运作与资产管理，产业研究，社会经济咨询。【依法经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

## 五、购回、出售或赎回上市证券

报告期内，本公司及其附属公司未有购回、出售或赎回本公司的任何上市证券（惟代表本公司或附属公司的客户以代理人身份进行买卖者除外）。

## 第八节 债券相关情况



## 一、企业债券、公司债券和非金融企业债务融资工具

### (一) 企业债券

适用 不适用

### (二) 公司债券

#### 1. 公司债券基本情况

以下为公司在半年度报告批准报出日存续的公司债券基本情况。

单位：亿元 币种：人民币

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券余额	利率 (%)	还本付息方式	交易场所	投资者适当性安排 (如有)	交易机制	是否存在终止上市交易的风险
2013年公司债券(第一期)	13海通03	122282	2013/11/25	2013/11/25	2023/11/25	23.9	6.18	单利按年计息	上交所	社会公众投资者、机构投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2013年公司债券(第二期)	13海通06	122313	2014/07/14	2014/07/14	2024/07/14	8	5.85	单利按年计息	上交所	社会公众投资者、机构投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向合格投资者公开发行2017年公司债券(第二期)	17海通03	143301	2017/9/20	2017/9/22	2027/9/22	55	4.99	单利按年计息	上交所	合格投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向合格投资者公开发行2019年公司债券(第二期)	19海通02	155830	2019/11/14	2019/11/15	2022/11/15	45	3.52	单利按年计息	上交所	合格投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向合格投资者公开发行2020年公司债券(第一期)	20海通01	163148	2020/2/26	2020/2/27	2023/2/27	50	3.01	单利按年计息	上交所	合格投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向合格投资者公开发行2020年公司债券(第二期)	20海通02	163290	2020/3/18	2020/3/19	2023/3/19	35	2.99	单利按年计息	上交所	合格投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向专业投资者公开发行2020年公司债券(第一期)(品种一)	20海通04	163507	2020/4/29	2020/4/30	2023/4/30	56	2.38	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向专业投资者公开发行2020年公司债券(第一期)(品种二)	20海通05	163508	2020/4/29	2020/4/30	2025/4/30	7	2.88	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向专业投资者公开发行2020年公司债券(第二期)	20海通06	163568	2020/5/22	2020/5/25	2023/5/25	67	2.7	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向专业投资者公开发行2020年公司债券(第三期)	20海通08	163903	2020/8/10	2020/8/11	2023/8/11	60	3.53	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券 余额	利率 (%)	还本付 息方式	交易 场所	投资者 适当性安排 (如有)	交易机制	是否 存在终 止上市 交易的 风险
2020年非公开发行人公司债券(第一期)(品种二)	20海通F2	167897	2020/10/20	2020/10/21	2022/10/21	50	3.82	单利按年计息	上交所	合格机构投资者	报价、询价、协议交易	否
面向专业投资者公开发行2021年公司债券(第一期)	21海通01	175630	2021/1/12	2021/1/13	2024/1/13	60	3.58	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向专业投资者公开发行2021年公司债券(第二期)	21海通02	175741	2021/2/5	2021/2/8	2024/2/8	54	3.79	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向专业投资者公开发行2021年公司债券(第三期)	21海通03	175975	2021/4/22	2021/4/23	2024/4/23	50	3.45	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向专业投资者公开发行2021年公司债券(第四期)	21海通04	188150	2021/5/26	2021/5/27	2024/5/27	28	3.35	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向专业投资者公开发行2021年公司债券(第五期)	21海通05	188202	2021/6/9	2021/6/10	2024/6/10	21	3.4	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向专业投资者公开发行2021年公司债券(第六期)(品种二)	21海通06	188458	2021/7/28	2021/7/29	2024/7/29	20	3.14	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向专业投资者公开发行2021年公司债券(第七期)	21海通07	188571	2021/8/19	2021/8/20	2024/8/20	30	3.04	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向专业投资者公开发行2021年公司债券(第八期)(品种一)	21海通08	188663	2021/8/27	2021/8/30	2024/8/30	20	3.1	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向专业投资者公开发行2021年公司债券(第八期)(品种二)	21海通09	188664	2021/8/27	2021/8/30	2026/8/30	20	3.43	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向专业投资者公开发行2021年公司债券(第九期)	21海通10	188962	2021/11/9	2021/11/10	2024/11/10	50	3.1	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
面向专业投资者公开发行2021年公司债券(第十期)	21海通11	185010	2021/11/19	2021/11/22	2024/11/22	50	3.09	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2022年面向专业投资者公开发行次级债券(第一期)	22海通C1	185219	2022/1/11	2022/1/12	2025/1/12	50	3.18	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2022年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)	22海通01	185285	2022/1/19	2022/1/20	2024/12/25	50	2.84	单利按年计息,到期一次还本付息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否



债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券余额	利率 (%)	还本付息方式	交易场所	投资者适当性安排 (如有)	交易机制	是否存在终止上市交易的风险
2022年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)	22海通02	185359	2022/2/17	2022/2/21	2025/2/21	29	2.9	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2022年面向专业投资者公开发行次级债券(第二期)	22海通C2	185400	2022/2/24	2022/2/25	2025/2/25	20	3.15	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2022年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)	22海通03	185448	2022/3/4	2022/3/7	2025/3/7	5	3.03	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2022年面向专业投资者公开发行次级债券(第三期)	22海通C3	185472	2022/3/8	2022/3/9	2025/3/9	24.8	3.29	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2022年面向专业投资者非公开发行短期公司债券(第一期)	22海通D1	194598	2022/6/7	2022/6/9	2023/6/9	45	2.5	到期一次还本付息	上交所	专业投资者	报价、询价和协议交易	否
2022年面向专业投资者公开发行公司债券(第四期)	22海通04	137555	2022/7/25	2022/7/26	2025/7/26	50	2.75	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否

公司对债券终止上市交易风险的应对措施

适用 不适用

公司所有债券不存在终止上市交易的风险。

逾期未偿还债券

适用 不适用

公司不存在逾期未偿还债券。

关于逾期债项的说明

适用 不适用

## 2. 发行人或投资者选择权条款、投资者保护条款的触发和执行情况

适用 不适用

## 3. 信用评级结果调整情况

适用 不适用

其他说明

无。

#### 4. 担保情况、偿债计划及其他偿债保障措施在报告期内的执行和变化情况及影响

现状	执行情况	是否发生变更	变更后情况	变更原因	变更是否已取得有权机构批准	变更对债券投资者权益的影响
存续的公司债券均为无担保债券	正常	否	-	-	-	-
严格按照债券募集说明书中有关偿债计划的约定履行兑付兑息职责	正常	否	-	-	-	-
偿债保障措施包括制定《债券持有人会议规则》、设立专门的偿付工作小组、充分发挥受托管理人的作用、严格履行信息披露义务等	正常	否	-	-	-	-

##### 其他说明

公司于 2022 年 6 月 21 日召开的 2021 年度股东大会审议通过了《关于公司发行境内外债务融资工具一般性授权的议案》，约定偿债保障措施——“在出现预计不能按期偿付境内外债务融资工具本息或者到期未能按期偿付境内外债务融资工具本息时，至少采取如下措施：①不向股东分配利润；②暂缓重大对外投资、收购兼并等资本性支出项目的实施；③调减或停发公司董事和高级管理人员的工资和奖金；④主要责任人员不得调离。”

#### 5. 公司债券其他情况的说明

(1) 为公司债券发行及存续期业务提供服务的中介机构

中介机构名称	办公地址	签字会计师姓名	联系人	联系电话
普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 50 楼	许康玮 刘伟	许康玮	021-23238888
德勤华永会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市延安东路 222 号外滩中心 21 楼	胡小骏 宫明亮	胡小骏	021-61412068
上海市锦天城律师事务所	上海市浦东新区银城中路 501 号上海中心大厦 11、12 层	-	肖文艳	021-20511000
中诚信国际信用评级有限责任公司	北京市东城区南竹杆胡同 2 号 1 幢 60101	-	乔爽	010-66428877
中信证券股份有限公司	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 22 层	-	聂磊、 宋頔岚	010-60833046
中信建投证券股份有限公司	北京市东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B、E 座 2 层	-	房蓓蓓、 吕宏图	010-65608396
申万宏源证券有限公司	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层	-	张胜寒	021-33389437
兴业证券股份有限公司	上海市浦东新区长柳路 36 号丁香国际商业中心东塔 6 楼	-	张振华、 杭雨	021-38565436
国信证券股份有限公司	北京市西城区金融大街兴盛街 6 号国信证券大厦四层	-	郭睿、 柯方钰	010-88005384
民生证券股份有限公司	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1168 号 B 座 2101、2104A 室	-	李跃林	021-80508899

## (2) 公司债券报告期内募集资金使用情况

单位：亿元 币种：人民币

债券名称	募集资金总金额	已使用金额	未使用金额	募集资金专项 账户运作情况 (如有)	募集资金违规 使用的整改情况 (如有)	是否与募集说明 书承诺的用途、 使用计划及其他 约定一致
2022年面向专业投资者公开发行次级债券（第一期）	50	50	0	无	无	是
2022年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）	50	50	0	无	无	是
2022年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）	29	29	0	无	无	是
2022年面向专业投资者公开发行次级债券（第二期）	20	20	0	无	无	是
2022年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）	5	5	0	无	无	是
2022年面向专业投资者公开发行次级债券（第三期）	24.8	24.8	0	无	无	是
2022年面向专业投资者非公开发行短期公司债券（第一期）	45	45	0	无	无	是
2022年面向专业投资者公开发行公司债券（第四期）	50	50	0	无	无	是

## (三) 其他债券

单位：亿元 币种：见明细表

债券名称	简称	代码	债券余额	利率（%）	发行日期	兑付日期	还本付息方式	交易场所
金融债（境外）	海通证券 4.5% B2023	5482	3 亿美元	4.50	2018/12/13	2023/12/13	单利按半年计息	香港联交所
金融债（境外）	海通证券 FRN B2023	5483	2.3 亿欧元	3M EURIBOR +1.65	2018/12/13	2023/12/13	单利按季计息	香港联交所
2019年第一期金融债券	19 海通证券 金融债 01	091900022	70 亿人民币	3.39	2019/08/29	2022/08/29	单利按年计息	银行间市场

## (四) 银行间债券市场非金融企业债务融资工具

适用 不适用

## (五) 公司报告期内合并报表范围亏损超过上年末净资产 10%

适用 不适用

## (六) 主要会计数据和财务指标

单位：亿元 币种：人民币

主要指标	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末 增减 (%)	变动原因
流动比率	2.15	1.99	8.04	
速动比率	2.15	1.99	8.04	
资产负债率 (%)	71.37	71.41	-0.06	
	本报告期 (1-6 月)	上年同期	本报告期比上年同期 增减 (%)	变动原因
扣除非经常性损益后净利润	42.35	78.97	-46.38	利润总额减少
EBITDA 全部债务比	0.03	0.05	-40.00	利润总额减少
利息保障倍数	1.97	3.06	-35.64	利润总额减少
现金利息保障倍数	4.44	7.92	-43.94	经营活动产生的现金流量净额减少
EBITDA 利息保障倍数	2.09	3.17	-34.07	利润总额减少
贷款偿还率 (%)	100	100	-	
利息偿付率 (%)	100	100	-	

注：扣除非经常性损益的净利润即归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润。

## 二、可转换公司债券情况

适用 不适用

## 第九节 财务报告



## 审阅报告

普华永道中天阅字 (2022) 第 0052 号

海通证券股份有限公司全体股东:

我们审阅了后附的海通证券股份有限公司 (以下简称“海通证券”) 的中期财务报表, 包括 2022 年 6 月 30 日的合并及公司资产负债表, 截至 2022 年 6 月 30 日止六个月期间的中期合并及公司利润表、合并及公司股东权益变动表和合并及公司现金流量表以及中期财务报表附注。按照《企业会计准则第 32 号—中期财务报告》的规定编制中期财务报表是海通证券管理层的责任, 我们的责任是在实施审阅工作的基础上对中期财务报表出具审阅报告。

我们按照《中国注册会计师审阅准则第 2101 号—财务报表审阅》的规定执行了审阅业务。该准则要求我们计划和实施审阅工作, 以对中期财务报表是否不存在重大错报获取有限保证。审阅主要限于询问公司有关人员和财务数据实施分析程序, 提供的保证程度低于审计。我们没有实施审计, 因而不发表审计意见。

根据我们的审阅, 我们没有注意到任何事项使我们相信上述中期财务报表没有在所有重大方面按照《企业会计准则第 32 号—中期财务报告》的规定编制。

普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)

注册会计师

许康玮

注册会计师

刘伟

中国·上海市

2022 年 8 月 26 日

## 合并及公司资产负债表

2022年6月30日

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

资产	附注四	合并		附注十四	母公司	
		2022年6月30日 (未经审计)	2021年12月31日 (经审计)		2022年6月30日 (未经审计)	2021年12月31日 (经审计)
<b>资产：</b>						
货币资金	1	186,275,510,234.59	161,482,162,662.33		112,543,102,444.14	93,457,408,323.97
其中：客户存款		114,094,553,019.29	106,920,250,703.11		69,043,583,962.99	61,628,757,721.35
结算备付金	2	15,106,526,527.81	16,765,417,520.72		22,412,205,588.93	23,908,471,077.41
其中：客户备付金		10,445,971,199.47	10,985,677,744.32		8,730,633,619.22	10,067,376,703.10
拆出资金		80,225,399.34	352,928,216.40		-	-
融出资金	3	69,668,200,894.61	75,223,404,481.86		60,327,098,666.65	67,692,375,195.87
衍生金融资产	4	2,277,485,754.74	1,084,731,024.74		1,517,182,188.65	354,429,554.46
存出保证金	5	20,042,711,989.12	17,655,168,606.23		4,904,890,009.14	3,949,884,809.25
应收款项	6	8,496,612,249.86	11,372,016,262.32		1,857,439,953.37	1,948,966,490.21
买入返售金融资产	7	42,099,456,966.02	39,761,016,348.21		32,487,623,238.09	29,337,912,589.23
<b>金融投资：</b>						
交易性金融资产	8	201,866,236,662.53	220,409,748,990.56		130,536,451,210.79	147,034,775,156.00
债权投资	9	5,291,159,984.88	4,725,209,073.62		-	-
其他债权投资	10	42,055,227,212.50	37,052,945,367.77		40,510,087,199.40	35,177,490,466.24
其他权益工具投资	11	6,612,455,737.01	10,246,870,931.21		5,833,774,220.05	10,183,589,167.34
应收融资租赁款	12	25,340,889,731.77	33,472,586,720.22		-	-
长期应收款	12	68,201,416,679.15	55,088,023,010.62		-	-
长期股权投资	13	6,328,009,199.15	6,454,419,884.32	1	39,071,433,089.37	38,855,455,864.40
投资性房地产	14	2,310,228,778.07	57,595,407.36		13,618,557.79	14,155,816.27
固定资产	15	14,266,074,479.75	14,272,799,842.14		7,523,047,286.32	7,683,889,574.18
在建工程	16	421,020,613.96	359,526,093.80		307,300,240.99	230,936,700.53
无形资产	17	1,188,216,750.97	1,248,785,126.57		282,946,282.60	324,719,627.89
使用权资产	18	989,647,651.88	1,031,842,359.31		454,766,513.61	502,623,677.48
商誉	19	3,519,765,142.16	3,365,312,536.77		-	-
递延所得税资产	20	4,435,588,155.05	5,171,925,443.84		1,552,407,034.91	2,307,574,317.95
其他资产	21	22,693,194,322.88	28,270,713,496.70		5,707,462,711.57	3,683,966,742.96
<b>资产总计</b>		<b>749,565,861,117.80</b>	<b>744,925,149,407.62</b>		<b>467,842,836,436.37</b>	<b>466,648,625,151.64</b>

## 合并及公司资产负债表 (续)

2022年6月30日

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

负债和股东权益	附注四	合并		附注十四	母公司	
		2022年6月30日 (未经审计)	2021年12月31日 (经审计)		2022年6月30日 (未经审计)	2021年12月31日 (经审计)
<b>负债：</b>						
短期借款	25	32,599,662,300.62	29,575,032,689.68		-	-
应付短期融资款	26	22,660,030,329.95	24,986,688,130.95		12,106,188,347.78	13,316,578,061.57
拆入资金	27	10,655,383,836.51	15,664,657,697.33		7,757,131,673.33	10,015,658,888.89
交易性金融负债	28	18,411,387,578.43	16,316,217,529.07		11,948,114,554.85	6,116,583,145.85
衍生金融负债	4	1,275,151,987.94	1,548,316,320.52		793,478,989.43	619,041,884.25
卖出回购金融资产款	29	81,567,484,109.38	91,911,952,065.34		76,840,114,012.82	89,332,830,556.70
代理买卖证券款	30	129,589,377,718.71	123,202,200,376.21		78,624,734,955.55	72,910,211,706.45
代理承销证券款		-	1,601,399,997.46		-	2,061,399,997.46
应付职工薪酬	31	6,819,398,150.06	7,498,186,828.37		4,502,578,275.23	4,606,187,299.51
应交税费	32	1,748,496,834.82	4,200,007,273.89		244,313,343.41	1,504,640,375.31
应付款项	33	10,757,399,124.25	11,872,937,682.85		4,725,519,484.37	4,969,686,683.11
合同负债		25,968,623.86	156,745,966.33		-	-
预计负债	34	185,791,383.63	203,799,720.94		-	-
长期借款	35	54,429,268,328.65	49,579,028,216.06		2,812,666,694.45	2,094,237,277.76
应付债券	36	173,470,980,662.80	163,586,069,656.61		118,016,645,241.67	113,233,660,700.54
租赁负债	18	1,012,952,733.20	1,047,179,113.49		449,832,079.26	493,775,560.60
递延所得税负债	20	965,254,305.51	1,320,650,854.60		-	-
其他负债	37	25,909,297,930.42	22,899,293,194.20		4,537,020,264.97	864,903,182.79
<b>负债合计</b>		<b>572,083,285,938.74</b>	<b>567,170,363,313.90</b>		<b>323,358,337,917.12</b>	<b>322,139,395,320.79</b>
<b>股东权益：</b>						
股本	38	13,064,200,000.00	13,064,200,000.00		13,064,200,000.00	13,064,200,000.00
资本公积	39	74,906,579,079.23	74,913,916,184.14		74,708,985,006.20	74,772,635,006.20
其他综合收益	40	(1,248,412,818.28)	(657,678,320.59)		151,932,340.12	411,799,777.79
盈余公积	41	8,693,605,698.21	8,693,605,698.21		8,693,605,698.21	8,693,605,698.21
一般风险准备	42	19,679,063,150.59	19,619,604,400.72		17,387,211,396.42	17,387,211,396.42
未分配利润	43	47,985,706,026.37	47,504,315,755.70		30,478,564,078.30	30,179,777,952.23
<b>归属于母公司股东权益合计</b>		<b>163,080,741,136.12</b>	<b>163,137,963,718.18</b>		<b>144,484,498,519.25</b>	<b>144,509,229,830.85</b>
少数股东权益		14,401,834,042.94	14,616,822,375.54		-	-
<b>股东权益合计</b>		<b>177,482,575,179.06</b>	<b>177,754,786,093.72</b>		<b>144,484,498,519.25</b>	<b>144,509,229,830.85</b>
<b>负债和股东权益总计</b>		<b>749,565,861,117.80</b>	<b>744,925,149,407.62</b>		<b>467,842,836,436.37</b>	<b>466,648,625,151.64</b>

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

第 74 页至第 178 页的财务报表由下列负责人签署：

周杰  
法定代表人

张信军  
主管会计工作负责人

马中  
会计机构负责人



## 合并及公司利润表

2022年1-6月

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	合并			母公司		
	附注四	本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)	附注十四	本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)
<b>一、营业总收入</b>		12,104,350,296.48	23,471,241,587.14		7,964,467,555.84	9,544,364,476.53
手续费及佣金净收入	44	6,140,680,386.57	7,165,176,960.88	2	4,335,306,867.71	3,990,032,781.63
其中：经纪业务手续费净收入		2,474,007,654.92	2,624,722,675.27		2,064,117,835.34	2,033,632,830.76
投资银行业务手续费净收入		2,434,751,965.24	2,524,747,356.00		2,143,973,926.93	1,834,945,545.00
资产管理业务手续费净收入		1,086,471,873.13	1,832,908,069.19		-	-
利息净收入	45	3,088,087,983.84	3,361,957,910.21	3	1,265,789,633.60	1,517,745,007.44
其中：金融资产利息收入		8,258,455,027.52	7,499,427,313.78		4,808,806,134.02	4,603,997,287.48
融资租赁收入		1,280,942,435.03	1,771,580,592.67		-	-
利息支出		(6,451,309,478.71)	(5,909,049,996.24)		(3,543,016,500.42)	(3,086,252,280.04)
投资收益	46	(362,282,684.28)	6,089,788,843.43	4	(778,809,826.56)	3,082,048,927.81
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		303,592,418.25	624,744,561.18		311,694,737.85	337,663,452.50
其他收益	47	721,755,618.98	561,491,888.57		463,248,025.00	280,614,259.08
公允价值变动收益	48	1,358,310,150.74	1,324,130,957.42	5	2,724,051,391.96	573,817,040.48
汇兑(损失)/收益		(297,909,682.71)	80,349,420.96		(49,466,656.40)	96,016,824.45
其他业务收入	49	1,494,134,804.58	4,918,695,749.61		4,345,764.28	3,965,219.13
资产处置(损失)/收益		(38,426,281.24)	(30,350,143.94)		2,356.25	124,416.51
<b>二、营业总支出</b>		6,259,598,598.71	11,837,101,306.29		2,441,371,321.80	3,420,123,424.65
税金及附加	50	156,694,507.48	151,625,754.50		90,606,983.26	103,182,239.73
业务及管理费	51	5,256,123,649.22	6,439,255,745.70	6	3,028,928,171.11	3,391,463,157.17
信用减值损失	52	178,662,978.58	1,024,765,121.75		(678,701,091.05)	(75,034,174.19)
其他资产减值损失		25,910,800.78	44,083,145.76		-	-
其他业务成本	53	642,206,662.65	4,177,371,538.58		537,258.48	512,201.94
<b>三、营业利润</b>		5,844,751,697.77	11,634,140,280.85		5,523,096,234.04	6,124,241,051.88
加：营业外收入	54	54,133,555.55	52,052,247.22		24,538,322.36	18,347,644.78
减：营业外支出	55	12,820,668.68	25,242,800.43		10,645,498.61	13,973,437.22
<b>四、利润总额</b>		5,886,064,584.64	11,660,949,727.64		5,536,989,057.79	6,128,615,259.44
减：所得税费用	56	1,420,703,701.27	2,772,210,076.66		1,027,303,243.47	1,440,643,943.84
<b>五、净利润</b>		4,465,360,883.37	8,888,739,650.98		4,509,685,814.32	4,687,971,315.60
(一)按经营持续性分类：						
1.持续经营净利润		4,465,360,883.37	8,888,707,373.39		4,509,685,814.32	4,687,971,315.60
2.终止经营净利润		-	32,277.59		-	-
(二)按所有权归属分类：						
1.归属于母公司股东的净利润		4,757,725,335.07	8,170,194,923.98		4,509,685,814.32	4,687,971,315.60
2.少数股东损益		(292,364,451.70)	718,544,727.00		-	-

## 合并及公司利润表 (续)

2022年1-6月

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	合并			母公司		
	附注四	本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)	附注十四	本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)
<b>六、其他综合收益的税后净额</b>		58,198,289.07	(346,786,150.51)		(551,507,125.92)	(230,598,394.45)
归属于母公司股东的其他综合收益的税后净额		(882,374,185.94)	(194,968,500.08)		(551,507,125.92)	(230,598,394.45)
(一) 不能重分类进损益的其他综合收益		(673,928,088.48)	(305,876,106.79)		(601,179,617.70)	(349,852,379.58)
1. 重新计量设定受益计划变动额		55,465,679.89	48,007,409.46		-	-
2. 其他权益工具投资公允价值变动		(729,393,768.37)	(353,883,516.25)		(601,179,617.70)	(349,852,379.58)
(二) 将重分类进损益的其他综合收益		(208,446,097.46)	110,907,606.71		49,672,491.78	119,253,985.13
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		4,365,114.58	-		4,365,114.58	-
2. 其他债权投资公允价值变动		38,171,582.84	528,562,235.82		80,236,564.75	519,473,397.11
3. 其他债权投资信用损失准备		(42,617,744.92)	(389,952,653.09)		(34,929,187.55)	(400,219,411.98)
4. 现金流量套期储备		33,598,149.21	37,600,183.83		-	-
5. 外币财务报表折算差额		(241,963,199.17)	(65,302,159.85)		-	-
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		940,572,475.01	(151,817,650.43)		-	-
<b>七、综合收益总额</b>		4,523,559,172.44	8,541,953,500.47		3,958,178,688.40	4,457,372,921.15
归属于母公司股东的综合收益总额		3,875,351,149.13	7,975,226,423.90		3,958,178,688.40	4,457,372,921.15
归属于少数股东的综合收益总额		648,208,023.31	566,727,076.57		-	-
<b>八、每股收益：</b>						
(一) 基本每股收益(元/股)		0.36	0.63		-	-
(二) 稀释每股收益(元/股)		0.36	0.63		-	-

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

法定代表人：周杰

主管会计工作负责人：张信军

会计机构负责人：马中

## 合并及公司现金流量表

2022年1-6月

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	母公司					
	附注四	本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)	附注十四	本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>						
收取利息、手续费及佣金的现金		14,194,729,654.65	15,566,609,930.91		9,885,958,143.78	9,604,126,966.71
为交易目的而持有的金融资产净减少额		20,276,363,076.85	16,662,072,493.85		23,729,654,873.43	5,609,666,748.77
拆入资金净增加额		-	914,739,122.04		-	1,200,000,000.00
回购业务资金净增加额		-	13,357,236,927.06		-	12,045,853,345.07
融出资金净减少额		5,097,014,619.57	-		7,035,108,335.08	-
代理买卖证券收到的现金净额		6,389,401,344.80	7,345,445,679.30		5,715,547,533.75	1,267,970,977.77
收到其他与经营活动有关的现金	57	10,000,836,650.20	13,796,889,828.08		557,562,889.49	2,982,092,096.84
经营活动现金流入小计		55,958,345,346.07	67,642,993,981.24		46,923,831,775.53	32,709,710,135.16
拆入资金净减少额		4,737,045,008.10	-		2,256,000,000.00	-
回购业务资金净减少额		13,012,414,188.56	-		15,960,630,671.02	-
融出资金净增加额		-	7,420,032,403.14		-	7,695,851,425.92
支付利息、手续费及佣金的现金		3,688,423,492.11	3,474,293,295.23		2,206,639,464.35	1,927,835,750.86
支付给职工以及为职工支付的现金		4,234,418,963.66	3,898,351,122.77		2,257,680,894.11	2,063,926,123.76
支付的各项税费		4,559,539,517.43	4,893,599,565.66		2,002,117,359.79	3,122,795,924.46
支付其他与经营活动有关的现金	57	8,412,830,462.99	13,198,299,387.05		5,277,567,704.82	3,350,245,234.92
经营活动现金流出小计		38,644,671,632.85	32,884,575,773.85		29,960,636,094.09	18,160,654,459.92
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>	58	17,313,673,713.22	34,758,418,207.39	7	16,963,195,681.44	14,549,055,675.24
<b>二、投资活动(使用)/产生的现金流量：</b>						
收回投资收到的现金		16,535,604,240.11	11,613,541,819.35		13,396,855,302.10	11,013,331,453.69
取得投资收益收到的现金		1,035,876,360.93	1,453,753,255.02		491,627,814.75	1,918,933,243.61
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额		132,053,369.74	-		-	-
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		1,204,388.53	779,807.03		1,049,046.05	1,712,733.63
投资活动现金流入小计		17,704,738,359.31	13,068,074,881.40		13,889,532,162.90	12,933,977,430.93
投资支付的现金		18,297,444,190.19	12,390,843,764.22		15,065,333,416.15	9,495,517,601.13
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		1,852,868,402.00	793,664,812.49		256,658,247.71	484,082,272.07
投资活动现金流出小计		20,150,312,592.19	13,184,508,576.71		15,321,991,663.86	9,979,599,873.20
<b>投资活动(使用)/产生的现金流量净额</b>		(2,445,574,232.88)	(116,433,695.31)		(1,432,459,500.96)	2,954,377,557.73

## 合并及公司现金流量表 (续)

2022年1-6月

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	母公司					
	附注四	本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)	附注十四	本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)
<b>三、筹资活动产生/(使用)的现金流量:</b>						
吸收投资收到的现金		-	295,543,406.11		-	-
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金		-	295,543,406.11		-	-
取得借款收到的现金		43,467,338,922.84	45,748,721,187.61		-	-
发行债券收到的现金		56,850,896,997.57	65,566,997,309.19		31,874,507,000.00	39,949,643,300.00
筹资活动现金流入小计		100,318,235,920.41	111,611,261,902.91		31,874,507,000.00	39,949,643,300.00
偿还债务支付的现金		87,529,796,495.23	114,406,839,122.19		27,670,133,000.00	38,572,599,878.18
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		4,360,877,437.41	4,468,797,773.06		2,129,829,475.43	1,768,593,989.67
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		189,226,709.76	405,802,023.10		-	-
支付其他与筹资活动有关的现金	57	725,177,276.63	395,256,261.07		86,216,086.61	96,999,350.65
筹资活动现金流出小计		92,615,851,209.27	119,270,893,156.32		29,886,178,562.04	40,438,193,218.50
<b>筹资活动产生/(使用)的现金流量净额</b>		<b>7,702,384,711.14</b>	<b>(7,659,631,253.41)</b>		<b>1,988,328,437.96</b>	<b>(488,549,918.50)</b>
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		<b>769,430,121.90</b>	<b>(383,061,199.34)</b>		<b>61,764,044.15</b>	<b>(11,632,297.37)</b>
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>	58	<b>23,339,914,313.38</b>	<b>26,599,292,059.33</b>	7	<b>17,580,828,662.59</b>	<b>17,003,251,017.10</b>
加：期初现金及现金等价物余额		175,257,907,676.68	137,311,262,918.57		117,262,317,533.08	91,698,084,523.06
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>	58	<b>198,597,821,990.06</b>	<b>163,910,554,977.90</b>	7	<b>134,843,146,195.67</b>	<b>108,701,335,540.16</b>

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

法定代表人：周杰

主管会计工作负责人：张信军

会计机构负责人：马中

## 合并股东权益变动表

2022年1-6月

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	2022年1-6月						少数股东权益	股东权益合计
	归属于母公司股东权益			一般风险准备	未分配利润	其他综合收益		
	股本	资本公积	盈余公积					
一、2021年12月31日余额	13,064,200,000.00	74,913,916,184.14	(657,678,320.59)	8,693,605,698.21	19,619,604,400.72	47,504,315,755.70	14,616,822,375.54	177,754,786,093.72
二、本期增减变动金额	-	(7,337,104.91)	(590,734,497.69)	-	59,458,749.87	481,390,270.67	(214,988,332.60)	(272,210,914.66)
(一)综合收益总额	-	-	(882,374,185.94)	-	-	4,757,725,335.07	648,208,023.31	4,523,559,172.44
(二)股东投入和减少资本	-	(7,337,104.91)	-	-	-	(5,911,505.21)	(674,034,767.22)	(687,283,377.34)
1. 股东投入的普通股	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 其他权益工具持有者投入资本和减少资本	-	-	-	-	-	-	(231,685,829.48)	(231,685,829.48)
3. 股份支付计入股东权益的金额	-	(32,902,799.03)	-	-	-	-	(16,070,820.71)	(48,973,619.74)
4. 其他	-	25,565,694.12	-	-	-	(5,911,505.21)	(426,278,117.03)	(406,623,928.12)
(三)利润分配	-	-	-	-	59,458,749.87	(3,978,783,870.94)	(189,161,588.69)	(4,108,486,709.76)
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	59,458,749.87	(59,458,749.87)	-	-
3. 对股东的分配	-	-	-	-	-	(3,919,260,000.00)	(189,226,709.76)	(4,108,486,709.76)
4. 其他	-	-	-	-	-	(65,121.07)	65,121.07	-
(四)股东权益内部结转	-	-	291,639,688.25	-	-	(291,639,688.25)	-	-
1. 资本公积转增股本	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 盈余公积转增股本	-	-	-	-	-	-	-	-
3. 盈余公积弥补亏损	-	-	-	-	-	-	-	-
4. 设定受益计划变动额结转留存收益	-	-	-	-	-	-	-	-
5. 其他综合收益结转留存收益	-	-	291,639,688.25	-	-	(291,639,688.25)	-	-
6. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-
三、2022年6月30日余额	13,064,200,000.00	74,906,579,079.23	(1,248,412,818.28)	8,693,605,698.21	19,679,063,150.59	47,985,706,026.37	14,401,834,042.94	177,482,575,179.06

## 合并股东权益变动表 (续)

2021年1-6月

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	2021年1-6月						少数股东权益	股东权益合计
	股本	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润		
一、2020年12月31日余额	13,064,200,000.00	74,888,284,930.75	(650,570,845.59)	7,663,172,125.37	17,260,983,392.72	41,222,398,224.28	14,677,844,008.23	168,126,311,835.76
二、本期增减变动金额	-	22,302,676.93	(217,019,399.13)	-	94,732,413.05	4,830,141,935.44	436,829,921.02	5,166,987,547.31
(一) 综合收益总额	-	-	(194,968,500.08)	-	-	8,170,194,923.98	566,727,076.57	8,541,953,500.47
(二) 股东投入和减少资本	-	22,302,676.93	-	-	-	-	274,583,393.01	296,886,069.94
1. 股东投入的普通股	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 其他权益工具持有者投入资本和减少资本	-	-	-	-	-	-	271,330,188.69	271,330,188.69
3. 股份支付计入股东权益的金额	-	8,211,382.35	-	-	-	-	44,862,380.42	53,073,762.77
4. 其他	-	14,091,294.58	-	-	-	-	(41,609,176.10)	(27,517,881.52)
(三) 利润分配	-	-	-	-	94,732,413.05	(3,362,103,887.59)	(404,480,548.56)	(3,671,852,023.10)
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	94,732,413.05	(94,732,413.05)	-	-
3. 对股东的分配	-	-	-	-	-	(3,266,050,000.00)	(405,802,023.10)	(3,671,852,023.10)
4. 其他	-	-	-	-	-	(1,321,474.54)	1,321,474.54	-
(四) 股东权益内部结转	-	-	(22,050,899.05)	-	-	22,050,899.05	-	-
1. 资本公积转增股本	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 盈余公积转增股本	-	-	-	-	-	-	-	-
3. 盈余公积弥补亏损	-	-	-	-	-	-	-	-
4. 设定受益计划变动额结转留存收益	-	-	-	-	-	-	-	-
5. 其他综合收益结转留存收益	-	-	(22,050,899.05)	-	-	22,050,899.05	-	-
6. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-
三、2021年6月30日余额	13,064,200,000.00	74,910,587,607.68	(867,590,244.72)	7,663,172,125.37	17,355,715,805.77	46,052,540,159.72	15,114,673,929.25	173,293,299,383.07

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

法定代表人：周杰

主管会计工作负责人：张信军

会计机构负责人：马中

## 公司股东权益变动表

2022年1-6月

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	2022年1-6月						
	股本	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	股东权益合计
一、2021年12月31日余额	13,064,200,000.00	74,772,635,006.20	411,799,777.79	8,693,605,698.21	17,387,211,396.42	30,179,777,952.23	144,509,229,830.85
二、本期增减变动金额	-	(63,650,000.00)	(259,867,437.67)	-	-	298,786,126.07	(24,731,311.60)
(一) 综合收益总额	-	-	(551,507,125.92)	-	-	4,509,685,814.32	3,958,178,688.40
(二) 股东投入和减少资本	-	(63,650,000.00)	-	-	-	-	(63,650,000.00)
1. 股东投入的普通股	-	-	-	-	-	-	-
2. 其他权益工具持有者投入资本	-	-	-	-	-	-	-
3. 股份支付计入股东权益的金额	-	-	-	-	-	-	-
4. 其他	-	(63,650,000.00)	-	-	-	-	(63,650,000.00)
(三) 利润分配	-	-	-	-	-	(3,919,260,000.00)	(3,919,260,000.00)
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	-	-	-
3. 对股东的分配	-	-	-	-	-	(3,919,260,000.00)	(3,919,260,000.00)
4. 其他	-	-	-	-	-	-	-
(四) 股东权益内部结转	-	-	291,639,688.25	-	-	(291,639,688.25)	-
1. 资本公积转增股本	-	-	-	-	-	-	-
2. 盈余公积转增股本	-	-	-	-	-	-	-
3. 盈余公积弥补亏损	-	-	-	-	-	-	-
4. 设定受益计划变动额结转留存收益	-	-	-	-	-	-	-
5. 其他综合收益结转留存收益	-	-	291,639,688.25	-	-	(291,639,688.25)	-
6. 其他	-	-	-	-	-	-	-
三、2022年6月30日余额	13,064,200,000.00	74,708,985,006.20	151,932,340.12	8,693,605,698.21	17,387,211,396.42	30,478,564,078.30	144,484,498,519.25

## 公司股东权益变动表 (续)

2021年1-6月

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	2021年1-6月						
	股本	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	股东权益合计
一、2020年12月31日余额	13,064,200,000.00	74,772,635,006.20	499,137,706.73	7,663,172,125.37	15,326,344,250.74	26,119,698,623.49	137,445,187,712.53
二、本期增减变动金额	-	-	(252,649,293.50)	-	-	1,443,972,214.65	1,191,322,921.15
(一) 综合收益总额	-	-	(230,598,394.45)	-	-	4,687,971,315.60	4,457,372,921.15
(二) 股东投入和减少资本	-	-	-	-	-	-	-
1. 股东投入的普通股	-	-	-	-	-	-	-
2. 其他权益工具持有者投入资本	-	-	-	-	-	-	-
3. 股份支付计入股东权益的金额	-	-	-	-	-	-	-
4. 其他	-	-	-	-	-	-	-
(三) 利润分配	-	-	-	-	-	(3,266,050,000.00)	(3,266,050,000.00)
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	-	-	-
3. 对股东的分配	-	-	-	-	-	(3,266,050,000.00)	(3,266,050,000.00)
4. 其他	-	-	-	-	-	-	-
(四) 股东权益内部结转	-	-	(22,050,899.05)	-	-	22,050,899.05	-
1. 资本公积转增股本	-	-	-	-	-	-	-
2. 盈余公积转增股本	-	-	-	-	-	-	-
3. 盈余公积弥补亏损	-	-	-	-	-	-	-
4. 设定受益计划变动额结转留存收益	-	-	-	-	-	-	-
5. 其他综合收益结转留存收益	-	-	(22,050,899.05)	-	-	22,050,899.05	-
6. 其他	-	-	-	-	-	-	-
三、2021年6月30日余额	13,064,200,000.00	74,772,635,006.20	246,488,413.23	7,663,172,125.37	15,326,344,250.74	27,563,670,838.14	138,636,510,633.68

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

法定代表人：周杰

主管会计工作负责人：张信军

会计机构负责人：马中



## 一、公司基本情况

### 1、公司概况

海通证券股份有限公司(以下简称“本公司”或“海通证券”)前身为成立于1988年的上海海通证券公司,是国内最早成立的证券公司之一。1994年9月,改制为全国性的有限责任公司,更名为“海通证券有限公司”,资本金增至10亿元。2000年,增资至37.46亿元。2001年12月,改制为股份有限公司,增资至40.06亿元,并于次月更名为“海通证券股份有限公司”。2002年11月,资本金增至87.34亿元。

2007年6月7日,本公司与原都市股份(600837)吸收合并事宜获得中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)批准。吸收合并后存续公司股本变更为33.89亿元,并于2007年7月31日在上海证券交易所上市。2007年经非公开发行股票,增加股本7.25亿元,本公司股本变更为41.14亿元。根据海通证券2007年度利润分配及资本公积转增方案,每10股派送股票股利3股(含税)和以资本公积每10股转增7股,本公司股本变更为8,227,821,180.00元。

2012年4月27日,本公司在香港联交所主板发行1,229,400,000股境外上市外资股(H股);次月因部分行使超额配售权,本公司额外发行127,500,000股H股;另外,本公司国有股股东的国有股减持划转给全国社会保障基金理事会并转为境外上市外资股(H股)合计135,690,000股。经过本次H股发行以及国有股减持后,本公司股份变更为9,584,721,180股,其中,于上海证券交易所上市的A股8,092,131,180股、于香港联交所上市的H股1,492,590,000股。

2015年5月,本公司非公开发行境外上市外资股(H股),发行规模为1,916,978,820股。经过本次H股非公开发行后,本公司股份变更为11,501,700,000股,其中,于上海证券交易所上市的A股8,092,131,180股、于香港联交所上市的H股3,409,568,820股。

2020年8月5日,本公司向13家特定对象非公开发行普通股股票(A股),发行规模为1,562,500,000股。经过本次A股非公开发行后,本公司股份变更为13,064,200,000股,其中,于上海证券交易所上市的A股9,654,631,180股、于香港联交所上市的H股3,409,568,820股。

截至2022年6月30日,本公司股本总数为13,064,200,000股,其中无限售条件股份为12,282,950,000股,有限售条件股份为781,250,000股。

本公司注册地和总部地址:上海市广东路689号。

截至2022年6月30日,本公司经批准设立分公司29家,338家证券及期货营业部(其中证券营业部301家,期货营业部37家)。

本公司经营范围为:证券经纪;证券自营;证券承销与保荐;证券投资咨询;与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问;直接投资业务;证券投资基金代销;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;股票期权做市业务;中国证监会批准的其他业务,公司可以对外投资设立子公司从事金融产品等投资业务。(依法须经批准的项目,经相关部门批准后方可开展经营活动)

## 一、公司基本情况 (续)

### 2、合并财务报表范围

合并财务报表范围包括直接或间接控制的子公司和结构化主体。

子公司包括通过设立或投资等方式取得的海富通基金管理有限公司(以下简称“海富通基金”)、海通开元投资有限公司(以下简称“海通开元”)、海通创新证券投资有限公司(以下简称“海通创新”)、上海海通证券资产管理有限公司(以下简称“海通资管”)、海通国际控股有限公司(以下简称“海通国际控股”)、上海惟泰置业管理有限公司(以下简称“惟泰置业”)、上海泽春投资发展有限公司(以下简称“泽春投资”)和通过非同一控制下企业合并取得的海通期货股份有限公司(以下简称“海通期货”)等子公司以及该等子公司控制的公司。本公司、子公司以及合并范围内的结构化主体以下合称“本集团”。

本年合并财务报表范围及其变动情况、在相关被投资单位权益的信息详见附注“五、合并范围的变更”和“六、在其他主体中的权益”。

## 二、中期财务报表的编制基础

本中期财务报表按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制。

本中期财务报表根据财政部颁布的《企业会计准则第32号——中期财务报告》和中国证监会颁布的《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第3号——半年度报告的内容与格式》(2021年修订)的要求列示和披露有关财务信息。本中期财务报表应与本集团经审计的2021年度财务报表一并阅读。

本中期财务报表以持续经营为基础编制。

## 三、遵循企业会计准则的声明

本中期财务报表符合《企业会计准则第32号——中期财务报告》的要求,真实、完整地反映了本集团及本公司于2022年6月30日的合并及公司财务状况以及2022年1月1日至6月30日止期间的合并及公司经营成果和现金流量。

## 四、合并财务报表项目附注

### 1、货币资金

(1) 按类别列示

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
库存现金	348,829.39	312,951.79
银行存款	181,024,557,340.66	156,895,014,697.50
其中：客户存款	114,094,553,019.29	106,920,250,703.11
公司存款	66,930,004,321.37	49,974,763,994.39
其他货币资金	821,654,206.09	1,296,834,329.18
存放中央银行款项	4,443,654,949.94	3,304,209,438.17
其中：存放中央银行法定准备金	14,124,032.10	19,774,042.73
存放中央银行超额存款准备金	4,429,530,917.84	3,284,435,395.44
小计	186,290,215,326.08	161,496,371,416.64
减：减值准备	14,705,091.49	14,208,754.31
合计	186,275,510,234.59	161,482,162,662.33

(2) 原值按币种列示

项目	2022年6月30日			2021年12月31日		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
库存现金						
人民币			113,609.35			31,762.34
美元	3,523.20	6.7114	23,645.60	4,703.98	6.3757	29,991.17
港币	9,594.67	0.85519	8,205.27	40,098.47	0.81760	32,784.51
欧元	8,455.10	7.0084	59,256.72	8,641.61	7.2197	62,389.83
其他			144,112.45			156,023.94
小计			348,829.39			312,951.79
银行存款						
其中：客户资金						
人民币			95,505,520,534.51			89,589,189,935.52
美元	714,925,115.98	6.7114	4,798,148,423.39	627,257,457.70	6.3757	3,999,205,373.06
港币	6,404,879,245.85	0.85519	5,477,388,682.26	8,074,614,291.49	0.81760	6,601,804,644.72
欧元	10,807,176.67	7.0084	75,741,016.97	8,965,631.61	7.2197	64,729,170.53
其他			84,848,013.04			68,397,866.36
小计			105,941,646,670.17			100,323,326,990.19
客户信用资金						
人民币			8,152,906,349.12			6,596,923,712.92
小计			8,152,906,349.12			6,596,923,712.92
客户存款合计			114,094,553,019.29			106,920,250,703.11

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 1、货币资金 (续)

(2) 原值按币种列示 (续)

项目	2022年6月30日			2021年12月31日		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
公司自有资金						
人民币			56,877,219,425.89			42,935,451,571.43
美元	763,338,640.16	6.7114	5,123,070,949.57	451,618,666.16	6.3757	2,879,385,129.84
港币	5,242,740,230.19	0.85519	4,483,539,017.46	4,674,805,383.68	0.81760	3,822,120,881.70
欧元	13,101,844.52	7.0084	91,822,967.13	11,477,079.20	7.2197	82,861,068.70
其他			354,351,961.32			254,945,342.72
小计			66,930,004,321.37			49,974,763,994.39
公司存款合计			66,930,004,321.37			49,974,763,994.39
其他货币资金						
人民币			513,096,264.92			1,022,800,824.11
美元	45,975,197.60	6.7114	308,557,941.17	42,980,928.38	6.3757	274,033,505.07
小计			821,654,206.09			1,296,834,329.18
存放中央银行款项						
欧元	621,353,133.71	7.0084	4,354,691,302.29	457,539,697.95	7.2197	3,303,299,357.29
其他			88,963,647.65			910,080.88
小计			4,443,654,949.94			3,304,209,438.17
合计			186,290,215,326.08			161,496,371,416.64

(3) 2022年6月30日, 受限制的货币资金为2,463,285,731.66元(2021年12月31日: 人民币2,554,523,629.32元), 主要为风险准备专户存款、银票保证金存款、飞机维修基金等。

### 2、结算备付金

(1) 按类别列示

单位: 人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
客户备付金	10,445,971,199.47	10,985,677,744.32
公司备付金	4,660,555,328.34	5,779,739,776.40
合计	15,106,526,527.81	16,765,417,520.72

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 2、结算备付金 (续)

(2) 按币种列示

类别	2022年6月30日			2021年12月31日		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
客户普通备付金						
人民币			8,993,600,694.24			8,966,341,226.91
美元	29,698,008.33	6.7114	199,315,213.11	33,666,216.14	6.3757	214,645,694.24
港币	122,285,057.26	0.85519	104,576,958.12	86,903,369.41	0.81760	71,052,194.83
小计			9,297,492,865.47			9,252,039,115.98
客户信用备付金						
人民币			1,148,478,334.00			1,733,638,628.34
小计			1,148,478,334.00			1,733,638,628.34
客户备付金合计			10,445,971,199.47			10,985,677,744.32
公司自有备付金						
人民币			4,660,555,328.34			5,779,739,776.40
小计			4,660,555,328.34			5,779,739,776.40
公司备付金合计			4,660,555,328.34			5,779,739,776.40
合计			15,106,526,527.81			16,765,417,520.72

### 3、融出资金

(1) 按类别列示

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
境内		
其中：个人	50,686,014,771.31	57,072,273,136.20
机构	10,896,618,218.42	11,708,390,911.40
减：减值准备	1,255,534,323.08	1,088,288,851.73
小计	60,327,098,666.65	67,692,375,195.87
境外		
其中：个人	1,560,301,367.52	1,527,571,066.72
机构	8,545,126,194.69	6,628,854,127.94
减：减值准备	764,325,334.25	625,395,908.67
小计	9,341,102,227.96	7,531,029,285.99
合计	69,668,200,894.61	75,223,404,481.86

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 3、融出资金 (续)

#### (2) 减值准备调节表

单位：人民币元

	阶段 1	阶段 2	阶段 3	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
于 2021 年 12 月 31 日	55,086,808.45	11,810,954.32	1,646,786,997.63	1,713,684,760.40
本期计提	24,462,925.40	16,725,200.07	271,446,498.98	312,634,624.45
本期核销	-	-	(38,360,406.14)	(38,360,406.14)
阶段转移	(2,239,964.58)	(8,704,680.43)	10,944,645.01	-
外汇变动及其他	1,625,765.64	640,326.23	29,634,586.75	31,900,678.62
于 2022 年 6 月 30 日	78,935,534.91	20,471,800.19	1,920,452,322.23	2,019,859,657.33

#### (3) 信用风险敞口

单位：人民币元

	阶段 1	阶段 2	阶段 3	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
于 2022 年 6 月 30 日	66,979,230,980.45	1,607,586,247.36	3,101,243,324.13	71,688,060,551.94
于 2021 年 12 月 31 日	73,158,319,859.73	1,019,080,437.36	2,759,688,945.17	76,937,089,242.26

#### (4) 客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况

单位：人民币元

担保物类别	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
资金	9,000,046,751.85	8,073,654,876.36
债券	1,055,016,268.94	1,044,933,265.53
基金	8,924,429,400.11	9,881,176,936.17
股票	221,051,767,256.90	252,689,360,469.02
合计	240,031,259,677.80	271,689,125,547.08

### 4、衍生金融工具

单位：人民币元

类别	2022 年 6 月 30 日					
	非套期工具 (注 1)			套期工具 (注 2)		
	名义金额	公允价值		名义金额	公允价值	
		资产	负债		资产	负债
利率衍生工具	84,402,162,732.90	332,151,166.54	253,670,074.75	2,490,532,109.22	39,398,753.72	15,486,230.27
货币衍生工具	22,061,665,052.36	330,192,179.37	262,771,914.54	3,011,553,016.20	47,561,778.91	92,962,110.24
权益衍生工具	129,892,269,010.22	1,525,468,999.51	632,617,967.13	-	-	-
信用衍生工具	342,000,000.00	-	918,426.00	-	-	-
其他衍生工具	18,805,339,516.84	2,712,876.69	16,725,265.01	-	-	-
合计		2,190,525,222.11	1,166,703,647.43		86,960,532.63	108,448,340.51

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 4、衍生金融工具 (续)

单位：人民币元

类别	2021年12月31日					
	非套期工具(注1)			套期工具(注2)		
	名义金额	公允价值		名义金额	公允价值	
		资产	负债		资产	负债
利率衍生工具	84,753,330,304.93	453,337,518.95	370,157,535.21	2,594,285,984.71	11,079,253.60	67,972,636.37
货币衍生工具	22,012,225,381.33	223,664,567.35	145,337,348.32	2,900,825,114.15	-	163,141,885.78
权益衍生工具	142,538,480,238.97	386,933,270.57	794,924,675.26	-	-	-
信用衍生工具	427,775,760.00	-	2,220,180.86	-	-	-
其他衍生工具	20,673,842,068.22	9,716,414.27	4,562,058.72	-	-	-
合计		1,073,651,771.14	1,317,201,798.37		11,079,253.60	231,114,522.15

注1：在每日无负债结算制度下，非套期衍生金融工具项下的期货合约和在上海清算所集中清算的利率互换合约按抵销后的净额列示，为人民币零元。于2022年6月30日，本集团未到期的期货合约的公允价值为人民币636,925,480.00元(2021年12月31日：41,362,915.00元)，本集团未到期的在上海清算所集中清算的利率互换的公允价值为42,710,099.66元(2021年12月31日：73,512,527.87元)。

注2：本集团利用套期衍生工具对利率风险及汇率风险导致的现金流量波动进行套期保值。被套期项目为借款及借款利息。截至2022年6月30日止6个月期间，本集团符合现金流量套期有效的部分净收益人民币39,527,262.61元计入其他综合收益(截至2021年6月30日止6个月期间：净收益人民币44,235,541.97元)，并未发生因无效的现金流量套期导致的当期损益。

### 5、存出保证金

#### (1) 项目列示

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
交易保证金	594,912,109.66	427,625,750.12
信用保证金	523,817,154.57	530,054,396.54
期货保证金	17,410,724,902.47	14,875,349,308.43
履约保证金	1,513,257,822.42	1,822,139,151.14
合计	20,042,711,989.12	17,655,168,606.23

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 5、存出保证金 (续)

(2) 按币种列示

类别	2022年6月30日			2021年12月31日		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
<b>交易保证金</b>						
人民币			493,996,485.65			309,053,425.48
美元	1,769,819.06	6.7114	11,877,963.64	1,770,015.87	6.3757	11,285,090.18
港币	91,497,305.36	0.85519	78,247,580.57	108,077,581.01	0.81760	88,364,230.23
欧元	1,539,592.46	7.0084	10,790,079.80	2,621,023.62	7.2197	18,923,004.23
小计			594,912,109.66			427,625,750.12
<b>信用保证金</b>						
人民币			523,817,154.57			530,054,396.54
小计			523,817,154.57			530,054,396.54
<b>期货保证金</b>						
人民币			17,370,276,289.21			14,857,075,737.21
港币	2,226,215.00	0.85519	1,903,836.81	6,641,351.00	0.81760	5,429,968.58
欧元	5,499,796.88	7.0084	38,544,776.45	1,778,966.25	7.2197	12,843,602.64
小计			17,410,724,902.47			14,875,349,308.43
<b>履约保证金</b>						
人民币			1,166,494,647.41			1,393,047,248.94
美元			-	3,909,233.64	6.3757	24,924,100.92
欧元	47,548,474.24	7.0084	333,238,726.86	53,473,479.49	7.2197	386,062,479.87
其他			13,524,448.15			18,105,321.41
小计			1,513,257,822.42			1,822,139,151.14
合计			20,042,711,989.12			17,655,168,606.23

### 6、应收款项

(1) 按明细列示

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
应收清算款	5,249,327,236.21	7,607,823,410.10
应收手续费及管理费	1,763,690,288.37	1,848,778,675.62
其他	1,698,342,408.24	2,118,520,370.99
应收款项余额	8,711,359,932.82	11,575,122,456.71
减：减值准备	214,747,682.96	203,106,194.39
应收款项账面价值	8,496,612,249.86	11,372,016,262.32



## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 6、应收款项 (续)

#### (2) 按账龄分析

单位：人民币元

账龄	2022年6月30日				2021年12月31日			
	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1年以内 (含1年)	8,141,706,576.63	93.47	20,197,899.91	9.41	10,870,076,372.21	93.91	28,244,974.70	13.91
1-2年 (含2年)	207,734,541.16	2.38	24,917,005.01	11.60	322,018,881.57	2.78	27,209,330.45	13.40
2-3年 (含3年)	209,443,162.54	2.40	48,125,073.35	22.41	156,457,410.83	1.35	36,540,416.95	17.99
3年以上	152,475,652.49	1.75	121,507,704.69	56.58	226,569,792.10	1.96	111,111,472.29	54.70
合计	8,711,359,932.82	100.00	214,747,682.96	100.00	11,575,122,456.71	100.00	203,106,194.39	100.00

### 7、买入返售金融资产

#### (1) 按标的物类别列示

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
股票	29,073,663,912.00	31,968,602,454.62
债券	13,745,438,091.42	9,584,043,119.95
小计	42,819,102,003.42	41,552,645,574.57
减：减值准备	719,645,037.40	1,791,629,226.36
合计	42,099,456,966.02	39,761,016,348.21

#### (2) 按业务类别列示

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
约定购回式证券	154,714,111.11	228,273,777.77
股票质押式回购 (6)	28,916,947,976.35	31,733,689,842.55
债券质押式回购	10,196,104,453.69	5,428,719,632.58
债券买断式回购	3,549,333,637.73	4,155,323,487.37
其他买入返售金融资产	2,001,824.54	6,638,834.30
小计	42,819,102,003.42	41,552,645,574.57
减：减值准备	719,645,037.40	1,791,629,226.36
合计	42,099,456,966.02	39,761,016,348.21

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 7、买入返售金融资产 (续)

#### (3) 减值准备调节表

单位: 人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2021 年 12 月 31 日	13,905,212.59	1,180,012.49	1,776,544,001.28	1,791,629,226.36
本期计提 / (转回)	(2,458,114.52)	1,771,817.15	(822,123,951.11)	(822,810,248.48)
阶段转移	2,242,154.93	(2,474,645.25)	232,490.32	-
本期其他终止确认	-	-	(249,175,551.03)	(249,175,551.03)
外汇变动及其他	1,610.55	-	-	1,610.55
于 2022 年 6 月 30 日	13,690,863.55	477,184.39	705,476,989.46	719,645,037.40

#### (4) 信用风险敞口

单位: 人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2022 年 6 月 30 日	40,551,449,475.22	76,447,739.58	2,191,204,788.62	42,819,102,003.42
于 2021 年 12 月 31 日	37,068,436,944.05	214,813,177.67	4,269,395,452.85	41,552,645,574.57

#### (5) 买入返售金融资产的担保物信息

单位: 人民币元

担保物类别	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
担保物	110,104,427,220.31	121,478,643,819.10
其中: 可出售或可再次向外抵押的担保物	3,983,023,003.91	6,499,494,769.70
其中: 已出售或已再次向外抵押的担保物	351,397,550.40	719,802,270.78

#### (6) 股票质押式回购业务

##### (i) 股票质押式回购剩余期限

单位: 人民币元

剩余期限	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
1 个月以内	6,019,800,067.37	6,993,571,271.67
1 个月以上到 3 个月内	4,682,702,445.38	4,181,484,195.86
3 个月以上到 1 年以内	17,651,704,861.33	19,982,883,145.29
1 年以上	562,740,602.27	575,751,229.73
合计	28,916,947,976.35	31,733,689,842.55

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 7、买入返售金融资产 (续)

(6) 股票质押式回购业务 (续)

(ii) 股票质押式回购信用风险敞口

单位: 人民币元

2022年6月30日	阶段1 未来12个月预期信用损失	阶段2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
账面余额	26,649,295,448.15	76,447,739.58	2,191,204,788.62	28,916,947,976.35
减值准备	13,571,895.30	477,184.39	705,476,989.46	719,526,069.15
担保物价值	91,596,076,437.17	596,482,968.22	3,290,417,346.10	95,482,976,751.49

单位: 人民币元

2021年12月31日	阶段1 未来12个月预期信用损失	阶段2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
账面余额	27,249,481,212.03	214,813,177.67	4,269,395,452.85	31,733,689,842.55
减值准备	13,841,486.98	1,180,012.49	1,776,544,001.28	1,791,565,500.75
担保物价值	103,335,537,451.01	731,734,270.40	4,965,737,678.27	109,033,009,399.68

### 8、交易性金融资产

(1) 按项目列示

单位: 人民币元

项目	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产			
	2022年6月30日		2021年12月31日	
	公允价值	初始投资成本	公允价值	初始投资成本
债券	93,074,282,189.75	95,789,127,078.25	117,085,316,620.24	119,454,124,953.81
公募基金	40,161,960,766.35	40,795,049,573.59	31,632,683,762.05	31,352,691,412.80
股票 / 股权	33,721,553,480.50	31,777,086,786.06	34,954,924,375.18	31,342,403,116.24
银行理财产品	4,264,848,755.79	4,262,133,400.00	3,427,357,682.52	3,424,930,000.00
券商资管产品	1,552,689,451.95	1,505,825,943.28	2,073,502,125.18	2,069,766,701.06
信托计划	2,463,475,579.44	2,624,892,601.65	667,091,909.08	650,875,801.05
其他	26,627,426,438.75	28,094,886,521.14	30,568,872,516.31	31,583,994,412.60
合计	201,866,236,662.53	204,849,001,903.97	220,409,748,990.56	219,878,786,397.56

(2) 2022年6月30日, 交易性金融资产中有承诺条件的金融资产, 系用于卖出回购业务、债券借贷业务、转融通业务和衍生业务等, 其公允价值为人民币 48,701,239,322.43 元 (2021年12月31日: 人民币 62,710,281,695.03 元), 其中包括存在限售期限的交易性金融资产, 其公允价值为人民币 891,550,274.08 元 (2021年12月31日: 人民币 1,728,628,638.50 元)。

交易性金融资产中用于借款质押的资产情况详见附注十、1、(1)。

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 8、交易性金融资产 (续)

(3) 2022年6月30日,存在限售期限的交易性金融资产账面价值合计人民币6,496,242,345.38元(2021年12月31日:人民币9,045,291,758.84元)。

### 9、债权投资

(1) 按项目列示

单位:人民币元

项目名称	2022年6月30日			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值
公司债	1,581,345,226.15	29,304,980.49	7,029,921.14	1,603,620,285.50
境外国债	2,606,369,620.89	16,813,930.78	2,041,591.80	2,621,141,959.87
金融债	296,758,421.98	1,967,241.76	544,980.19	298,180,683.55
其他	740,246,321.43	40,260,017.71	12,289,283.18	768,217,055.96
合计	5,224,719,590.45	88,346,170.74	21,905,776.31	5,291,159,984.88

单位:人民币元

项目名称	2021年12月31日			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值
公司债	1,681,753,018.71	17,120,439.54	6,429,114.20	1,692,444,344.05
境外国债	1,782,016,907.91	33,508,720.63	1,683,692.41	1,813,841,936.13
金融债	336,489,130.91	4,311,814.02	625,745.82	340,175,199.11
其他	851,859,252.83	38,638,826.41	11,750,484.91	878,747,594.33
合计	4,652,118,310.36	93,579,800.60	20,489,037.34	4,725,209,073.62

(2) 减值准备调节表

单位:人民币元

	阶段 1	阶段 2	阶段 3	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
于 2021 年 12 月 31 日	20,489,037.34	-	-	20,489,037.34
本期计提	1,238,060.90	-	-	1,238,060.90
外汇变动及其他	178,678.07	-	-	178,678.07
于 2022 年 6 月 30 日	21,905,776.31	-	-	21,905,776.31

(3) 信用风险敞口

单位:人民币元

	阶段 1	阶段 2	阶段 3	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
于 2022 年 6 月 30 日	5,313,065,761.19	-	-	5,313,065,761.19
于 2021 年 12 月 31 日	4,745,698,110.96	-	-	4,745,698,110.96

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 9、债权投资 (续)

(4) 存在有承诺条件的债权投资

2022年6月30日, 债权投资中有承诺条件的金融资产, 系用于卖出回购、向葡萄牙央行融资等, 其账面价值为人民币 3,452,169,921.82 元 (2021年12月31日: 2,565,294,134.70 元)。

### 10、其他债权投资

(1) 按项目列示

单位: 人民币元

项目名称	2022年6月30日				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
境外及境内国债	7,657,692,778.75	95,923,724.24	84,874,756.72	7,838,491,259.71	1,827,869.03
金融债	1,958,346,064.16	18,001,473.33	(12,663,040.81)	1,963,684,496.68	2,290,941.24
企业债	2,981,424,271.11	81,191,355.32	45,066,767.89	3,107,682,394.32	74,434,136.78
公司债	3,698,753,511.24	101,254,940.02	(44,204,413.64)	3,755,804,037.62	59,331,913.14
地方政府债	22,024,689,042.82	375,378,733.04	90,574,938.28	22,490,642,714.14	31,240,580.03
其他	2,783,383,815.94	89,610,359.46	25,928,134.63	2,898,922,310.03	44,114,327.78
合计	41,104,289,484.02	761,360,585.41	189,577,143.07	42,055,227,212.50	213,239,768.00

单位: 人民币元

项目名称	2021年12月31日				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
境外及境内国债	6,207,608,047.85	91,485,243.46	85,811,347.69	6,384,904,639.00	1,609,294.41
金融债	1,255,599,111.89	24,524,049.70	6,792,435.05	1,286,915,596.64	10,336,651.39
企业债	1,843,843,843.84	40,564,139.72	26,856,996.16	1,911,264,979.72	56,072,138.41
公司债	3,216,870,626.06	75,784,382.85	(48,842,322.54)	3,243,812,686.37	64,779,769.34
地方政府债	20,303,763,829.15	309,866,185.28	28,709,515.85	20,642,339,530.28	41,166,363.26
其他	3,496,908,280.47	77,381,969.84	9,417,685.45	3,583,707,935.76	85,693,808.66
合计	36,324,593,739.26	619,605,970.85	108,745,657.66	37,052,945,367.77	259,658,025.47

(2) 减值准备调节表

单位: 人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2021 年 12 月 31 日	100,389,026.75	159,002,609.68	266,389.04	259,658,025.47
本期转回	(31,214,696.64)	(23,335,728.49)	-	(54,550,425.13)
阶段转移	12,919,709.56	(12,659,041.41)	(260,668.15)	-
外汇变动及其他	151,429.46	7,986,459.09	(5,720.89)	8,132,167.66
于 2022 年 6 月 30 日	82,245,469.13	130,994,298.87	-	213,239,768.00

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 10、其他债权投资 (续)

#### (3) 信用风险敞口

单位：人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2022 年 6 月 30 日	38,165,545,409.47	3,700,104,659.96	-	41,865,650,069.43
于 2021 年 12 月 31 日	33,469,180,713.90	3,436,585,235.24	38,433,760.97	36,944,199,710.11

#### (4) 存在有承诺条件的其他债权投资

2022 年 6 月 30 日，其他债权投资中有承诺条件的金融资产，系用于卖出回购业务、债券借贷业务质押、转融通业务和衍生业务等，其公允价值为人民币 33,144,925,516.26 元 (2021 年 12 月 31 日：27,051,143,124.81 元)。

### 11、其他权益工具投资

单位：人民币元

项目	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
非交易性权益工具	6,612,455,737.01	10,246,870,931.21

于 2022 年 6 月 30 日，其他权益工具投资包括本公司持有的非交易性股权及股票。

由于上述权益工具并非为交易目的而持有，本集团将其指定为其他权益工具投资。由于本公司战略调整，本集团对部分其他权益工具进行处置，相应的税后亏损人民币 291,639,688.25 元从其他综合收益重分类为留存收益。

2022 年 6 月 30 日，其他权益工具中有承诺条件的金融资产，系用于融出证券业务，其公允价值为人民币 2,436,740,925.16 元 (2021 年 12 月 31 日：2,569,298,491.46 元)。

### 12、应收融资租赁款及长期应收款

单位：人民币元

项目	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
应收融资租赁款 (1)	25,340,889,731.77	33,472,586,720.22
长期应收款 (2)	68,201,416,679.15	55,088,023,010.62
合计	93,542,306,410.92	88,560,609,730.84

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 12、应收融资租赁款及长期应收款 (续)

(1) 应收融资租赁款

(i) 应收融资租赁款列示如下:

单位: 人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
资产负债表日后第一年	20,251,731,542.85	25,533,152,225.96
资产负债表日后第二年	6,290,484,622.49	9,925,218,660.26
资产负债表日后第三年	1,462,103,845.66	1,871,410,047.50
资产负债表日后第四年	375,148,643.02	396,805,373.14
资产负债表日后第五年	263,846,565.48	296,805,788.90
以后年度	1,068,581,130.64	597,410,448.86
最低租赁收款额合计	29,711,896,350.14	38,620,802,544.62
减: 未实现融资收益	2,783,124,529.08	3,584,006,385.15
应收融资租赁款余额	26,928,771,821.06	35,036,796,159.47
减: 减值准备	1,587,882,089.29	1,564,209,439.25
应收融资租赁款净额	25,340,889,731.77	33,472,586,720.22
其中: 一年内到期的应收融资租赁款净额	17,382,484,881.06	22,202,397,621.24
一年后到期的应收融资租赁款净额	7,958,404,850.71	11,270,189,098.98

期末用于抵押或担保的资产情况见附注十、1、(1)。

(ii) 应收融资租赁款减值准备调节表如下:

单位: 人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2021 年 12 月 31 日	523,852,009.19	496,925,855.42	543,431,574.64	1,564,209,439.25
本期计提 / (转回)	(8,122,592.75)	317,483,977.41	330,500,778.95	639,862,163.61
本期核销	-	-	(207,437,493.66)	(207,437,493.66)
阶段转移	(37,005,861.23)	(128,188,534.40)	165,194,395.63	-
收回以前年度核销	-	-	38,788,141.58	38,788,141.58
本期其他终止确认	-	-	(447,540,161.49)	(447,540,161.49)
于 2022 年 6 月 30 日	478,723,555.21	686,221,298.43	422,937,235.65	1,587,882,089.29

(iii) 应收融资租赁款现值分析如下:

单位: 人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
2022 年 6 月 30 日	24,007,170,766.84	2,047,089,663.25	874,511,390.97	26,928,771,821.06
2021 年 12 月 31 日	32,415,837,634.65	1,647,131,081.80	973,827,443.02	35,036,796,159.47

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 12、应收融资租赁款及长期应收款 (续)

(2) 长期应收款

(i) 长期应收款列示如下:

单位: 人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
资产负债表日后第一年	32,235,071,516.94	26,278,931,159.11
资产负债表日后第二年	23,094,549,009.15	18,371,250,869.75
资产负债表日后第三年	12,408,719,194.53	10,718,659,578.87
资产负债表日后第四年	5,214,283,744.13	3,873,796,378.83
资产负债表日后第五年	2,674,957,701.11	1,991,888,989.75
以后年度	632,947,737.73	158,862,312.07
长期应收款总额	76,260,528,903.59	61,393,389,288.38
减: 利息调整	7,144,914,515.60	5,535,329,998.44
长期应收款余额	69,115,614,387.99	55,858,059,289.94
减: 减值准备	914,197,708.84	770,036,279.32
长期应收款净额	68,201,416,679.15	55,088,023,010.62
其中: 一年内到期的长期应收款净额	28,796,530,835.81	23,566,177,390.96
一年后到期的长期应收款净额	39,404,885,843.34	31,521,845,619.66

期末用于抵押或担保的资产情况见附注十、1、(1)。

(ii) 长期应收款减值准备调节表如下:

单位: 人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2021 年 12 月 31 日	699,717,900.31	41,973,825.95	28,344,553.06	770,036,279.32
本期计提	80,736,280.84	26,657,016.09	38,193,234.86	145,586,531.79
本期核销	-	-	(2,849,814.53)	(2,849,814.53)
阶段转移	(4,857,537.24)	(15,313,457.17)	20,170,994.41	-
收回以前年度核销	-	-	1,424,712.26	1,424,712.26
于 2022 年 6 月 30 日	775,596,643.91	53,317,384.87	85,283,680.06	914,197,708.84

(iii) 长期应收款现值分析如下:

单位: 人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
2022 年 6 月 30 日	68,699,361,358.34	259,413,092.77	156,839,936.88	69,115,614,387.99
2021 年 12 月 31 日	55,618,393,269.70	179,113,196.06	60,552,824.18	55,858,059,289.94



## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 13、长期股权投资

被投资单位	2021年12月31日			2022年6月30日			减值准备 期末余额
	追加投资	减少投资	本期增、减变动	2022年6月30日	其他综合收益调整	公司享有的宣告发放现金股利或利润	
<b>一、合营企业</b>							
上海彤关投资管理合伙企业(有限合伙)	-	-	-	1,317.81	-	-	1,317.81
小计	-	-	-	1,317.81	-	-	1,317.81
<b>二、联营企业</b>							
富国基金管理有限公司	-	-	1,957,895,348.40	-	4,365,114.58	(388,850,000.00)	1,885,105,200.83
吉林省现代农业和新兴产业投资基金有限公司	-	-	103,418,825.43	-	(509,251.51)	-	102,909,573.92
西安航天新能源产业投资基金有限公司	-	(74,126,000.00)	400,525,111.60	-	14,053,189.41	-	340,452,301.01
上海文化产业股权投资合伙企业(有限合伙)	-	-	273,806,513.02	-	(13,241,952.76)	-	260,564,560.26
上海并购股权投资合伙企业(有限合伙)	-	-	271,602,078.03	-	(24,756,010.34)	-	246,846,067.69
海通(吉林)现代服务业创业投资基金合伙企业(有限合伙)	373,197.28	-	67,194,307.19	-	377,998.68	-	67,945,503.15
海通兴泰(安徽)新兴产业投资基金(有限合伙)	-	-	208,857,617.08	-	1,304,702.72	-	210,162,319.80
海通齐东(威海)股权投资合伙企业(有限合伙)	-	(1,470,000.00)	182,967,097.06	-	31,099,462.30	(5,516,032.24)	191,080,527.12
广东南方媒体融合发展投资基金(有限合伙)	-	(1,572,392.19)	207,544,278.67	-	10,406,200.60	(9,206,990.85)	197,171,096.23
海通(吉林)股权投资合伙企业(有限合伙)	-	-	49,358,463.56	-	(21,195.70)	-	49,337,267.86
西安军融电子卫星基金投资有限公司	-	-	80,624,540.69	-	3,583,268.65	-	84,207,809.34
嘉兴海通旭初股权投资合伙企业(有限合伙)	-	-	127,895,392.48	-	(14,654,642.03)	-	113,240,750.45
上海并购股权投资基金二期合伙企业(有限合伙)	-	-	160,252,094.85	-	9,091,058.27	-	169,343,153.12
辽宁海通新动能股权投资合伙企业(有限合伙)	-	-	303,098,725.11	-	3,212,684.50	-	306,311,409.61
许昌海通创新股权投资合伙企业(有限合伙)	-	-	14,829,042.55	-	(235,509.64)	-	14,593,532.91
吉林海通创新卫星投资中心(有限合伙)	-	-	30,000,000.00	-	-	-	30,000,000.00
合肥市海通锦源股权投资合伙企业(有限合伙)	-	-	75,090,769.22	-	3,096,765.46	-	78,187,534.68
辽宁中德产业股权投资合伙企业(有限合伙)	-	-	440,225,616.66	-	54,650,794.43	-	494,876,411.09
西安航天海通创新新材料股权投资合伙企业(有限合伙)	-	-	38,845,194.83	-	(5,639,277.26)	-	33,205,917.57
中小企业发展基金海通(合肥)合伙企业(有限合伙)	-	-	60,000,000.00	-	7,693,735.43	-	67,693,735.43
央视融媒体产业投资基金(有限合伙)	-	-	675,250,000.00	-	(215,841.05)	-	675,034,158.95
辽宁海通新能源低碳产业股权投资基金有限公司	-	-	725,137,550.08	-	(87,398,499.76)	-	637,739,050.32
海通临沂股权投资合伙企业(有限合伙)	12,000,000.00	-	-	-	-	-	12,000,000.00
安徽省皖能海通双碳产业并购投资基金合伙企业(有限合伙)	60,000,000.00	-	-	-	-	-	60,000,000.00
小计	6,454,418,566.51	(103,168,392.19)	303,592,418.25	4,365,114.58	(403,573,023.09)	-	6,328,007,881.34
合计	6,454,419,884.32	(103,168,392.19)	303,592,418.25	4,365,114.58	(403,573,023.09)	-	6,328,009,199.15

注：在合营和联营企业中的权益相关信息详见附注六、2。

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 14、投资性房地产

单位：人民币元

项目	房屋、建筑物
一、账面原值	
1、2021年12月31日	86,061,809.57
2、本期转入	-
3、本期增加金额	2,254,147,638.91
4、本期减少金额	-
5、外币报表折算差额	-
6、2022年6月30日	2,340,209,448.48
二、累计折旧和累计摊销	-
1、2021年12月31日	28,466,402.21
2、本期转入	-
3、本期增加金额	1,514,268.20
4、本期减少金额	-
5、外币报表折算差额	-
6、2022年6月30日	29,980,670.41
三、账面价值	-
1、2022年6月30日	2,310,228,778.07
2、2021年12月31日	57,595,407.36

于2022年6月30日，本集团投资性房地产的公允价值为人民币3,004,812,804.70元(2021年12月31日：308,709,533.30元)，系参考相同或相似地点及状况的类似物业的近期市价厘定公允价值。

于2022年6月30日，本集团无用于抵押或担保的投资性房地产(2021年12月31日：同)。

### 15、固定资产

#### (1) 账面价值

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
固定资产原值	17,749,114,457.32	17,383,606,000.41
减：累计折旧	3,403,961,538.86	3,034,163,491.10
减：固定资产减值准备	79,078,438.71	76,642,667.17
固定资产账面价值合计	14,266,074,479.75	14,272,799,842.14

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 15、固定资产 (续)

#### (2) 固定资产增减变动表

单位：人民币元

项目	房屋及建筑物	电子通讯设备	交通运输工具	机器设备	经营租赁固定资产	合计
一、账面原值：						
2021年12月31日	9,518,750,763.91	1,756,609,464.34	158,587,787.54	298,081,079.96	5,651,576,904.66	17,383,606,000.41
本期增加	-	64,078,623.40	1,556,263.73	10,013,660.27	-	75,648,547.40
(1) 本期购置	-	61,953,339.65	1,556,263.73	5,631,616.01	-	69,141,219.39
(2) 在建工程转入	-	2,125,283.75	-	4,382,044.26	-	6,507,328.01
(3) 其他转入	-	-	-	-	-	-
本期减少	-	26,393,159.11	1,431,242.00	7,768,288.87	-	35,592,689.98
(1) 转让和出售	-	-	-	-	-	-
(2) 清理报废	-	26,393,159.11	1,431,242.00	7,768,288.87	-	35,592,689.98
(3) 其他减少	-	-	-	-	-	-
外币报表折算差额	18,395,512.34	7,056,152.06	26,275.41	2,401,943.44	297,572,716.24	325,452,599.49
2022年6月30日	9,537,146,276.25	1,801,351,080.69	158,739,084.68	302,728,394.80	5,949,149,620.90	17,749,114,457.32
二、累计折旧：						
2021年12月31日	952,231,555.22	1,192,216,512.45	133,003,688.54	201,317,401.22	555,394,333.67	3,034,163,491.10
本期转入	-	-	-	-	-	-
本期计提	129,084,691.74	112,476,212.90	3,884,687.15	12,470,480.17	104,105,255.63	362,021,327.59
本期减少	-	25,251,320.50	1,359,680.25	7,383,849.98	-	33,994,850.73
外币报表折算差额	2,053,513.58	5,509,082.84	19,316.29	1,656,463.24	32,533,194.95	41,771,570.90
2022年6月30日	1,083,369,760.54	1,284,950,487.69	135,548,011.73	208,060,494.65	692,032,784.25	3,403,961,538.86
三、减值准备：						
2021年12月31日	30,381,872.93	-	-	-	46,260,794.24	76,642,667.17
本期计提	-	-	-	-	-	-
本期减少	-	-	-	-	-	-
外币报表折算差额	-	-	-	-	2,435,771.54	2,435,771.54
2022年6月30日	30,381,872.93	-	-	-	48,696,565.78	79,078,438.71
四、账面价值：						
2022年6月30日	8,423,394,642.78	516,400,593.00	23,191,072.95	94,667,900.15	5,208,420,270.87	14,266,074,479.75
2021年12月31日	8,536,137,335.76	564,392,951.89	25,584,099.00	96,763,678.74	5,049,921,776.75	14,272,799,842.14

(3) 期末用于抵押或担保的固定资产情况见附注十、1、(1)。

(4) 于2022年6月30日，尚未办妥产权证书的固定资产账面价值为人民币28,859,767.55元(2021年12月31日：29,460,080.75元)。

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 16、在建工程

#### (1) 在建工程账面价值

项目	2022年6月30日			2021年12月31日		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
办公楼装修及设备改造	398,203,981.34	-	398,203,981.34	330,123,361.89	-	330,123,361.89
软件系统	22,816,632.62	-	22,816,632.62	29,402,731.91	-	29,402,731.91
合计	421,020,613.96	-	421,020,613.96	359,526,093.80	-	359,526,093.80

#### (2) 在建工程项目变动情况

工程名称	资金来源	2021年 12月31日	本期增加	本期减少				外币报表折 算差额	2022年 6月30日
				本期转入 固定资产	本期转入无 形资产	本期转入长期 待摊费用	其他减少		
办公楼装修及设备改造	自有资金	330,123,361.89	89,830,306.84	6,507,328.01	-	14,944,577.89	-	(297,781.49)	398,203,981.34
软件系统	自有资金	29,402,731.91	4,473,887.74	-	10,802,497.36	-	-	(257,489.67)	22,816,632.62
合计		359,526,093.80	94,304,194.58	6,507,328.01	10,802,497.36	14,944,577.89	-	(555,271.16)	421,020,613.96

### 17、无形资产

#### (1) 无形资产增减变动表

单位：人民币元

项目	土地使用权	计算机软件	交易席位费	其他	合计
一、账面原值					
2021年12月31日	832,440,829.50	1,745,004,124.54	224,042,334.51	132,175,847.78	2,933,663,136.33
本期增加	-	41,109,988.55	-	51,886.79	41,161,875.34
本期减少	-	9,299,458.66	-	-	9,299,458.66
外币报表折算差额	-	13,571,953.66	286,087.90	1,598,150.92	15,456,192.48
2022年6月30日	832,440,829.50	1,790,386,608.09	224,328,422.41	133,825,885.49	2,980,981,745.49
二、累计摊销					
2021年12月31日	98,133,268.75	1,377,802,339.56	116,600,323.50	92,342,077.95	1,684,878,009.76
本期增加	10,151,966.04	90,645,408.00	-	3,354,118.87	104,151,492.91
本期减少	-	9,041,224.73	-	-	9,041,224.73
外币报表折算差额	-	11,532,931.00	-	1,243,785.58	12,776,716.58
2022年6月30日	108,285,234.79	1,470,939,453.83	116,600,323.50	96,939,982.40	1,792,764,994.52
三、减值准备					
2021年12月31日	-	-	-	-	-
本期增加	-	-	-	-	-
本期减少	-	-	-	-	-
外币报表折算差额	-	-	-	-	-
2022年6月30日	-	-	-	-	-
四、账面价值					
2022年6月30日	724,155,594.71	319,447,154.26	107,728,098.91	36,885,903.09	1,188,216,750.97
2021年12月31日	734,307,560.75	367,201,784.98	107,442,011.01	39,833,769.83	1,248,785,126.57

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 17、无形资产 (续)

(2) 期末无用于抵押或担保的无形资产。

### 18、使用权资产与租赁负债

(1) 使用权资产

单位：人民币元

项目	房屋及建筑物	电子通讯设备	交通运输工具	其他	合计
一、账面原值					
2021年12月31日	2,134,659,619.18	802,356.13	4,160,113.42	2,107,849.81	2,141,729,938.54
本期增加	170,787,631.81	-	-	48,409.35	170,836,041.16
本期减少	385,827,034.26	-	977,209.71	-	386,804,243.97
外币报表折算差额	17,618,438.54	(11,631.52)	129,643.18	(4,343.65)	17,732,106.55
2022年6月30日	1,937,238,655.27	790,724.61	3,312,546.89	2,151,915.51	1,943,493,842.28
二、累计折旧					
2021年12月31日	1,106,565,182.98	214,639.37	1,964,835.06	1,142,921.82	1,109,887,579.23
本期增加	210,379,952.50	101,743.96	454,472.54	249,837.76	211,186,006.76
本期减少	371,283,252.33	-	770,558.26	-	372,053,810.59
外币报表折算差额	4,828,107.55	(7,091.98)	6,185.99	(786.56)	4,826,415.00
2022年6月30日	950,489,990.70	309,291.35	1,654,935.33	1,391,973.02	953,846,190.40
三、减值准备					
2021年12月31日	-	-	-	-	-
本期增加	-	-	-	-	-
本期减少	-	-	-	-	-
外币报表折算差额	-	-	-	-	-
2022年6月30日	-	-	-	-	-
四、账面价值					
2022年6月30日	986,748,664.57	481,433.26	1,657,611.56	759,942.49	989,647,651.88
2021年12月31日	1,028,094,436.20	587,716.76	2,195,278.36	964,927.99	1,031,842,359.31

(2) 租赁负债

租赁负债的到期期限分析如下：

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
1年以内	294,800,421.09	307,758,712.73
1-2年	243,152,340.44	238,764,169.83
2-5年	258,904,325.60	249,730,888.55
5年以上	216,095,646.07	250,925,342.38
合计	1,012,952,733.20	1,047,179,113.49

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 18、使用权资产与租赁负债 (续)

#### (2) 租赁负债 (续)

本集团租赁了多项资产，包括房屋及建筑物和交通运输设备等。租赁条款系在个别基础上磋商，包括各种不同条款及条件。在厘定租赁期及评估不可撤销期间的长度时，本集团应用合同的定义并厘定合同可强制执行的期间。

2022年上半年，租赁资金流出总额达人民币22,734.03万元(2021年上半年：人民币27,656.51万元)。

2022年上半年，租赁负债利息支出人民币2,091.17万元(2021年上半年：人民币2,026.89万元)。

截至2022年6月30日止，除本集团向出租人支付的押金作为租入资产的担保权益外，租赁协议不附加任何其他担保条款。租入资产不可被用于借款担保。

于2022年6月30日，本集团未订立尚未开始的任何重大租赁。

### 19、商誉

单位：人民币元

被投资单位名称	2021年12月31日	本期增加	本期减少	汇兑调整	2022年6月30日
商誉					
海通期货股份有限公司	5,896,464.26	-	-	-	5,896,464.26
海通国际证券集团有限公司	641,800,350.67	-	-	29,507,430.51	671,307,781.18
海通恒信金融集团有限公司	2,047,416,253.99	-	-	94,132,065.79	2,141,548,319.78
Haitong International Holdings (UK) Limited	120,876,909.37	-	-	5,557,440.10	126,434,349.47
Haitong Bank, S.A.	953,606,000.91	-	-	43,843,015.62	997,449,016.53
Haitong International Financial Services (Singapore) Pte. Ltd.	4,516,557.57	-	-	207,653.37	4,724,210.94
小计	3,774,112,536.77	-	-	173,247,605.39	3,947,360,142.16
减：减值准备					
Haitong Bank, S.A.	(408,800,000.00)	-	-	(18,795,000.00)	(427,595,000.00)
小计	(408,800,000.00)	-	-	(18,795,000.00)	(427,595,000.00)
合计	3,365,312,536.77	-	-	154,452,605.39	3,519,765,142.16

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 20、递延所得税资产和递延所得税负债

#### (1) 未经抵销的递延所得税资产

单位：人民币元

项目	2022年6月30日		2021年12月31日	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
资产减值准备	11,499,252,373.61	2,885,957,526.50	12,765,198,778.87	3,216,706,561.72
应付未付款项可抵扣税款	6,050,310,831.66	1,514,377,740.52	5,498,371,789.69	1,373,612,681.01
可抵扣亏损	3,130,041,374.33	660,531,561.81	2,982,337,330.71	620,455,097.08
交易性金融资产	522,765,184.29	130,691,296.08	150,509,914.70	37,627,478.68
其他权益工具投资	282,371,984.27	70,592,996.07	-	-
衍生金融工具	171,102,641.16	63,828,920.09	279,202,126.73	84,421,039.80
其他债权投资	99,085,838.86	31,274,992.58	27,547,125.94	11,269,367.34
无形资产、固定资产及长期待摊费用	931,452.14	232,863.04	931,452.14	232,863.04
交易性金融负债	-	-	203,272,246.76	50,818,061.69
其他	113,636,127.40	39,348,931.00	231,724,478.82	59,653,090.32
合计	21,869,497,807.72	5,396,836,827.69	22,139,095,244.36	5,454,796,240.68

#### (2) 未经抵销的递延所得税负债

单位：人民币元

项目	2022年6月30日		2021年12月31日	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
交易性金融资产	4,370,527,163.08	1,092,631,790.77	5,177,188,491.25	1,294,297,122.81
衍生金融工具	1,340,372,559.99	335,093,140.00	8,972,639.81	2,202,132.84
交易性金融负债	678,542,044.65	169,635,511.16	-	-
无形资产、固定资产及长期待摊费用	584,292,695.25	77,605,076.22	511,409,458.17	68,322,185.37
其他债权投资	266,044,932.50	66,511,233.13	159,062,846.16	39,765,711.54
其他权益工具投资	-	-	130,347,921.67	32,586,980.42
其他	747,340,061.17	185,026,226.87	672,795,935.25	166,347,518.46
合计	7,987,119,456.64	1,926,502,978.15	6,659,777,292.31	1,603,521,651.44

#### (3) 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
递延所得税资产	4,435,588,155.05	5,171,925,443.84
递延所得税负债	(965,254,305.51)	(1,320,650,854.60)

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 21、其他资产

#### (1) 项目列示

单位：人民币元

项目	注释	2022年6月30日	2021年12月31日
其他应收款	(2)	3,850,011,499.47	3,629,018,019.94
长期待摊费用	(3)	230,028,519.50	254,522,815.28
发放贷款和垫款	(4)	5,347,697,706.59	4,712,651,351.76
其他贷款和应收款	(5)	7,352,771,912.35	14,938,665,453.65
政府合作项目长期应收款项		816,073,184.19	885,384,824.69
回收融资租赁设备		161,394,254.48	219,013,072.20
抵债资产		93,445,900.51	250,329,579.15
存货		168,555,207.79	166,905,500.40
其他		4,673,216,138.00	3,214,222,879.63
合计		22,693,194,322.88	28,270,713,496.70

#### (2) 其他应收款

##### (i) 其他应收款明细列示

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
应收项目保证金及待结算款	2,104,607,149.70	2,102,870,808.82
预付款项	1,522,401,571.90	1,458,367,258.74
浙江斯文新技术投资有限公司	429,993,924.48	440,894,056.51
其他	302,331,536.97	120,534,269.21
其他应收款余额	4,359,334,183.05	4,122,666,393.28
减：坏账准备(注)	509,322,683.58	493,648,373.34
其他应收款账面价值	3,850,011,499.47	3,629,018,019.94

##### (ii) 其他应收款按账龄分析

单位：人民币元

账龄	2022年6月30日				2021年12月31日			
	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1年以内	1,518,239,137.11	34.83	25,606,240.77	5.03	3,387,569,658.55	82.17	7,432,216.03	1.51
1-2年	2,231,601,702.27	51.19	11,176,322.37	2.19	116,412,680.90	2.82	7,385,684.68	1.50
2-3年	42,292,121.32	0.97	3,481,146.53	0.68	67,126,327.99	1.63	6,176,888.97	1.25
3年以上	567,201,222.35	13.01	469,058,973.91	92.10	551,557,725.84	13.38	472,653,583.66	95.74
合计	4,359,334,183.05	100.00	509,322,683.58	100.00	4,122,666,393.28	100.00	493,648,373.34	100.00

注：于2022年6月30日，其他应收款坏账准备主要为本公司通过浙江斯文新技术投资有限公司存放在广东证券的保证金人民币429,993,924.48元，公司已根据可收回情况计提了100%的坏账准备。

##### (iii) 期末其他应收款项余额中无持本公司5%以上(含5%)表决权股份的股东单位欠款。



## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 21、其他资产 (续)

#### (3) 长期待摊费用

单位：人民币元

项目	2021年12月31日	本期增加额	本期摊销额	其他减少	2022年6月30日
装修及布线改造等	254,522,815.28	35,135,791.41	55,528,203.78	4,101,883.41	230,028,519.50

#### (4) 发放贷款和垫款

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
个人贷款和垫款	32,959,224.39	15,367,402.25
企业贷款和垫款	5,411,550,799.02	4,793,380,518.62
小计	5,444,510,023.41	4,808,747,920.87
减：贷款损失准备	96,812,316.82	96,096,569.11
合计	5,347,697,706.59	4,712,651,351.76

#### (i) 发放贷款和垫款减值准备调节表如下：

单位：人民币元

	阶段1 未来12个月预期信用损失	阶段2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于2021年12月31日	18,528,581.16	37,736,532.33	39,831,455.62	96,096,569.11
本期转回	(1,048,126.57)	(812,030.39)	(701,576.77)	(2,561,733.73)
阶段转移	530,397.48	(530,397.48)	-	-
外汇变动及其他	218,716.29	2,726,002.50	332,762.65	3,277,481.44
于2022年6月30日	18,229,568.36	39,120,106.96	39,462,641.50	96,812,316.82

#### (ii) 发放贷款和垫款风险敞口如下：

单位：人民币元

	阶段1 未来12个月预期信用损失	阶段2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于2022年6月30日	4,653,347,770.61	723,694,242.51	67,468,010.29	5,444,510,023.41
于2021年12月31日	4,116,861,694.38	596,883,007.99	95,003,218.50	4,808,747,920.87

#### (5) 其他贷款和应收款

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
境外贷款和应收款项	7,144,892,114.04	8,926,485,330.36
境内委托贷款及其他贷款	598,991,696.45	720,223,588.06
应收保理款	-	6,030,531,975.74
小计	7,743,883,810.49	15,677,240,894.16
减：减值准备	391,111,898.14	738,575,440.51
合计	7,352,771,912.35	14,938,665,453.65

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 21、其他资产 (续)

(5) 其他贷款和应收款 (续)

(i) 其他贷款和应收款减值准备调节表如下:

单位: 人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2021 年 12 月 31 日	130,639,664.84	249,588,964.94	358,346,810.73	738,575,440.51
本期计提 / (转回)	(117,662,478.35)	637,361.00	34,181,895.39	(82,843,221.96)
本期核销	-	-	(184,792,557.45)	(184,792,557.45)
本期其他终止确认	-	(101,866,600.92)	9,043,981.11	(92,822,619.81)
外汇变动及其他	784,303.27	-	12,210,553.58	12,994,856.85
于 2022 年 6 月 30 日	13,761,489.76	148,359,725.02	228,990,683.36	391,111,898.14

(ii) 其他贷款和应收款风险敞口如下:

单位: 人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2022 年 6 月 30 日	3,858,287,589.71	378,612,074.53	3,506,984,146.25	7,743,883,810.49
于 2021 年 12 月 31 日	10,575,552,717.84	935,291,189.57	4,166,396,986.75	15,677,240,894.16

### 22、融券业务情况

单位: 人民币元

项目	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
融出证券	5,614,558,266.76	7,634,493,512.41
交易性金融资产	1,432,636,630.02	2,492,533,914.75
其中: 股票	1,180,019,189.66	2,296,842,278.18
基金	252,617,440.36	195,691,636.57
其他权益工具投资 - 股票	2,436,740,925.16	2,569,298,491.46
转融通融入证券	1,745,180,711.58	2,572,661,106.20
转融通融入证券总额	2,343,261,232.20	3,201,601,620.00

注: 本年融券业务无违约情况 (2021 年: 同)。

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 23、资产减值准备变动表

单位：人民币元

项目	年初余额	本期增加 (含汇率变动)		本期减少			期末余额
		计提	其他增加	转回	核销	其他减少	
货币资金减值准备	14,208,754.31	1,281,578.78	(57,131.98)	728,109.62	-	-	14,705,091.49
融出资金减值准备	1,713,684,760.40	312,634,624.45	31,900,678.62	-	38,360,406.14	-	2,019,859,657.33
应收款项坏账准备	203,106,194.39	40,029,003.07	(9,709,442.31)	11,675,118.34	1,653,882.31	5,349,071.54	214,747,682.96
其他应收款坏账准备	493,648,373.34	25,970,056.78	681,575.94	10,977,322.48	-	-	509,322,683.58
买入返售金融资产减值准备	1,791,629,226.36	43,812,794.45	1,610.55	866,623,042.93	-	249,175,551.03	719,645,037.40
发放贷款和垫款损失准备	96,096,569.11	5,443,685.91	3,277,481.44	8,005,419.64	-	-	96,812,316.82
应收融资租赁款减值准备	1,564,209,439.25	639,862,163.61	-	-	168,649,352.08	447,540,161.49	1,587,882,089.29
长期应收款减值准备	770,036,279.32	145,586,531.79	-	-	1,425,102.27	-	914,197,708.84
其他贷款和应收款项减值准备	738,575,440.51	34,599,079.57	12,994,856.85	117,442,301.53	184,792,557.45	92,822,619.81	391,111,898.14
其他债权投资减值准备	259,658,025.47	1,288,082.62	8,132,167.66	55,838,507.75	-	-	213,239,768.00
债权投资减值准备	20,489,037.34	2,314,238.76	178,678.07	1,076,177.86	-	-	21,905,776.31
其他金融资产减值准备	66,444,954.69	-	10,656,836.60	1,792,861.06	209,982.88	4,920,990.13	70,177,957.22
<b>金融工具及其他项目信用减值准备小计</b>	<b>7,731,787,054.49</b>	<b>1,252,821,839.79</b>	<b>58,057,311.44</b>	<b>1,074,158,861.21</b>	<b>395,091,283.13</b>	<b>799,808,394.00</b>	<b>6,773,607,667.38</b>
固定资产减值准备	76,642,667.17	-	2,435,771.54	-	-	-	79,078,438.71
商誉减值准备	408,800,000.00	-	18,795,000.00	-	-	-	427,595,000.00
其他资产减值准备	35,641,474.16	26,658,607.83	1,179,396.02	747,807.05	11,347,914.25	-	51,383,756.71
<b>其他资产减值准备小计</b>	<b>521,084,141.33</b>	<b>26,658,607.83</b>	<b>22,410,167.56</b>	<b>747,807.05</b>	<b>11,347,914.25</b>	<b>-</b>	<b>558,057,195.42</b>
<b>合计</b>	<b>8,252,871,195.82</b>	<b>1,279,480,447.62</b>	<b>80,467,479.00</b>	<b>1,074,906,668.26</b>	<b>406,439,197.38</b>	<b>799,808,394.00</b>	<b>7,331,664,862.80</b>

### 24、金融工具及其他项目预期信用损失准备表

单位：人民币元

金融工具类别	2022年6月30日			合计
	未来12个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
货币资金减值准备	14,705,091.49	-	-	14,705,091.49
融出资金减值准备	78,935,534.91	20,471,800.19	1,920,452,322.23	2,019,859,657.33
应收款项坏账准备	76,111,330.09	88,759,212.52	49,877,140.35	214,747,682.96
其他应收款坏账准备	40,254,606.39	35,047,448.30	434,020,628.89	509,322,683.58
买入返售金融资产减值准备	13,690,863.55	477,184.39	705,476,989.46	719,645,037.40
发放贷款和垫款损失准备	18,229,568.36	39,120,106.96	39,462,641.50	96,812,316.82
应收融资租赁款减值准备	478,723,555.21	686,221,298.43	422,937,235.65	1,587,882,089.29
长期应收款减值准备	775,596,643.91	53,317,384.87	85,283,680.06	914,197,708.84
其他贷款和应收款项减值准备	13,761,489.76	148,359,725.02	228,990,683.36	391,111,898.14
其他债权投资减值准备	82,245,469.13	130,994,298.87	-	213,239,768.00
债权投资减值准备	21,905,776.31	-	-	21,905,776.31
其他金融资产减值准备	13,020,571.01	7,494,136.37	49,663,249.84	70,177,957.22
<b>合计</b>	<b>1,627,180,500.12</b>	<b>1,210,262,595.92</b>	<b>3,936,164,571.34</b>	<b>6,773,607,667.38</b>

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 24、金融工具及其他项目预期信用损失准备表 (续)

单位: 人民币元

金融工具类别	2021年12月31日			合计
	未来12个月 预期信用损失	整个存续期 预期信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期 预期信用损失 (已发生信用减值)	
货币资金减值准备	14,208,754.31	-	-	14,208,754.31
融出资金减值准备	55,086,808.45	11,810,954.32	1,646,786,997.63	1,713,684,760.40
应收款项坏账准备	69,149,758.49	73,809,233.88	60,147,202.02	203,106,194.39
其他应收款坏账准备	19,500,227.23	29,227,385.19	444,920,760.92	493,648,373.34
买入返售金融资产减值准备	13,905,212.59	1,180,012.49	1,776,544,001.28	1,791,629,226.36
发放贷款和垫款损失准备	18,528,581.16	37,736,532.33	39,831,455.62	96,096,569.11
应收融资租赁款减值准备	523,852,009.19	496,925,855.42	543,431,574.64	1,564,209,439.25
长期应收款减值准备	699,717,900.31	41,973,825.95	28,344,553.06	770,036,279.32
其他贷款和应收款项减值准备	130,639,664.84	249,588,964.94	358,346,810.73	738,575,440.51
其他债权投资减值准备	100,389,026.75	159,002,609.68	266,389.04	259,658,025.47
债权投资减值准备	20,489,037.34	-	-	20,489,037.34
其他金融资产减值准备	13,451,370.38	6,953,877.06	46,039,707.25	66,444,954.69
合计	1,678,918,351.04	1,108,209,251.26	4,944,659,452.19	7,731,787,054.49

### 25、短期借款

单位: 人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
信用借款	30,448,069,659.68	27,668,765,395.63
抵押借款	2,014,762,240.94	1,906,267,294.05
保证借款	136,830,400.00	-
合计	32,599,662,300.62	29,575,032,689.68

注1: 基于贷款合同对息税折旧及摊销前利润与融资成本比率约定了相关要求, 海通国际证券集团有限公司已于本财务报表批准报出前就其截至2022年6月30日账面价值为港币138.00亿元(折合人民币118.02亿元)的银行贷款潜在无法满足贷款合同约定比率获得了有关银行的豁免。

注2: 短期借款质押物情况详见附注十、1、(1)。

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 26、应付短期融资款

单位：人民币元

发行主体	类型	起息日期	到期日期	票面利率	2021年12月31日	本期增加	本期减少	2022年6月30日
海通证券股份有限公司	短期公司债券	2021年7月12日	2022年6月16日	2.82%	6,080,196,164.38	76,949,835.62	6,157,146,000.00	-
海通证券股份有限公司	短期公司债券	2021年7月29日	2022年7月29日	2.72%	5,058,126,027.40	67,441,095.89	-	5,125,567,123.29
海通证券股份有限公司	短期公司债券	2022年6月9日	2023年6月9日	2.50%	-	4,506,780,821.92	-	4,506,780,821.92
海通证券股份有限公司	短期收益凭证	2021年7月5日 至2022年7月1日	2022年7月3日 至2023年6月29日	0.00%-3.30%	2,178,255,869.79	9,167,848,611.46	8,872,264,078.68	2,473,840,402.57
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2021年4月30日	2022年1月21日	3.35%	1,022,451,724.46	1,835,616.43	1,024,287,340.89	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2021年5月21日	2022年1月21日	3.25%	1,019,895,592.42	1,780,821.92	1,021,676,414.34	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2021年5月24日	2022年2月18日	3.30%	509,907,715.41	2,169,863.03	512,077,578.44	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2021年8月6日	2022年4月22日	2.97%	1,011,491,941.00	9,032,054.80	1,020,523,995.80	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2021年8月23日	2022年3月11日	2.83%	504,892,952.47	2,674,931.51	507,567,883.98	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2021年10月13日	2022年3月25日	2.85%	1,005,767,817.21	6,480,821.92	1,012,248,639.13	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2021年11月25日	2022年4月15日	2.85%	1,002,323,933.61	8,120,547.94	1,010,444,481.55	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2022年1月11日	2022年5月27日	2.60%	-	1,009,687,671.23	1,009,687,671.23	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2022年1月19日	2022年6月17日	2.60%	-	505,306,849.32	505,306,849.32	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2022年2月16日	2022年8月26日	2.43%	-	504,334,865.49	-	504,334,865.49
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2022年3月8日	2022年8月25日	2.46%	-	503,709,700.84	-	503,709,700.84
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2022年3月23日	2022年8月12日	2.46%	-	1,006,455,369.54	-	1,006,455,369.54
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2022年4月13日	2022年10月28日	2.49%	-	502,367,665.83	-	502,367,665.83
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2022年4月20日	2022年11月18日	2.28%	-	1,003,761,049.77	-	1,003,761,049.77
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2022年5月25日	2023年2月17日	2.05%	-	1,000,956,731.39	-	1,000,956,731.39
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2022年6月15日	2023年3月10日	2.06%	-	499,818,795.39	-	499,818,795.39
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年4月8日	2022年1月10日	0.72%	320,487,169.73	14,734,726.89	335,221,896.62	-
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年7月16日	2022年1月18日	0.60%	655,867,316.03	30,154,173.69	686,021,489.72	-
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年7月16日	2022年7月15日	0.70%	207,419,894.30	10,383,355.14	-	217,803,249.44
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年7月29日	2022年1月28日	0.60%	311,477,237.00	14,320,485.98	325,797,722.98	-
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年8月3日	2022年2月7日	0.60%	311,454,080.01	14,319,421.31	325,773,501.32	-

## 四、合并财务报表项目附注(续)

### 26、应付短期融资款(续)

(续上表)

单位:人民币元

发行主体	类型	起息日期	到期日期	票面利率	2021年12月31日	本期增加	本期减少	2022年6月30日
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年8月18日	2022年2月18日	0.50%	655,193,197.27	30,123,180.39	685,316,377.66	-
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年8月26日	2022年8月25日	0.58%	319,294,531.55	17,863,562.66	-	337,158,094.21
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年9月14日	2022年3月14日	0.00%	246,644,109.47	11,339,716.34	257,983,825.81	-
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年9月20日	2022年9月19日	0.59%	638,365,713.35	35,715,504.08	-	674,081,217.43
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年12月8日	2022年12月7日	0.75%	636,685,533.75	36,633,099.43	-	673,318,633.18
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年12月13日	2022年6月13日	0.65%	653,938,283.19	30,065,484.43	684,003,767.62	-
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2021年12月16日	2022年12月15日	0.75%	636,551,327.15	36,625,907.85	-	673,177,235.00
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2022年1月13日	2022年7月13日	0.75%	-	404,030,139.55	-	404,030,139.55
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2022年1月31日	2022年8月1日	0.60%	-	134,523,534.13	-	134,523,534.13
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2022年2月17日	2023年2月16日	1.00%	-	878,665,040.83	-	878,665,040.83
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2022年6月8日	2023年1月9日	2.10%	-	1,454,173,848.80	-	1,454,173,848.80
海通国际证券集团有限公司	中期票据	2022年6月9日	2023年1月10日	2.00%	-	85,506,811.35	-	85,506,811.35
合计					24,986,688,130.95	23,626,691,714.09	25,953,349,515.09	22,660,030,329.95

注:于2022年6月30日,应付短期融资款包括未到期偿付的短期公司债券以及原始期限为1年以内的收益凭证。于2022年6月30日及2021年12月31日,本集团发行的应付短期融资款没有出现过本金、利息或赎回款项的违约情况。

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 27、拆入资金

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
银行拆入	4,642,600,503.17	6,649,257,697.33
转融通业务融入	6,012,783,333.34	9,015,400,000.00
合计	10,655,383,836.51	15,664,657,697.33

本公司转融通融入资金的剩余期限及利率如下表所示：

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	利率区间	2021年12月31日	利率区间
1至3个月	6,012,783,333.34	2.50%、2.80%	9,015,400,000.00	2.80%
合计	6,012,783,333.34		9,015,400,000.00	

### 28、交易性金融负债

单位：人民币元

项目	2022年6月30日		
	为交易目的而持有的金融负债	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	公允价值合计
黄金期权	-	58,650,898.73	58,650,898.73
归属结构化主体其他份额持有人的利益	-	871,249,005.12	871,249,005.12
结构化收益产品	-	10,277,529,369.48	10,277,529,369.48
其他	973,880,287.82	6,230,078,017.28	7,203,958,305.10
合计	973,880,287.82	17,437,507,290.61	18,411,387,578.43

单位：人民币元

项目	2021年12月31日		
	为交易目的而持有的金融负债	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	公允价值合计
归属结构化主体其他份额持有人的利益	-	1,828,521,494.85	1,828,521,494.85
结构化收益产品	-	8,078,933,081.66	8,078,933,081.66
其他	2,382,469,707.90	4,026,293,244.66	6,408,762,952.56
合计	2,382,469,707.90	13,933,747,821.17	16,316,217,529.07

注：于2022年6月30日和2021年12月31日，本集团的指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的公允价值与按合同到期日应支付持有人的金额的差异并不重大。由于本集团自身信用风险变化导致上述金融负债公允价值变化的金额并不重大。本集团指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债主要为本集团发行的结构化收益产品、收益凭证以及纳入合并范围内的结构化主体中归属于第三方权益等。

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 29、卖出回购金融资产款

#### (1) 按金融资产种类列示

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
股票	1,523,163,576.65	876,186,358.52
债券	69,158,727,083.60	80,060,041,759.48
黄金	10,885,593,449.13	10,975,723,947.34
合计	81,567,484,109.38	91,911,952,065.34

#### (2) 按业务类别列示

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
债券质押式报价回购	151,919,459.78	120,310,229.64
其他质押式回购	65,751,069,298.90	78,109,337,270.35
买断式回购	4,778,901,901.57	2,706,580,618.01
黄金掉期业务	10,885,593,449.13	10,975,723,947.34
合计	81,567,484,109.38	91,911,952,065.34

#### (3) 债券质押式报价回购的剩余期限和利率区间

单位：人民币元

剩余期限	2022年6月30日	利率区间	2021年12月31日	利率区间
一个月以内	140,376,269.42	1.70%-8.18%	110,179,572.17	1.70%-2.95%
一个月至三个月内	11,541,190.23		10,092,652.47	
三个月至一年以内	2,000.13		38,005.00	
合计	151,919,459.78		120,310,229.64	

#### (4) 卖出回购金融资产款的担保物信息

单位：人民币元

担保物类别	2022年6月30日	2021年12月31日
股票	1,656,768,677.67	1,015,470,893.00
债券	78,050,362,510.67	87,782,433,633.05
其他	10,967,600,000.00	10,654,725,000.00
合计	90,674,731,188.34	99,452,629,526.05



## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 30、代理买卖证券款

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
普通经纪业务		
- 个人	73,750,432,628.37	69,114,289,287.08
- 机构	46,838,003,570.23	46,013,271,922.24
小计	120,588,436,198.60	115,127,561,209.32
信用业务		
- 个人	7,278,089,583.03	6,563,275,812.87
- 机构	1,722,851,937.08	1,511,363,354.02
小计	9,000,941,520.11	8,074,639,166.89
合计	129,589,377,718.71	123,202,200,376.21

### 31、应付职工薪酬

#### (1) 应付职工薪酬列示

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
短期薪酬 (2)	6,401,231,454.86	7,059,865,604.91
离职后福利设定提存计划 (3)	17,291,784.30	14,257,739.20
其他长期职工福利 (2)	400,874,910.90	424,063,484.26
合计	6,819,398,150.06	7,498,186,828.37

#### (2) 短期薪酬及其他长期职工福利列示

单位：人民币元

项目	2021年12月31日	本期增加额	本期减少额	2022年6月30日
一、工资、奖金、津贴和补贴	7,436,926,404.40	2,603,728,485.30	3,290,533,857.85	6,750,121,031.85
二、职工福利费	12,368,489.37	62,994,437.62	64,346,236.90	11,016,690.09
三、社会保险费	11,586,349.96	186,596,956.72	186,272,675.19	11,910,631.49
其中：医疗保险费	8,599,589.11	112,527,972.13	112,187,666.81	8,939,894.43
工伤保险费	182,855.06	2,286,234.00	2,276,247.79	192,841.27
生育保险费	24,621.91	1,208,310.92	1,208,338.98	24,593.85
四、住房公积金	9,671,678.36	143,732,638.69	143,477,488.61	9,926,828.44
五、工会经费和职工教育经费	13,376,167.08	60,298,083.18	54,543,066.37	19,131,183.89
六、因解除劳动关系给予的补偿	-	6,725,891.34	6,725,891.34	-
七、其他	-	32,900,065.72	32,900,065.72	-
合计	7,483,929,089.17	3,096,976,558.57	3,778,799,281.98	6,802,106,365.76
其中：短期薪酬	7,059,865,604.91			6,401,231,454.86
其他长期职工福利	424,063,484.26			400,874,910.90

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 31、应付职工薪酬 (续)

(3) 设定提存计划

单位：人民币元

项目	2021年12月31日	本期增加	本期减少	2022年6月30日
基本养老保险	13,470,298.72	184,507,640.37	183,904,780.52	14,073,158.57
失业保险费	451,040.60	5,784,083.13	5,750,466.25	484,657.48
企业年金缴费	336,399.88	202,932,980.36	200,535,411.99	2,733,968.25
合计	14,257,739.20	393,224,703.86	390,190,658.76	17,291,784.30

### 32、应交税费

单位：人民币元

税费项目	2022年6月30日	2021年12月31日
增值税	136,088,025.19	301,064,936.32
城建税	7,679,813.31	18,322,045.11
教育费附加及地方教育费附加	5,566,153.73	13,134,213.60
企业所得税	1,339,885,600.15	3,477,590,424.49
个人所得税	168,975,452.49	266,250,196.83
其他	90,301,789.95	123,645,457.54
合计	1,748,496,834.82	4,200,007,273.89

### 33、应付款项

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
应付各类清算款	5,006,389,745.44	4,448,164,076.79
收益互换保证金	2,226,435,920.00	2,494,087,726.79
应付票据	1,578,972,455.45	2,899,881,127.44
其他	1,945,601,003.36	2,030,804,751.83
合计	10,757,399,124.25	11,872,937,682.85

期末余额中无欠持公司 5% 以上 (含 5%) 表决权股份的股东单位款项。

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 34、预计负债

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
对外提供担保	6,684,888.49	7,102,910.08
未决诉讼及其他	179,106,495.14	196,696,810.86
合计	185,791,383.63	203,799,720.94

### 35、长期借款

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	利率区间	2021年12月31日	利率区间
信用借款	29,470,550,575.62	1.75%-5.45%	27,008,539,612.89	1.46%-5.45%
抵押借款	20,418,061,764.65	1.35%-4.78%	17,576,035,877.29	1.13%-4.99%
保证借款	4,540,655,988.38	1.35%、2.39%	4,994,452,725.88	1.29%、1.52%
合计	54,429,268,328.65		49,579,028,216.06	

注 1：基于贷款合同对息税折旧及摊销前利润与融资成本比率约定了相关要求，海通国际控股已于本财务报表批准报出前就其截至 2022 年 6 月 30 日账面价值为港币 119.09 亿元（折合人民币 101.84 亿元）的银行贷款潜在无法满足贷款合同约定比率获得了有关银行的豁免。

注 2：长期借款质押物情况详见附注十、1、(1)。

## 四、合并财务报表项目附注(续)

### 36、应付债券

发行主体	债券类型	币种	面值(原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2021年12月31日	本期增加	本期减少	2022年6月30日
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,390,000,000.00	2013年11月25日	2023年11月25日	6.18%	2,401,346,496.57	74,149,870.65	-	2,475,496,367.22
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	800,000,000.00	2014年7月14日	2024年7月14日	5.85%	821,925,479.45	23,207,671.23	-	845,133,150.68
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2017年8月11日	2022年8月11日	4.80%	1,018,550,717.29	24,009,893.51	-	1,042,560,610.80
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,500,000,000.00	2017年9月22日	2027年9月22日	4.99%	5,569,377,374.72	136,594,503.05	-	5,705,971,877.77
海通证券股份有限公司	公司债券	美元	300,000,000.00	2018年12月13日	2023年12月13日	4.50%	1,913,075,161.20	170,891,460.03	69,363,847.32	2,014,602,773.91
海通证券股份有限公司	公司债券	欧元	230,000,000.00	2018年12月13日	2023年12月13日	Euribor+165bps	1,661,502,041.64	66,087,438.04	114,783,882.62	1,612,805,597.06
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2019年4月11日	2022年4月11日	3.75%	5,136,130,136.99	51,369,863.01	5,187,500,000.00	-
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	4,500,000,000.00	2019年11月15日	2022年11月15日	3.52%	4,520,396,712.33	78,549,041.09	-	4,598,945,753.42
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2020年2月27日	2023年2月27日	3.01%	5,126,997,260.27	74,631,506.85	150,500,000.00	5,051,128,767.12
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,500,000,000.00	2020年3月19日	2023年3月19日	2.99%	3,582,573,150.68	51,894,931.51	104,650,000.00	3,529,818,082.19
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,600,000,000.00	2020年4月30日	2023年4月30日	2.38%	5,689,827,068.49	66,092,273.98	133,280,000.00	5,622,639,342.47
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	700,000,000.00	2020年4月30日	2025年4月30日	2.88%	713,587,287.67	9,997,150.69	20,160,000.00	703,424,438.36
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	6,700,000,000.00	2020年5月25日	2023年5月25日	2.70%	6,809,531,232.88	89,706,575.34	180,900,000.00	6,718,337,808.22
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	6,000,000,000.00	2020年8月11日	2023年8月11日	3.53%	6,082,979,178.08	105,029,569.04	-	6,188,008,767.12
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2020年10月21日	2022年10月21日	3.82%	5,037,676,712.33	94,715,068.49	-	5,132,391,780.82
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2020年11月19日	2022年11月13日	3.70%	5,206,794,520.55	6,081,479.45	5,212,876,000.00	-
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	6,000,000,000.00	2021年1月13日	2024年1月13日	3.58%	6,207,738,082.19	106,517,260.28	214,800,000.00	6,099,455,342.47
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,400,000,000.00	2021年2月8日	2024年2月8日	3.79%	5,583,352,931.51	101,488,931.50	204,660,000.00	5,480,181,863.01
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2021年4月23日	2024年4月23日	3.45%	5,119,568,493.15	85,541,095.89	172,500,000.00	5,032,609,589.04
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,800,000,000.00	2021年5月27日	2024年5月27日	3.35%	2,856,280,000.00	46,514,520.55	93,800,000.00	2,808,994,520.55
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,100,000,000.00	2021年6月10日	2024年6月10日	3.40%	2,140,101,369.86	35,406,575.35	71,400,000.00	2,104,107,945.21
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,000,000,000.00	2021年7月29日	2024年7月29日	3.14%	2,026,840,547.95	31,141,917.80	-	2,057,982,465.75
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,000,000,000.00	2021年8月20日	2024年8月20日	3.04%	3,033,481,643.84	45,225,205.48	-	3,078,706,849.32
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,000,000,000.00	2021年8月30日	2024年8月30日	3.10%	2,021,063,013.70	30,745,205.48	-	2,051,808,219.18
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,000,000,000.00	2021年8月30日	2026年8月30日	3.43%	2,023,305,205.48	34,018,082.19	-	2,057,323,287.67
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2021年11月10日	2024年11月10日	3.10%	5,022,082,191.78	76,863,013.70	-	5,098,945,205.48
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2021年11月22日	2024年11月22日	3.09%	5,016,931,506.85	76,615,068.49	-	5,093,546,575.34
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2022年1月20日	2024年12月25日	2.84%	-	5,063,024,657.53	-	5,063,024,657.53

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 36、应付债券 (续)

(续上表)

发行主体	债券类型	币种	面值 (原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2021年12月31日	本期增加	本期减少	2022年6月30日
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,900,000,000.00	2022年2月21日	2025年2月21日	2.90%	-	2,929,953,424.66	-	2,929,953,424.66
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	500,000,000.00	2022年3月7日	2025年3月7日	3.03%	-	504,814,794.52	-	504,814,794.52
海通证券股份有限公司	次级债券	人民币	3,300,000,000.00	2019年2月28日	2022年2月28日	4.09%	3,413,522,712.33	21,447,287.67	3,434,970,000.00	-
海通证券股份有限公司	次级债券	人民币	5,000,000,000.00	2022年1月12日	2025年1月12日	3.18%	-	5,074,054,794.52	-	5,074,054,794.52
海通证券股份有限公司	次级债券	人民币	2,000,000,000.00	2022年2月25日	2025年2月25日	3.15%	-	2,021,747,945.21	-	2,021,747,945.21
海通证券股份有限公司	次级债券	人民币	2,480,000,000.00	2022年3月9日	2025年3月9日	3.29%	-	2,505,483,528.77	-	2,505,483,528.77
海通证券股份有限公司	金融债券	人民币	7,000,000,000.00	2019年8月29日	2022年8月29日	3.39%	7,081,267,123.29	117,674,794.52	-	7,198,941,917.81
海通证券股份有限公司	收益凭证	人民币	506,007,000.00	2020年7月14日至 2022年7月1日	2022年7月3日至 2024年6月27日	0.00%-3.70%	395,855,347.47	191,530,850.59	73,688,999.59	513,697,198.47
上海海通证券资产管理有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2020年11月4日	2025年11月4日	3.85%	1,006,012,328.74	19,091,780.81	-	1,025,104,109.55
上海海通证券资产管理有限公司	次级债券	人民币	1,000,000,000.00	2018年4月4日	2023年4月4日	5.00%	103,726,027.36	2,479,452.03	5,000,000.00	101,205,479.39
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	500,000,000.00	2019年2月28日	2022年2月28日	5.20%	521,679,191.15	4,131,506.84	525,810,697.99	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	500,000,000.00	2019年7月24日	2022年7月24日	4.83%	510,204,281.66	12,651,982.15	-	522,856,263.81
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2020年5月11日	2023年5月11日	3.50%	1,019,972,561.36	17,356,164.39	34,111,065.71	1,003,217,660.04
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	700,000,000.00	2020年6月19日	2022年6月19日	3.95%	713,762,112.13	12,802,328.81	726,564,440.94	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,200,000,000.00	2020年7月28日	2023年7月28日	4.00%	1,216,709,100.18	25,017,968.22	-	1,241,727,068.40
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2020年9月10日	2022年9月10日	4.40%	1,011,399,263.30	23,292,239.01	-	1,034,691,502.31
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2020年9月17日	2023年9月17日	4.20%	1,008,703,365.63	21,798,383.86	-	1,030,501,749.49
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	800,000,000.00	2020年10月30日	2023年10月30日	4.15%	802,798,413.42	17,240,209.76	-	820,038,623.18

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 36、应付债券 (续)

(续上表)

发行主体	债券类型	币种	面值 (原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2021年12月31日	本期增加	本期减少	2022年6月30日
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2021年4月26日	2025年4月26日	4.10%	1,024,572,884.78	20,331,506.84	39,707,856.59	1,005,196,535.03
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	800,000,000.00	2021年6月18日	2025年6月18日	3.85%	812,963,577.23	15,273,424.66	29,035,693.05	799,201,308.84
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	600,000,000.00	2021年8月12日	2024年8月12日	3.90%	606,339,503.21	12,100,009.39	-	618,439,512.60
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2021年10月25日	2023年10月25日	3.80%	1,001,516,772.57	20,369,693.10	-	1,021,886,465.67
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2021年12月24日	2024年12月24日	3.70%	995,925,408.90	19,164,973.91	-	1,015,090,382.81
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,500,000,000.00	2022年4月21日	2024年4月21日	3.48%	-	1,503,443,712.74	-	1,503,443,712.74
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	500,000,000.00	2022年5月5日	2025年5月5日	3.57%	-	500,404,210.86	-	500,404,210.86
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2022年6月21日	2024年6月21日	3.16%	-	995,942,593.42	-	995,942,593.42
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	500,000,000.00	2020年8月31日	2023年8月31日	4.20%	505,672,855.09	10,834,157.30	-	516,507,012.39
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	1,000,000,000.00	2020年11月6日	2022年11月6日	3.97%	1,004,601,820.86	20,492,116.36	-	1,025,093,937.22
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	500,000,000.00	2021年1月20日	2023年1月20日	4.00%	518,051,552.66	9,917,808.24	19,584,141.98	508,385,218.92
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	1,000,000,000.00	2021年12月9日	2024年12月9日	3.70%	997,362,827.61	19,242,241.80	-	1,016,605,069.41
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	800,000,000.00	2022年1月13日	2025年1月13日	3.64%	-	810,011,831.31	-	810,011,831.31
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	1,000,000,000.00	2022年5月27日	2025年5月27日	3.42%	-	998,469,518.69	-	998,469,518.69
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持票据	人民币	950,000,000.00	2019年11月11日	2022年3月19日	4.57%	21,635.82	-	21,635.82	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持票据	人民币	950,000,000.00	2020年3月25日	2022年11月19日	4.10%	118,444,878.83	1,386,617.17	102,022,321.14	17,809,174.86

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 36、应付债券 (续)

(续上表)

发行主体	债券类型	币种	面值 (原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2021年12月31日	本期增加	本期减少	2022年6月30日
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持票据	人民币	950,000,000.00	2021年8月16日	2023年3月27日	3.40%、4.00%	367,062,619.97	5,059,295.70	270,182,577.27	101,939,338.40
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持票据	人民币	950,000,000.00	2021年8月18日	2022年8月26日	3.50%	339,796,130.77	3,600,922.91	285,100,395.06	58,296,658.62
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持票据	人民币	970,000,000.00	2021年11月18日	2022年5月17日	3.25%	972,226,447.72	11,746,301.37	983,972,749.09	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持票据	人民币	950,000,000.00	2021年11月29日	2023年5月26日	3.70%、3.95%	947,282,729.20	16,006,876.53	491,976,629.94	471,312,975.79
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持票据	人民币	950,000,000.00	2022年3月10日	2024年8月26日	3.00%-3.50%	-	953,663,974.79	-	953,663,974.79
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,440,000,000.00	2019年6月14日	2022年2月24日	4.50%	109,029.00	-	109,029.00	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	926,000,000.00	2019年12月24日	2022年5月26日	4.60%	62,769,763.81	650,501.88	63,420,265.69	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2020年4月15日	2023年2月27日	3.40%	131,229,499.01	1,354,565.24	113,310,344.40	19,273,719.85
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	880,000,000.00	2020年5月28日	2022年7月26日	3.40%	203,538,087.87	1,736,467.70	169,380,478.09	35,894,077.48
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2020年6月17日	2023年2月27日	3.70%	248,766,985.08	3,223,659.56	164,550,208.37	87,440,436.27
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2020年6月19日	2022年1月26日	3.80%	26,979,013.62	69,649.39	27,048,663.01	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	190,000,000.00	2020年4月7日	2023年2月13日	5.00%	190,498,238.69	4,710,958.92	4,403,724.93	190,805,472.68
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2020年7月28日	2023年5月26日	4.10%	280,674,885.77	3,891,665.80	193,307,479.29	91,259,072.28
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2020年8月14日	2022年4月26日	3.68%、3.99%	153,060,221.21	628,444.53	153,688,665.74	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2020年9月9日	2023年4月26日	4.00%、4.20%	320,239,672.78	3,828,484.91	216,160,183.78	107,907,973.91
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2020年10月22日	2023年6月26日	4.00%、4.30%	311,193,031.64	5,200,494.88	209,759,107.77	106,634,418.75

## 四、合并财务报表项目附注(续)

### 36、应付债券(续)

(续上表)

发行主体	债券类型	币种	面值(原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2021年12月31日	本期增加	本期减少	2022年6月30日
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2020年11月24日	2022年4月26日	4.15%、4.30%	240,693,373.10	1,881,110.12	242,574,483.22	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2020年12月9日	2023年7月26日	4.24%、4.30%	419,463,439.74	5,818,782.77	235,027,605.24	190,254,617.27
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2021年2月2日	2023年8月28日	3.80%、4.55%	432,614,960.04	6,533,782.74	243,518,284.20	195,630,458.58
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2021年3月25日	2023年8月28日	4.00%、4.50%	501,058,066.66	7,860,364.46	263,336,770.28	245,581,660.84
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2021年3月31日	2022年11月28日	4.00%、4.40%	388,691,143.40	5,501,959.35	264,585,573.29	129,607,529.46
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2021年4月29日	2023年9月26日	4.00%、4.50%	515,133,019.96	9,069,759.25	244,966,985.25	279,235,793.96
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2021年5月31日	2023年1月26日	3.85%、4.35%	610,325,723.90	8,118,886.21	307,529,141.87	310,915,468.24
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2021年6月17日	2023年8月28日	3.80%、4.40%	587,188,099.93	8,686,941.31	303,963,553.32	291,911,487.92
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2021年8月5日	2023年9月26日	3.50%、4.20%	594,323,717.72	8,916,376.91	295,042,666.22	308,197,428.41
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2021年9月24日	2023年4月26日	3.17%、3.99%	954,383,743.13	9,638,058.64	574,075,165.16	389,946,636.61
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2021年11月19日	2023年8月28日	3.50%、3.95%	947,632,480.25	15,530,090.42	453,073,715.08	510,088,855.59
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2021年12月8日	2023年8月28日	3.35%、4.00%	944,484,506.05	11,990,095.60	540,045,263.54	416,429,338.11
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2022年1月26日	2023年5月26日	3.00%、3.40%	-	960,117,540.10	-	960,117,540.10
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2022年6月29日	2025年2月26日	2.69%、3.60%	-	942,444,291.42	-	942,444,291.42
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	非公开定向债务融资工具	人民币	300,000,000.00	2019年4月23日	2022年4月23日	4.65%	309,505,662.33	4,280,547.97	313,786,210.30	-



## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 36、应付债券 (续)

(续上表)

发行主体	债券类型	币种	面值 (原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2021年12月31日	本期增加	本期减少	2022年6月30日
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	非公开定向债务融资工具	人民币	1,000,000,000.00	2019年5月31日	2022年5月31日	4.70%	1,027,050,783.94	19,315,068.51	1,046,365,852.45	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	非公开定向债务融资工具	人民币	1,400,000,000.00	2019年12月4日	2022年12月4日	4.50%	1,402,664,237.02	32,312,812.22	-	1,434,977,049.24
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	非公开定向债务融资工具	人民币	1,000,000,000.00	2021年6月4日	2023年6月4日	3.95%	1,020,317,747.46	19,587,671.23	38,645,059.05	1,001,260,359.64
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	非公开定向债务融资工具	人民币	1,000,000,000.00	2021年11月11日	2024年11月11日	4.19%	1,001,266,816.88	21,582,489.88	-	1,022,849,306.76
海通恒信国际融资租赁股份有限公司 / 海通恒信小微融资租赁 (上海) 有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,140,000,000.00	2022年5月18日	2024年3月26日	2.69%-3.20%	-	1,136,557,921.33	-	1,136,557,921.33
海通恒信国际融资租赁股份有限公司 / 海通恒信小微融资租赁 (上海) 有限公司	资产支持专项计划	人民币	760,000,000.00	2021年12月29日	2023年8月15日	3.60%-3.95%	754,449,668.52	11,102,336.66	305,436,561.69	460,115,443.49
海通恒信国际融资租赁股份有限公司 / 海通恒信小微融资租赁 (上海) 有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,140,000,000.00	2022年4月13日	2023年12月26日	3.00%-3.40%	-	1,139,995,834.53	355,700,911.04	784,294,923.49
Unican Limited	境外私募债	美元	150,000,000.00	2019年7月31日	2022年7月31日	3.80%	970,421,691.78	64,803,156.80	12,606,734.40	1,022,618,114.18
Haitong UT Brilliant Limited	中期票据	美元	100,000,000.00	2021年6月3日	2024年6月3日	3.00%	601,447,014.04	43,637,357.59	4,509,852.12	640,574,519.51
Haitong UT Brilliant Limited	中期票据	美元	200,000,000.00	2022年4月27日	2025年4月27日	4.20%	-	1,346,621,450.83	-	1,346,621,450.83
海通国际证券集团有限公司	公司债券	美元	700,000,000.00	2019年7月19日	2024年7月19日	3.38%	4,517,313,604.04	239,908,520.42	-	4,757,222,124.46
海通国际证券集团有限公司	公司债券	美元	400,000,000.00	2019年11月18日	2025年5月18日	3.13%	2,545,220,830.45	135,791,709.31	-	2,681,012,539.76
海通国际证券集团有限公司	公司债券	美元	400,000,000.00	2020年7月2日	2023年7月2日	2.13%	2,570,702,677.00	137,211,684.40	-	2,707,914,361.40
海通国际证券集团有限公司	公司债券	美元	300,000,000.00	2021年5月20日	2026年5月20日	2.13%	1,909,959,751.61	101,137,975.33	-	2,011,097,726.94
Haitong International Finance Holdings 2015 Limited	公司债券	美元	670,000,000.00	2020年3月12日	2025年3月11日	2.11%	4,291,224,174.04	279,467,305.87	52,281,897.56	4,518,409,582.35
Haitong Investment Ireland PLC	中期票据	欧元	6,799,000.00	2017年12月30日至2018年7月25日	2022年12月10日至2026年1月25日	0.98%-1.71%	45,880,285.01	-	2,206,676.50	43,673,608.51

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 36、应付债券 (续)

(续上表)

发行主体	债券类型	币种	面值 (原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2021年12月31日	本期增加	本期减少	2022年6月30日
Haitong Bank, S.A.	金融债券	欧元	230,000,000.00	2022年2月10日	2025年2月10日	0.90%	-	1,605,569,495.92	-	1,605,569,495.92
Haitong Bank, S.A.	金融债券	美元	150,000,000.00	2022年5月25日	2027年5月31日	4.00%	-	1,013,204,531.96	-	1,013,204,531.96
Haitong Banco de Investimento do Brasil S.A.	金融债券	巴西雷亚尔	538,316,842.74	2018年5月21日至2022年6月30日	2022年1月3日至2026年3月30日	5.47%-17.36%	193,125,019.44	551,281,819.61	4,662,643.96	739,744,195.09
合计							163,586,069,656.61	36,256,913,696.11	26,372,002,689.92	173,470,980,662.80

### 37、其他负债

(1) 按类别列示

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
其他应付款	3,784,785,076.75	3,884,505,991.05
代理兑付债券款	17,567,398.02	17,567,398.02
长期应付款	8,831,193,078.64	10,063,025,294.18
中央银行款项及国家外汇存款	2,234,453,682.48	2,305,613,009.16
吸收存款	6,378,073,898.18	5,944,490,787.02
应付股利	3,959,036,419.13	7,535,561.12
同业存放	15,508,458.82	72,787,045.30
其他	688,679,918.40	603,768,108.35
合计	25,909,297,930.42	22,899,293,194.20

单位: 人民币元

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 37、其他负债 (续)

#### (2) 其他应付款

##### (i) 明细列示

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
应付投资者保护基金及风险准备金等	791,682,068.54	820,387,653.30
应付服务费	93,378,542.31	213,799,039.71
其他	2,899,724,465.90	2,850,319,298.04
合计	3,784,785,076.75	3,884,505,991.05

(ii) 期末无欠持公司 5%以上 (含 5%) 表决权股份的股东单位款项。

#### (3) 长期应付款

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
承租人保证金	8,215,556,033.80	9,471,476,641.74
其他	615,637,044.84	591,548,652.44
合计	8,831,193,078.64	10,063,025,294.18

#### (4) 吸收存款

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
活期存款	225,354,683.00	321,061,526.32
公司	223,304,807.51	321,006,463.31
个人	2,049,875.49	55,063.01
定期存款 (含通知存款)	6,152,719,215.18	5,623,429,260.70
公司	3,857,574,427.90	3,833,793,801.96
个人	2,295,144,787.28	1,789,635,458.74
合计	6,378,073,898.18	5,944,490,787.02

### 38、股本

单位：人民币元

流通股	2021年12月31日	本期变动	2022年6月30日
无限售条件流通股份 -A 股	8,482,678,055.00	390,703,125.00	8,873,381,180.00
有限售条件流通股份 -A 股	1,171,953,125.00	(390,703,125.00)	781,250,000.00
无限售条件流通股份 -H 股	3,409,568,820.00	-	3,409,568,820.00
合计	13,064,200,000.00	-	13,064,200,000.00

于 2022 年 2 月 7 日, 3 家股东持有的限售股共计 390,703,125 股达到解禁期限已完成解禁。截止 2022 年 6 月 30 日, 公司无限售条件流通股为 12,282,950,000 股, 有限售条件流通股为 781,250,000 股。

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 39、资本公积

单位：人民币元

	2021年12月31日	本期增加	本期减少	2022年6月30日
资本溢价(股本溢价)				
(1) 投资者投入的资本	74,932,781,994.07	-	-	74,932,781,994.07
(2) 其他	(18,865,809.93)	-	7,337,104.91	(26,202,914.84)
合计	74,913,916,184.14	-	7,337,104.91	74,906,579,079.23

### 40、其他综合收益

单位：人民币元

项目	2021年12月31日		本期发生金额		2022年6月30日
	归属于母公司股东的其他综合收益	本期所得税前发生额	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益	
1、不能重分类进损益的其他综合收益	(45,227,996.70)	(979,648,375.05)	-	(291,639,688.25)	(427,516,396.93)
其中：重新计量设定受益计划变动额	(85,950,035.50)	55,465,679.89	-	-	(30,484,355.61)
其他权益工具投资公允价值变动	40,722,038.80	(1,035,114,054.94)	-	(291,639,688.25)	(397,032,041.32)
2、以后将重分类进损益的其他综合收益	(612,450,323.89)	795,447,683.51	16,262,990.07	-	(820,896,421.35)
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	(6,361,998.26)	4,365,114.58	-	-	(1,996,883.68)
其他债权投资公允价值变动和信用减值准备	348,429,554.74	8,382,395.21	16,262,990.07	-	343,983,392.66
现金流量套期	18,567,039.28	22,457,907.79	-	-	52,165,188.49
外币财务报表折算差额	(962,857,440.70)	760,242,265.93	-	-	(1,204,820,639.87)
其他	(10,227,478.95)	-	-	-	(10,227,478.95)
其他综合收益合计	(657,678,320.59)	(184,200,691.54)	16,262,990.07	(291,639,688.25)	(1,248,412,818.28)

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 41、盈余公积

单位：人民币元

项目	2021年12月31日	本期增加	本期减少	2022年6月30日
法定盈余公积	8,693,605,698.21	-	-	8,693,605,698.21
合计	8,693,605,698.21	-	-	8,693,605,698.21

### 42、一般风险准备

单位：人民币元

项目	2021年12月31日	本期增加	本期减少	2022年6月30日
一般风险准备	10,484,586,397.76	59,458,749.87	-	10,544,045,147.63
交易风险准备	9,135,018,002.96	-	-	9,135,018,002.96
合计	19,619,604,400.72	59,458,749.87	-	19,679,063,150.59

### 43、未分配利润

单位：人民币元

项目	2022年1-6月	2021年度
期 / 年初未分配利润	47,504,315,755.70	41,222,398,224.28
加：本期归属于母公司股东的净利润	4,757,725,335.07	12,826,517,065.48
其他	-	110,505,046.78
减：提取法定盈余公积 (注 1)	-	1,030,433,572.84
提取一般风险准备 (注 1)	59,458,749.87	2,358,621,008.00
应付普通股股利 (注 2)	3,919,260,000.00	3,266,050,000.00
其他	297,616,314.53	-
期 / 年末未分配利润	47,985,706,026.37	47,504,315,755.70

注 1：本公司每年末对税后净利润根据《公司法》规定计提 10% 法定盈余公积，根据《金融企业财务规则》计提 10% 一般风险准备，根据《证券法》计提 10% 交易风险准备。一般风险准备还包括本公司下属子公司根据所属行业或所属地区适用法规提取的一般风险准备。

注 2：根据海通证券 2022 年 6 月 21 日召开的 2021 年股东大会审议批准向全体股东宣派 2021 年度现金股利每 10 股人民币 3.00 元 (含税)，宣派总额为人民币 39.19 亿元 (含税)。于 2022 年 7 月 28 日，该现金股利已发放。

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 44、手续费及佣金净收入

(1) 按类别列示

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
<b>证券经纪业务净收入</b>	2,250,206,979.99	2,355,596,659.65
——证券经纪业务收入	3,067,020,881.96	3,328,721,209.19
其中：代理买卖证券业务	2,430,237,793.13	2,672,958,766.75
交易单元席位租赁	455,054,708.28	512,902,621.48
代销金融产品业务	181,728,380.55	142,859,820.96
——证券经纪业务支出	816,813,901.97	973,124,549.54
其中：代理买卖证券业务	816,813,901.97	973,124,549.54
<b>期货经纪业务净收入</b>	223,800,674.93	269,126,015.62
——期货经纪业务收入	917,867,206.23	1,199,576,989.51
——期货经纪业务支出	694,066,531.30	930,450,973.89
<b>投资银行业务净收入</b>	2,434,751,965.24	2,524,747,356.00
——投资银行业务收入	2,459,952,506.95	2,571,577,276.15
其中：证券承销业务	2,314,001,827.53	2,324,436,550.77
证券保荐业务	33,201,886.79	68,467,924.51
财务顾问业务	112,748,792.63	178,672,800.87
——投资银行业务支出	25,200,541.71	46,829,920.15
其中：证券承销业务	10,977,282.09	25,596,275.31
证券保荐业务	-	-
财务顾问业务	14,223,259.62	21,233,644.84
<b>资产管理业务净收入</b>	220,901,159.11	863,690,952.73
——资产管理业务收入	220,901,159.11	863,690,952.73
——资产管理业务支出	-	-
<b>基金管理业务净收入</b>	865,570,714.02	969,217,116.46
——基金管理业务收入	887,153,810.12	982,202,426.37
——基金管理业务支出	21,583,096.10	12,985,309.91
<b>投资咨询业务净收入</b>	90,387,916.88	112,764,785.90
——投资咨询业务收入	90,387,916.88	112,764,785.90
——投资咨询业务支出	-	-
<b>其他手续费及佣金净收入</b>	55,060,976.40	70,034,074.52
——其他手续费及佣金收入	56,027,288.07	72,764,327.09
——其他手续费及佣金支出	966,311.67	2,730,252.57
<b>合计</b>	<b>6,140,680,386.57</b>	<b>7,165,176,960.88</b>
其中：手续费及佣金收入合计	7,699,310,769.32	9,131,297,966.94
手续费及佣金支出合计	1,558,630,382.75	1,966,121,006.06

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 44、手续费及佣金净收入 (续)

(2) 财务顾问业务净收入按类别列示

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
并购重组财务顾问业务净收入 - 境内上市公司	3,350,943.40	7,386,792.50
并购重组财务顾问业务净收入 - 其他	7,755,833.32	35,224,277.31
其他财务顾问业务净收入	87,418,756.29	114,828,086.22
合计	98,525,533.01	157,439,156.03

### 45、利息净收入

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
<b>利息收入</b>		
其中：货币资金及结算备付金利息收入	1,774,837,922.24	1,485,798,226.91
融出资金利息收入	2,321,896,271.42	2,638,593,143.87
买入返售金融资产利息收入	1,016,331,185.11	1,119,155,273.72
其中：约定购回利息收入	6,776,394.14	6,067,213.83
股权质押回购利息收入	922,279,353.40	933,935,505.42
债权投资利息收入	50,015,024.55	17,373,148.57
其他债权投资利息收入	665,731,905.38	311,083,315.96
长期应收款利息收入	1,937,065,265.24	1,248,140,123.09
贷款和应收款利息收入	487,593,240.22	678,899,566.93
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	4,984,213.36	384,514.73
小计	8,258,455,027.52	7,499,427,313.78
<b>融资租赁收入</b>	1,280,942,435.03	1,771,580,592.67
<b>收入合计</b>	<b>9,539,397,462.55</b>	<b>9,271,007,906.45</b>
<b>利息支出</b>		
其中：借款利息支出	1,217,833,733.16	1,325,051,134.63
应付短期融资款利息支出	215,682,586.53	190,468,800.92
拆入资金利息支出	184,162,019.95	166,732,695.48
其中：转融通利息支出	126,416,666.44	78,267,777.68
卖出回购金融资产款利息支出	981,576,191.06	718,687,832.20
其中：报价回购利息支出	5,881,903.68	2,085,130.96
代理买卖证券款利息支出	377,405,785.91	255,851,237.26
应付债券利息支出	3,004,959,366.45	2,889,587,603.07
其中：次级债券利息支出	145,213,008.20	143,693,373.52
租赁负债利息支出	20,911,676.90	20,268,884.87
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	448,778,118.75	342,401,807.81
<b>支出合计</b>	<b>6,451,309,478.71</b>	<b>5,909,049,996.24</b>
<b>利息净收入</b>	<b>3,088,087,983.84</b>	<b>3,361,957,910.21</b>

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 46、投资收益

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
权益法核算的长期股权投资收益	303,592,418.25	624,744,561.18
处置长期股权投资产生的投资收益	10,292.93	-
金融工具投资收益	(665,885,395.46)	5,465,044,282.25
(1) 持有期间取得的收益	2,479,827,496.37	3,865,514,934.74
交易性金融工具	2,411,790,376.68	2,863,734,300.43
其他权益工具投资	68,037,119.69	1,001,780,634.31
(2) 处置金融工具取得的收益	(3,145,712,891.83)	1,599,529,347.51
交易性金融工具	(1,522,296,576.67)	1,414,991,574.06
其他债权投资	33,523,153.34	(771,469,867.92)
衍生金融工具	(1,632,231,821.82)	1,176,095,185.11
其他	(24,707,646.68)	(220,087,543.74)
合计	(362,282,684.28)	6,089,788,843.43

### 47、其他收益

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
政府补助 / 财政补贴	676,499,337.97	543,328,270.87
其他	45,256,281.01	18,163,617.70
合计	721,755,618.98	561,491,888.57

### 48、公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产	(1,399,212,330.35)	1,658,547,256.68
衍生金融工具	1,759,124,861.26	201,306,930.05
交易性金融负债	998,397,619.83	(535,723,229.31)
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	983,274,419.83	(319,797,704.27)
合计	1,358,310,150.74	1,324,130,957.42

### 49、其他业务收入

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
服务收入	488,559,145.68	588,160,675.03
大宗商品销售收入	479,251,903.46	3,974,659,849.42
出租收入	267,556,463.23	239,302,793.83
其他	258,767,292.21	116,572,431.33
合计	1,494,134,804.58	4,918,695,749.61



## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 50、税金及附加

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
城建税	55,062,336.06	47,561,376.74
教育费附加及地方教育费附加	39,614,626.20	34,107,032.09
房产税	34,141,633.07	42,508,985.15
印花税	8,146,792.25	8,551,319.97
其他	19,729,119.90	18,897,040.55
合计	156,694,507.48	151,625,754.50

### 51、业务及管理费

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
职工费用	3,488,369,344.03	4,299,088,761.77
固定资产折旧费	257,916,071.96	226,877,149.37
使用权资产折旧	211,186,006.76	226,784,962.77
咨询费	149,542,713.78	242,643,795.14
电子设备运转费	127,629,904.60	167,257,055.72
证券投资者保护基金	120,451,346.18	54,084,563.68
无形资产摊销	104,151,492.91	108,083,698.43
聘请中介机构费	94,875,828.17	124,216,390.99
基金销售费	92,067,593.24	170,950,676.72
公杂费	70,786,500.35	60,184,466.73
其他	539,146,847.24	759,084,224.38
合计	5,256,123,649.22	6,439,255,745.70

### 52、信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
货币资金	553,469.16	6,806,446.10
融出资金	312,634,624.45	284,991,225.44
应收款项	28,353,884.73	36,791,981.38
其他应收款	14,992,734.30	9,207,814.19
买入返售金融资产	(822,810,248.48)	(133,367,815.25)
发放贷款和垫款	(2,561,733.73)	(13,275,186.70)
应收融资租赁款	639,862,163.61	497,562,425.52
长期应收款	145,586,531.79	131,908,287.34
其他贷款和应收款项	(82,843,221.96)	160,972,785.61
其他债权投资	(54,550,425.13)	37,699,962.52
债权投资	1,238,060.90	3,324,602.08
其他金融资产	(1,792,861.06)	2,142,593.52
合计	178,662,978.58	1,024,765,121.75

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 53、其他业务成本

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
大宗商品销售成本	474,761,005.95	3,918,072,326.46
出租成本	105,619,523.82	107,176,216.15
其他	61,826,132.88	152,122,995.97
合计	642,206,662.65	4,177,371,538.58

### 54、营业外收入

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额	计入本期非经常性损益的金额
非流动资产处置利得	356,678.95	620,435.54	356,678.95
其他	53,776,876.60	51,431,811.68	53,776,876.60
合计	54,133,555.55	52,052,247.22	54,133,555.55

### 55、营业外支出

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额	计入本期非经常性损益的金额
非流动资产处置损失	1,008,363.60	1,510,146.99	1,008,363.60
捐赠支出	9,416,440.03	18,787,040.60	9,416,440.03
其他	2,395,865.05	4,945,612.84	2,395,865.05
合计	12,820,668.68	25,242,800.43	12,820,668.68

### 56、所得税费用

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
当期所得税费用	883,632,598.67	1,970,154,153.83
递延所得税费用	537,071,102.60	802,055,922.83
合计	1,420,703,701.27	2,772,210,076.66

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 57、现金流量表项目注释

#### (1) 收到的其他与经营活动有关的现金

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
其他业务收入	1,494,134,804.58	4,918,695,749.61
发放的其他贷款和应收款项净额	6,814,354,141.89	5,821,033,381.93
吸收存款的增加	433,583,111.16	926,111,787.75
营业外收入及其他收益	775,532,495.58	612,923,700.25
其他	483,232,096.99	1,518,125,208.54
合计	10,000,836,650.20	13,796,889,828.08

#### (2) 支付的其他与经营活动有关的现金

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
存出保证金增加	2,387,543,382.89	1,819,351,492.88
其他业务成本	536,587,138.82	4,070,195,322.43
日常经营费用等	1,171,875,328.81	1,478,786,715.61
融资租赁支付的款项净额	2,549,137,675.22	125,214,408.58
其他	1,767,686,937.25	5,704,751,447.55
合计	8,412,830,462.99	13,198,299,387.05

#### (3) 支付其他与筹资活动有关的现金

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
偿还租赁负债款	211,223,664.97	245,567,799.91
发行债券支付的承销费用等	92,731,477.73	149,688,461.16
子公司购买股份用于股份奖励计划	14,679,529.20	-
少数股东收回投资款	406,542,604.73	-
合计	725,177,276.63	395,256,261.07

## 四、合并财务报表项目附注 (续)

### 58、现金流量表补充资料

#### (1) 现金流量表补充资料

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
1、将净利润调节为经营活动现金流量		
净利润	4,465,360,883.37	8,888,739,650.98
加：信用减值损失	178,662,978.58	1,024,765,121.75
其他资产减值损失	25,910,800.78	44,083,145.76
固定资产及投资性房地产折旧	363,535,595.79	334,053,365.53
使用权资产折旧	211,186,006.76	226,784,962.77
无形资产摊销	104,151,492.91	108,083,698.43
长期待摊费用摊销	55,528,203.78	54,225,569.40
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失	651,684.65	889,711.45
公允价值变动收益	(1,358,310,150.74)	(1,324,130,957.42)
利息净支出	3,743,640,433.11	4,096,919,958.96
汇兑损失	297,909,682.71	383,061,199.34
投资收益	(625,295,662.42)	(868,132,432.24)
递延所得税资产减少	892,467,651.65	102,224,259.92
递延所得税负债 (减少)/增加	(355,396,549.09)	549,222,758.41
交易性金融资产等的减少	21,270,272,619.58	11,260,721,849.34
经营性应收项目的减少/(增加)	3,923,452,952.09	(122,132,370.80)
经营性应付项目的(减少)/增加	(15,880,054,910.29)	9,999,038,715.81
经营活动产生的现金流量净额	17,313,673,713.22	34,758,418,207.39
2、不涉及现金收支的重大投资和筹资活动		
债务转为资本	-	-
一年内到期的可转换公司债券	-	-
融资租入固定资产	-	-
3、现金及现金等价物净变动情况		
现金的期末余额	198,597,821,990.06	163,910,554,977.90
减：现金的年初余额	175,257,907,676.68	137,311,262,918.57
加：现金等价物的期末余额	-	-
减：现金等价物的年初余额	-	-
现金及现金等价物净增加额	23,339,914,313.38	26,599,292,059.33

#### (2) 现金和现金等价物的构成

单位：人民币元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
现金	198,597,821,990.06	175,257,907,676.68
其中：库存现金	348,829.39	312,951.79
可随时用于支付的银行存款	179,058,543,530.45	154,942,203,221.11
可随时用于支付的其他货币资金	2,872,184.57	265,538,587.62
存放中央银行款项	4,429,530,917.84	3,284,435,395.44
结算备付金	15,106,526,527.81	16,765,417,520.72
现金等价物	-	-
现金及现金等价物合计	198,597,821,990.06	175,257,907,676.68

## 四、合并财务报表项目附注（续）

### 59、所有权或使用权受到限制的资产

所有权或使用权受到限制的资产，具体参见附注四、1 货币资金，7 买入返售金融资产，8 交易性金融资产，9 债权投资，10 其他债权投资，11 其他权益工具投资，12 应收融资租赁款及长期应收款，以及 15 固定资产。

### 60、金融资产转移

#### (1) 资产支持证券

本集团发行了以应收融资租赁款和长期应收款为基础资产的资产支持证券。由于本集团持有全部的次级资产并对该资产支持证券提供差额支付承诺，该等资产支持证券的基础资产不符合金融资产终止确认条件，本集团未终止确认已转移的应收融资租赁款和长期应收款，并将收到的对价确认为金融负债。

截至 2022 年 6 月 30 日，本集团未予终止确认的已转移应收融资租赁款和长期应收款的账面价值为人民币 83.16 亿元（2021 年 12 月 31 日：人民币 93.38 亿元）。

#### (2) 资产支持票据

本集团发行了以应收融资租赁款和长期应收款为基础资产的资产支持票据。由于本集团持有全部的次级资产并对该资产支持票据提供差额支付承诺，该等资产支持票据的基础资产不符合金融资产终止确认条件，本集团未终止确认已转移的应收融资租赁款和长期应收款，并将收到的对价确认为金融负债。

截至 2022 年 6 月 30 日，本集团未予终止确认的已转移应收融资租赁款和长期应收款的账面价值为人民币 13.99 亿元（2021 年 12 月 31 日：人民币 22.76 亿元）。

#### (3) 融出证券

本集团与客户订立协议，融出股票及基金予客户，以客户的证券或押金为抵押，由于本集团仍保留有关证券的全部风险，因此并未于资产负债表终止确认该等证券。于 2022 年 6 月 30 日，上述转让资产的账面价值为人民币 38.69 亿元（2021 年 12 月 31 日：人民币 50.62 亿元）。

## 五、合并范围的变更

### 1、非同一控制下企业合并

公司本期无通过非同一控制下企业合并取得的子公司。

## 五、合并范围的变更 (续)

### 2、同一控制下企业合并

公司本期无通过同一控制下企业合并取得的子公司。

## 六、在其他主体中的权益

### 1、在子公司中的权益

(1) 企业集团的重要子公司

子公司全称	注册及 营业地	注册资本	业务性质	年末实际出资额	持股比例 (%)		取得方式
					直接	间接	
海富通基金管理有限公司	上海	人民币 30,000 万元	基金管理	人民币 6,700 万元	51.00		设立或投资等方式
海富通资产管理 (香港) 有限公司	香港	港币 6,000 万元	资产管理	港币 6,000 万元		51.00	设立或投资等方式
上海富诚海富通资产管理有限公司	上海	人民币 20,000 万元	资产管理	人民币 20,000 万元		51.00	设立或投资等方式
海通开元投资有限公司	上海	人民币 750,000 万元	私募股权投资管理	人民币 750,000 万元	100.00		设立或投资等方式
海富产业投资基金管理有限公司	上海	人民币 10,000 万元	基金管理	人民币 6,365 万元		67.00	设立或投资等方式
海通吉禾私募股权投资基金管理有限责任公司	上海	人民币 5,000 万元	股权投资管理	人民币 2,550 万元		51.00	设立或投资等方式
海通创新私募基金管理有限公司	上海	人民币 5,000 万元	股权投资管理	人民币 2,550 万元		51.00	设立或投资等方式
海通创意私募基金管理有限公司	上海	人民币 12,000 万元	股权投资管理	人民币 6,390 万元		53.25	设立或投资等方式
海通新能源私募股权投资管理有限公司	上海	人民币 5,000 万元	股权投资管理	人民币 2,550 万元		51.00	设立或投资等方式
海通并购资本管理 (上海) 有限公司	上海	人民币 10,000 万元	股权投资管理	人民币 5,100 万元		51.00	设立或投资等方式
上海海通旭禹股权投资有限公司	上海	人民币 35,000 万元	股权投资	人民币 35,000 万元		100.00	设立或投资等方式
海通新创投资管理有限公司	上海	人民币 10,000 万元	股权投资管理	人民币 600 万元		60.00	设立或投资等方式
上海海通创世投资管理有限公司	上海	人民币 100 万元	股权投资管理	人民币 100 万元		53.25	设立或投资等方式
海通创新证券投资有限公司	上海	人民币 1,150,000 万元	金融产品投资、 股权投资、证券投资	人民币 1,465,000 万元	100.00		设立或投资等方式
上海海通证券资产管理有限公司	上海	人民币 220,000 万元	证券资产管理	人民币 220,000 万元	100.00		设立或投资等方式
上海惟泰置业管理有限公司	上海	人民币 1,000 万元	物业管理、房地 产开发经营、 餐饮企业管理	人民币 75,607 万元	100.00		收购
上海泽春投资发展有限公司	上海	人民币 10,000 万元	实业投资、房地 产开发与经营、 投资管理	人民币 86,834 万元	100.00		收购
海通国际控股有限公司	香港	港币 1,117,973 万元	投资控股	港币 1,117,973 万元	100.00		设立或投资等方式
Haitong Investment Ireland PLC	爱尔兰	欧元 825,000 元	非银行金融公司	港币 10,451 万元		100.00	非同一控制下企业合并
海通期货股份有限公司	上海	人民币 130,150 万元	期货代理	人民币 172,861 万元	73.83		非同一控制下企业合并

## 六、在其他主体中的权益 (续)

### 1、在子公司中的权益 (续)

#### (1) 企业集团的重要子公司 (续)

子公司全称	注册及营业地	注册资本	业务性质	年末实际出资额	持股比例 (%)		取得方式
					直接	间接	
上海海通资源管理有限公司	上海	人民币 100,000 万元	资源管理	人民币 70,000 万元	73.83		非同一控制下企业合并
海通期货香港有限公司	香港	港币 7,000 万元	期货经纪	港币 7,000 万元	73.83		非同一控制下企业合并
海通国际证券集团有限公司 *	百慕达	港币 66,416 万元	投资控股	港币 1,456,688 万元	65.76		非同一控制下企业合并
海通国际投资经理有限公司	香港	港币 4,700 万元	资产管理	港币 4,700 万元	65.76		非同一控制下企业合并
海通国际资产管理有限公司	香港	港币 1,300 万元	资产管理	港币 1,300 万元	65.76		非同一控制下企业合并
海通国际资产管理 (香港) 有限公司	香港	港币 2,000 万元	资产管理	港币 2,000 万元	65.76		非同一控制下企业合并
海通国际证券有限公司	香港	港币 1,150,000 万元	经纪业务	港币 1,150,000 万元	65.76		非同一控制下企业合并
海通国际证券代理人有限公司	香港	港币 2 元	经纪业务	港币 2 元	65.76		非同一控制下企业合并
海通国际期货有限公司	香港	港币 40,000 万元	经纪业务	港币 40,000 万元	65.76		非同一控制下企业合并
海通国际金融产品有限公司	香港	港币 5,000 万元	FICC 及衍生品	港币 5,000 万元	65.76		非同一控制下企业合并
海通国际金融服务有限公司	香港	港币 100 万元	FICC 及衍生品	港币 100 万元	65.76		非同一控制下企业合并
海通国际融资 (香港) 有限公司	香港	港币 1,000 万元	企业融资	港币 1,000 万元	65.76		非同一控制下企业合并
海通国际资本有限公司	香港	港币 2,000 万元	企业融资	港币 2,000 万元	65.76		非同一控制下企业合并
海通国际研究有限公司	香港	港币 100 万元	研究服务	港币 100 万元	65.76		非同一控制下企业合并
Haitong International (Japan) K.K.	日本	日元 1,000 万元	研究服务	日元 1,000 万元	65.76		非同一控制下企业合并
Haitong International (UK) Limited	英国	英镑 8,334,563 元	研究服务	英镑 8,334,563 元	65.76		非同一控制下企业合并
Haitong International Securities (USA) Inc.	美国	美元 12,654,319 元	研究服务	美元 12,654,319 元	65.76		非同一控制下企业合并
Haitong International Securities Group (Singapore) Pte Ltd.	新加坡	新加坡元 730,550,721 元	投资控股	新加坡元 730,550,721 元	65.76		非同一控制下企业合并
Haitong Securities India Private Limited	印度	印度卢比 260,732,520 元	证券业务	印度卢比 260,732,520 元	65.76		非同一控制下企业合并
Haitong International Securities (Australia) Pty Ltd.	澳大利亚	澳元 1,380,435 元	经纪业务	澳元 1,380,435 元	65.76		非同一控制下企业合并
Haitong International Securities (UK) Limited	英国	英镑 560 元	企业融资咨询	英镑 560 元	65.76		非同一控制下企业合并
Haitong Securities USA LLC	美国	美元 13,738,443 元	企业融资	美元 13,738,443 元	65.76		非同一控制下企业合并
演天资讯科技 (深圳) 有限公司	深圳	港币 1,000 万元	提供软件开发服务	港币 1,000 万元	65.76		非同一控制下企业合并
海通恒信金融集团有限公司	香港	港币 414,616 万元	投资控股	港币 822,709 万元	100.00		非同一控制下企业合并
海通恒信国际融资租赁股份有限公司 *	上海	人民币 823,530 万元	租赁	人民币 648,374 万元	85.00		非同一控制下企业合并
海通恒信国际融资租赁 (天津) 有限公司	天津	人民币 21,000 万元	租赁	人民币 21,000 万元	85.00		非同一控制下企业合并
上海泛圆投资发展有限公司	上海	人民币 10,000 万元	物业管理、单位后勤管理服务、餐饮管理	人民币 10,000 万元	85.00		非同一控制下企业合并
海通恒运融资租赁 (上海) 有限公司	上海	人民币 136,000 万元	租赁	人民币 120,000 万元	85.00		非同一控制下企业合并

## 六、在其他主体中的权益 (续)

### 1、在子公司中的权益 (续)

#### (1) 企业集团的重要子公司 (续)

子公司全称	注册及 营业地	注册资本	业务性质	年末实际出资额	持股比例 (%)		取得方式
					直接	间接	
海通恒信租赁 (香港) 有限公司	香港	美元 25,315 万元	租赁	美元 25,315 万元		85.00	非同一控制下企业合并
海通恒信小微融资租赁 (上海) 有限公司	上海	人民币 150,000 万元	租赁	人民币 155,000 万元		85.00	非同一控制下企业合并
Haitong Bank, S.A.	葡萄牙	欧元 84,477 万元	银行	港币 780,163 万元		100.00	非同一控制下企业合并
Haitong Global Asset Management, SGOIC, S.A.	葡萄牙	欧元 2,500 万元	资产管理	欧元 4,266 万元		100.00	非同一控制下企业合并
Haitong Ancillary Services Poland SP Zoo	波兰	兹罗提 1,095 万元	物业管理服务型公司	兹罗提 999 万元		100.00	非同一控制下企业合并
Haitong Banco de Investimento do Brasil S.A.	巴西	雷亚尔 42,000 万元	投资银行	雷亚尔 54,570 万元		80.00	非同一控制下企业合并
Haitong Negócios, SA	巴西	雷亚尔 11,138 万元	投资控股	雷亚尔 14,005 万元		80.00	非同一控制下企业合并
Haitong Securities do Brasil Corretora de Câmbio Valores Mobiliários S.A.	巴西	雷亚尔 10,000 万元	证券经纪	雷亚尔 3,434 万元		80.00	非同一控制下企业合并
Haitong do Brasil Distribuidora de Títulos Valores Mobiliários S.A.	巴西	雷亚尔 5,190 万元	资产管理	雷亚尔 5,174 万元		80.00	非同一控制下企业合并

\* 海通国际证券集团有限公司和海通恒信国际融资租赁股份有限公司均为香港上市公司，其所控制的子公司均被纳入合并范围。

#### (2) 重要的非全资子公司

单位：人民币亿元

子公司全称	持股比例 (%)	少数股东持股比例 (%)	本期归属于少数股东的损益	本期向少数股东宣告分派的股利	期末少数股东权益余额
海通国际证券集团有限公司	65.76	34.24	(4.85)	-	74.29
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	85.00	15.00	1.08	0.36	23.95

#### (3) 重要非全资子公司的主要财务信息

单位：人民币百万元

项目	海通国际证券集团有限公司		海通恒信国际融资租赁股份有限公司	
	期末余额	年初余额	期末余额	年初余额
流动资产	73,151.02	75,711.32	59,164.19	61,867.27
非流动资产	14,317.19	10,129.81	57,027.39	52,874.04
资产合计	87,468.21	85,841.13	116,191.58	114,741.31
流动负债	53,267.13	51,509.31	56,297.26	57,562.34
非流动负债	12,261.67	11,826.19	42,024.79	39,559.33
负债合计	65,528.80	63,335.50	98,322.05	97,121.67



## 六、在其他主体中的权益 (续)

### 1、在子公司中的权益 (续)

#### (3) 重要非全资子公司的主要财务信息 (续)

单位：人民币百万元

项目	海通国际证券集团有限公司		海通恒信国际融资租赁股份有限公司	
	本期发生额	上期发生额	本期发生额	上期发生额
营业收入	74.86	3,119.34	4,228.83	4,238.75
净利润	(1,396.69)	900.38	764.87	685.04
综合收益总额	(1,557.58)	914.84	846.42	722.14
经营活动现金流量	(2,848.23)	5,728.79	24.65	994.66

### 2、在合营企业或联营企业中的权益

#### (1) 重要的合营企业或联营企业

联营企业名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例 (%)		对联营企业投资的会计处理方法
				直接	间接	
富国基金管理有限公司	上海	上海	基金管理	27.775	-	权益法

#### (2) 重要联营企业的主要财务信息

单位：人民币百万元

富国基金管理有限公司	期末余额 / 本期发生额	年初余额 / 上期发生额
资产总额	12,243.85	12,646.26
负债总额	5,456.88	5,597.22
归属于母公司股东权益总额	6,786.97	7,049.04
营业收入	3,772.56	3,998.34
净利润	1,122.21	1,241.94
其他综合收益	15.72	(2.58)
综合收益总额	1,137.93	1,239.36
本期收到的来自联营企业的股利	388.85	200.54

## 六、在其他主体中的权益 (续)

### 2、在合营企业或联营企业中的权益 (续)

(3) 不重要合营企业和联营企业的汇总财务信息

单位：人民币百万元

	期末余额 / 本期发生额	年初余额 / 上期发生额
合营企业：		
投资账面价值合计	-	-
下列各项按持股比例计算的合计数		
—净利润	-	5.41
—其他综合收益	-	-
—综合收益总额	-	5.41
联营企业：		
投资账面价值合计	4,442.90	4,496.52
下列各项按持股比例计算的合计数		
—净利润 / (亏损)	(8.10)	281.67
—其他综合收益	-	-
—综合收益总额	(8.10)	281.67

### 3、在结构化主体中的权益

(1) 在纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

本集团合并了部分结构化主体,这些主体主要包括资产管理计划等。对于本集团持有的结构化主体,本集团评估其所持份额连同管理人报酬和信用增级及其他利益使其面临的可变回报的风险敞口是否足够重大,从而表明本集团为主要责任人。如果本集团担任主要责任人的角色,则需将这些结构化主体纳入合并范围。

本集团持有的上述纳入合并财务报表范围的结构化主体对本集团于 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日的财务状况及 2022 上半年及 2021 年度的经营成果和现金流量影响并不重大,因此,本集团未对这些被合并结构化主体的财务信息进行单独披露。

于 2022 年 6 月 30 日,本集团于所有合并结构化主体之直接权益的公允价值为人民币 333.09 亿元(2021 年 12 月 31 日:人民币 301.20 亿元)。该等本集团所有直接权益包括本集团于分级产品中认购的风险级产品,本集团作为风险级产品持有人为优先级产品持有人提供增信支持。于 2022 年 6 月 30 日,本集团认购的上述风险级产品公允价值为人民币 0.10 亿元(2021 年 12 月 31 日:人民币 3.71 亿元)。

(2) 在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

对于本集团持有的结构化主体,除上述已经合并的结构化主体以外,本集团认为,本集团所面临的可变回报并不重大。因此,本集团没有合并这些结构化主体。

## 六、在其他主体中的权益 (续)

### 3、在结构化主体中的权益 (续)

(2) 在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益 (续)

于 2022 年 6 月 30 日, 由本集团担任投资管理人且持有权益之未合并结构化主体的账面价值为人民币 132.25 亿元 (2021 年 12 月 31 日: 人民币 134.49 亿元), 本集团所面临风险敞口与账面价值相若。2022 年上半年, 本集团作为投资管理人, 于未纳入合并范围的结构化主体获取的管理费收入为人民币 9.64 亿元 (2021 年上半年: 17.22 亿元)。

除上述披露的本集团管理的未纳入合并范围的结构化主体中的权益之外, 本集团还在其不作为投资管理人的未纳入合并范围的结构化主体中享有权益。与本集团在结构化产品和信托产品有关的最大风险敞口接近于各自的账面价值。

## 七、关联方及关联交易

### 1、持有公司 5% 以上股份的股东情况

股东名称	关联关系	注册地	业务性质	注册资本	股东对本公司的持股比例 (%)	股东对本公司的表决权比例 (%)
上海国盛 (集团) 有限公司	第一大股东	上海市	商务服务	人民币 200.66 亿元	8.56%	8.56%

### 2、公司的子公司情况

本公司子公司的情况详见附注“六、1、在子公司中的权益”。

### 3、公司的合营和联营企业情况

本公司合营或联营企业详见附注“四、13、长期股权投资”。

### 4、其他关联方情况

其他关联方名称	其他关联方与本公司的关系
光明食品 (集团) 有限公司	重大影响
上海电气控股集团有限公司	重大影响

## 七、关联方及关联交易（续）

### 5、关联方交易

(1) 本公司与关联方之间的交易按照市场价格进行，无高于或低于正常交易价格的情况发生。

(2) 存在控制关系且已纳入本公司合并财务报表范围的子公司，其相互间交易及母子公司交易已作抵销。

(3) 向关联方收取的手续费及佣金收入

单位：人民币元

关联方名称	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
富国基金管理有限公司	佣金收入等	85,352,739.74	80,261,223.72
央视融媒体产业投资基金（有限合伙）	管理费收入等	34,382,075.47	-
辽宁海通新动能股权投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	12,735,849.06	12,735,849.06
辽宁中德产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	8,490,566.04	8,490,566.04
上海并购股权投资基金二期合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	7,095,169.01	7,438,356.15
吉林省现代农业和新兴产业投资基金有限公司	管理费收入等	4,261,222.34	12,404,505.79
西安航天新能源产业基金投资有限公司	管理费收入等	3,419,766.00	4,754,487.15
西安军融电子卫星基金投资有限公司	管理费收入等	2,465,419.93	4,505,456.06
广东南方媒体融合发展投资基金（有限合伙）	管理费收入等	2,127,155.71	2,087,951.74
安徽省皖能海通双碳产业并购投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	1,940,036.19	-
许昌海通创新股权投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	1,415,094.30	94,400.00
海通（吉林）股权投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	575,420.01	1,103,881.11
上海电气控股集团有限公司	佣金收入等	196,939.13	280,591.58
上海国盛（集团）有限公司	佣金收入等	86,335.61	624,531.44
上海并购股权投资基金合伙企业（有限合伙）	佣金收入等	20,811.90	12,939,114.87
嘉兴海通旭初股权投资基金合伙企业（有限合伙）	佣金收入等	11,226.04	2,442,452.76
海通兴泰（安徽）新兴产业投资基金（有限合伙）	管理费收入等	-	14,208,543.44
其他（注）	管理费收入等	47,794.44	941,515.50

注：“其他”包含西安航天海通创新新材料股权投资合伙企业（有限合伙）、上海文化产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）、海通（吉林）现代服务业创业投资基金合伙企业（有限合伙）。

(4) 向关联方收取的利息净收入

单位：人民币元

关联方名称	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
上海国盛（集团）有限公司	利息净收入	535,341.00	87,358.86
上海电气控股集团有限公司	利息净收入	193,030.49	134,877.62
其他（注）	利息净收入	400,748.70	47,341.35

注：“其他”包含西安航天新能源产业基金投资有限公司、上海并购股权投资基金二期合伙企业（有限合伙）、西安航天海通创新新材料股权投资合伙企业（有限合伙）、富国基金管理有限公司、上海并购股权投资基金合伙企业（有限合伙）、吉林省现代农业和新兴产业投资基金有限公司、嘉兴海通旭初股权投资基金合伙企业（有限合伙）、光明食品（集团）有限公司、广东南方媒体融合发展投资基金（有限合伙）、上海文化产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）、上海彤光投资管理合伙企业（有限合伙）、辽宁海通新能源低碳产业股权投资基金有限公司。

## 七、关联方及关联交易 (续)

### 5、关联方交易 (续)

#### (5) 向关联方收取的投资收益

单位：人民币元

关联方名称	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
上海国盛(集团)有限公司	投资收益	4,905,213.76	-

#### (6) 其他关联方交易

单位：人民币元

关联方名称	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
上海国盛(集团)有限公司	公允价值变动收益	(2,503,249.32)	(1,511,002.74)

#### (7) 关键管理人员薪酬

单位：人民币万元

项目	本期发生额	上期发生额
关键管理人员薪酬	1,804.14	1,839.35

### 6、关联方应收应付款项

#### (1) 应收关联方款项

单位：人民币元

项目名称	关联方名称	2022年6月30日	2021年12月31日
应收款项	辽宁海通新动能股权投资基金合伙企业(有限合伙)	13,520,000.00	20,000.00
应收款项	上海并购股权投资基金二期合伙企业(有限合伙)	7,500,000.00	-
应收款项	安徽省皖能海通双碳产业并购投资基金合伙企业(有限合伙)	2,056,438.36	-
应收款项	吉林省现代农业和新兴产业投资基金有限公司	760,000.00	-
应收款项	上海国盛(集团)有限公司	405,000.00	585,000.00
应收款项	上海文化产业股权投资基金合伙企业(有限合伙)	-	17,079,880.60
应收款项	其他(注)	70,000.00	20,000.00

注：“其他”包含许昌海通创新股权投资基金合伙企业(有限合伙)、辽宁中德产业股权投资基金合伙企业(有限合伙)。

## 七、关联方及关联交易（续）

### 6、关联方应收应付款项（续）

#### (2) 应付关联方款项

单位：人民币元

项目名称	关联方名称	2022年6月30日	2021年12月31日
代理买卖证券款	西安航天海通创新新材料股权投资合伙企业（有限合伙）	45,959,215.45	-
代理买卖证券款	上海并购股权投资基金二期合伙企业（有限合伙）	36,442,132.23	31,031.98
代理买卖证券款	上海电气控股集团有限公司	31,643,019.64	7,762,374.89
代理买卖证券款	嘉兴海通旭初股权投资基金合伙企业（有限合伙）	8,846,257.36	303,992.67
代理买卖证券款	西安航天新能源产业基金投资有限公司	825,118.58	150,000,100.02
代理买卖证券款	上海国盛（集团）有限公司	100.00	174,698,913.24
代理买卖证券款	其他（注）	49,449.07	1,096,465.83
应付款项	上海国盛（集团）有限公司	58,511,107.40	91,600,000.00
应付款项	西安军融电子卫星基金投资有限公司	2,700,000.00	-

注：“其他”包含吉林省现代农业和新兴产业投资基金有限公司、光明食品（集团）有限公司、广东南方媒体融合发展投资基金（有限合伙）、上海并购股权投资基金合伙企业（有限合伙）、富国基金管理有限公司、上海文化产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）、西安军融电子卫星基金投资有限公司、辽宁海通新能源低碳产业股权投资基金有限公司。

#### (3) 其他关联方款项

单位：人民币元

项目名称	关联方名称	2022年6月30日	2021年12月31日
衍生金融负债	上海国盛（集团）有限公司	1,554,000.00	-
衍生金融资产	上海国盛（集团）有限公司	-	949,249.32

## 八、风险管理

### 1、风险管理政策及组织架构

#### (1) 风险管理政策

公司始终注重风险防范与控制，确立了“务实、开拓、稳健、卓越”的经营理念，树立了“稳健乃至保守”的风险控制理念，经营管理实行合规优先、风险管理优先。公司严格按照有关法律法规和监管部门的要求，建立了完整有效的全面风险管理架构体系。公司时刻牢记合规底线，通过各类合规管理工具以及合规监测手段，防范合规风险和洗钱及恐怖融资风险；采用征信授信、久期分析、外汇敞口分析、风险价值分析、最短生存期和现金缺口分析、敏感性分析、压力测试等方法进行风险计量；建立了净资本等风控指标监控体系，稳健配置资产，规范各类业务流程，全面加强各类风险的事前防范、事中监控和事后控制管理。集团层面，公司将各境内外子公司的风险管理纳入统一体系，对其风险管理工作实行垂直管理，并每日开展风控指标并表管理，建立了集团 T+1 风险数据集市，强化子公司现场检查和风险考核，深入推进集团化风险管理全覆盖。

## 八、风险管理 (续)

### 1、风险管理政策及组织架构 (续)

#### (1) 风险管理政策 (续)

公司在使用金融工具时主要面临信用风险、市场风险及流动性风险。为有效管理上述风险,公司制定了风险管理政策和程序并严格落实,及时开展风险识别与评估,严格执行风险限额管理及内部控制流程,科学使用量化模型实施计量并审慎考虑模型局限性,完善专业风险管理信息系统和风险数据治理工作,为风险管理工作提供有效支撑。

#### (2) 风险治理组织架构

公司依据《公司法》、《证券法》、《证券公司内部控制指引》、《证券公司全面风险管理规范》等法规及公司规章制度要求,搭建了多层次的风险管理组织架构,明确了董事会、监事会、经营层、首席风险官、风险管理部门、业务及管理部门、分支机构、子公司等各层级在风险管理工作中的具体职责。

公司董事会是公司风险管理战略目标的制定者和授权人,负责审议批准公司风险管理的总体目标、基本政策和重要制度、公司整体风险偏好和风险容忍度、重大风险的解决方案、定期风险评估报告,监督公司风险管理政策的实施,任免考核首席风险官,建立与首席风险官的直接沟通机制,及公司章程规定的其他职责。公司董事会设合规与风险管理委员会,具体履行董事会风险管理职责。

公司监事会是公司风险管理和内部控制体系的监督者,负责对董事会、经理层建立和实施风险管理及内部控制的情况进行监督,并履行公司章程规定的其他职责。

公司经营层根据董事会的授权,负责建立责任明确、程序清晰的组织结构,制定公司风险管理的政策、规章和制度,贯彻执行公司整体风险偏好和风险容忍度政策,组织实施各类风险的识别、评估及应对工作,建立健全和有效执行风险管理制度和机制,及时处理或者改正存在的问题缺陷,审议处理公司重大风险事件,建立涵盖风险管理有效性的全员绩效考核体系,建立完备的信息技术系统和数据质量控制机制,及董事会授予的其他风险管理职责。

公司设首席风险官,由董事会聘任。首席风险官是负责公司全面风险管理工作的高级管理人员,负责组织实施董事会、经营层确定的风险管理政策、规章和制度,组织对公司建立健全各项业务风险管理制度进行督导、审查和评估,组织对公司风险管理政策和流程的执行情况进行监督和检查,对风险管理中存在的问题提出处理意见并督促整改,组织评估和完善风险管理的工具和方法,定期组织对公司面临主要风险水平及其管理状况进行评估,并向经营层、董事会及监管部门提交评估报告,组织对子公司风险管理工作负责人的提名和考核等。

公司设立风险管理部,在首席风险官的领导下履行风险管理职责,负责拟定公司风险管理的政策、规章和制度,督导公司各单位制定业务风险管理制度和流程,对相关业务的主要风险进行识别和评估,组织对各项业务风险管理制度执行情况的监督、检查,定期对公司整体风险水平及其风险管理状况进行评估和报告,对重大风险隐患或风险事件,及时报告并提出风险处置建议等。此外,公司合规法务部负责管理公司合规风险、洗钱及恐怖融资风险,公司资金管理总部负责管理公司流动性风险,公司总经理办公室负责管理公司声誉风险,公司信息技术管理部门负责管理公司信息技术风险。

## 八、风险管理（续）

### 1、风险管理政策及组织架构（续）

#### (2) 风险治理组织架构（续）

公司各部门、分支机构和子公司负责其经营管理范围内的风险管理工作，建立健全相应的风险管理制度和流程，落实公司风险管理政策，组织实施相应的风险管理工作。公司各部门、各分支机构和子公司负责人承担本单位风险管理有效性的直接责任。公司各部门、各分支机构和子公司指定专人负责本单位的风险管理工作，对风险管理政策和制度的执行情况进行监督、检查和报告，履行一线风险管理职责。

公司稽核部负责定期对公司风险管理工作进行稽核检查，定期评估风险管理体系的有效性，并根据评估结果提出改进建议。

各子公司规范运作，依法经营。公司通过各项机制将子公司风险管理纳入全面风险管理体系，从子公司风险管理负责人提名、风险限额与报告、重大事项审批、数据对接、风控指标并表、督导与检查、评价考核等方面落实对子公司的垂直风险管理。

### 2、信用风险管理

信用风险是指因融资人、交易对手方或债务发行人无法履行其约定的财务义务或信用资质发生不利变化而可能对本集团经营造成损失的风险。

#### A、存放在其他金融机构的自有货币资金、经纪业务相关风险

货币资金主要存放在国有商业银行或信誉良好的股份制商业银行，结算备付金存放在中国证券登记结算有限责任公司，此类现金及现金等价物面临的信用风险相对较低。经纪业务采取全额保证金结算，切实规避相关信用风险。

#### B、交易性融资业务相关风险

本集团开展的交易性融资业务主要包括：融资融券、股票质押式回购、孖展交易、约定购回式证券交易等。相关主体通过制定和实施各项严格的制度和措施，主要从尽职调查、内部评级、项目评审、授信管理、逐日盯市、限额监控、贷后跟踪、补充增信、平仓处置、司法追索和拨备计提等环节实施管控。

#### C、信用债券交易与投资业务相关风险

本集团注重通过分散投资控制集中度风险，投资标的主要倾向于高信用评级资产，在信用风险管理中密切跟踪投资标的的经营情况和信用评级变化，落实内部评级和统一授信管理机制，建立健全债务发行人、行业和地域集中度等信用风险监控指标，在投后跟踪中及时根据财务指标变动、重大风险事件和负面舆情等信息更新债务发行人内部评级和授信限额指标，动态调整交易策略。



## 八、风险管理 (续)

### 2、信用风险管理 (续)

#### D、融资租赁业务相关风险

本集团在开展融资租赁业务、支持实体经济发展时,坚持以行业与客户并重的策略确定信用风险管理政策。行业信用风险管理方面,本集团就融资租赁客户所处行业的景气程度施行动态跟踪和评估,以此为基础制定相应的行业投放政策、管控行业集中度风险。客户信用风险管控方面,本集团主要通过开展尽职调查、内部评级、授信审核、贷后资产巡检、风险预警与监测、集中度限额控制等措施对客户信用风险实施管控。

#### E、债券回购等同业短期拆借、场外衍生品业务相关风险

针对债券回购等同业短期拆借业务,本集团以交易对手准入和授信管理为抓手,审慎筛选信用资质良好的交易对手和信用等级较高的担保证券,从源头上控制信用风险水平。针对场外衍生品业务,本集团从交易对手准入和授信管理、标的证券管理、风险应对与处置等方面建立了完善的管理制度与流程,对存续期内的场外衍生品交易进行逐日盯市,并通过严格履行净额结算和履约保障等措施管理交易对手信用风险。本集团同业短期拆借和场外衍生品业务的交易对手主要是商业银行、证券公司、资产管理计划等主体,在开展此类业务的过程中,合理选择业务模式、严格控制业务规模并采取合理的风控措施。同时,本集团关注信用风险和市场风险之间的相关性,对市场波动背景下的信用风险采取必要的监控和应对措施,包括但不限于交易保证金安排、交易对手内部评级与授信管理、未来潜在风险暴露计量、错向风险识别等。

本集团根据行业监管政策、资本市场环境和集团业务发展战略,持续完善信用风险管理体系。报告期内,本集团以信用风险管理办法等制度为依据,全面落实以同一客户、同一业务为核心的信用风险识别、评估、计量、监控、报告及应对工作,包括以集团 T+1 风险数据集市为依托,对可覆盖母子公司业务的信用风险管理信息系统进行持续升级,通过提升风险识别、计量与压力测试能力持续完善资产质量、风险抵补和集中度风险等维度的信用风险限额体系,持续强化统一评级与集中授信管理机制,对信用评级和授信限额模型进行动态优化,搭建以云计算、区块链、大数据、人工智能等金融科技为支撑的客户关系图谱集团智能预警中心、舆情风险异动监控、违约预警监控、财报风险分析及高风险客户管控工具,强化信用类业务风险资产系统化管理程序,以此实现对集团整体信用风险状况和风险限额执行情况的有效跟踪和监控。本集团以 ESG 风险管理办法等制度为依据,建立健全客户 ESG 风险准入及跟踪监控机制,积极落实客户 ESG 尽职调查和 ESG 风险评估等工作。报告期内,本集团核心信用风险监控指标运行平稳,整体信用风险可控。

#### 预期信用损失计量

公司基于单项金融工具或金融工具组合,进行减值阶段划分,有效监控资产信用风险的情况,并定期进行调整。针对不同业务类型,公司制定明确的阶段划分标准,包括但不限于债务人主体的财务和运营情况、信用评级变动情况、担保资产变动情况、重大负面舆情、司法诉讼、逾期信息等因素,以全面揭示业务风险程度、动态反映债务人主体履约的可靠性,为减值阶段划分提供依据。公司金融工具减值共分为三个阶段:

## 八、风险管理 (续)

### 2、信用风险管理 (续)

#### 预期信用损失计量 (续)

##### ①第一阶段:

在资产负债表日信用风险较低的金融工具, 或初始确认后信用风险未显著增加的金融工具, 公司按照相当于该金融工具未来 12 个月内 (若预期存续期少于 12 个月, 则为预期存续期内) 预期信用损失的金额计量其损失准备。

##### ②第二阶段:

自初始确认后信用风险已显著增加的金融工具, 但未发生信用减值, 即不存在表明金融工具发生信用损失事件的客观证据, 公司按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

##### ③第三阶段:

初始确认后已发生信用减值的金融工具, 公司按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。金融工具已发生信用减值的证据包括但不限于以下可观察信息:

- 债务人发生重大财务困难;
- 债务人违反合同, 如: 偿付利息或本金违约或逾期超过 (含) 90 个自然日;
- 债务人很可能破产或进行其他财务重组;
- 因债务人财务困难导致相关金融资产的活跃市场消失;
- 债务人明显缺乏或已丧失清偿能力, 被法院指定管理人或已开始相关的诉讼程序;
- 债权人出于与债务人财务困难有关的经济或合同考虑, 给予债务人在其他任何情况下都不会做出的让步, 包括但不限于债务减免、以物抵债和债转股;
- 债务人已停止经营活动, 被有权机关依法注销、吊销营业执照;
- 债务人依法宣告破产、关闭、解散, 并终止法人资格。

金融工具发生信用减值时, 有可能是多个事件的共同作用所致, 未必是可单独识别的事件所致。

#### 信用风险显著增加的判断标准

在每个报告期末, 公司对除应收账款外的金融工具自初始确认之后信用风险是否显著增加作出评估。公司基于金融工具本身的性质以及债务人的风险因素, 对信用风险进行综合性评估考虑。当评估信用风险是否显著增加时, 本公司认为应考虑的因素包括但不限于以下几点:

## 八、风险管理 (续)

### 2、信用风险管理 (续)

#### 信用风险显著增加的判断标准 (续)

- 自初始确认后债务人实际或预期的内部信用风险级次显著下调, 或内部用于评估信用风险的行为评分显著下降;
- 初始确认时债务人在中国境内评级机构 AA 以上 (含) 的主体或债项评级发生下调, 且下调后等级在 AA 以下 (不含); 国际三大评级机构 BBB-/Baa3 以上 (含) 的主体或债项评级发生下调, 且下调后等级在 BBB-/Baa3 以下 (不含);
- 初始确认时债务人在中国境内评级机构 AA 以下的主体或债项评级发生下调; 国际三大评级机构 BBB-/Baa3 以下的主体或债项评级发生下调;
- 债务人未按照规定时间支付约定的款项, 既包括本金不能按时足额支付的情形, 也包括利息和其他合约项下的债务义务不能按时足额支付的情形, 且该类情形持续时间超过 (含) 30 个自然日;
- 作为债务抵押的担保物价值或第三方提供的担保的显著变化, 可能降低债务人按合同规定期限还款的经济动机, 或影响发生违约的概率; 例如, 若因质押证券的价值下跌而导致债务人的履约保障能力弱化, 债务人无法在合理时间内按照合同约定补充担保物或将有更大的动机拖欠债务;
- 预期将导致债务人按照合约规定履行债务义务的经济动机或能力发生显著变化的经营、财务或宏观经济状况的不利变化;
- 特定金融工具或具有相同预计存续期的类似金融工具的信用风险外部市场指标发生显著变化; 例如: 债务人的信用利差、针对债务人的信用违约互换价格或与债务人相关的其他市场信息;
- 担保人所提供的信用支持质量的实际或预期显著变化, 可能降低债务人按合同约定期限还款的经济动机; 例如, 若担保人不再向债务人提供财务支持而导致后者将面临破产或破产管理, 或导致该债务人有限支付经营所需款项 (如薪资和关键供货商款项), 而将金融负债的支付义务排在较低优先级, 导致这些负债违约发生的概率增加;
- 对于证券化中发行的债券, 其信用增级或支持的质量发生实际或预期的显著变化, 可能导致相关次级权益吸收预期信用损失的能力降低;
- 其他可表明金融工具预计存续期内违约风险的相对变化, 而非违约风险变动的绝对值的情形。

## 八、风险管理（续）

### 2、信用风险管理（续）

#### 信用风险显著增加的判断标准（续）

公司融资融券和股票质押式回购业务根据融资主体或合约的维持担保比例及担保证券处置难易程度等情况，综合考虑融资主体在报告期末的运营情况、还款能力、司法诉讼、逾期信息等因素，最终得出减值阶段划分结论。针对维持担保比例，公司参照融资主体在交易时的信用状况、担保证券所属板块、流动性、限售情况等因素，为不同融资主体或合约设置不同的预警线和平仓线。其中，预警线分布在 150%-170% 区间，平仓线分布在 130%-150% 区间。在评估减值阶段时，公司为审慎评估担保证券处置风险，根据担保证券处置难易程度确定不同融资主体或合约的穿仓警示线，穿仓警示线分布在 110%-平仓线之间。

- 维持担保比例高于或等于预警线的，划分为“第一阶段”；
- 维持担保比例介于预警线与穿仓警示线之间，或满足其他“信用风险显著增加”条件的，划分为“第二阶段”；
- 维持担保比例低于穿仓警示线，或存在其他“已发生信用减值”证据的，划分为“第三阶段”。

#### 预期信用损失计量的参数和估值技术

公司计量预期信用损失使用的关键输入值如下：

- 违约概率 (Probability of Default, PD)；
- 违约损失率 (Loss Given Default, LGD)；
- 违约风险敞口 (Exposure at Default, EAD)。

如上所述，关键参数通常来源于本公司内部开发的风险计量模型和其他历史数据，且通过调整以反映概率加权的前瞻性信息。

违约概率 PD 为在给定的时间范围内违约可能性的估计值，是在某一时间点上进行估计。违约损失率 LGD 为违约产生的损失的估计值，乃基于到期合同现金流量与本公司预期收到金额之间的差额，同时考虑担保品的预期未来可回收现金流量。违约风险敞口 EAD 为在某未来违约日期风险敞口的估计值，考虑了报告日后风险敞口的预期变动，如本金和利息还款、预期从承诺融资协议提用的贷款。

公司采取以违约概率 PD、违约损失率 LGD 和违约风险敞口 EAD 三项关键风险指标为基础的预期信用损失模型，用于第一阶段和第二阶段金融工具的减值准备计量，三项指标的乘积即为金融工具的预期信用损失。其中，违约概率 PD 是以内部或外部信用评级，或基于内部历史数据得出的迁徙率或滚动率为基础，经前瞻性调整后计量得到的。在评估违约损失率 LGD 时，公司充分考虑担保证券的预期处置周期和担保证券在预期处置周期内的价值波动影响，包括担保证券的可处置数量、日均交易量、流通受限条件、减持规则和历史波动性等因素，再考虑相关税费后得到担保证券的可回收现金流量。公司的违约风险敞口 EAD 反映了假设各类金融工具在相应计量期间发生违约时的未付余额。

## 八、风险管理 (续)

### 2、信用风险管理 (续)

#### 预期信用损失计量的参数和估值技术 (续)

针对第三阶段金融工具,公司全部采用单项减值测试方法评估预期信用损失。具体而言,公司根据单一项目的特定风险情况,在充分考虑债务人主体和担保证券标的上市公司的财务和经营可持续性状况、司法诉讼、减持限制、重大负面舆情、退市风险等因素的前提下,合理评估担保证券的处置变现价值;同时结合债务人主体提供的其他补充增信资产的估值情况,综合评判债务人主体的预期可回收现金流量,折现后预期仍不足以覆盖其风险敞口的部分计入减值准备。

#### 前瞻性信息

信用风险显著增加的评估及预期信用损失的计算均涉及前瞻性信息。

对于债券投资类金融资产,公司定性选取关键经济指标作为前瞻因子,识别出影响信用风险及预期信用损失的关键经济指标主要包括广义货币供应量(M2)同比增速等。对于融资类金融资产,违约概率前瞻采用回归分析方法,构建违约概率与宏观经济指标的相关性模型,利用该模型与预测的宏观经济指标来推断未来的违约概率变动情形。宏观经济指标包括但不限于国内生产总值(GDP)增速、广义货币供应量(M2)增速、固定资产投资完成额增速等,通过构建这些经济指标与业务风险特征之间的关系,最终实现对融资类金融资产的预期信用损失进行前瞻性调整。

除了提供基准经济情景外,公司管理层也结合市场预期提供了其他可能的情景及对应权重。公司针对主要业务或产品类别的风险特征设定不同的情景,以合理评估相关金融资产在不同经济情景下可能出现的风险变迁。公司在每一个资产负债表日重新评估情景的数量及其特征。

公司认为,对于公司的信用类金融资产组合,应当考虑应用乐观、基准及悲观这三种不同情景来合理反映选定经济指标对预期信用损失可能产生的影响。公司结合统计分析及专家判断来确定情景权重,也同时考虑了各情景所代表的可能结果的范围。目前本公司使用的基准情景权重超过其他情形权重之和。

公司以加权的12个月预期信用损失(阶段一)或加权的整个存续期预期信用损失(阶段二及阶段三)计量相关的损失准备。上述加权的信用损失是由各情景下,预期信用损失乘以相应情景的权重计算得出。

与其他经济预测类似,对预计经济指标和发生可能性的估计具有高度的固有不确定性,因此实际结果可能同预测存在重大差异。公司认为这些预测体现了公司对可能结果的最佳估计。

#### 敏感性分析

预期信用损失计量模型会使用到模型参数、前瞻性预测的宏观经济变量、经济场景权重及运用专家判断时考虑的其他因素等,上述参数、假设和判断的变化将对信用风险显著增加以及预期信用损失计量产生影响。公司每年定期对模型进行重检并根据具体情况对模型中使用的假设和参数进行适当的修正,本年对模型及参数的调整对预期信用损失结果的影响不重大。

## 八、风险管理（续）

### 2、信用风险管理（续）

#### 敏感性分析（续）

公司对前瞻性计量所使用的经济指标进行了敏感性分析，当乐观、悲观情景权重变动 10% 时，对公司已计提的预期信用损失的影响不重大。

同时，公司还对信用风险阶段分类进行了敏感性分析。于 2022 年 6 月 30 日，假设信用风险自初始确认后未发生显著变化，导致阶段二的金融工具全部进入阶段一，则对资产负债表中确认的预期信用损失影响不重大。

#### 担保物及其他信用增级措施

公司采用一系列政策和信用增级措施来降低信用风险敞口至可接受水平。其中，最为普遍的方法是提供抵押物或担保。公司根据交易对手的信用风险评估决定所需的担保物金额及类型。融出资金和买入返售协议下的担保物主要为股票、债券和基金等。公司定期检查担保物的市场价值，根据相关协议要求追加担保物，并在进行损失准备的充足性审查时监视担保物的市场价值变化。

#### 金融工具减值管理

为保证金融工具减值准备计提工作的有效性，公司建立了一套与金融工具信用风险管理目标相一致的减值准备计提政策和流程。公司已在各业务主管部门、风险管理部门和财务部门之间建立起相互制衡与协作的工作机制，并清晰划分各部门职责，以确保对金融工具信用风险的计量和信用减值准备的计提是及时、准确、合理的。公司经理层和被授权机构负责通过下述措施管理本公司的金融工具减值工作：

- 基于公司战略和风险偏好建立起一个权责分明、制度完善的金融工具信用风险管理架构，并及时进行调整；
- 组织并完善资产负债表日金融工具的减值评估工作，确保减值模型的验证、发展和维护得到有效保障；
- 评估本公司金融工具的减值状况和财务影响，并及时向董事会汇报；
- 复核确认本公司对于主要减值事件所作出的决策；
- 建立金融工具减值的综合化信息系统和数据质量控制机制；
- 董事会承诺的其他信用风险管理职责。

报告期内，公司以《海通证券股份有限公司金融工具减值管理办法》为基础，持续优化用于信用减值准备计量的预期信用损失模型，保证模型运行稳健，对信用风险变化的反应灵敏，预期信用损失的计量能够动态刻画债务人的信用资质变化、抵质押品估值变化、市场行情波动及宏观经济变动等因素的影响，各项金融工具减值管理相关政策和流程落实到位，为公司信用减值准备计提的合理性与时效性提供了保障。

## 八、风险管理 (续)

### 3、市场风险管理

市场风险主要指在本集团的经营活动中，因市场价格（股票价格、利率、汇率及商品价格等）的不利变动而使自有资金投资的相关业务发生损失的风险。

本集团采用风险价值 (VaR) 方法对各类投资金融工具及持仓组合的市场风险进行评估和分析。计量口径包含集团范围内以交易为目的的自有资金投资组合。集团所使用的风险价值模型置信度为 95%，目标期间为下个交易日。具体如下：

项目	2022 年上半年 VaR95%			
	本公司风险价值 (万元)	本集团风险价值 (万元)	本公司风险价值 / 公司净资产	本集团风险价值 / 集团净资产
报告期最高月末值	32,679.24	37,486.80	0.22%	0.20%
报告期最低月末值	21,295.32	24,378.83	0.15%	0.14%
报告期平均月末值	28,326.89	31,823.39	0.19%	0.18%
2022 年 6 月 30 日值	32,679.24	37,486.80	0.22%	0.20%

报告期内，公司各月月末风险价值占公司净资产比例以及集团风险价值占集团净资产比例始终处于 0.3% 以内，市场风险可控可承受。

本集团和本公司按风险类别分类的风险价值 (VaR) 分析概括如下：

单位：万元

项目	本集团		本公司	
	2022 年 6 月 30 日	2021 年 6 月 30 日	2022 年 6 月 30 日	2021 年 6 月 30 日
权益风险价值	34,896.80	38,517.73	31,074.65	33,067.04
利率风险价值	8,686.15	9,756.50	8,476.90	8,228.37
商品风险价值	1,526.05	1,320.10	258.94	461.51
汇率风险价值	1,631.70	5,278.24	316.29	800.93
整体组合风险价值	37,486.80	37,893.23	32,679.24	30,890.61

项目	本公司					
	2022 年上半年度			2021 年上半年度		
	平均	最高	最低	平均	最高	最低
权益风险价值	24,989.14	31,074.65	20,499.01	27,046.45	33,067.04	16,125.25
利率风险价值	8,496.29	10,219.68	7,340.96	7,231.15	8,533.24	5,410.90
商品风险价值	283.20	958.08	-	263.12	632.76	49.34
汇率风险价值	305.64	332.80	292.11	814.99	851.66	766.10
整体组合风险价值	28,326.89	32,679.24	21,295.32	25,551.99	30,890.61	15,445.21

## 八、风险管理（续）

### 3、市场风险管理（续）

#### (1) 股票价格风险

股票价格风险主要指集团所投资的权益类证券市场价格发生变化致使本集团承受损失的风险。承担此类风险的业务主要包括权益类证券自营业务、做市业务和场外衍生品业务等。

股票价格风险具有较大的不确定性，是本集团主要面对的市场风险类型之一。集团密切关注相关资产价格波动，并采取相应措施予以防范，通过每日跟踪证券持仓的投资规模和风险价值 (VaR) 变化情况进行监测和管控。集团通过实施多元化投资策略，对各类证券品种的投资规模进行适当控制和适时调整，并结合各类套期保值工具，较为有效地控制了市场风险。

#### (2) 利率风险

利率风险是指因市场收益率曲线或信用价差等因素变动导致的风险，承担此类风险的业务主要包括债券投资业务和利率衍生品业务等。本集团对利率风险的控制，主要采用规模控制和投资组合等方法，合理配置资产，匹配负债与资产的期限结构，并通过定期测算投资组合久期、凸性、DV01 等指标衡量利率风险。

#### (3) 汇率风险

汇率风险是指因外汇汇率变动而导致的风险。报告期内，集团国际化布局不断完善，面对复杂多变的境外市场，主动降低境外资产杠杆水平，整体外币资产规模有所减少，汇率风险敞口也相应降低。集团持续跟踪研究外汇市场，不断完善制度建设和内部管理，通过套保等一系列措施对冲、缓释汇率风险。集团注重外币资产和负债的匹配，以缩小外汇风险的敞口，集团还采用境外经营净投资套期等方法平滑外汇敞口对集团经营成果的影响。

#### (4) 商品价格风险

商品价格风险是由各类商品价格发生不利变动引起。报告期内，集团商品类市场风险敞口相对较低，主要通过商品期货、期权等商品衍生工具进行对冲，有效管理商品风险。

### 4、流动性风险管理

流动性风险是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。由于公司自营业务规模及融资类业务规模较大，公司经营过程中易受宏观政策、市场变化、经营状况、客户信用等因素影响，并可能因资产负债结构不匹配而引发流动性风险。



## 八、风险管理 (续)

### 4、流动性风险管理 (续)

在日间流动性风险管理方面,公司按照制定的流动性风险偏好及风险指标限额的要求,通过合理的监测机制和调控手段,始终确保流动性风险可测、可控和可承受,同时按照管理要求,储备了充足的优质流动性资产,保障了公司业务的顺利开展和到期负债的顺利偿付。公司持续开展日间流动性和风险指标管理,结合资产端和负债端,构建资金、指标联动体系,完善了包括日间指标头寸跟进、月度指标前瞻分析和部门指标拆解在内的流动性风险分析框架,丰富了不同期限内流动性风险管理的工具,提升了公司流动性风险管理和预判的效率。

在中长期流动性风险管理方面,公司不断优化资产配置结构,强化对资产负债发展趋势的分析,从源头上把控流动性风险。一方面,公司成立资产负债配置委员会,积极开展资产负债管理工作,通过及时分析业务发展趋势、潜在中长期资金需求,调整负债期限结构,保持资产负债的期限、规模的合理匹配;另一方面,公司持续提升流动性精细化管理水平,负债端结构和到期日分布更趋合理,也保证资产端在安全性、流动性、收益性之间的平衡。报告期内,公司重视与各大商业银行保持良好的合作关系,注重规范经营,维系良好信誉,保持融资渠道畅通。

此外,公司稳步推进对集团和子公司流动性风险管理的要求,以集团流动性风险管理办法为指引,根据各子公司业务特点制定了较为科学有效的流动性风险管理策略,基本实现集团层面流动性风险的统一管理。首先,公司以流动性风险管理为基础,从风险和资产负债管理等方面持续对子公司实行分类管理,并从组织制度保障、风险管控框架、风险应对手段三个维度提出不同要求,指导子公司完善其流动性风险管理体系;其次,以流动性风险并表指标为基础,根据各子公司所处行业、地域和风险特征的差异,下发各子公司的限额管理要求,以更有效地监测各子公司的流动性风险实质情况;最后,为强化集团流动性风险处置能力,公司以集团流动性支持管理办法作为整体管理方针,持续完善集团流动性支持体系,牢牢守住集团不发生流动性风险的底线。

### 5、风险控制指标监控

公司按照《证券公司风险控制指标管理办法》的要求编制公司的风险控制指标监管报表,并将净资本等风控指标纳入日常监控范围。对各项影响净资本及风险控制指标的业务、因素进行及时的监测与控制,使其达到合规要求。报告期间,公司的净资本及各项风险控制指标均符合监管要求。

## 八、风险管理 (续)

### 5、风险控制指标监控 (续)

2022年6月末公司主要风控指标与监管标准对照表

风控指标	2022年6月30日	监管标准
核心净资本 (亿元)	843.12	
附属净资本 (亿元)	66.36	
净资本 (亿元)	909.48	
净资产 (亿元)	1,444.84	
各项风险资本准备之和 (亿元)	445.86	
表内外资产总额 (亿元)	4,242.09	
风险覆盖率	203.98%	不得低于 100%
资本杠杆率	21.35%	不得低于 8%
流动性覆盖率	244.45%	不得低于 100%
净稳定资金率	162.18%	不得低于 100%
净资本 / 净资产	62.95%	不得低于 20%
净资本 / 负债	37.16%	不得低于 8%
净资产 / 负债	59.04%	不得低于 10%
自营权益类证券及其衍生品 / 净资本	17.15%	不得高于 100%
自营非权益类证券及其衍生品 / 净资本	178.64%	不得高于 500%

公司在进行股利分配、重大投资、开展创新业务等重要事项时，高度重视上述事项对净资本及风险控制指标的影响。在实施上述事项之前，公司对净资本等风险控制指标进行敏感性分析或压力测试，只有在满足净资本等风险控制指标监管要求的情况下，公司才实施上述重要事项。

另外，公司每半年针对未来经营计划进行展望，充分考虑经营规模达到最大、市场状况出现负面逆转等条件，对净资本等风险控制指标进行敏感性分析和压力测试，确保未来各项风险控制指标满足监管要求。

报告期内，公司未出现净资本等各项风险控制指标超过监管标准的情况。

## 九、公允价值的披露

集团部分金融资产和金融负债是以公允价值计量的。本集团董事建立了相关过程来确定公允价值计量中合适的估值技术和输入值。本集团董事定期复核相关过程以及公允价值确定的合适性。

确定金融资产及金融负债公允价值的方式如下：

- 附标准条款和条件且在活跃流动市场交易的金融资产的公允价值分别参照所报市场竞价确定；
- 衍生工具的公允价值以报价计算。如无报价，非期权衍生工具以工具年期的适用收益曲线进行贴现现金使用分析，期权衍生工具则以期权定价模式进行贴现现金使用分析；
- 其他金融资产及金融负债（不包括上述那些）的公允价值根据普遍采纳的定价模式如贴现现金使用分析、市场可比法等。

## 九、公允价值的披露 (续)

当无法从公开市场获取报价时，本集团通过估值技术来确定金融工具的公允价值。

本集团在金融工具估值技术中使用的主要参数包括债券价格、利率、汇率、权益及股票价格、波动水平、相关性、提前还款率及交易对手信用差价等，均为可观察到的且可从公开市场获取的参数。

根据有关确定金融资产公允价值的会计政策，本集团对公允价值计量的输入值划分为三个层次。

对于本集团持有的第三层次的金融工具，管理层已评估了宏观经济变动，外部评估师估值及损失覆盖率等参数的影响。若根据合理可能替代假设改变一个或多个不可观察参数，将不会对这些金融工具的公允价值评估产生重大影响。本集团已建立相关内部控制程序监控集团对此类金融工具的敞口。

### 1、以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

单位：人民币元

项目	2022年6月30日			合计
	第一层次公允价值计量	第二层次公允价值计量	第三层次公允价值计量	
(一) 交易性金融资产	17,502,680,979.83	152,748,697,612.96	31,614,858,069.74	201,866,236,662.53
(1) 债券	1,107,479,457.27	85,726,048,423.04	6,240,754,309.44	93,074,282,189.75
(2) 公募基金	3,312,989,054.26	36,817,880,189.84	31,091,522.25	40,161,960,766.35
(3) 股票 / 股权	13,082,212,468.30	2,500,860,741.29	18,138,480,270.91	33,721,553,480.50
(4) 银行理财产品	-	4,264,848,755.79	-	4,264,848,755.79
(5) 券商资管产品	-	1,552,689,451.95	-	1,552,689,451.95
(6) 信托计划	-	150,422,954.12	2,313,052,625.32	2,463,475,579.44
(7) 其他	-	21,735,947,096.93	4,891,479,341.82	26,627,426,438.75
(二) 以公允价值计量且变动计入其他综合收益的金融资产	6,286,287,851.96	40,263,704,614.82	2,117,690,482.73	48,667,682,949.51
(1) 其他债权投资	746,765,979.59	40,263,704,614.82	1,044,756,618.09	42,055,227,212.50
(2) 其他权益工具投资	5,539,521,872.37	-	1,072,933,864.64	6,612,455,737.01
(三) 衍生金融资产	67,957,143.81	758,678,448.30	1,450,850,162.63	2,277,485,754.74
(四) 交易性金融负债	371,142,098.53	6,026,387,505.01	12,013,857,974.89	18,411,387,578.43
(1) 为交易目的而持有的金融负债	371,142,098.53	602,738,189.29	-	973,880,287.82
(2) 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	-	5,423,649,315.72	12,013,857,974.89	17,437,507,290.61
(五) 衍生金融负债	28,793,610.64	653,607,033.07	592,751,344.23	1,275,151,987.94

## 九、公允价值的披露 (续)

### 2、以公允价值计量的资产和负债的上年末公允价值

单位：人民币元

项目	2021年12月31日			合计
	第一层次公允价值计量	第二层次公允价值计量	第三层次公允价值计量	
(一) 交易性金融资产	19,063,768,635.23	170,690,349,670.36	30,655,630,684.97	220,409,748,990.56
(1) 债券	698,881,204.47	110,654,909,743.61	5,731,525,672.16	117,085,316,620.24
(2) 公募基金	3,261,745,262.75	28,323,251,000.72	47,687,498.58	31,632,683,762.05
(3) 股票 / 股权	15,103,142,168.01	579,054,867.38	19,272,727,339.79	34,954,924,375.18
(4) 银行理财产品	-	3,427,357,682.52	-	3,427,357,682.52
(5) 券商资管产品	-	2,073,502,125.18	-	2,073,502,125.18
(6) 信托计划	-	163,453,870.43	503,638,038.65	667,091,909.08
(7) 其他	-	25,468,820,380.52	5,100,052,135.79	30,568,872,516.31
(二) 以公允价值计量且变动计入其他综合收益的金融资产	10,785,936,717.74	34,837,660,885.51	1,676,218,695.73	47,299,816,298.98
(1) 其他债权投资	927,857,733.44	34,837,660,885.51	1,287,426,748.82	37,052,945,367.77
(2) 其他权益工具投资	9,858,078,984.30	-	388,791,946.91	10,246,870,931.21
(三) 衍生金融资产	59,072,362.28	735,176,286.38	290,482,376.08	1,084,731,024.74
(四) 交易性金融负债	425,337,806.93	15,445,178,270.29	445,701,451.85	16,316,217,529.07
(1) 为交易目的而持有的金融负债	425,337,806.93	1,957,131,900.97	-	2,382,469,707.90
(2) 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	-	13,488,046,369.32	445,701,451.85	13,933,747,821.17
(五) 衍生金融负债	44,520,107.29	884,578,357.20	619,217,856.03	1,548,316,320.52

本期和上期合并财务报表按公允价值计量的金融工具在第一层次和第二层次之间无重大转移。

### 3、持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

合并财务报表持续第一层次公允价值计量项目的市价为交易所等活跃市场期末时点收盘价。

### 4、持续第二层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

合并财务报表持续第二层次公允价值计量项目估值通常基于底层投资 ( 投资组合中的债务证券或公开交易的权益工具 ) 的公允价值计算得出，或由第三方 ( 如中央结算公司 ) 基于现金流贴现模型提供估值。所有重大输入值均为市场中直接或间接可观察的输入值。

## 九、公允价值的披露 (续)

### 5、持续第三层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

合并财务报表持续第三层次公允价值计量项目估值采用管理层自对手方处获取估值报价，或使用估值技术确定其公允价值，包括现金流贴现分析、净资产价值、市场可比法和期权定价模型等。这些金融工具的公允价值可能基于对估值有重大影响的不可观测输入值，因此公司将其分为第三层次。不可观测输入值包括流动性折扣、风险调整折扣、经调整的波动率和市场乘数等。合并财务报表持续第三层次公允价值计量项目对这些不可观察输入值的合理变动无重大敏感性。

### 6、持续第三层次公允价值计量项目，期初与期末账面价值之间的调节信息

项目	2021年 12月31日	转入第三层次	转出第三层次	当期利得或损失总额		增加	减少	2022年 6月30日
				计入损益	计入其他 综合收益			
交易性金融资产	30,655,630,684.97	2,781,684,914.27	(2,821,487,196.88)	(236,128,696.47)	-	3,949,612,438.41	(2,714,454,074.56)	31,614,858,069.74
其他债权投资	1,287,426,748.82	-	(39,379,486.98)	(121,548,417.92)	18,019,602.62	165,733,718.25	(265,495,546.70)	1,044,756,618.09
其他权益工具投资	388,791,946.91	-	-	-	(177,518,528.66)	861,660,446.39	-	1,072,933,864.64
衍生金融工具	(328,735,479.95)	7,638,458.18	-	754,675,444.45	-	-	424,520,395.72	858,098,818.40
交易性金融负债	(445,701,451.85)	-	-	(809,315,831.71)	-	(13,940,424,989.44)	3,181,584,298.11	(12,013,857,974.89)

项目	2020年 12月31日	转入第三层次	转出第三层次	当期利得或损失总额		增加	减少	2021年 12月31日
				计入损益	计入其他 综合收益			
交易性金融资产	26,158,747,432.21	3,205,927,460.21	(3,111,052,641.35)	2,004,607,950.09	-	9,000,790,799.88	(6,603,390,316.07)	30,655,630,684.97
其他债权投资	3,099,638,990.42	-	(27,392,560.56)	470,008,795.67	67,575,225.47	284,458,722.28	(2,606,862,424.46)	1,287,426,748.82
其他权益工具投资	267,042,600.00	-	-	-	121,259,116.15	490,230.76	-	388,791,946.91
衍生金融工具	(13,594,362.75)	139,843.90	-	(315,280,961.10)	-	-	-	(328,735,479.95)
交易性金融负债	(331,829,555.70)	(956,179,481.20)	324,149,150.02	549,877,947.54	-	(31,719,512.51)	-	(445,701,451.85)

## 九、公允价值的披露 (续)

### 7、不以公允价值计量的金融资产和金融负债的公允价值情况

下表概述了在集团合并报表中未以公允价值列示、预期公允价值有明显偏差金融资产和负债：

单位：人民币元

项目	2022年6月30日		2021年12月31日	
	账面价值	公允价值	账面价值	公允价值
<b>金融资产</b>				
债权投资	5,291,159,984.88	5,075,002,749.15	4,725,209,073.62	4,310,574,198.30
<b>金融负债</b>				
应付债券 - 非可转换债券	173,470,980,662.80	174,386,228,251.16	163,586,069,656.61	170,269,519,381.12

除此以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的公允价值和账面金额差异不重大。

## 十、或有事项、承诺及表外事项

### 1、重大承诺事项

#### (1) 银行借款质押情况

截至 2022 年 6 月 30 日，约有人民币 13.33 亿元借款 (2021 年 12 月 31 日：人民币 13.33 亿元) 以本公司持有的上海市黄浦区中山南路 858 号绿地外滩中心 B2 办公楼作为抵押。

截至 2022 年 6 月 30 日，约有人民币 7.54 亿元借款 (2021 年 12 月 31 日：人民币 7.59 亿元) 以本公司持有的上海市黄浦区中山南路 888 号绿地外滩中心 B3 办公楼作为抵押。

截至 2022 年 6 月 30 日，约有人民币 6.8 亿元借款 (2021 年 12 月 31 日：无) 以本公司持有的上海市黄浦区中山南路 868 号绿地外滩中心 B1 办公楼作为抵押。

截至 2022 年 6 月 30 日，约有人民币 8.55 亿元的流动借款 (2021 年 12 月 31 日：人民币 8.18 亿元) 以集团持有的大成海通中国债券基金 1 号作为抵押，该抵押品的公允价值约为人民币 27.85 亿元 (2021 年 12 月 31 日：人民币 26.13 亿元)。

截至 2022 年 6 月 30 日，约有人民币 96.92 亿元的银行贷款 (2021 年 12 月 31 日：人民币 67.56 亿元) 以本公司下属子公司海通恒信金融集团有限公司和海通银行的股权作为质押。

截至 2022 年 6 月 30 日，本公司下属子公司海通国际的银行质押借款余额合计港币 3.39 亿元 (折合人民币 2.90 亿元) (2021 年 12 月 31 日：港币 0.78 亿元，折合人民币 0.64 亿元)，该款项部分系本公司在客户同意下，以其给予客户的融资款而取得的质押品 (持有的上市公司股份) 作为质押借入，截止 2022 年 6 月 30 日，该质押品期末市值为港币 17.70 亿元 (折合人民币 15.14 亿元) (2021 年 12 月 31 日：港币 24.37 亿元，折合人民币 19.92 亿元)。

## 十、或有事项、承诺及表外事项 (续)

### 1、重大承诺事项 (续)

#### (1) 银行借款质押情况 (续)

截至 2022 年 6 月 30 日, 本集团持有短期及长期借款余额 (含应付利息) 合计人民币 87.82 亿元 (2021 年 12 月 31 日: 人民币 97.41 亿元), 以应收融资租赁款项、长期应收款、下属子公司股权作为质押及飞机租赁固定资产作为抵押。截止 2022 年 6 月 30 日, 质押的应收融资租赁款项账面价值为人民币 5.36 亿元 (2021 年 12 月 31 日: 人民币 11.37 亿元), 质押的长期应收款账面价值为人民币 60.64 亿元 (2021 年 12 月 31 日: 人民币 80.24 亿元), 抵押的飞机租赁计入固定资产的账面价值为人民币 47.53 亿元 (2021 年 12 月 31 日: 人民币 46.08 亿元)。

#### (2) 有关公司为境外全资附属公司提供融资担保

2017 年 8 月 29 日, 本公司召开第六届董事会第二十五次会议, 审议通过了《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》。本公司 2018 年 5 月 14 日作为担保人签署《贷款协议》, 为境外全资附属子公司海通国际控股的银团贷款提供 6 亿美元连带责任保证担保。

本公司于 2019 年 4 月 25 日召开第六届董事会第三十七次会议, 审议通过了《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》, 同意本公司为在境外的全资子公司海通国际控股有限公司 Haitong International Holdings 及其全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保, 担保金额不超过 6.7 亿美元债务融资本金 (含 6.7 亿美元或等值其他币种)、利息、借款人应当承担的其他费用等, 担保期限不超过 10 年 (含 10 年)。公司于 2020 年 3 月 12 日签署《担保协议》, 为公司境外全资附属公司 Haitong International Finance Holdings 2015 Limited 发行金额为 6.7 亿美元、于 2025 年到期、票面利率为 2.107% 的美元债券, 提供连带责任保证担保。

2020 年 8 月 28 日, 公司召开第七届董事会第十一次会议, 审议通过了《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》。同意公司为在境外的全资附属公司海通银行或其附属公司境外债务融资 (包括但不限于发行境外债券、中长期商业借款及其他符合监管要求的融资方式) 提供连带责任保证担保, 担保金额不超过 3.75 亿欧元债务融资本金 (含 3.75 亿欧元或等值其他币种)、利息、借款人应当承担的其他费用等, 担保期限不超过 6 年 (含 6 年)。公司于 2021 年 5 月 17 日作为担保人签署《贷款协议》, 为境外全资附属公司海通银行 3.75 亿欧元 (含 3.75 亿欧元或等值其他货币) 银团贷款提供连带责任保证担保。

2021 年 3 月 30 日, 公司召开第七届董事会第十五次会议, 审议通过了《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》, 同意公司为在境外的全资子公司海通银行或其附属公司境外债券融资提供连带责任保证担保, 担保金额不超过 7.5 亿欧元债券本金 (含 7.5 亿欧元或等值其他币种)、利息、借款人应当承担的其他费用等, 担保期限不超过 9 年 (含 9 年)。公司于 2022 年 2 月 8 日签署《担保函》, 为公司境外全资附属公司海通银行发行金额为 2.3 亿欧元、于 2025 年到期的欧元债券提供连带责任保证担保。公司于 2022 年 5 月 31 日签署《担保协议》, 为境外全资附属公司海通银行发行金额为 1.5 亿美元、于 2027 年到期的债券提供连带责任保证担保, 担保期限 66 个月。

## 十、或有事项、承诺及表外事项 (续)

### 1、重大承诺事项 (续)

(3) 有关公司为上海海通证券资产管理有限公司提供和追加净资本担保承诺

本公司第五届董事会第十二次会议审议通过了《关于对上海海通证券资产管理有限公司提供净资本担保承诺的议案》，董事会同意本公司随时对资产管理子公司提供不超过 15 亿元的净资本担保承诺，以保证其净资本保持充足。2013 年 6 月 9 日，上海证监局下发《关于海通证券股份有限公司向上海海通证券资产管理有限公司 (以下简称“海通资管公司”) 出具净资本担保承诺书的无异议函》(沪证监机构字 [2013]145 号)，同意本公司向资产管理子公司提供 8 亿元的担保承诺。

2016 年 8 月 29 日，经本公司第六届董事会十八次会议审议通过了《关于公司为海通资管公司追加净资本担保承诺及对其增加注册资本的议案》，同意本公司对海通资管公司追加不超过人民币 40 亿元的净资本担保承诺。本公司为海通资管公司提供最高额度为人民币 40 亿元的净资本担保承诺，并承诺当海通资管公司开展业务需要现金支持时，本公司将无条件在上述额度内提供现金。净资本担保承诺期限自公司董事会审议通过之日起生效。就本次净资本担保事宜，海通资管公司已于 2016 年 9 月 27 日获得中国证监会上海监管局出具的《关于对海通证券股份有限公司向上海海通证券资产管理有限公司出具净资本担保承诺书的无异议函》(沪证监机构字 [2016]325 号)。

2021 年 12 月，公司对海通资管公司减少提供净资本担保承诺金额 18 亿元。就本次净资本担保减少事宜，海通资管公司已收到中国证监会上海监管局《关于对海通证券股份有限公司向上海海通证券资产管理有限公司减少提供部分净资本担保承诺事项的无异议函》(沪证监机构字 [2021]532 号)。截止 2022 年 6 月 30 日，公司对海通资管公司提供净资本担保承诺金额为人民币 30 亿元。

(4) 有关公司为海通开元投资有限公司减资过程中未清偿债务提供一般保证担保

本公司全资子公司海通开元将所持有的海通恒信国际融资租赁股份有限公司 (以下简称“海通恒信”) 2,440,846,824 股内资股划转给公司全资子公司海通创新。海通开元将注册资本从人民币 106.50 亿元减至人民币 75 亿元，减资人民币 31.50 亿元。公司为海通开元减资过程中未清偿债务人民币 105,502.08 万元提供一般保证担保。此担保事项经过公司于 2021 年 1 月 29 日召开的第七届董事会第十四次会议 (临时会议) 审议通过。截止 2022 年 6 月 30 日，本公司的该项担保责任余额为人民币 16,978.29 万元。

(5) 资本承诺

单位：人民币万元

项目	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
已签约但未拨付的购建长期资产承诺	124,614.77	222,633.09



## 十、或有事项、承诺及表外事项 (续)

### 1、重大承诺事项 (续)

#### (6) 经营租赁

根据与承租人已签订的不可撤销的经营性租赁合同，未来最低应收取租金汇总如下：

单位：人民币万元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
一年以内	53,913.78	50,317.99
一至二年	56,675.31	55,293.09
二至三年	51,263.84	50,623.60
三至四年	44,410.77	46,784.65
四至五年	43,621.31	43,131.50
五年以上	94,439.66	107,298.90
合计	344,324.67	353,449.73

#### (7) 其他承诺事项

其他存在限售期及有承诺条件的资产为交易性金融资产、债权投资、其他债权投资和其他权益工具投资，详见附注四、8，附注四、9，附注四、10及附注四、11。

### 2、表外事项

单位：人民币万元

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
保函和备用信用证 (注 1)	92,091.15	96,304.78
不可撤销贷款承诺 (注 2)	103,536.77	182,498.88
合计	195,627.92	278,803.66

注 1：保函和备用信用证属于发生代付情况下才可能导致子公司资本流出的银行业务。

注 2：不可撤销信贷承诺为向客户提供信贷协议（如未使用的信贷额度）。这些协议通常约定了固定期限或其他要素，且需要客户支付一定的手续费。所有的信贷承诺在授信时都需要客户维持一定的已核实的条件。

## 十一、资产负债表日后事项

于 2022 年 6 月 30 日后至本报告日期，本集团无其他重大的资产负债表日后事项。

## 十二、分部报告

根据本公司战略规划及内部管理要求，本公司确定六大经营分部：财富管理、投资银行、资产管理、交易及机构、融资租赁及其他。财富管理分部主要提供经纪服务、投资顾问服务、财富管理服务、融资类业务服务等；投资银行分部主要提供保荐和承销服务、财务顾问服务、新三板服务等；资产管理分部主要提供资产管理、基金管理和股权投资服务等；交易及机构分部主要提供股票销售交易、大宗经纪、股票借贷、股票研究等；融资租赁分部主要提供融资租赁服务等；其他分部主要提供仓单服务等其他服务。

单位：人民币元

本期发生额 / 期末余额	财富管理	投资银行	资产管理	交易及机构	融资租赁	其他	合计
一、营业总收入	4,851,698,113.48	2,471,305,202.59	1,639,739,944.55	334,375,483.58	2,309,981,502.96	497,250,049.32	12,104,350,296.48
手续费及佣金 净收入	1,699,828,379.90	2,525,822,838.12	1,056,647,727.52	858,381,441.03	-	-	6,140,680,386.57
其他收入	3,151,869,733.58	(54,517,635.53)	583,092,217.03	(524,005,957.45)	2,309,981,502.96	497,250,049.32	5,963,669,909.91
二、营业 总支出	1,411,050,067.57	1,482,523,150.87	653,217,052.67	679,321,669.92	1,493,913,399.59	539,573,258.09	6,259,598,598.71
三、营业利润	3,440,648,045.91	988,782,051.72	986,522,891.88	(344,946,186.34)	816,068,103.37	(42,323,208.77)	5,844,751,697.77
四、利润总额	3,458,722,386.82	996,610,737.61	986,930,814.35	(329,623,684.13)	815,744,779.16	(42,320,449.17)	5,886,064,584.64
五、资产总额							749,565,861,117.80
分部资产	243,587,325,971.92	9,731,562,942.16	15,336,709,701.82	356,769,276,358.77	115,924,570,228.23	3,780,827,759.85	745,130,272,962.75
递延所得税 资产							4,435,588,155.05
六、负债总额							572,083,285,938.74
分部负债	198,140,502,840.43	9,779,329,332.24	6,566,702,361.06	248,302,933,808.78	107,528,821,258.35	799,742,032.37	571,118,031,633.23
递延所得税 负债							965,254,305.51
七、补充信息							
1、折旧与摊销 费用	210,791,056.37	128,028,790.80	87,022,100.56	128,450,455.11	156,711,571.78	23,397,324.62	734,401,299.24
2、资本性 支出	165,837,378.62	48,890,184.03	11,414,040.85	1,599,868,234.36	12,106,790.20	14,751,773.94	1,852,868,402.00
3、信用减值 损失	(497,649,079.08)	13,582,671.07	(10,243,236.10)	5,406,552.96	667,984,441.21	(418,371.48)	178,662,978.58
4、其他减值 损失	-	-	-	-	23,438,997.32	2,471,803.46	25,910,800.78

## 十二、分部报告 (续)

单位: 人民币元

上期发生额 / 上年末余额	财富管理	投资银行	资产管理	交易及机构	融资租赁	其他	合计
一、营业总收入	5,189,483,318.31	3,007,570,572.44	2,415,765,932.99	6,472,615,931.43	2,421,897,705.32	3,963,908,126.65	23,471,241,587.14
手续费及佣金净收入	1,856,754,463.10	2,523,756,800.15	1,804,111,571.15	980,554,126.48	-	-	7,165,176,960.88
其他收入	3,332,728,855.21	483,813,772.29	611,654,361.84	5,492,061,804.95	2,421,897,705.32	3,963,908,126.65	16,306,064,626.26
二、营业总支出	1,936,581,172.06	1,367,055,736.59	903,072,911.38	2,009,913,866.77	1,624,820,081.31	3,995,657,538.18	11,837,101,306.29
三、营业利润	3,252,902,146.25	1,640,514,835.85	1,512,693,021.61	4,462,702,064.66	797,077,624.01	(31,749,411.53)	11,634,140,280.85
四、利润总额	3,264,417,160.26	1,632,068,175.92	1,515,178,575.28	4,488,112,838.27	792,920,182.47	(31,747,204.56)	11,660,949,727.64
五、资产总额							744,925,149,407.62
分部资产	241,389,287,428.05	10,094,708,372.19	15,782,693,384.81	354,700,501,229.70	114,017,445,611.34	3,768,587,937.69	739,753,223,963.78
递延所得税资产							5,171,925,443.84
六、负债总额							567,170,363,313.90
分部负债	192,472,694,740.19	9,040,398,315.65	7,705,571,945.83	250,499,641,629.90	106,049,410,529.99	81,995,297.74	565,849,712,459.30
递延所得税负债							1,320,650,854.60
七、补充信息							
1、折旧与摊销费用	163,434,658.75	103,886,117.89	75,453,136.25	181,390,436.16	171,854,425.41	27,207,898.55	723,226,673.01
2、资本性支出	259,467,770.55	90,390,979.49	7,708,037.86	145,315,314.59	290,742,000.00	40,710.00	793,664,812.49
3、信用减值损失	58,574,999.42	(66,388.02)	80,643,870.46	58,202,788.84	827,190,332.87	219,518.18	1,024,765,121.75
4、其他减值损失	-	-	-	-	39,555,500.41	4,527,645.35	44,083,145.76

## 十三、其他重要事项

### 1、海通国际证券集团购股权计划

#### (1) 海通国际证券集团有限公司 2015 年购股权计划

2015 年 6 月 8 日 (收购日), 海通国际证券集团有限公司 (以下简称“海通国际证券”) 股东通过了一项新的购股权计划 (“2015 购股权计划”)。作为海通国际控股有限公司的控股公司, 海通国际证券的控制方, 海通证券以及香港联交所上市委员会, 也分别于 2015 年 6 月 8 日以及 2015 年 6 月 12 日通过了该计划。

海通国际证券 2015 购股权计划的详情已于本集团 2021 年度财务报表中披露, 该购股权计划应与海通国际证券有关购股权的公告一并阅读。

## 十三、其他重要事项 (续)

### 1、海通国际证券集团购股权计划 (续)

(1) 海通国际证券集团有限公司 2015 年购股权计划 (续)

2021 年 7 月 21 日, 根据 2015 年购股权计划, 海通国际证券以每股港币 2.398 元的价格授予了 10,645,000 股份给予员工, 合计 9,845,000 份购股权被接受。此项计划的有效期间是 2022 年 2 月 17 日至 2026 年 7 月 20 日。所有的购股权的等待期间是授予日起的 6 个月内。海通国际证券的股份的收盘价为每股港币 2.18 元。

在 2021 年 7 月 21 日授权日, 根据 2015 年购股权计划授予股权的估计公允价格折合港币 3.6 百万元, 这个价格是用二项式期权定价模型得出的, 关键数据如下:

项目	2021 年
授予日之加权平均股价	港币 2.18
初始行权价格	港币 2.398
预期波动	37.533%
预期授权期限	5 年
无风险折现率	0.495%
预期股息率	7.514%
提前行权乘数 - 海通国际证券董事	1.68
提前行权乘数 - 海通国际证券员工	1.91

预期波动是由海通国际证券股权在授予日之前 5 年内的历史价格决定的。

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间, 根据 2015 年购股权计划, 海通国际证券于综合损益表中确认权益结算的股份支付港币 892,000.00 元, 折合人民币 762,829.48 元 (截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间: 无权益结算的股份支付)。

下表披露年内海通国际证券 2015 年购股权计划授予其董事及雇员的购股权的变动:

	2022 上半年度		2021 年度	
	加权平均行使价 每股港币	配股权数目 千份	加权平均行使价 每股港币	配股权数目 千份
于期 / 年初	2.860	40,551	3.369	62,102
期 / 年内授予及接受的购股权	-	-	2.398	9,845
期 / 年内调整 (注)	2.590	3,998	-	-
期 / 年内行使	-	-	1.727	(1,750)
期 / 年内没收	3.140	(732)	3.840	(29,646)
于期 / 年末	2.590	43,817	2.860	40,551

## 十三、其他重要事项 (续)

### 1、海通国际证券集团购股权计划 (续)

(1) 海通国际证券集团有限公司 2015 年购股权计划 (续)

截止各报告日期未行使购股权的行使价及行使期如下:

购股权数目 千份	行使价 每股港币 (注)	行权期
2022 年 6 月 30 日		
6,924	4.547	2018 年 6 月 7 日至 2022 年 11 月 9 日
12,139	2.635	2019 年 5 月 28 日至 2023 年 10 月 31 日
6,891	2.322	2019 年 12 月 27 日至 2024 年 5 月 30 日
7,859	1.570	2020 年 12 月 25 日至 2025 年 5 月 28 日
10,004	2.180	2022 年 2 月 17 日至 2026 年 7 月 20 日
<b>43,817</b>		
2021 年 12 月 31 日		
6,546	5.002	2018 年 6 月 7 日至 2022 年 11 月 9 日
11,125	2.898	2019 年 5 月 28 日至 2023 年 10 月 31 日
6,340	2.554	2019 年 12 月 27 日至 2024 年 5 月 30 日
7,345	1.727	2020 年 12 月 25 日至 2025 年 5 月 28 日
9,195	2.398	2022 年 2 月 17 日至 2026 年 7 月 20 日
<b>40,551</b>		

注: 购股权的行使价可就供股、股利或红股发行或海通国际证券股本的其他类似变动而作出调整。

截止到 2022 年 6 月 30 日, 海通国际证券在 2015 购股权计划中拥有 43,817,278 份 (2021 年 12 月 31 日: 40,551,041 份) 购股权, 大约占到海通国际证券当天发行股票的 0.66% (2021 年 12 月 31 日: 0.67%)。

根据海通国际证券现有的资本结构, 行使所有剩余的股票期权会使海通国际证券发行额外普通股 43,817,278 股 (2021 年: 40,551,041 股), 发行额外股本港币 4,382,000 元, 折合人民币 3,747,442.58 元 (2021 年: 港币 4,055,000 元, 折合人民币 3,315,368.00 元), 股本溢价港币 109,236,000 元, 折合人民币 93,417,534.84 元 (2021 年: 港币 111,855,000 元, 折合人民币 91,452,648.00 元) (不包括发行费用)。

## 十三、其他重要事项 (续)

### 1、海通国际证券集团购股权计划 (续)

#### (2) 海通国际证券集团有限公司股权激励计划

在 2014 年 12 月 19 日，海通国际证券董事会通过了一项为期 10 年股份奖励计划 (“该计划”)，以激励选定的员工或董事为集团作出的贡献并为集团的进一步发展吸引合适人才。

在 2022 年 6 月 30 日被授予和失效的股票的信息如下：

授予股份的日期	授予股份的数量	可行权股份的数量	已失效授予股份的数量 (附注 (f))	未及可行权日股份的数量	可行权日期	被授予日的公允价值 (港元)
2019 年 3 月 25 日	6,848,366	5,678,547	1,169,819	-	附注 (a)	21,024,000
2019 年 10 月 29 日	8,175,000	6,635,000	1,540,000	-	附注 (b)	18,557,000
2020 年 3 月 25 日	14,294,205	8,092,251	2,541,023	3,660,931	附注 (c)	28,731,000
2021 年 3 月 25 日	29,000,000	29,000,000	-	-	附注 (d)	69,890,000
2021 年 8 月 31 日	36,788,082	15,800,639	187,600	20,799,843	附注 (e)	82,773,000

授予股权的公允价值以海通国际证券股票的市价衡量。截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间，本集团于综合损益表中确认该计划的权益结算股份支付共计港币 19,649,000 元，折合人民币 16,803,628.31 元 (截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间：港币 79,037,000 元，折合人民币 65,859,951.36 元)。

于 2022 年 6 月 30 日，海通国际证券无 2019 年 3 月 25 日被授权但未及可行权日的股份 (2021 年 12 月 31 日：1,620,854 股)。本六个月期间内，于 2019 年 3 月 25 日授权的股份无失效 (截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间：248,307 股)，于 2019 年 3 月 25 日授权的 1,620,854 可行权 (截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间：1,933,971 股)。

于 2022 年 6 月 30 日，海通国际证券无 2019 年 10 月 29 日被授权但未及可行权日的股份 (2021 年 12 月 31 日：1,635,000 股)。本六个月期间内，于 2019 年 10 月 29 日授权的股份无失效 (截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间：335,000 股)，于 2019 年 10 月 29 日授权的 1,635,000 股可行权 (截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间：2,385,000 股)。

于 2022 年 6 月 30 日，海通国际证券持有 2020 年 3 月 25 日被授权但未及可行权日的股份 3,660,931 股 (2021 年 12 月 31 日：7,506,259 股)。本六个月期间内，于 2020 年 3 月 25 日授权的 112,105 股失效 (截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间：838,471 股)。于 2020 年 3 月 25 日授权的 3,733,223 股可行权 (截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间：4,359,028 股)。

## 十三、其他重要事项 (续)

### 1、海通国际证券集团购股权计划 (续)

#### (2) 海通国际证券集团有限公司股权激励计划 (续)

于 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，海通国际证券未持有 2021 年 3 月 25 日被授予但未及可行权日的股份。

于 2022 年 6 月 30 日，海通国际证券持有 2021 年 8 月 31 日被授权但未及可行权日的股份 20,799,843 股 (2021 年 12 月 31 日：20,799,843 股)。本六个月期间，于 2021 年 8 月 31 日授权股份并无失效及可行权。

附注：

(a) 按照商定的条款，于 2019 年 3 月 25 日授予的三分之一激励股权的行使日是 2020 年 3 月 23 日，而于 2019 年 3 月 25 日授予的另外三分之一激励股权的行使日是 2021 年 3 月 23 日，最后剩余的三分之一激励股权的行使日是 2022 年 3 月 23 日。

(b) 按照商定的条款，于 2019 年 10 月 29 日授予的三分之一激励股权的行使日是 2020 年 1 月 2 日，而于 2019 年 10 月 29 日授予的另外三分之一激励股权的行使日是 2021 年 1 月 2 日，最后剩余的三分之一激励股权的行使日是 2022 年 1 月 2 日。

(c) 按照商定的条款，于 2020 年 3 月 25 日授予的三分之一激励股权的行使日是 2021 年 3 月 24 日，而于 2020 年 3 月 25 日授予的另外三分之一激励股权的行使日是 2022 年 3 月 24 日，最后剩余的三分之一激励股权的行使日是 2023 年 3 月 24 日。

(d) 按照商定的条款，于 2021 年 3 月 25 日授予的所有激励股权的行使日是 2021 年 4 月 30 日。

(e) 按照商定的条款，于 2021 年 8 月 31 日授予的三分之一激励股权的行使日是 2021 年 9 月 30 日，而于 2021 年 8 月 31 日授予的另外三分之一激励股权的行使日是 2022 年 9 月 30 日，最后剩余的三分之一激励股权的行使日是 2023 年 9 月 30 日。

(f) 由于员工离职，被授予的股票在他们的期权到期之前就已经失效。根据协议，已到期的股份由受托人持有，经行政委员会批准，可重新选择任何被选定的参与者。如简明综合权益变动表的披露所示，股份已从股票奖励储备转至股票溢价。

下表披露本期在该计划下的股权的变动：

	2022 上半年度		2021 年度	
	港币千元	股份数量	港币千元	股份数量
期 / 年初数	269,732	117,409,723	389,986	172,705,979
本期购买	17,670	14,662,000	-	-
根据红股发行的股份	-	12,508,264	-	-
本期失效并且转出	(16,057)	(6,989,077)	(120,254)	(55,296,256)
期 / 年末数	271,345	137,590,910	269,732	117,409,723

## 十三、其他重要事项 (续)

### 2、金融工具计量基础分类表

单位：人民币元

金融资产项目	金融资产计量基础分类表									
	以摊余成本计量的金融资产		以公允价值计量且其变动计入其他综合收益		以公允价值计量且其变动计入其他综合收益		以公允价值计量且其变动计入当期损益		以公允价值计量且其变动计入当期损益	
	期末数	年初数	期末数	年初数	期末数	年初数	期末数	年初数	期末数	年初数
货币资金	186,275,510,234.59	161,482,162,662.33								
结算备付金	15,106,526,527.81	16,765,417,520.72								
拆出资金	80,225,399.34	352,928,216.40								
融出资金	69,688,200,894.61	75,223,404,481.86								
衍生金融资产										
存出保证金	20,042,711,989.12	17,655,168,606.23								
应收款项	8,496,612,249.86	11,372,016,262.32								
买入返售金融资产	42,099,456,966.02	39,761,016,348.21								
交易性金融资产										
债权投资	5,291,159,984.88	4,725,209,073.62								
其他债权投资										
其他权益工具投资										
长期应收款	68,201,416,679.15	55,088,023,010.62								
其他资产	17,366,554,302.60	24,165,719,650.04								
(金融资产)										
合计	432,628,375,227.98	406,591,065,832.35	42,055,227,212.50	37,052,945,367.77	6,612,455,737.01	10,246,870,931.21	204,056,761,884.64	221,483,400,761.70	86,960,532.63	11,079,253.60



## 十三、其他重要事项 (续)

### 2、金融工具计量基础分类表 (续)

单位: 人民币元

金融负债项目	金融负债计量基础分类表							
	以摊余成本计量的金融负债		分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		以公允价值计量且其变动计入当期损益		按照《套期会计》准则指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	
	期末数	年初数	期末数	年初数	期末数	年初数	期末数	年初数
短期借款	32,599,662,300.62	29,575,032,689.68						
应付短期融资款	22,660,030,329.95	24,986,688,130.95						
拆入资金	10,655,383,836.51	15,664,657,697.33						
交易性金融负债			973,880,287.82	2,382,469,707.90	17,437,507,290.61	13,933,747,821.17		
衍生金融负债			1,166,703,647.43	1,317,201,798.37			108,448,340.51	231,114,522.15
卖出回购金融资付款	81,567,484,109.38	91,911,952,065.34						
代理买卖证券款	129,589,377,718.71	123,202,200,376.21						
代理承销证券款	-	1,601,399,997.46						
应付款项	10,757,399,124.25	11,872,937,682.85						
长期借款	54,429,268,328.65	49,579,028,216.06						
应付债券	173,470,980,662.80	163,586,069,656.61						
其他负债(金融负债)	21,244,014,194.87	22,270,422,126.71						
合计	536,973,600,605.74	534,250,388,639.20	2,140,583,935.25	3,699,671,506.27	17,437,507,290.61	13,933,747,821.17	108,448,340.51	231,114,522.15

## 十三、其他重要事项 (续)

### 3、社会责任

2022年1-6月在环保公益项目、救灾捐款、教育资助、慈善捐赠等公益性方面的投入金额共计1,017.56万元。

2022年1-6月公益性投入构成明细

单位：人民币万元

项目	本期发生额
慈善捐赠、教育资助、救灾捐款等	1,017.56
合计	1,017.56

## 十四、母公司财务报表项目注释

### 1、长期股权投资

(1) 长期股权投资分类如下

单位：人民币元

项目	2022年6月30日			2021年12月31日		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
子公司	37,186,327,888.54	-	37,186,327,888.54	36,897,560,516.00	-	36,897,560,516.00
联营企业	1,885,105,200.83	-	1,885,105,200.83	1,957,895,348.40	-	1,957,895,348.40
合计	39,071,433,089.37	-	39,071,433,089.37	38,855,455,864.40	-	38,855,455,864.40

(2) 对子公司投资

单位：人民币元

被投资单位	初始投资成本	2021年12月31日	本期增加	本期减少	2022年6月30日	本期计提减值准备	减值准备期末余额
海富通基金管理有限公司	76,500,000.00	76,500,000.00	-	-	76,500,000.00	-	-
海富产业投资基金管理有限公司	-	63,650,000.00	-	63,650,000.00	-	-	-
海通期货股份有限公司	1,728,609,150.15	1,376,191,777.61	352,417,372.54	-	1,728,609,150.15	-	-
海通国际控股有限公司	9,406,814,500.00	9,406,814,500.00	-	-	9,406,814,500.00	-	-
海通开元投资有限公司	7,500,000,000.00	7,500,000,000.00	-	-	7,500,000,000.00	-	-
海通创新证券投资咨询有限公司	14,650,000,000.00	14,650,000,000.00	-	-	14,650,000,000.00	-	-
上海海通证券资产管理有限公司	2,200,000,000.00	2,200,000,000.00	-	-	2,200,000,000.00	-	-
上海惟泰置业管理有限公司	756,066,063.75	756,066,063.75	-	-	756,066,063.75	-	-
上海泽春投资发展有限公司	868,338,174.64	868,338,174.64	-	-	868,338,174.64	-	-
合计	37,186,327,888.54	36,897,560,516.00	352,417,372.54	63,650,000.00	37,186,327,888.54	-	-

## 十四、母公司财务报表项目注释 (续)

### 1、长期股权投资 (续)

#### (3) 对联营企业投资

单位：人民币元

被投资单位	2021年 12月31日	本期增、减变动							2022年 6月30日	减值准备 期末余额	
		追加 投资	减少 投资	权益法下确认的 投资收益	其他综合收益调整	公司享有 其他权益 变动	公司享有的宣告发 放现金股利或利润	计提减 值准备			其他
联营企业											
富国基金管 理有限公司	1,957,895,348.40	-	-	311,694,737.85	4,365,114.58	-	(388,850,000.00)	-	-	1,885,105,200.83	-

(4) 公司无向投资企业转移资金能力受到限制的情况。

### 2、手续费及佣金净收入

#### (1) 手续费及佣金净收入按类别列示

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
<b>证券经纪业务净收入</b>	2,064,117,835.34	2,033,632,830.76
— 证券经纪业务收入	2,772,335,680.54	2,852,829,912.82
其中：代理买卖证券业务	2,131,557,883.21	2,194,260,990.78
交易单元席位租赁	455,054,708.28	512,902,621.48
代销金融产品业务	185,723,089.05	145,666,300.56
— 证券经纪业务支出	708,217,845.20	819,197,082.06
其中：代理买卖证券业务	708,217,845.20	819,197,082.06
<b>投资银行业务净收入</b>	2,143,973,926.93	1,834,945,545.00
— 投资银行业务收入	2,159,069,354.30	1,860,560,499.51
其中：证券承销业务	2,109,050,886.38	1,742,635,946.04
证券保荐业务	33,201,886.79	68,467,924.51
财务顾问业务	16,816,581.13	49,456,628.96
— 投资银行业务支出	15,095,427.37	25,614,954.51
其中：证券承销业务	10,977,282.09	25,596,275.31
财务顾问业务	4,118,145.28	18,679.20
<b>投资咨询业务净收入</b>	72,154,129.04	67,215,118.90
— 投资咨询业务收入	72,154,129.04	67,215,118.90
— 投资咨询业务支出	-	-
<b>其他手续费及佣金净收入</b>	55,060,976.40	54,239,286.97
— 其他手续费及佣金收入	56,027,288.07	55,770,975.39
— 其他手续费及佣金支出	966,311.67	1,531,688.42
<b>合计</b>	<b>4,335,306,867.71</b>	<b>3,990,032,781.63</b>
其中：手续费及佣金收入合计	5,059,586,451.95	4,836,376,506.62
手续费及佣金支出合计	724,279,584.24	846,343,724.99

## 十四、母公司财务报表项目注释 (续)

### 2、手续费及佣金净收入 (续)

(2) 财务顾问业务净收入按类别列示

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
并购重组财务顾问业务净收入 - 境内上市公司	3,350,943.40	7,386,792.50
并购重组财务顾问业务净收入 - 其他	283,018.87	-
其他财务顾问业务净收入	9,064,473.58	42,051,157.26
合计	12,698,435.85	49,437,949.76

### 3、利息净收入

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
<b>利息收入</b>	<b>4,808,806,134.02</b>	<b>4,603,997,287.48</b>
其中：货币资金及结算备付金利息收入	1,228,248,811.49	1,030,306,587.82
融出资金利息收入	2,059,179,044.17	2,224,619,593.02
买入返售金融资产利息收入	873,500,226.85	1,039,243,477.18
其中：约定购回利息收入	6,776,394.14	6,067,213.83
股票质押回购利息收入	833,271,964.21	907,656,150.99
其他债权投资利息收入	631,208,450.23	303,201,259.37
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	16,669,601.28	6,626,370.09
<b>利息支出</b>	<b>3,543,016,500.42</b>	<b>3,086,252,280.04</b>
其中：借款利息支出	43,429,416.69	37,068,830.54
应付短期融资款利息支出	192,278,813.79	144,534,664.90
拆入资金利息支出	153,000,756.45	105,576,069.42
其中：转融通利息支出	126,416,666.44	78,267,777.68
卖出回购金融资产利息支出	946,501,586.54	641,049,344.82
其中：报价回购利息支出	5,881,903.68	2,085,130.96
代理买卖证券款利息支出	131,701,257.18	123,691,006.13
应付债券利息支出	1,980,771,488.98	1,914,956,836.72
其中：次级债券利息支出	142,733,556.17	100,592,277.57
租赁负债利息支出	9,005,125.10	9,351,458.97
其他按实际利率法计算的金融负债利息支出	86,328,055.69	110,024,068.54
<b>利息净收入</b>	<b>1,265,789,633.60</b>	<b>1,517,745,007.44</b>

## 十四、母公司财务报表项目注释 (续)

### 4、投资收益

(1) 投资收益按类别列示

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
成本法核算的长期股权投资收益 (2)	-	126,584,144.65
权益法核算的长期股权投资收益	311,694,737.85	337,663,452.50
<b>金融工具投资收益</b>	(1,090,504,564.41)	2,617,801,330.66
(1) 持有期间取得的收益	2,167,939,823.33	2,715,470,198.91
交易性金融工具	2,099,902,703.64	1,713,689,564.60
其他权益工具投资	68,037,119.69	1,001,780,634.31
(2) 处置金融工具取得的收益	(3,258,444,387.74)	(97,668,868.25)
交易性金融工具	(1,244,389,826.57)	(168,837,712.62)
其他债权投资	33,633,905.39	(686,546,848.46)
衍生金融工具	(2,048,589,952.95)	1,178,560,845.36
其他	901,486.39	(420,845,152.53)
<b>合计</b>	<b>(778,809,826.56)</b>	<b>3,082,048,927.81</b>

(2) 按成本法核算的长期股权投资收益

单位：人民币元

被投资单位	本期发生额	上期发生额	本期比上年增减变动的原因
海富通基金管理有限公司	-	93,754,144.65	被投资单位分红发生变动
海富产业投资基金管理有限公司	-	32,830,000.00	被投资单位分红发生变动
合计	-	126,584,144.65	

### 5、公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产	306,853,164.97	622,676,234.31
衍生金融工具	1,535,383,935.58	123,644,340.01
交易性金融负债	881,814,291.41	(172,503,533.84)
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	866,691,091.41	(172,678,133.84)
合计	2,724,051,391.96	573,817,040.48

## 十四、母公司财务报表项目注释 (续)

### 6、业务及管理费

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
职工费用	2,147,175,151.70	2,493,153,941.37
固定资产折旧费	199,840,586.93	155,685,513.11
证券投资者保护基金	113,053,533.68	44,865,728.66
使用权资产折旧	81,124,644.04	87,183,890.87
电子设备运转费	70,322,011.94	102,616,407.98
无形资产摊销	57,879,051.38	51,219,588.16
业务招待费	43,815,598.46	64,466,668.50
咨询费	40,558,901.16	51,747,641.81
物业管理费	38,876,680.07	36,728,044.63
邮电通讯费	31,246,124.73	81,277,546.89
其他	205,035,887.02	222,518,185.19
合计	3,028,928,171.11	3,391,463,157.17

## 十四、母公司财务报表项目注释 (续)

### 7、现金流量表补充资料

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
1、将净利润调节为经营活动现金流量		
净利润	4,509,685,814.32	4,687,971,315.60
加：信用减值损失	(678,701,091.05)	(75,034,174.19)
固定资产及投资性房地产折旧	200,377,845.41	156,197,715.05
使用权资产折旧	81,124,644.04	87,183,890.87
无形资产摊销	57,879,051.38	51,219,588.16
长期待摊费用摊销	30,839,417.80	27,817,665.88
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失	482,033.90	1,798,167.69
公允价值变动收益	(2,724,051,391.96)	(573,817,040.48)
利息支出	1,629,718,460.08	1,798,440,223.44
汇兑损失 / (收益)	49,466,656.40	(96,016,824.45)
投资收益	(413,365,762.93)	(779,915,394.28)
递延所得税资产减少	843,244,800.45	194,332,723.36
交易性金融资产等的减少	25,298,575,250.58	3,130,494,067.90
经营性应收项目的减少 / (增加)	1,086,667,811.36	(4,903,649,546.68)
经营性应付项目的 (减少) / 增加	(13,008,747,858.34)	10,842,033,297.37
经营活动产生的现金流量净额	16,963,195,681.44	14,549,055,675.24
2、不涉及现金收支的重大投资和筹资活动		
债务转为资本	-	-
一年内到期的可转换公司债券	-	-
融资租入固定资产	-	-
3、现金及现金等价物净变动情况		
现金的期末余额	134,843,146,195.67	108,701,335,540.16
减：现金的年初余额	117,262,317,533.08	91,698,084,523.06
加：现金等价物的期末余额	-	-
减：现金等价物的年初余额	-	-
现金及现金等价物净增加额	17,580,828,662.59	17,003,251,017.10

## 十五、财务报表的批准报出

本财务报表业经本公司董事会于 2022 年 8 月 26 日批准报出。

## 补充资料

### 1、非经常性损益明细表

项目	本期发生额
非流动资产处置损益	(39,077,965.89)
计入当期损益的政府补助(与企业业务密切相关,按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外)	677,311,826.43
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益	-
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	86,408,364.08
减: 所得税影响额	178,720,773.76
少数股东权益影响额(税后)	22,877,318.27
合计	523,044,132.59

注: 本集团交易性金融资产、交易性金融负债、衍生金融工具等投资产生的公允价值变动损益, 交易性金融资产、交易性金融负债、衍生金融工具、债权投资及其他债权投资等投资产生的投资收益, 均不作为非经常性损益项目, 而界定为经常性损益项目。本集团作为证券经营机构和金融企业, 上述业务均属于本集团的正常经营业务。

### 2、境内外会计准则下会计数据差异

公司按照中国会计准则编制的合并财务报表及按照国际财务报告准则编制的合并财务报表中列示的 2022 年 1-6 月及 2021 年 1-6 月的净利润和 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日的净资产并无差异。

### 3、净资产收益率及每股收益

本净资产收益率和每股收益计算表是本公司按照中国证监会颁布的《公开发行证券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) 的有关规定而编制的。

报告期利润	加权平均净资产收益率 (%)	每股收益 (元)	
		基本每股收益	稀释每股收益
归属于公司普通股股东的净利润	2.88	0.36	0.36
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	2.57	0.32	0.32



## 第十节 证券公司信息披露



## 一、公司重大行政许可事项的相关情况

日期	批复标题	批复单位	批文号
2022年1月1日	内部资料性出版物准印证	上海市新闻出版局	准印证号(K) 0772

## 二、监管部门对公司的分类结果

适用 不适用

