



**申万宏源集团股份有限公司**  
**SHENWAN HONGYUAN GROUP CO., LTD.**

(A 股股票代码：000166 H 股股票代码：6806)

## **2022年半年度报告**

二〇二二年八月三十日

## 第一节 重要提示、目录和释义

### 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、准确、完整，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、本半年度报告经公司第五届董事会第十二次会议审议通过。会议应参加表决董事 11 人，实际参加表决董事 11 人。没有董事、监事、高级管理人员声明对半年度报告内容的真实性、准确性、完整性无法保证或存在异议。

三、本公司法定代表人、执行董事、总经理黄昊先生，财务总监任全胜女士及计划财务部总经理张艳女士声明：保证本半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。

四、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。

五、本半年度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实质承诺，敬请投资者注意投资风险。

六、公司已在本半年度报告中详细描述可能存在的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、政策风险、法律合规风险、创新业务风险和汇率风险，请投资者认真阅读本半年度报告第三节“管理层讨论与分析”，并特别注意上述风险因素。

七、公司计划 2022 年半年度不派发现金红利，不送红股，不以公积金转增股本。

八、报告期内，公司不存在优先股。

## 目录

第一节	重要提示、目录和释义 .....	1
第二节	公司简介和主要财务指标 .....	7
第三节	管理层讨论与分析 .....	12
第四节	公司治理 .....	54
第五节	环境和社会责任 .....	63
第六节	重要事项 .....	66
第七节	股份变动及股东情况 .....	95
第八节	债券相关情况 .....	100
第九节	财务报告 .....	108

## 备查文件目录

- 一、载有公司负责人、主管会计工作负责人、会计机构负责人（会计主管人员）签名并盖章的财务报表。
- 二、报告期内公开披露过的所有公司文件的正本及公告的原稿。
- 三、在其他证券市场公布的半年度报告。

## 释义

在本半年度报告中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

释义项		释义内容
“公司”、“本公司”、“申万宏源集团”	指	申万宏源集团股份有限公司
“集团、本集团”	指	本公司及本公司的子公司
“《公司章程》或《章程》”	指	本公司的公司章程，以不时修订的内容为准
“股东大会”	指	公司股东大会
“董事会”	指	公司董事会
“监事会”	指	公司监事会
“控股股东”、“中国建投”	指	中国建银投资有限责任公司
“实际控制人”、“中央汇金”	指	中央汇金投资有限责任公司
“申万宏源证券”	指	申万宏源证券有限公司
“宏源汇富”	指	宏源汇富创业投资有限公司
“宏源汇智”	指	宏源汇智投资有限公司
“宏源期货”	指	宏源期货有限公司
“宏源恒利”	指	宏源恒利（上海）实业有限公司
“申万宏源承销保荐”	指	申万宏源证券承销保荐有限责任公司
“申万创新投”	指	申银万国创新证券投资有限公司
“申万期货”	指	申银万国期货有限公司
“申万投资”	指	申银万国投资有限公司
“申万研究所”	指	上海申银万国证券研究所有限公司
“申万菱信”	指	申万菱信基金管理有限公司
“富国基金”	指	富国基金管理有限公司
“中国证监会”	指	中国证券监督管理委员会
“深交所”	指	深圳证券交易所
“上交所”	指	上海证券交易所
“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
“《公司法》”	指	《中华人民共和国公司法》
“《证券法》”	指	《中华人民共和国证券法》
“《证券及期货条例》”	指	香港法例第 571 章《证券及期货条例》
“《香港上市规则》”	指	香港联合交易所有限公司证券上市规则
“《企业管治守则》”	指	《香港上市规则》附录十四所载之《企业管治守则》(经修订版本已于 2022 年 1 月 1 日生效)
“《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》
“上证综指”	指	上海证券交易所股票价格综合指数
“深证成指”	指	深圳证券交易所成份股股价指数

释义项		释义内容
“A股”	指	本公司每股面值为人民币1.00元的内资普通股，于深交所上市并以人民币买卖
“H股”	指	本公司每股面值人民币1.00元的境外上市外资普通股，于香港联交所上市并以港元买卖
“ETF”	指	交易所交易基金
“FICC”	指	固定收益、货币及商品
“CMBS”	指	商业房地产抵押贷款支持证券
“IPO”	指	首次公开募集股份
“PRE-IPO”	指	对上市前或预期可上市企业进行直接股权投资
“ABS”	指	资产支持证券
“PE”	指	私募股权投资
“VC”	指	风险投资
“FOF”	指	一种专门投资于其他证券投资基金的基金
“PTA”	指	在郑州商品期货交易所上市的期货品种
“WIND”	指	万得信息技术股份有限公司，一家中国大陆金融资料、资讯和软件服务企业
“CHOICE”	指	一家为金融机构提供专业金融数据服务的平台
“QDLP”	指	合格境内有限合伙人
“融资融券”	指	投资者向合资格进行融资融券业务的证券公司提供担保品，以为购买证券借取资金（融资）或借取及卖出证券（融券）
“新三板”	指	全国中小企业股份转让系统
“净资本”	指	净资产扣减金融资产风险调整减其他资产风险调整及或有负债的风险调整，再加或减中国证监会认可或核准的其他调整项目
“科创板”	指	上海证券交易所设立的科技创新板
“创业板”	指	深交所推出的创业板
“股票质押式融资”	指	证券公司向合资格并以所持股票为担保品的投资者提供融资的交易
“收益凭证”	指	证券公司发行订有支付本金及与特定相关资产挂钩回报条款的有价证券
“VaR”	指	风险价值
“PB系统”	指	主经纪商系统
“EBITDA”	指	息税折旧及摊销前利润
“人民币”	指	中国法定货币人民币
“港币”	指	香港法定货币港元及港仙

释义项		释义内容
“香港”	指	中国香港特别行政区
“美元”	指	美国法定货币美元
“报告期”	指	2022年1月1日至2022年6月30日止六个月期间
“%”	指	百分比
“元、万元、亿元”	指	人民币“元、万元、亿元”

2022年半年度报告中，部分合计数与各加总数直接相加之和在尾数上可能有差异，这些差异是由于四舍五入造成的。

## 第二节 公司简介和主要财务指标

### 一、公司简介

股票简称	申万宏源	股票代码	000166（深交所）、 6806（香港联交所）
股票上市证券交易所	深交所、香港联交所		
公司的中文名称	申万宏源集团股份有限公司		
公司的中文简称	申万宏源		
公司的外文名称	Shenwan Hongyuan Group Co., Ltd.		
公司的外文名称缩写	Shenwan Hongyuan		
公司的法定代表人	黄昊先生		
授权代表	刘健先生、徐亮先生		
联席公司秘书	徐亮先生、黄伟超先生		

### 二、联系人和联系方式

	董事会秘书	证券事务代表
姓名	徐亮先生	徐亮先生
联系地址	中国新疆乌鲁木齐市高新区北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼	中国新疆乌鲁木齐市高新区北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼
电话	0991-2301870、010-88085333	0991-2301870、010-88085333
传真	0991-2301779	0991-2301779
电子信箱	swhy@swhysc.com	swhy@swhysc.com

### 三、其他情况

#### （一）公司联系方式

公司注册地址	中国新疆乌鲁木齐市高新区北京南路358号大成国际大厦20楼2001室
公司注册地址的邮政编码	830011
公司办公地址	中国新疆乌鲁木齐市高新区北京南路358号大成国际大厦20楼； 中国北京市西城区太平桥大街19号
公司办公地址的邮政编码	830011； 100033
香港主要营业地点	香港湾仔皇后大道东248号大新金融中心40楼
公司网址	www.swhygh.com
公司电子信箱	swhy@swhysc.com

## （二）信息披露及备置地点

公司选定的信息披露报纸的名称	《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》
公司披露A股半年度报告的证券交易所网站	深圳证券交易所：www.szse.cn
公司披露A股半年度报告的媒体名称及网址	巨潮资讯网：www.cninfo.com.cn
公司披露H股中期报告的证券交易所网站	香港联交所披露易：www.hkexnews.hk
公司半年度报告备置地点	中国新疆乌鲁木齐市高新区北京南路358号大成国际大厦20楼公司董事会办公室

## （三）其他有关资料

股份登记处	A股：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司 中国广东省深圳市福田区深南大道2012号深圳证券交易所广场22-28楼 H股：香港中央证券登记有限公司 香港湾仔皇后大道东183号合和中心17楼1712-1716室
法律顾问	北京颐和中鸿律师事务所（中国境内法律顾问） 中国北京市东城区建国门内大街7号光华长安大厦2座1910室 高伟绅律师行（香港法律顾问） 香港中环康乐广场1号怡和大厦27楼

会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）（境内） 中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼 罗兵咸永道会计师事务所（国际） 香港中环雪厂街5号太子大厦22楼
--------	---

#### 四、主要会计数据和财务指标

合并

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期	上年同期	本报告期比上年同期增减（%）
营业收入	12,818,884,641.34	16,079,341,984.03	-20.28
归属于上市公司股东的净利润	3,361,795,635.20	4,520,909,978.30	-25.64
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润	3,213,100,129.79	4,513,747,589.57	-28.82
其他综合收益的税后净额	-131,524,019.16	-226,372,911.61	不适用
经营活动产生的现金流量净额	25,517,521,798.27	-28,343,077,579.22	不适用
基本每股收益（元/股）	0.13	0.18	-27.78
稀释每股收益（元/股）	0.13	0.18	-27.78
加权平均净资产收益率（%）	3.47	5.01	减少1.54个百分点
项目	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年末增减（%）
资产总额	624,957,963,235.55	601,011,467,253.09	3.98
负债总额	516,988,313,524.72	493,956,873,232.83	4.66
归属于上市公司股东的净资产	95,933,101,010.34	95,222,008,059.47	0.75

母公司

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期	上年同期	本报告期比上年同期增减（%）
营业收入	3,129,381,972.49	3,244,943,747.77	-3.56
净利润	3,028,616,124.57	3,173,287,335.36	-4.56
其他综合收益的税后净额	-	-	-
经营活动使用的现金流量净额	284,623,041.53	-1,087,687,493.13	不适用
基本每股收益（元/股）	0.12	0.13	-7.69
稀释每股收益（元/股）	0.12	0.13	-7.69
加权平均净资产收益率（%）	5.01	5.32	减少0.31个百分点
项目	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年末增减（%）
资产总额	90,189,348,181.14	84,070,910,087.36	7.28
负债总额	30,751,038,492.73	25,157,222,067.52	22.24
所有者权益总额	59,438,309,688.41	58,913,688,019.84	0.89

截止披露前一交易日的公司总股本（股）

25,039,944,560

用最新股本计算的全面摊薄每股收益：

支付的优先股股利	-
支付的永续债利息（元）	-
用最新股本计算的全面摊薄每股收益（元/股）	0.13

## 五、境内外会计准则下会计数据差异

（一）同时按照国际会计准则与按照中国会计准则披露的财务报告中净利润和净资产差异情况

不适用

（二）同时按照境外会计准则与按照中国会计准则披露的财务报告中净利润和净资产差异情况

不适用

（三）境内外会计准则下会计数据差异原因说明

不适用

## 六、非经常性损益的项目和金额

单位：元 币种：人民币

项目	金额	说明
非流动资产处置损益(包括已计提资产减值准备的冲销部分)	812,939.37	主要是固定资产处置损益
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)	245,950,181.61	主要是财政奖励资金
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-48,350,823.47	主要是对外捐赠及赞助支出
减: 所得税影响额	49,570,545.25	
少数股东权益影响额(税后)	146,246.85	
合计	148,695,505.41	

## 七、净资产及有关风险控制指标(以申万宏源证券母公司数据计算)

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减
核心净资产	59,259,157,589.08	62,373,396,232.22	-4.99%
附属净资产	17,240,000,000.00	20,760,000,000.00	-16.96%
净资产	76,499,157,589.08	83,133,396,232.22	-7.98%
净资产	97,878,432,048.50	98,220,020,332.90	-0.35%
各项风险资本准备之和	41,917,364,536.29	40,148,468,918.55	4.41%

表内外资产总额	505,108,589,642.01	481,426,172,384.72	4.92%
风险覆盖率	182.50%	207.06%	减少 24.56 个百分点
资本杠杆率	11.98%	13.11%	减少 1.13 个百分点
流动性覆盖率	232.82%	208.79%	增加 24.03 个百分点
净稳定资金率	134.81%	131.00%	增加 3.81 个百分点
净资本/净资产	78.16%	84.64%	减少 6.48 个百分点
净资本/负债	23.00%	25.58%	减少 2.58 个百分点
净资产/负债	29.42%	30.22%	减少 0.80 个百分点
自营权益类证券及其衍生品/净资本	53.90%	44.99%	增加 8.91 个百分点
自营非权益类证券及其衍生品/净资本	298.65%	271.01%	增加 27.64 个百分点

## 八、审计委员会之审阅

董事会审计委员会已审阅并确认公司截至2022年6月30日止六个月的未经审计的2022年半年度财务报告，未对公司所采纳的会计政策及常规等事项提出异议。

## 第三节 管理层讨论与分析

### 一、报告期内公司所处行业情况

#### （一）报告期内公司所属行业基本情况

2022年上半年，全球疫情依然严峻、地缘政治冲突升级、全球化与区域化不断博弈，多重不利因素影响对我国国民经济发展带来了前所未有的挑战，资本市场行情呈现较大波动。为维护资本市场稳定，提振市场信心，中国证监会坚决贯彻国务院金融稳定发展委员会专题会议精神，陆续出台系列政策，全力维护资本市场平稳运行。在高效统筹疫情防控和经济社会发展各项政策措施的支持下，国内经济逐步企稳回升，呈现稳中加固、稳中向好、稳中提质运行态势，证券行业整体经营环境有所改善，各项业务重回良性发展的正轨。报告期内，我国证券行业主要呈三大发展特征：

#### 1. 资本市场波动加剧，券商行情及经营业绩整体承压

2022年上半年，面对国内经济运行下行和疫情防控形势趋紧的双重压力，证券市场主要指数出现一定幅度的震荡下调，截至6月30日，上证综指、深证成指、创业板指较年初分别下跌6.63%、13.20%、15.41%，受市场剧烈波动影响，一季度证券市场震荡下跌，伴随着二季度市场回暖，以及机构自身策略调整，券商行情回暖，但整体表现较去年同期相比仍有一定程度下滑。

#### 2. 改革夯实资本市场韧性，流动性宽松叠加政策面持续向好

报告期内资本市场围绕“稳字当头、稳中求进”推进各项改革举措，制度建设逐步完善，推动资本市场长期向好，个人养老金制度落地带来资管行业增量；加快推进公募基金行业高质量发展推动中长期资金入市；股票交易过户费下调利于促进成交额上升；北交所转板制度正式落地，标志着我国多层次资本市场实现了真正意义上的互联互通；科创板做市商制度试点落地，填补A股做市制度空白；《中华人民共和国期货和衍生品法》发布，为期货市场的对外开放和高质量发展提供更广阔的发展空间。此外，中央政治局会议明确提出全面稳增长，国常会部署稳经济一揽子政策加速落地生效，坚决稳住宏观经济大盘，市场生态逐步改善，市场活力持续增强，推动证券行业健康可持续发展。

#### 3. 全面贯彻“零容忍”监管方针，持续完善市场发展生态

资本市场“零容忍”监管执法持续升级，报告期内证监系统密集发布各类监管文件，涵盖从业人员执业规范、业务操作指引、合规文化建设、声誉管理等，稳步推进各项法规条例建设。与此同时，监管机构对证券公司各类违规行为依然保持严监管态势，行政处罚力度显著加强，对中介机构执业过程尽职尽责提出更高要求。2022年上半年，各监管主体向证券公司及个人共发出163张罚单，涉及60家机构，137名相关从业人员，数量较同期明显增加，并呈现一案“多罚”、后督追责时间拉长等特点。通过加强制度建设，加大监管力度，进一步构建“合规、诚信、专业、稳健”为核心的证券行业文化理念，持续推动证券行业高质量发展。

## （二）公司所处的行业地位

作为一家以资本市场为依托的综合金融服务商，公司见证了中国证券业的发展历程，经历了多个市场周期变化，确立了在中国证券行业内历史悠久、多方位、高质量的领先地位。公司充分利用“投资控股集团+证券子公司”的双层架构优势，坚持稳健经营，严控风险，围绕企业金融、个人金融、机构服务及交易、投资管理等客户需求，不断丰富证券业务领域、优化资产配置结构、加快各类业务协同、持续完善可持续发展投资模式，全力打造综合金融服务闭环。报告期内，公司积极应对新冠肺炎疫情和经济发展压力的双重挑战，认真贯彻落实党中央、国务院各项决策部署，统筹疫情防控和经营管理，全力做好“六稳”工作、落实“六保”任务，不断增强客户综合服务能力，积极优化业务布局、加快改革转型、强化风险防控，多措并举服务国家战略，支持各类市场主体纾困解难，助力稳住经济大盘。现阶段，公司资产质量优良、财务状况良好，在经营业绩和业务行业排名等方面均保持较好水平，综合实力稳居行业第一梯队。

## 二、公司从事的主要业务

### （一）报告期内公司从事的主要业务

作为一家投资控股集团，公司以资本市场为依托，以证券业务为核心，致力于为客户提供多元化的金融产品及服务。公司依托“投资控股集团+证券子公司”的架构，形成了具有差异化竞争优势的经营发展模式。公司的业务主要包括企业金融、个人金融、机构服务及交易、投资管理四个板块，具体业务构架如下：

企业金融		个人金融	机构服务及交易	投资管理
投资银行	本金投资			
· 股权融资	· 股权投资	· 证券经纪与	· 主经纪商服务	· 资产管理
· 债权融资	· 债权投资	期货经纪	· 研究咨询	· 公募基金管理
· 财务顾问	· 其他投资	· 融资融券	· 自营交易	· 私募基金管理
		· 股票质押式融资		
		· 金融产品销售		

### 1. 企业金融

公司的企业金融业务由投资银行业务和本金投资业务组成。投资银行业务为企业客户提供股票承销保荐、债券承销及财务顾问等服务；本金投资业务主要从事非上市公司的股权和债权投资。

### 2. 个人金融

公司的个人金融业务覆盖个人及非专业机构投资者全方位的需要，通过线上线下相结合的方式提供证券经纪、期货经纪、融资融券、股票质押式融资、金融产品销售和投资顾问等服务。

### 3. 机构服务及交易

公司的机构服务包括为专业机构客户提供主经纪商服务与研究咨询等服务；此外，公司也从事 FICC、权益类及权益挂钩类证券交易，并以此为基础向机构客户提供销售、交易、对冲及场外衍生品服务。

### 4. 投资管理

公司的投资管理业务包括资产管理、公募基金管理和私募基金管理服务。

公司的主要业务和经营模式在报告期内没有发生重大变化。

## (二) 报告期内获得的主要奖项及荣誉

颁发机构	奖项名称
中国人民银行上海总部	2021 年度上海经济金融调研机制调研工作先进集体
中国人民银行上海总部	2021 年度上海经济金融调研机制优秀调研成果综合奖一等奖
中国证券业协会	2021-2022 年度投资者教育工作 A 类评价
新疆维吾尔自治区地方金融监督管理局	新疆维吾尔自治区金融业及金融监管部门支持新疆经济高质量发展考核奖励表彰单位

新疆证券期货业协会	新疆辖区 2021 年度合规风控优秀会员单位（申万宏源西部证券 6 家单位）
深圳证券交易所	2021 年优秀债券投资交易机构
深圳证券交易所	2021 年度优秀公募 REITs 做市商
深圳证券交易所	2021 年度“新锐 ETF 基金管理人”
深圳证券交易所	2021 年度“优秀利率债承销机构”
深圳证券交易所	“优秀利率债承销个人奖”（万海燕）
深圳证券交易所	“优秀利率债承销个人奖”（隋颜休）
上海证券交易所	2021 年度优秀 REITs 流动性券服务商
上海证券交易所	2021 年度公司债券优秀承销商
上海证券交易所	2021 年度公司债券创新产品优秀承销商
上海证券交易所	西部子公司昌吉延安路营业部、乌鲁木齐北京南路营业部获 2021 年“ETF 百强营业部”
上海证券交易所	地方政府债优秀承销机构
中央国债登记结算有限责任公司	2021 年度中债成员业务发展质量评价结果-结算 100 强（证券机构）
中央国债登记结算有限责任公司	2021 年度中债成员业务发展质量评价结果-地方债承销杰出机构（非银类）
中央国债登记结算有限责任公司	地方债承销杰出机构
中央国债登记结算有限责任公司	债券交易投资类自营结算 100 强
中国外汇交易中心	年度市场影响力奖-活跃交易商
中国外汇交易中心	市场创新奖-债券承销（承销商）
中国外汇交易中心	市场创新奖-iDeal
中国上市公司协会	2021 年度 A 股上市公司现金分红榜单丰厚回报榜
中国金融期货交易所	2021 年度优秀会员白金奖
中国金融期货交易所	2021 年度风险管理服务奖（股指期货类）
中国金融期货交易所	2021 年度风险管理服务奖（股指期货类）
中国金融期货交易所	2021 年度市场宣传奖
上海期货交易所	做市业务银奖
上海期货交易所	优秀会员奖
上海期货交易所	贵金属产业服务奖
上海期货交易所	能化产业服务奖
郑州商品交易所	优秀期权做市商奖
郑州商品交易所	2021 年度优秀会员
郑州商品交易所	2021 年度农业产业服务奖
郑州商品交易所	2021 年度纺织产业服务奖
郑州商品交易所	2021 年度优秀风险管理公司
郑州商品交易所	优秀期货做市商奖
大连商品交易所	“企业风险管理计划”优秀项目奖
大连商品交易所	做市商贡献奖
大连商品交易所	2021 年度优秀会员金奖
大连商品交易所	2021 年度优秀技术服务奖
大连商品交易所	2021 年度优秀能化产业服务奖
大连商品交易所	2021 年度优秀钢铁原燃料产业服务奖

大连商品交易所	2021 年度优秀机构服务奖
上海浦东发展银行	2021 年浦发银行最佳 FICC 合作伙伴
融资中国	2021 年度中国最佳券商母基金、2021 年度中国最佳 S 基金投资机构
证券时报	第十三届中国上市公司投资者关系“天马奖”之“中国上市公司最佳投资者关系奖”
新财富（第十五届）	本土最佳投行第 9 名
新财富（第十五届）	最佳践行 ESG 投行
新财富（第十五届）	最佳股权承销投行第 8 名
新财富（第十五届）	最佳债权承销投行第 9 名
新财富（第十五届）	最佳再融资投行第 8 名
新财富（第十五届）	新能源产业最佳投行第 5 名
新财富（第十五届）	最佳 IPO 项目第 9 名--中自环保
新财富（第十五届）	最佳再融资项目第 10 名--中环股份
新财富（第十五届）	最佳公司债项目第 7 名--南京江宁旅游产业集团
新财富（第十五届）	最佳投行业务精英（杨晓）
新财富（第十五届）	最佳保荐代表人（廖妍华）
WIND	2021 年度 Wind 最佳投行-最佳 A 股股权承销商
WIND	2021 年度 Wind 最佳投行-最佳 A 股再融资承销商
WIND	2021 年度 Wind 最佳投行-最佳科创板股权承销商
WIND	2021 年度 Wind 最佳投行-最佳北交所股权承销商
Structured Retail Products Limited 第三届中国区结构化产品年度奖项	年度人物奖
Structured Retail Products Limited 第三届中国区结构化产品年度奖项	年度新星奖
CNABS	第六届 CNABS 中国资产证券化年度评选“金桂奖”

### 三、核心竞争力分析

公司依照战略要求，充分发挥既有优势，统筹推进各个业务板块协调发展，积极打造以证券业务为核心的投资控股集团，形成了自身的核心竞争力，主要体现在以下几个方面：

#### （一）领先的综合实力

公司拥有强大的股东优势，资本实力雄厚，品牌影响广泛，客户资源丰富，网点分布全面，经营业绩良好，综合竞争力位于证券行业前列。公司坚持以客户为中心的发展理念，全面推进证券业务发展和转型创新，并围绕证券业务积极拓展投资业务，持续巩固和提升综合金融服务能力。

#### （二）全面的业务布局

公司健全以资本市场为依托的全产业链服务体系，持续完善证券业务产品线和服务线，充分发挥牌照齐全和业务能力领先优势，发展势头良好，行业竞争力稳步提升。公司围绕资本市场和证券业务积极拓展投资布局，推进证券业务与投资业务的高效协同发展。

### （三）良好的区位优势

公司紧密结合国家发展战略，推动建立东西联动、资源协同的区域发展格局。在上海和新疆等传统优势地区广泛布局，深入挖掘上海“两个中心”和自贸区建设的发展机遇，积极对接西部大开发和“一带一路”建设，不断深化在粤港澳大湾区、京津冀、大西南等地区的前瞻布局，进一步打造重要区域增长极。

### （四）有效的风险管理

公司高度重视依法合规经营和内部控制建设，建立了全面、全员、全过程、全覆盖的集团化风险管理体系，不断完善风险政策，优化风险识别和应对，有效地控制了经营风险。申万宏源证券的各项风险控制指标均达到监管要求，业务保持健康发展的良好态势，为公司综合实力的进一步提高提供了保障。

### （五）完善的人才机制

公司坚持以人为本，秉承德才兼备、任人唯贤、人尽其才的用人理念，营造公开、平等、竞争、择优、适用的用人环境，持续完善以市场化机制为核心的人力资源发展体系，促进公司、股东和员工利益共享，为员工长期发展和自我价值实现提供持久坚实的职业保障。

## 四、主营业务分析

2022 年上半年，面对错综复杂的国际形势和不断加大的经济下行压力，公司坚持“稳中求进”工作总基调，立足主责主业，发挥金融优势，支持“专精特新”企业、战略性新兴产业、前沿科技企业发展，助力先进制造业、产业链重要环节和核心节点企业转型升级，丰富供应链金融服务供给，推动自身业务发展融入到我国经济、资本市场高质量发展的大局之中。同时积极践行国有金融企业责任担当，帮助受疫情影响、暂时困难的行业企业渡过难关、恢复发展，以发展促就业、以就业保民生。

### （一）总体情况

2022 年上半年，公司实现合并营业收入人民币 128.19 亿元，同比下降 20.28%；归属于母公司股东的净利润人民币 33.62 亿元，同比下降 25.64%；基本每股收益人民

币 0.13 元/股，同比下降 27.78%；加权平均净资产收益率 3.47%，同比减少 1.54 个百分点。

## （二）主营业务分析

申万宏源集团旗下包括证券、投资、基金、期货等类型子公司，业务涵盖企业金融、个人金融、机构服务及交易、投资管理四大板块，公司持续构建以资本市场为依托的投资与金融服务全产业链，为客户提供多元化的金融产品和服务。

### 1. 企业金融业务

企业金融业务以企业客户为对象，包括投资银行业务和本金投资业务。其中：投资银行业务包括股权融资、债权融资、财务顾问等；本金投资业务包括股权投资、债权投资、其他投资等。报告期内，公司企业金融业务板块实现营业收入人民币 12.57 亿元，同比下降 4.00%，其中投资银行业务板块实现营业收入人民币 8.40 亿元，同比增加 14.41%；本金投资业务板块实现营业收入人民币 4.17 亿元，同比下降 27.52%。

#### （1）投资银行业务

##### 市场环境：

股权融资方面，受上半年新冠疫情反复影响，全市场股权业务整体呈下行趋势，股权项目家数和规模均较去年同期均有所下降。报告期内，A 股上市新股合计 176 家，同比下降 33.83%，首发募资金额达人民币 2,600.64 亿元，同比增长 18.96%。2022 年上半年 A 股再融资规模达人民币 4,291.31 亿元，同比下降 16.10%，其中定向增发募资规模达人民币 2,382.38 亿元，同比下降 28.02%；可转债合计发行规模达人民币 1,175.36 亿元，同比下降 22.17%。（WIND, 2022）

债权融资方面，2022 年上半年债券市场主要品种发行规模同比均出现下滑，其中企业债发行人民币 2,166.77 亿元，同比下降 1.00%；公司债发行人民币 15,144.34 亿元，同比下降 9.13%；金融债发行人民币 45,827.72 亿元，同比下降 2.96%（WIND, 2022）。报告期内，为防范地方政府债务风险，各债券主管部门仍延续较为严格的直接债务融资审核政策，且维持收紧状态；债券一级市场不同地域分化明显，评级机构开展业务尤其是评级提升业务较为谨慎；产业类主体、民营企业发行债券受到政策支持。

财务顾问方面，在注册制改革稳步推进的背景下，IPO 成为优质资产的优选通道，优质资产供给端的日益匮乏导致并购市场相对冷清。证券监管部门审核通过的上市公司重组项目 15 项，同比下降约 11.76%（WIND, 2022）

### 经营举措及业绩：

公司主要通过申万宏源证券等子公司开展投资银行业务。

公司坚持以落实国家战略、服务实体经济为核心，切实发挥专业优势，深化业务转型创新，持续推动行业、区域、产品优化，持续提升对国家重大发展战略的金融服务能力。坚持履行经济责任与社会责任的有机统一，做好“六稳”“六保”工作，践行服务国家战略的初心与使命。具体举措如下：

服务国家战略方面	具体举措
服务科技自立自强	<b>股权融资方面：</b> 支持中信科移动通信技术股份有限公司、中触媒（688267.SH）、必易微(688045.SH)等一批高新技术企业开展股权融资活动。科创板开板以来，已累计助力 10 家企业登陆科创板。 <b>债权融资方面：</b> 紧抓风口业务，发行 5 只“双创债”，发行规模人民币 32 亿元，为贯彻落实创新驱动发展的国家战略贡献专业力量。报告期内成功发行全国首批、上海首单人民币 10 亿元科创债券。
服务绿色金融	<b>股权融资方面：</b> 助力绿色环保企业中触媒上市科创板，报告期末在审碳中和概念企业项目 5 家。 <b>债权融资方面：</b> 报告期内先后完成中国建设银行绿色金融债、宝钢绿色债（全国首单低碳转型绿色公司债券）、嘉兴天然气绿色资产证券化等各类债券 12 只，累计发行规模人民币 134.50 亿元。
服务“专精特新”中小企业	持续加大中小企业服持力度，累计服务 3,000 余家中小企业，制定并落实申万宏源“专精特新”、“投资+投行”战略。报告期内，北交所承销家数市场排名前 2；截至报告期末，北所在审家数市场排名第 1。
服务乡村振兴	报告期内共发行乡村振兴相关债券 2 只，承销规模和总发行额均为人民币 6.2 亿元，以实际行动助力国家乡村振兴战略。
服务国家“一带一路”战略	<b>股权融资方面：</b> 助力华新水泥香港上市，开创上交所 B 股转 H 股先河。 <b>债权融资方面：</b> 报告期内实现首单“一带一路”债券项目“22 渝北 01”的发行，发行规模人民币 10 亿元。
服务普惠金融政策	积极落实普惠金融政策，服务中小微企业，已连续多年为新三板企业减免持续督导费用；积极为中小微企业开展政策宣讲、专题讲座、业务培训及互动交流等活动十余次，帮助企业及时了解和掌握国家普惠金融相关政策、企业所属市场及行业动态、资本市场的发展态势等。报告期内公司新三板定向发行排名市场前 2，推荐挂牌储备项目市场前 2；发行北京银行、北部湾银行、江苏银行等债券项目 11 只，发行总规模人民币 464.06 亿元。

#### a. 股权融资：

报告期内，公司股权融资业务取得跨越式发展，行业排名快速提升，IPO 业务表现亮眼，再融资业务奋楫争先，新三板业务厚积薄发。

境内股权融资业务方面，报告期内公司承销总规模人民币 161.74 亿元，承销家数 14 家，承销规模行业排名第 10（WIND，发行日口径），行业排名快速上升。其中，再融资承销规模人民币 125.78 亿元，承销家数 9 家，承销规模排名行业第 8，承销家数排名行业第 7；科创板 IPO 承销规模人民币 27.98 亿元，承销家数 2 家，承销规模排名行业第 9；截至报告期末，公司 IPO 在审及已过会待发行数量共 36 家，储备数量位居行业第 9。

此外，公司积极推进“专精特新”战略，大力发展普惠金融业务，全力助推中小企业发展，截至报告期末新三板挂牌企业持续督导 578 家，市场排名第 2，其中创新层持续督导 158 家，市场排名第 2；累计推荐挂牌企业 812 家，累计为挂牌企业提供定向发行 862 次，累计为挂牌企业进行股权融资共计人民币 355.51 亿元，均排名行业第 1（CHOICE，上市日口径）；北交所累计承销 8 家，排名行业第 3；北交所累计过会 9 家，排名行业第 3；北交所在审 13 家，排名行业第 1。

境外股权融资方面，公司持续推进国际化及境内外一体化战略，逐步扩大项目储备、加快项目周转速度，报告期内，作为独家保荐人和财务顾问助力华新水泥香港上市，完成上交所首单 B 股转 H 股项目。

#### b. 债权融资：

2022 年上半年，在债券发行市场负增长以及新冠疫情持续反复背景下，公司债权融资业务保持良好发展态势，行业排名持续提升，市场影响力进一步增加。报告期内公司债券全口径（公司债+金融债+企业债）共计发行债券 150 只，承销家数行业排名第 8；承销规模人民币 978.75 亿元，承销规模行业排名第 7，较 2021 年末上升 1 位。（WIND, 2022）

此外，公司积极落实服务国家战略要求，拓展布局服务国家战略类项目和特色业务品种，报告期内债券发行募集资金流向多为疫情防控、双碳发展和科技创新等关键领域，积极助力受疫情影响严重的交通运输、文化旅游和工程建设等困难企业和中小微企业拓宽融资渠道，报告期内发行市场年度首单由央企发行的疫情防控债“22 上航 01”。

境外债权融资方面，公司持续开发大型央企、综合国企等优质企业境外债券项目，持续完善境内外团队协作能力，报告期内，共完成 60 单债券项目，融资规模共 99.57 亿美元，承销金额位列中资券商系第 7 名。此外，公司发行首单欧元债券——台州市

黄岩交通旅游投资集团有限公司欧元债，为浙江省内首笔欧元备证增信债券，实现了债券承销种类的新突破，为公司实现债券品种全覆盖奠定良好的基础。

#### c. 财务顾问

报告期内，公司完成并购财务顾问项目 2 家，境外财务咨询项目 6 单，连续 6 年荣获并购重组财务顾问执业能力评价 A 类券商。

#### 2022 年下半年展望：

2022 年下半年，公司继续牢固树立“以客户为中心”的服务宗旨，秉持“简单金融、成就梦想”的经营理念，凭借丰富的资本市场经验，继续构筑资源整合力，全方位夯实资本、定价、销售、协同、风控、科技等综合能力，持续为客户提供全生命周期的综合金融服务，打造全产业链的大投行生态圈，积极响应国家政策、服务国家战略，助力实体经济发展，充分发挥国有金融企业担当作用。

#### (2) 本金投资业务

##### 市场环境：

随着多层次资本市场不断建设完善，特别是设立科创板并试点注册制、创业板改革并试点注册制，建立上市公司创投基金股东减持股份“反向挂钩”机制，PE/VC 退出渠道进一步扩宽，有利于创业投资机构实现投资收益。与此同时注册制为中小企业打通直接融资渠道，并配套保荐跟投制度，推动券商投行业务转型升级，促进券商本金投资业务与投行承销保荐业务协同。

##### 经营举措及业绩：

公司及所属申万宏源证券等多个子公司开展本金投资业务。

2022 年上半年，公司立足“十四五”时期新的发展趋势，围绕证券业务核心，继续以协同业务为抓手，重点服务战略业务和战略客户，稳步开展投资业务布局，全面提升发展质量，积极构建以“投资+投行”为特色的综合金融服务体系，持续提升服务国家战略能力，全力支持稳定经济大盘，不断提升本金投资业务的市场竞争力。

宏源汇智以服务重要战略客户为核心，进一步加强区域聚焦，深化与重点地区地方政府、龙头企业合作，优化不动产投资业务模式，积极开发 ABS、REITs、CMBS 等投资产品；持续加大对实体经济支持力度，拓展普惠金融服务广度和深度，积极助力绿色低碳转型发展，新增服务中小微企业项目 2 个，中小微企业项目投资余额人民币 7.97 亿元。

申万创新投完成 2 单科创板跟投项目，择优投放 2 个 PRE-IPO 项目。

**2022 年下半年展望：**

2022 年下半年，公司将持续以科创板、创业板跟投等业务为重点，积极探索与证券业务一体化的投资业务模式，实现投资业务与证券业务的协同并进，不断提升投资业务的盈利贡献及稳定性。

**2. 个人金融业务**

个人金融业务主要涵盖证券经纪、期货经纪、融资融券、股票质押式融资以及金融产品销售等。报告期内，公司个人金融业务板块实现营业收入人民币 44.10 亿元，同比增长 5.66%。

**(1) 证券经纪业务****市场环境：**

2022 年上半年，资本市场整体呈震荡回调走势，截至报告期末，上证综指、深证成指、创业板指较年初分别下跌 6.63%、13.20%、15.41%（WIND, 2022）；市场交投较 2021 年上半年略显活跃，沪深两市股票成交额人民币 114.41 万亿元，同比增长 6.32%。（中国人民银行，2022）

**经营举措及业绩：**

公司主要通过申万宏源证券等子公司开展证券经纪业务。

报告期内，公司证券经纪业务以“稳中求进、进中求精”为目标，积极做强获客引资工作，做大客户和资产规模，完善标准化零售客户服务体系，扎实做好基础服务，提高综合服务能力，提升客户质量。报告期末，公司证券客户托管资产达到人民币 4.17 万亿元，市场占有率 5.93%，行业排名靠前。公司大赢家 APP 月活跃度均值 157.7 万，月活跃度峰值达 162.93 万。与此同时，公司证券经纪业务进一步加大金融科技赋能力度，现已启动新一代移动终端—申财有道 APP 的建设工作，申财有道 APP 将充分利用金融科技力量，发力数字化、智能化，结合公司特色业务开展，为客户提供全方位的服务。

**2022 年下半年展望：**

2022 年下半年，公司将持续推进财富管理业务转型，以资产配置与增值、投顾服务、金融科技为抓手，构建高质量客群服务核心竞争力，打造申万宏源财富管理特色品牌。夯实基础客户资产，转型买方投顾模式，强化金融科技赋能，加强财富管理业务协同，打造均衡、可持续发展的财富管理业务模式。

**(2) 期货经纪业务**

### 市场环境：

2022 年，伴随着经济下行压力、国内外货币政策分化和大宗商品价格波动扩大等的复杂的宏观环境，产业和金融机构风险管理需求上升，期货市场风险管理的功能持续发挥。上半年受内外部经济环境日趋复杂因素影响，国内期货市场整体活跃度有所下降，1 月至 6 月全国期货市场累计成交量为 30.46 亿手，累计成交额为人民币 2,574,793.66 亿元，同比分别下降 18.04% 和 10.08%。（中国期货业协会）

### 经营举措及业绩：

公司主要通过子公司申万期货和宏源期货开展期货经纪业务。

2022 年上半年，申万期货以“凝聚共识、夯实基础、深化转型、创先争优”为工作重点，加快建立完善以代理业务为基础，以风险管理业务和财富管理业务为两翼的“一主两翼”的业务体系，建立“机构+财富+资管”为协同的大机构业务模式，深化证券公司与期货公司协同，提高对重点区域产业、机构及高净值客户的服务能力，提升分支机构业务辐射能力，增强整体市场竞争力。上半年日均客户权益规模人民币 312.97 亿元，同比增长 51.83%，6 月末客户权益规模达人民币 345.2 亿元，较去年年末增长 29.15%，均创历史新高。报告期内，申万期货“保险+期货”服务企业案例、党建优秀案例获评中国期货业协会优秀案例，行业地位和品牌形象不断提升。

宏源期货积极适应市场和客户需求变化，抢抓经纪业务市场机遇，实现日均客户权益人民币 134.65 亿元，同比增长 21.61%；深化与机构客户的合作，持续优化客户结构，法人客户权益占比达到 63.78%；风险管理业务进一步加强策略优化升级，期现业务稳步推进含权贸易，实现含税现货贸易人民币 42.29 亿元；做市业务、场外衍生品业务快速发展，做市品种增加至 15 个，新增名义本金规模人民币 148.79 亿元。

### 2022 年下半年展望：

《中华人民共和国期货和衍生品法》已正式实施，进一步夯实市场法治建设基础，为期货市场的对外开放和高质量发展提供更广阔的发展空间。在期货行业快速发展同时，市场持续升温，竞争日益加剧。2022 年下半年，公司期货经纪业务将持续贯彻落实“大力发展轻资本业务，高质量发展重资本业务”发展理念，进一步夯实经纪业务基础，打造财富管理业务和风险管理业务核心能力，加快创

新业务发展，推动客户、业务、收入结构转变。

### （3）融资融券业务

#### 市场环境：

2022 年上半年，A 股市场行情震荡回调，市场整体融资融券余额在 1 月-4 月加速下降后迎来阶段性小幅反弹。截止 2022 年 6 月末，市场融资融券余额人民币 16,033.31 亿元，较上年同期下降 10.14%。（WIND,2022）

#### 经营举措及业绩：

公司主要通过申万宏源证券等子公司开展融资融券业务。

报告期内，公司着力推进企业客户、机构客户、高净值客户综合服务，加快向机构化转型。同时，从制度修订、流程优化、集中度管控、盯市管理等多方面，持续完善融资融券业务管控机制。截至报告期末，公司融资业务余额人民币 641.54 亿元，融券业务余额人民币 38.88 亿元(按证券公司监管报送口径统计)。公司整体融资融券业务的平均维持担保比例为 279.57%，较上年同期提升 3.62 个百分点。

#### 2022 年下半年展望：

2022 年下半年，公司将针对不同客户类别建立差异化营销服务体系，有效提高精准服务能力，切实提升客户服务体验；进一步构建完善券源产业链，加强机构客户券源合作，提升上下游客户融券体验，提高公司融券业务市场竞争力；进一步优化融资融券风险管控手段，持续加强信用业务风险管控及体系优化，积极布局全面注册制证券分类和集中度管控，分层分类进行管控、提升风险控制精准度，确保不发生重大风险事件。

### （4）股票质押式融资业务

#### 市场环境：

2022 年以来，股票质押业务全市场总体规模仍然保持下降态势，上市公司控股股东、大股东股票质押规模进一步减少。报告期内，面对“降规模、调结构”的市场环境，市场参与各方愈发重视股票质押风险防范，主动调整股票质押式融资业务定位。

#### 经营举措及业绩：

公司主要通过申万宏源证券等子公司开展股票质押式融资业务。

报告期内，公司股票质押式融资业务继续保持“控风险，调结构”业务思路，加强项目风险管理，高质量发展股票质押业务，截至报告期末，公司以自有资金出资的股票质押业务融资余额人民币 55.63 亿元，较年初下降 5.31%。

### 2022 年下半年展望：

公司作为大型券商，资本金充足、业务种类齐全、风险管理能力较强，将继续以高质量发展为方向，把股票质押业务作为服务客户的重要工具，致力于为客户提供全方位综合金融服务，切实服务国家战略、服务实体经济。

#### （5）金融产品销售业务

##### 市场环境：

受 2022 年上半年市场行情影响，基金备案规模较 2021 年呈现下滑态势，券商报告期内金融产品销量出现明显下滑。与此同时，大型券商依托雄厚的资本金实力，充分发挥内部主动管理与风险定价能力、资本、风控、销售、协同、科技等综合能力协同，财富管理领域“强者恒强”的趋势进一步显现。作为投资者资产配置服务手段之一，金融产品销售能力也逐渐成为衡量券商财富管理业务质量的重要标准之一。

##### 经营举措及业绩：

公司主要通过申万宏源证券等子公司开展金融产品销售业务。

公司金融产品销售包括销售公司自行开发的金融产品及代销第三方金融产品，金融产品类型涵盖公募证券投资基金、私募证券投资基金、信托计划、资产管理计划、收益凭证、质押式报价回购及其他金融产品等。

2022 年上半年，公司全面贯彻大财富管理的理念，持续推进自有产品能力提升、产品体系完善、产品销售强赋能、合规风险防范，通过完善科学化产品研究和评价体系、客户分级服务体系，持续为客户提供专业化、多层次的产品服务。报告期内，公司共销售金融产品人民币 1,963.94 亿元，其中：自行开发金融产品人民币 1,724.82 亿元，代理销售第三方金融产品人民币 239.12 亿元。

### 2022 年下半年展望：

2022 年下半年，公司将继续以客户为中心，致力于提升投资者长期收益及保有规模，着力加强优势业务资源产品化，提升自有产品竞争力，不断丰富产品储备与供给；加强产品研究能力建设，充分发挥分支区域资源禀赋，加码潜力管理人及优质产品的挖掘及筛选；加强资产配置能力建设，提升财富管理综合解决方案输出能力；全面优化客户服务体系，提升客户体验和获得感，为客户持续创造价值，进一步实现产品销售业务高质量可持续发展。

#### 3.机构服务及交易业务

机构服务及交易业务包括主经纪商服务、研究咨询、FICC 销售及交易和权益类

销售及交易等。报告期内，公司机构服务及交易业务板块实现营业收入人民币 63.67 亿元，同比下降 35.87%。

### （1）主经纪商业务

#### 市场环境：

随着居民资产配置需求提升和资管新规的全面实施，各类资管机构同台竞技，呈现不同发展态势，公募、私募基金产品规模快速增长，机构化、产品化趋势日渐加强，专业化服务需求日益增长。

#### 经营举措及业绩：

公司主要通过申万宏源证券等子公司开展主经纪商服务业务，包括交易席位租赁、PB 系统及基金行政服务。

2022 年上半年，在努力克服疫情带来的不利影响下，公司机构业务持续以产品为纽带，协同整合公司内外部资源，聚焦公募、保险、私募、银行和大型机构客户，为其提供研究、产品和交易等一站式综合金融服务，打造机构业务全业务链。同时，依托控股子公司申万研究所强大的研究实力和品牌影响力，机构客户资源不断积累，机构业务稳步发展。

席位租赁方面，报告期内公司实现收入人民币 5.27 亿元，同比增长 30.09%，排名继续位于行业第一梯队。

PB 系统方面，公司持续加强对银行理财子等重点机构客户的个性化服务，报告期末客户 1,096 家，规模约人民币 2,551.30 亿元。“SWHYMatrix”极速交易平台持续完善功能、优化性能，可为机构客户提供丰富的交易终端系统功能和算法，报告期末公司“SWHYMatrix”极速交易平台接入产品规模达人民币 262.68 亿元。

基金托管和运营外包服务业务方面，公司依靠其广大的分支机构和业务总部赋能，加强属地化业务拓展，深度触达各区域各类资管产品管理人，为其提供产品托管和运营的全生命周期服务。常规化开展线上沙龙营销活动，活动内容涵盖了私募投资策略、合规和运营知识分享、服务功能升级等多个维度，疫情期间开辟了线上维度的新兴营销渠道。报告期内公司新增公募基金、私募基金、私募资管计划的托管及运营外包服务 215 只，新增托管及运营外包服务规模总规模 202.92 亿份。在券商托管机构中，公司报告期内新增公募托管数量排名第 11，新增私募托管数量排名第 10。

#### 2022 年下半年展望：

2022 年下半年，全球疫情日益可控，经济发展逐渐重启，国内经济发展和各项

财政、货币政策支持力度不减。在产品化、机构化的趋势下，公司将继续聚焦大机构、大销售、大交易、大平台的总体思路不动摇，做大做强机构金融“朋友圈”，加大布局投入，确保重点机构客户全覆盖，利用全牌照优势，增强客户黏性，发挥领先交易能力，满足各类客户需求，以资本引介服务，推动构建一站式服务体系。

## （2）研究咨询业务

### 经营举措及业绩：

公司主要通过申万研究所开展研究咨询业务。

报告期内，申万研究所不断践行“研究+投资+投行”战略，深入落实“六稳”“六保”任务，切实发挥品牌优势，着力布局深度研究，不断提升研究质量，市场影响力进一步提升。一是以金融力量服务国家战略。报告期内研究所成功当选中国绿色碳汇基金会副理事长单位，进一步提升在“碳中和”研究领域的影响力；受邀参与 ESG 行业标准编制《企业 ESG 信息披露通则》《企业 ESG 评价通则》，助力我国企业 ESG 信息披露走向标准化；与工信部中国中小企业发展促进中心合作，共同研究建立完善综合性、全链条产业金融服务体系，促进中小企业特别是专精特新企业高质量发展。二是发挥智库实效，为支持企业复工复产、修复经济动能贡献智库力量。联合《上海证券报》重磅推出“发挥资本要素在现代经济体系建设中的正向作用”5 篇研究系列报道，在新华社客户端和上证报整版连载发布，累计阅读量超过 320 万次，网络转载 51 篇，进一步彰显研究所“政策投研智库”的实力与底蕴。三是贯彻落实七大研究主题，巩固既有品牌优势。围绕“碳中和、专精特新、新基建、创新消费、数字经济、共同富裕、十四五规划”专题系列，开展“回乡见闻”、多场大型策略会、数字经济高端交流活动、2022 年一季报前瞻系列电话会议、明星分析师十四五规划系列电话会议等，引起主流财经媒体全方位报道，受到市场及客户认可。

### 2022 年下半年展望：

2022 年下半年，公司将继续以研究为本，对内积极协同支持各业务条线发展，对外保持卖方研究影响力，聚力抓好当前各项重点工作，持续提升决策影响力和行业影响力。

## （3）自营交易

### ①FICC 销售及交易业务

#### 市场环境：

在海外地缘政治危机升级、货币政策集体转向、国内疫情超预期变化下，国家陆

续出台“稳经济、扩投资、保就业”系列政策，通过实施积极的财政和稳健的货币政策，支持经济有序复苏，报告期内在货币政策整体宽松、宽信用预期、疫情反复以及资产荒背景下，债券利率整体呈现窄幅震荡走势，债券市场总体呈现波动格局。

### 经营举措及业绩：

公司主要通过申万宏源证券等子公司开展 FICC 销售及交易业务。

公司 FICC 销售及交易业务以传统固收投资交易为依托，着力打造强大的投研平台，从宏观层面出发，通过统一的视角，自上而下分析各类资产的周期轮动，实现基于大类资产配置视角的多品种全覆盖，同时积极向客盘衍生品业务转型，力争打造完善的 FICC 业务链条。

报告期内，公司积极把握市场机遇，稳健开展固收投资，坚持控风险调结构，稳步推进投资风格转型，传统债券自营作为基本盘业务，策略交易表现成熟，在震荡行情里把握波段行情机会，利用利率衍生品灵活管理组合敞口风险，投资业绩在同行业中处于领先水平。在策略交易上，灵活把握组合交易机会，扩容量化交易。同时，公司积极推进战略转型，期权业务不断丰富产品结构，收益互换业务进一步提高了标的市场覆盖能力，收益凭证业务稳步增长，投资顾问业务规模不断提升，做市业务有序开展，信用衍生品业务实现业务模式及规模突破式发展，商品业务和公募 REITS 发挥投研优势，力争形成有效补充。

与此同时，公司积极推进各类业务创新，报告期内实现美国国债期货交易落地；与实体企业、私募基金分别开展了首笔场外利率期权交易，实现客群范围的拓展；新开辟公司零售柜台发行渠道，为上市公司、零售客户提供挂钩 FICC 类标的的财富管理工具；于交易所落地“不可质押交易所公募债+信用保护工具”的产品模式，实现公司在交易所信用保护工具业务上的突破，成功助力企业债券二级流通。

此外，公司围绕服务国家战略目标，切实履行央企社会责任，通过债券投资为国家科技自强战略、服务区域重大发展战略、绿色发展战略等项目提供支持，同时坚持“金融服务实体经济”，助力复工复产、稳价保供，综合运用金融衍生工具为实体企业提供精准解决方案。

### 2022 年下半年展望：

2022 年下半年，公司 FICC 业务持续贯彻“三条盈利曲线”战略思想，打好“巩固传统领先业务+培育特色新生业务”组合拳，坚持以“债券多策略”提升固收自营能力，坚持以“多资产多策略”实现大类资产配置多品种全覆盖，坚持以“客盘交易、

投资顾问”为聚焦点持续做大综合金融服务，形成固定收益、产品创设和投顾业务、商品交易齐头并进的“1+3”业务格局，争取实现优异的投资经营业绩。

## ②权益类销售及交易业务

### 市场环境：

报告期内，权益市场在内外部多重因素的共振下，经历了四个月的持续下跌，至4月27日沪深300指数最大跌幅近22%，随后市场开启了两个月的修复性上涨。市场风格上方面，受益于政策刺激加码和疫后复苏的大消费板块以及内外需共振、高景气度的新能源车、光伏、风电和军工等板块表现较好。

### 经营举措及业绩：

公司主要通过申万宏源证券等子公司开展权益类销售及交易业务。

报告期内，公司权益类销售及交易业务坚持以“非方向、低波动、绝对回报”为目标，逐步构建“多资产、多策略”的能力圈，在切实控制方向性资产投入的基础上，采取了一系列的精准改革措施，进一步夯实了以中性量化策略资产、含权债及公募REITS等“基石类”资产为主的组合配置结构，持续推动向“非方向”的中性多资产、多策略大类资产配置组合优化转型。

### 2022年下半年展望：

2022年下半年，公司权益类销售及交易业务将持续践行“低波、稳健”的核心理念，以量化对冲业务、资本市场业务及权益做市业务等“三大基石商业模式”为依托，通过买方投研体系赋能，优化合规风控运营管理机制，打造立体化证券投资交易体系。以“一体两翼”为资产配置抓手，加速资产结构优化，加大业务转型力度。

## ③衍生品业务

### 市场环境：

2022年上半年，全球资本市场和大宗商品市场波动加剧，机构投资者和实体企业出于资产配置和风险管理的考虑，对衍生品工具的需求进一步增长，从场外衍生品交易规模来看，上半年延续了近几年的上升趋势，存续规模再创新高，参考境外发达资本市场体量和衍生品规模，国内衍生品业务仍有巨大的发展潜力。伴随着衍生品业务的蓬勃发展，行业政策加速落地，《中华人民共和国期货和衍生品法》正式出台，立法明确了衍生品业务的法律地位，为衍生品业务长期健康发展和更好地服务实体经济提供法律保障。

### 经营举措及业绩：

公司主要通过申万宏源证券等子公司开展衍生品业务。

2022 年上半年，公司场外衍生品业务保持竞争优势，新增、存续规模稳居行业前列。公司通过投研赋能和金融科技赋能不断提升定价和对冲交易能力，快速响应客户需求，持续向客户提供差异化的产品创设，进一步做大场外期权业务规模；同时加强境内外一体化系统建设，全面发力收益互换和跨境业务。场内做市方面，公司不断新增做市业务资格，持续对做市策略进行优化，形成稳定且可持续的做市交易模式，业务排名位于行业前列。量化业务方面，公司自主研发量化策略指数，在全球股票、债券、商品等不同大类资产上实现动态、分散化配置，挂钩相关指数的收益凭证等策略指数化产品已逐步落地，目前系列产品规模已达数十亿名义本金。公司坚持衍生品业务要服务于实体经济高质量发展，积极响应国家“六稳”“六保”政策要求，在服务产业客户规避风险、稳定生产经营方面不断进行探索与尝试。

报告期内，公司场内衍生品做市业务新增上海期货交易所铝期权做市业务资格、郑州商品交易所 PTA 期货做市业务资格、郑州商品交易所菜粕、棉花、白糖期权一般做市商资格，其中菜粕、棉花在一般做市商中连续三个月均排名第一，现已成为主做市商。

#### **2022 年下半年展望：**

2022 年下半年，公司将继续提升产品、定价、交易等核心竞争力，着力打造场内外衍生品交易及产品创设的一体化平台，持续利用衍生品为市场提供有效的风险管理、财富管理及资产配置工具，为专业投资者提供差异化、一站式的综合金融服务方案。公司衍生品业务将结合市场环境，加强多样化的配置型和交易型产品开发力度，重点发力交易平台建设提高收益互换和跨境业务规模，场内做市实现新品种扩容，加大量化策略研发，完善人才梯队建设，同时进一步发挥衍生品业务引领优势，通过综合服务，带动公司经纪、信用、投行、托管等整体业务的协同发展。

#### **4.投资管理业务**

投资管理业务包括资产管理、公募基金管理以及私募基金管理等。报告期内，公司投资管理业务板块实现营业收入人民币 7.85 亿元，同比增长 17.47%。

##### **（1）资产管理业务**

#### **市场环境：**

报告期内，我国资产管理市场进入全面发展新阶段，证券、基金行业资产管理继续呈差异化发展，证券资管、基金及其子公司在度过资管新规的影响后，资产管理规

模开始“触底反弹”。2022 年上半年发布的《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定(征求意见稿)》等，为券商资管子公司设立后申请公募牌照放宽了条件，同时昭示公募产品将成为承接未来“万亿”个人养老金的重要载体，凸显公募牌照对未来资管行业发展的重要作用。

### **经营举措及业绩：**

公司主要通过申万宏源证券、申万菱信、申万期货、宏源期货开展资产管理业务。

2022 年上半年，公司资产管理业务继续围绕专业化改革和主动管理能力提升转型，不断完善产品图谱建设，持续推进投研体系建设，产品投资管理水平和投资业绩得到明显提升。一是持续深入推进主动管理业务转型，加速优化业务结构，资产管理规模企稳回升。截至报告期末，公司资产管理业务净收入行业排名第 9 位，较上年度上升 1 位；资产管理业务规模人民币 2,839.63 亿元，较 2021 年末增长 4.80%；主动管理能力稳步提升，截至报告期末主动管理比重较去年同期增长 111.24%；专项 ABS 业务规模稳步增长，报告期末市场排名进入前十。投顾业务持续发力，规模较 2021 年末增长接近翻倍；报告期内公司新设立集合产品 51 只，在券商资管同业中排名第 4 位。二是完善产品图谱建设取得初步成效，不断丰富具有申万宏源“全资产配置商、数量化精品店”特色的基础产品图谱，现已形成 7 大产品类型、18 个产品小类、8 大品牌标签的完整产品体系，持续丰富配置策略与产品类型。三是投研体系建设已显成效，通过持续推进专业化分工，加强研究覆盖和深挖能力，构建重点深度覆盖的领域和标的跟踪机制。完善部门策略会机制，规范模拟组合推荐分享机制，丰富大类资产配置、多维度投资策略的资产管理业务思路。促进人才队伍专业化转型，达成研究资源共享、高效、专业、团队化合作模式，促进投资业绩和客户粘性提升。

### **2022 年下半年展望：**

2022 年下半年，公司将以推进设立资产管理子公司为契机，进一步巩固完善投研体系，提升主动管理能力，实现投资策略多元化；推动券商资管公募化，顺应行业转型发展趋势进入公募新赛道，解决客户准入和客户数量问题；大力发挥分支机构优势，拓展优化销售网络，协同销售以实现规模迅速增长；全面推动金融科技运用，统筹现有系统平台实现体系化，同时根据公募基金运营需求加快升级，提升专业运营能力。

#### **(2) 公募基金管理业务**

#### **市场环境：**

2022 年上半年，A 股市场先抑后扬，公募基金行业也经历了从市场新发进入冰点到基金产品总数突破万只的里程碑时刻，随着二季度中国证监会发布《关于加快推进公募基金行业高质量发展的意见》，公募基金行业高质量发展有了清晰的“路线图”。截至 2022 年 6 月 30 日，全部 153 家公募基金管理机构在管的公募基金产品 10,010 只，净值总规模人民币 26.79 万亿元（中国证券投资基金业协会,2022），公募基金已经成为居民财富保值增值的重要工具。金融机构在财富管理端加速从产品销售向资产配置转型，自试点以来，有超 60 家机构分三批获得公募基金投资顾问业务牌照，包括 26 家基金公司、29 家证券公司、3 家银行及 3 家第三方独立代销机构（毕马威，中国基金投顾蓝皮书 2022）。

### 经营举措及业绩：

公司主要通过申万宏源证券、申万菱信和富国基金开展公募基金管理业务。

报告期内，公司围绕着财富管理深化转型开展全方位工作，从商业模式、资产配置体系、人才队伍、金融科技、制度建设等方面全面升级，截至报告期末，公募基金投顾累计签约客户近 10 万人，存量客户人均委托资产达到人民币 6.93 万元；共上线 5 大类 10 个组合策略，累计复投率达 66%以上，部分中低风险组合盈利客户占比超过 90%。

申万菱信以持续建设完善的集研究、投资、风控于一体的关键假设平台为依托，有效发挥全面风险管理的“滑雪杖”作用，实现中长期投资业绩稳中向好。数字化战略推进方面，申万菱信正式上线第一期面向用户的“总量 EBS（Excellent Branding and Service）小程序”，开启公司关键假设平台通过 EBS 对外赋能的新篇章。财务回报方面，申万菱信克服前 4 个月市场持续下行、机构及个人投资者悲观情绪持续发酵的不利影响，净利润较去年同期增长 7.52%。产品布局方面，报告期内申万菱信共计发行 7 只公募基金和 7 只专户产品，稳步推进“新理财”系列产品，完成包括宏量、智量、双禧、鑫享稳健、稳鑫 30 天滚动持有期短债等多只产品布局并开始积累业绩曲线，力求尽快为投资者提供较好的理财替代产品选择。创新业务方面，报告期内申万菱信正式完成基金投顾业务和 QDLP 业务落地，其中基金投顾业务正式上线 10 只策略，完成 2,800 户客户签约。

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人民币 1.4 万亿元，再创历史新高，其中公募基金管理规模人民币 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。

### 2022 年下半年展望：

2022 年下半年，公司战略层面积极布局基金投顾业务，以专业服务客户投资需求，以陪伴共享客户投资体验，推进财务管理由卖方模式向买方模式转型；同时结合新颁布的《关于加快推进公募基金行业高质量发展的意见》，持续通过研究、投资、风控一体化平台建设，构建公募基金业务发展的核心竞争力。

#### （3）私募基金管理业务

##### 市场环境：

近年来，新兴产业高速发展推动私募股权行业兴起，叠加政策层面持续支持私募股权行业稳步发展，推动“募投管退”良性循环生态加速形成。报告期内，因受复杂的国际形势和频发的国内疫情影响，募资、投资以及退出均受影响，根据中国证券投资基金业协会数据，2022 年上半年新成立私募股权投资基金 1,659 只，备案规模人民币 1,262.71 亿元，同比分别下降 15.66% 和 46.87%。

##### 经营举措及业绩：

公司主要通过宏源汇富、申万投资开展私募基金管理业务。

公司大力加强私募基金投资能力建设，积极开发大型企业集团和优质中小科创类客户，依托在新三板的业务优势，加大“专精特新”企业的布局力度，不断提升母基金、产业基金、并购基金等业务能力，发挥综合金融服务优势持续推动产业链和资本链的相互融合。

报告期内，宏源汇富围绕资本市场和证券业务，进一步强化专业化产品能力建设，成功中标规模达 50.1 亿的绵阳科技城重大产业股权投资基金母基金管理人资格，积极服务重点产业强链补链、转型升级；深化与公司证券业务的协同，发起设立规模 3 亿元的贵州优势产业发展股权投资基金，积极支持长江经济带建设和西部大开发战略。

申万投资充分发挥公司私募基金管理平台的作用，积极响应公司“五大科创基金”战略布局，聚焦五大基金、聚焦重点区域、聚焦重点行业，分层扩张基金管理规模，进一步丰富基金产品线，持续推进产业基金、专精特新基金的落地与战略布局，加大对实体产业的扶持力度。报告期内公司设立的专精特新基金（1 支）以及“碳中和”主题基金（1 支）已开始投资运作。

### 2022 年下半年展望：

2022 年下半年，公司将继续积极响应国家战略，持续推进专精特新基金的设立，积极设立区域基金，丰富基金产品线，同时加强“研究+投资+投行”的协同工作，

进一步梳理区域、行业投资核心逻辑，实现高质量基金投资。

### （三）主要财务数据

#### 1.主要财务数据同比变化情况

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期末	上年末	同比增减 (%)	变动原因
衍生金融资产	6,302,754,939.03	2,800,299,619.84	125.07	权益衍生工具投资规模增加以及公允价值变动影响
应收款项	7,900,778,736.56	4,093,736,594.48	93.00	应收清算款增加
代理承销证券款	19,909,120.00	-	不适用	股票承销募集资金增加
应交税费	888,936,303.69	2,689,015,801.16	-66.94	应交代扣代缴个人所得税、企业所得税、增值税等减少
应付款项	27,852,018,147.57	16,950,753,669.24	64.31	应付履约保证金增加
递延所得税负债	4,731,819.62	27,297,930.73	-82.67	应纳税暂时性差异减少
项目	本报告期	上年同期	同比增减 (%)	变动原因
利息净(支出)/收入	-34,757,761.87	947,157,687.22	-103.67	融出资金、其他债权投资利息收入减少，同时外部融资利息支出增加
投资收益	287,286,300.50	5,050,962,743.49	-94.31	处置金融工具取得收益减少
其他收益	245,950,181.61	47,578,932.82	416.93	公司取得的政府补助增加
公允价值变动收益/(损失)	4,465,678,262.92	-16,937,898.39	不适用	金融工具公允价值上升
其他业务收入	3,544,556,615.55	5,874,790,613.18	-39.66	所属期货子公司商品贸易收入减少
资产处置收益	812,939.37	1,993,193.33	-59.21	固定资产处置收益减少
信用减值损失	684,361,499.00	226,075,733.80	202.71	买入返售金融资产计提减值准备增加
其他资产减值转回	-24,267,341.62	-1,357,625.55	不适用	所属期货子公司转回大宗商品减值准备增加
其他业务成本	3,625,529,803.32	5,803,689,125.88	-37.53	所属期货子公司商品贸易成本减少
营业外收入	3,297,084.89	6,268,856.96	-47.41	罚没及赔款利得减少
所得税费用	456,342,313.33	780,731,889.26	-41.55	当期所得税费用减少
其他综合收益的税后净额	-131,524,019.16	-226,372,911.61	不适用	受汇率波动、金融资产公允价值波动和计提减值准备变动影响
经营活动产生的现金流量净额	25,517,521,798.27	-28,343,077,579.22	不适用	出售为交易目的而持有的金融工具现金流入增加
投资活动产生的	-6,157,260,664.34	34,969,131,833.97	-117.61	投资支付的现金流出增加

现金流量净额				
筹资活动产生的现金流量净额	4,376,515,442.21	2,479,067,432.10	76.54	发行债券收到的现金流入增加
现金及现金等价物的变动净额	23,715,135,877.57	9,075,415,190.07	161.31	经营活动产生的现金流量净额增加

公司报告期利润构成或利润来源发生重大变动情况不适用

## 2.营业收入构成

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期		上年同期		变动幅度(%)
	金额	占营业收入比重(%)	金额	占营业收入比重(%)	
手续费及佣金净收入	4,330,998,801.83	33.79	4,203,503,209.16	26.14	3.03
其中：经纪业务手续费净收入	2,787,646,691.29	21.75	2,853,807,249.26	17.75	-2.32
投资银行业务手续费净收入	813,411,847.55	6.35	713,506,925.30	4.44	14.00
资产管理及基金管理业务手续费净收入	662,923,224.03	5.17	605,028,588.57	3.76	9.57
利息净(支出)/收入	-34,757,761.87	-0.27	947,157,687.22	5.89	-103.67
投资收益	287,286,300.50	2.24	5,050,962,743.49	31.41	-94.31
公允价值变动收益	4,465,678,262.92	34.84	-16,937,898.39	-0.11	不适用
其他收入 <sup>注</sup>	3,769,679,037.96	29.40	5,894,656,242.55	36.67	-36.05
<b>合计：</b>	<b>12,818,884,641.34</b>	<b>100.00</b>	<b>16,079,341,984.03</b>	<b>100.00</b>	<b>-20.28</b>

注：其他收入包括其他收益、汇兑损失、其他业务收入和资产处置收益。

相关数据发生变动的的原因说明：

(1) 手续费及佣金净收入人民币 43.31 亿元，占比 33.79%，同比增加人民币 1.27 亿元，增长 3.03%。其中：受 2022 年上半年资本市场整体呈震荡回调影响，导致经纪业务净收入同比减少；受股票和债券承销业务收入增加影响，投行业务净收入同比增加；受管理规模和业绩报酬增加的影响，资产管理及基金管理业务净收入同比增加。

(2) 投资收益与公允价值变动收益合计实现人民币 47.53 亿元，占比 37.08%，同比减少人民币 2.81 亿元，下降 5.58%，主要是金融资产处置取得收益减少。

(3) 利息净支出人民币 0.35 亿元，其中：利息收入人民币 49.65 亿元，同比减少 6.14 亿元，下降 11.01%，主要是公司持有其他债权投资规模减少和两融业务规模下降影响；利息支出人民币 50.00 亿元，同比增加人民币 3.67 亿元，增长 7.93%，主要是融资规模增加的影响。

(4) 其他收入包括其他收益、汇兑损益、其他业务收入和资产处置收益。合计金额人民币 37.70 亿元，同比减少人民币 21.25 亿元，下降 36.05%，主要是大宗商品销售收入减少影响。

### 3. 主营业务分业务情况

单位：元 币种：人民币

业务类别	营业收入	营业支出	营业利润率 (%)	营业收入比上年同期增减 (%)	营业支出比上年同期增减 (%)	营业利润率比上年同期增减 (百分点)
企业金融	1,256,857,262.66	646,459,426.66	48.57	-4.00	20.32	-10.39
其中：投资银行	840,288,100.28	489,237,196.37	41.78	14.41	22.40	-3.80
本金投资	416,569,162.38	157,222,230.29	62.26	-27.52	14.27	-13.80
个人金融	4,409,664,822.36	3,114,407,249.92	29.37	5.66	46.50	-19.69
机构服务及交易	6,367,147,411.31	4,535,352,852.79	28.77	-35.87	-39.95	4.84
投资管理	785,215,145.01	385,397,809.44	50.92	17.47	-20.03	23.02
合计	12,818,884,641.34	8,681,617,338.81	32.27	-20.28	-18.84	-1.20

### 4. 主营业务分地区情况

#### (1) 营业收入地区分部情况

单位：元 币种：人民币

地区	本报告期		上年同期		营业收入比上年同期增减 (%)
	证券营业部数量	营业收入	证券营业部数量	营业收入	
中南地区	54	458,896,188.74	57	469,122,672.39	-2.18
华北地区	15	159,067,341.15	15	172,992,335.32	-8.05
西北地区	46	556,808,216.88	46	634,389,841.39	-12.23
西南地区	26	256,243,774.05	25	273,140,705.11	-6.19
华东地区	141	2,037,557,455.30	147	2,193,412,106.59	-7.11
东北地区	15	139,144,062.29	16	143,044,367.34	-2.73
境内子公司		3,693,635,785.83		7,497,132,316.85	-50.73
境外子公司		174,156,967.60		288,039,029.98	-39.54

地区	本报告期		上年同期		营业收入比上年同期增减(%)
	证券营业部数量	营业收入	证券营业部数量	营业收入	
本部		5,832,078,029.99		4,513,277,524.74	29.22
抵销		-488,703,180.49		-105,208,915.68	不适用
合计	297	12,818,884,641.34	306	16,079,341,984.03	-20.28

## (2) 营业利润地区分部情况

单位：元 币种：人民币

地区	本报告期		上年同期		营业利润比上年同期增减(%)
	证券营业部数量	营业利润	证券营业部数量	营业利润	
中南地区	54	204,544,870.78	57	279,793,411.27	-26.89
华北地区	15	66,401,827.97	15	107,442,364.58	-38.20
西北地区	46	345,515,160.98	46	460,543,528.51	-24.98
西南地区	26	127,889,708.82	25	164,683,746.43	-22.34
华东地区	141	1,208,193,055.86	147	1,579,244,842.00	-23.50
东北地区	15	44,756,502.50	16	71,719,388.47	-37.59
境内子公司		444,349,008.71		676,264,763.10	-34.29
境外子公司		-100,211,776.58		60,440,640.44	-265.80
本部		2,034,008,612.41		1,935,226,610.00	5.10
抵销		-238,179,668.92		46,520,539.75	-611.99
合计	297	4,137,267,302.53	306	5,381,879,834.55	-23.13

## 四、非主营业务分析

不适用

## 五、资产及负债情况分析

## (一) 资产及负债构成重大变动情况

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期末		上年度末		比重增减(百分点)	重大变动说明
	金额	占总资产比例(%)	金额	占总资产比例(%)		
货币资金	129,810,200,675.82	20.77	108,580,453,632.49	18.07	2.70	公司自有资金和客户资金增加
结算备付金	23,887,122,744.96	3.82	24,343,165,506.63	4.05	-0.23	不适用
融出资金	67,378,075,125.46	10.78	76,296,755,210.91	12.69	-1.91	客户融资需求下降导致
衍生金融资产	6,302,754,939.03	1.01	2,800,299,619.84	0.47	0.54	权益衍生工具投资规模增加以及公允价值变动影响
存出保证金	31,148,219,336.93	4.98	29,113,660,023.59	4.84	0.14	交易保证金规模增加

应收款项	7,900,778,736.56	1.26	4,093,736,594.48	0.68	0.58	应收清算款增加
买入返售金融资产	29,461,463,942.51	4.71	25,398,184,483.40	4.23	0.48	债券质押式回购业务规模增加
交易性金融资产	268,043,439,543.04	42.89	272,576,458,805.60	45.35	-2.46	不适用
债权投资	4,586,626,251.96	0.73	5,021,564,425.53	0.84	-0.11	信托计划投资规模减少
其他债权投资	40,604,245,017.50	6.50	37,125,399,149.14	6.18	0.32	公司债等债券投资规模增加
其他权益工具投资	3,018,386,382.93	0.48	2,623,807,751.94	0.44	0.04	非交易性权益工具投资规模增加
长期股权投资	4,562,330,436.17	0.73	4,512,057,679.62	0.75	-0.02	不适用
投资性房地产	50,222,968.17	0.01	52,465,794.00	0.01	-	不适用
固定资产	1,113,309,777.00	0.18	1,126,484,508.82	0.19	-0.01	不适用
在建工程	203,660,829.17	0.03	227,067,332.24	0.04	-0.01	不适用
使用权资产	912,039,002.73	0.15	948,606,204.58	0.16	-0.01	不适用
无形资产	231,338,904.83	0.04	250,180,959.41	0.04	-	不适用
递延所得税资产	2,674,863,925.98	0.43	2,570,403,334.75	0.43	-	可抵扣暂时性差异增加
其他资产	3,068,884,694.80	0.49	3,350,716,236.12	0.54	-0.04	大宗商品存货减少
项目	本报告期末		上年度末		比重增减(百分点)	重大变动说明
	金额	占总负债比例(%)	金额	占总负债比例(%)		
短期借款	3,089,108,001.74	0.60	3,229,797,786.23	0.65	-0.05	不适用
应付短期融资款	36,032,626,484.09	6.97	29,586,843,198.81	5.99	0.98	发行的短期公司债及收益凭证规模增加
拆入资金	3,337,755,264.73	0.65	4,366,724,506.15	0.88	-0.23	转融通拆入资金规模减少
交易性金融负债	4,959,070,430.38	0.96	6,166,995,391.55	1.25	-0.29	结构化票据投资规模减少
衍生金融负债	8,010,149,615.46	1.55	7,309,855,457.95	1.48	0.07	权益衍生工具规模增加及公允价值变动影响
卖出回购金融资产款	130,220,011,282.10	25.19	137,977,519,780.54	27.93	-2.74	债券质押式卖出回购业务规模减少
代理买卖证券款	116,768,953,955.58	22.59	104,738,358,649.63	21.20	1.39	客户保证金增加
代理承销证券款	19,909,120.00	0.00	-	-	不适用	股票承销募集资金增加
应付职工薪酬	6,675,269,633.09	1.29	6,226,949,469.47	1.26	0.03	计提人力费用
应交税费	888,936,303.69	0.17	2,689,015,801.16	0.54	-0.37	应交代扣代缴个人所得税、企业所得税、增值税

						等减少
应付款项	27,852,018,147.57	5.39	16,950,753,669.24	3.43	1.96	应付履约保证金增加
应付债券	161,899,437,257.60	31.32	160,486,724,010.28	32.49	-1.17	不适用
租赁负债	951,302,234.52	0.18	969,215,294.92	0.20	-0.02	不适用
递延所得税负债	4,731,819.62	0.00	27,297,930.73	0.01	-0.01	应纳税暂时性差异减少
合同负债	112,812,838.90	0.02	140,220,205.93	0.03	-0.01	不适用
其他负债	16,166,221,135.65	3.12	13,090,602,080.24	2.66	0.46	应付股利增加

## (二) 主要境外资产情况

单位：元 币种：港币

资产的具体内容	形成原因	资产规模	所在地	运营模式	保障资产安全性的控制措施	收益状况	境外资产占公司净资产的比重	是否存在重大减值风险
申万宏源(国际)集团有限公司	投资	33,747,282,312.40	香港	全资子公司	通过《境外子公司管理实施细则》等制度保障资产安全	210,243,091.89	26.73%	否

## (三) 以公允价值计量的资产和负债

单位：元 币种：人民币

项目	期初数	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期计提的减值	本期购买金额	本期出售金额	期末数
金融资产							
1.交易性金融资产	272,576,458,805.60	1,460,913,583.46	-	-	1,368,404,960,519.15	1,374,992,392,776.44	268,043,439,543.04
2.衍生金融资产	2,800,299,619.84	2,888,055,927.78	-	-	不适用	不适用	6,302,754,939.03
3.其他债权投资	37,125,399,149.14	-	-173,395,540.72	48,746,046.76	40,366,000,527.77	36,954,017,247.59	40,604,245,017.50
4.其他权益工具投资	2,623,807,751.94	-	-237,224,525.39	-	878,813,115.77	247,009,959.39	3,018,386,382.93
金融资产合计	<b>315,125,965,326.52</b>	<b>4,348,969,511.24</b>	<b>-410,620,066.11</b>	<b>48,746,046.76</b>	<b>1,409,649,774,162.69</b>	<b>1,412,193,419,983.42</b>	<b>317,968,825,882.50</b>
金融负债							
1.交易性金融负债	6,166,995,391.55	724,887,522.11	-	-	10,638,961,886.51	11,121,999,325.57	4,959,070,430.38
2.衍生金融负债	7,309,855,457.95	-608,178,770.43	-	-	不适用	不适用	8,010,149,615.46
金融负债合计	<b>13,476,850,849.50</b>	<b>116,708,751.68</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>10,638,961,886.51</b>	<b>11,121,999,325.57</b>	<b>12,969,220,045.84</b>

报告期内公司主要资产计量属性未发生重大变化。

## (四) 截至报告期末的资产权利受限情况

公司所有权受到限制的资产，具体请参见“第九节财务报告，附注五 1、8、10、11、15”的相关内容。

## （五）公司融资渠道及长短期负债结构分析

### 1.公司融资渠道

公司主要的融资方式包括同业拆借、收益凭证、公司债券、次级债券、短期公司债券、短期融资券、短期借款和股权融资等。依据相关的法律法规规定，公司根据自身的资金需求进行短、中、长期融资，支持公司业务的发展。

### 2.公司长短期负债结构分析

单位：元 币种：人民币

项目	2022年6月30日	2021年12月31日
短期借款	3,089,108,001.74	3,229,797,786.23
应付短期融资款	36,032,626,484.09	29,586,843,198.81
拆入资金	3,337,755,264.73	4,366,724,506.15
应付债券	161,899,437,257.60	160,486,724,010.28
合计：	204,358,927,008.16	197,670,089,501.47

上述负债中融资期限在一年以上的为人民币 1,360.91 亿元，融资期限在一年以下的为人民币 682.68 亿元，分别占上述债务总额比例为 66.59 %和 33.41%。除借款和债务融资工具外，公司还通过场内和场外回购融入资金，报告期末卖出回购金融资产款余额为人民币 1,302.20 亿元，融资期限均在一年以下。截至报告期末，公司无到期未偿还的债务，公司整体偿债能力较强，流动性风险可控。

### 3.公司流动性管理政策及措施

公司以“加强自有资金管理，保障自有资金安全，提高自有资金使用效率，控制自有资金运用风险”为管理目标，已经建立了全面风险管理体系及流动性风险管理机制，并通过不断完善流动性储备管理体系，注重资产与负债在规模、期限、结构上的匹配，提升融资渠道多样性，开展流动性风险应急计划演练等，有效防范了流动性风险。报告期内，公司保持了足够的流动性储备，流动性覆盖率和净稳定资金率等监管指标均符合监管标准。

### 4.公司融资能力分析

公司已形成以银行间市场同业拆借、银行间市场及交易所市场债券回购、发行证券公司短期融资券、发行金融债、发行公司债券、发行次级债券及融资业务债权收益权转让、通过中国证券金融公司转融通、发行收益凭证等多种方式为一体的融资体系。

公司规范经营，信誉良好，具有良好的信用记录，与商业银行保持良好的合作关系，有充足的银行授信额度，拥有较强的盈利能力和偿付能力，具备较强的短期和长期融资能力。

## 六、投资状况分析

### （一）长期股权投资情况

单位：元 币种：人民币

报告期末投资额	上年期末投资额	变动幅度(%)
4,562,330,436.17	4,512,057,679.62	1.11

### （二）报告期内获取的重大股权投资情况

报告期内，公司无获取的重大股权投资情况。

### （三）报告期内正在进行的重大非股权投资情况

报告期内，公司无正在进行的重大非股权投资。

### （四）金融资产投资

#### 1. 证券投资情况

单位：元 币种：人民币

证券品种	证券代码	证券简称	最初投资成本	会计计量模式	期初账面价值	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	本期购买金额	本期出售金额	报告期损益	期末账面价值	会计核算科目	资金来源
资管计划	113938	宝盈金元宝10号集合资产管理计划	11,809,989,164.18	公允价值计量	8,789,367,305.37	269,023,474.13	-	2,799,999,997.32	310,823.33	268,712,650.80	11,858,079,953.49	交易性金融资产	自有资金
资管计划	113914	融通基金申万宏源证券1号集合资产管理计划	8,113,802,982.77	公允价值计量	7,554,886,959.29	169,096,281.94	-	699,999,999.29	202,824,271.36	168,672,010.58	8,221,158,969.16	交易性金融资产	自有资金
股票	300750	宁德时代	5,468,095,770.07	公允价值计量	1,166,376,204.00	957,767,591.43	-	9,213,080,301.10	5,008,877,792.62	554,916,871.14	6,328,346,303.91	交易性金融资产	自有资金
资管计划	SLS119	东兴量彩FOF1号单一资产管理计划	5,008,213,361.01	公允价值计量	6,740,079,975.69	193,665,300.79	-	123,678,798.06	1,520,982,569.30	338,290,659.73	5,536,441,505.24	交易性金融资产	自有资金
债券	200018	20 附息国债 18	3,860,551,531.15	公允价值计量	4,476,159,360.00	-6,837,964.39	-	-	603,079,075.61	54,777,828.91	3,920,977,920.00	交易性金融资产	自有资金
资管计划	E1ZX01	财达燕山智选 FOF1 号单一资产管理计划	2,823,912,178.68	公允价值计量	3,808,978,455.25	252,564,898.66	-	-	535,381,720.13	355,165,385.91	3,526,161,633.78	交易性金融资产	自有资金
资管计划	SSG105	国金证券睿选1号 FOF 单一资产管	3,107,790,345.97	公允价值计量	4,321,196,069.52	141,857,452.66	-	200,000,000.00	1,217,907,774.81	245,611,866.96	3,445,145,747.37	交易性金融资产	自有资金

		理计划											
资管计划	113936	宝盈金元宝9号集合资产管理计划	2,698,299,971.24	公允价值计量	1,934,927,684.87	44,937,084.89	-	754,999,993.96	-	44,937,084.89	2,734,864,763.72	交易性金融资产	自有资金
资管计划	390050	中海聚盈单一资产管理计划	2,154,292,148.76	公允价值计量	2,856,615,773.21	12,302,429.86	-	2,200,000,000.00	2,872,086,251.11	64,316,178.75	2,196,831,951.96	交易性金融资产	自有资金
股票	002415	海康威视	2,123,081,272.01	公允价值计量	4,605,113,688.96	-48,903,637.20	-	3,122,638,922.67	5,924,563,018.83	-1,362,798,225.98	1,754,285,955.60	交易性金融资产	自有资金
期末持有的其他证券投资			266,334,022,541.45	--	271,093,528,656.05	-524,559,329.31	-410,620,066.11	1,391,119,329,161.38	1,395,306,338,316.30	596,396,167.55	266,730,402,491.20	--	--
<b>合计</b>			<b>313,502,051,267.29</b>	<b>--</b>	<b>317,347,230,132.21</b>	<b>1,460,913,583.46</b>	<b>-410,620,066.11</b>	<b>1,410,233,727,173.78</b>	<b>1,413,192,351,613.40</b>	<b>1,328,998,479.24</b>	<b>316,252,697,195.43</b>	<b>--</b>	<b>--</b>

注：1.上述证券投资的报告期损益未包括对冲交易衍生金融工具的损益。

2.本表按期末账面价值占本集团期末证券投资总额的比例排序，填列本集团期末所持前十只证券情况。

3.其他证券投资指：除前十只证券以外的其他证券投资。

## 2.衍生品投资情况

不适用

## 七、募集资金使用情况

(一) 报告期内, 公司无发行股票、可转换公司债券等证券发行募集资金情况。

(二) 公司报告期内发行公司债券募集资金及报告期之前募集资金延续到报告期使用情况

单位: 万元 币种: 人民币

募集年份	募集方式	募集资金总额	本期已使用募集资金总额	已累计使用募集资金总额	报告期内变更用途的募集资金总额	累计变更用途的募集资金总额	累计变更用途的募集资金总额比例	尚未使用募集资金总额	尚未使用募集资金去向	闲置两年以上募集资金金额
2018年	面向合格投资者公开发行公司债券	700,000	0	700,000	0	0	0	0	不适用	0
2019年	非公开发行公司债券	580,000	0	580,000	0	0	0	0	不适用	0
2021年	面向专业投资者公开发行公司债券	800,000	0	800,000	0	0	0	0	不适用	0
2022年	面向专业投资者公开发行公司债券	955,000	300,000	300,000	0	0	0	655,000	扣除发行费用后, 全部用于偿还到期债务	0
合计	--	3,035,000	300,000	2,380,000	0	0	0	655,000	--	0

### 募集资金总体使用情况说明

公司严格按照募集说明书约定的用途使用募集资金。尚未使用的募集资金存放于募集资金专用账户。

(三) 募集资金承诺项目情况  
不适用

(四) 募集资金变更项目情况  
不适用

## 八、重大资产和股权出售

报告期内, 公司无重大资产和股权出售情况。

## 九、主要控股参股公司分析

### (一) 主要控股公司

单位：元 币种：人民币

公司名称	公司类型	主要业务	注册资本	总资产	净资产	营业收入	营业利润	净利润
申万宏源证券有限公司	全资子公司	证券经纪、证券投资咨询、融资融券、代销金融产品、证券资产管理业务、证券承销与保荐业务和证券自营业务	53,500,000,000	579,305,754,564.32	105,597,570,270.65	9,644,141,550.53	4,081,680,475.84	3,619,806,739.79
申万宏源产业投资管理有限责任公司	全资子公司	投资与资产管理，投资咨询服务。（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）	200,000,000	272,801,551.96	219,100,198.09	1,663,218.78	2,610,112.78	3,440,312.73
宏源汇智投资有限公司	全资子公司	投资；资产管理；投资管理；企业管理咨询；投资咨询	2,000,000,000	5,713,418,556.37	2,184,288,269.73	89,051,564.67	49,862,091.05	37,237,303.95
宏源期货有限公司	全资子公司	商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询	1,000,000,000	17,362,207,209.16	1,584,443,540.02	3,065,285,328.07	72,512,222.11	53,306,770.20
宏源汇富创业投资有限公司	全资子公司	创业投资业务；创业投资咨询业务；为创业企业提供创业管理服务业务；参与设立创业投资企业与创业投资管理顾问机构	500,000,000	545,916,511.31	501,686,073.45	18,604,357.84	-4,003,462.45	-4,410,144.07
申万宏源西部证券有限公司	全资子公司	证券经纪、证券投资咨询、融资融券、代销金融产品、证券投资基金代销、为期货公司提供中间介绍业务（以上各项业务限新疆、甘肃、陕西、宁夏、青海、	5,700,000,000	20,028,080,054.95	8,378,717,171.74	674,316,497.46	443,564,046.24	333,048,042.24

		西藏区域), 证券自营(限服务新疆、甘肃、陕西、宁夏、青海、西藏区域证券经纪业务客户的证券自营。(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)						
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	全资子公司	证券承销(不含除可转换债券以外的债券品种)与保荐, 与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问	1,000,000,000	2,092,195,515.87	1,538,080,435.39	463,296,435.78	129,939,134.35	110,630,358.60
申银万国期货有限公司	控股子公司	商品期货经纪、金融期货经纪、期货投资咨询、资产管理、基金销售	1,441,588,300	41,945,099,273.90	4,036,905,269.27	1,189,801,466.15	204,604,898.30	163,531,963.03
申万菱信基金管理 有限公司	控股子公司	基金管理业务、发起设立基金以及经中国证监会批准的其他业务(包括销售其本身发起设立的基金)	150,000,000	1,593,124,268.70	1,187,058,917.38	315,455,082.36	103,687,779.51	77,962,836.38
申银万国创新证券投资 有限公司	全资子公司	投资管理、咨询服务、顾问服务	2,000,000,000	2,346,159,306.82	2,324,610,444.13	-119,656,246.36	-128,343,091.71	-100,469,549.47
申银万国投资有限 公司	全资子公司	私募基金	1,000,000,000	1,252,320,519.24	1,114,345,829.03	15,634,186.04	2,278,187.09	2,277,792.14
上海申银万国证券 研究所有限公司	控股子公司	投资咨询业务	20,000,000	257,057,454.56	87,394,526.89	135,342,180.55	11,201,137.68	8,426,825.20
申万宏源(国际) 集团有限公司	全资子公司	投资控股	4,070,919,698 港元	33,747,282,312.40 港元	5,908,849,843.78 港元	210,243,091.89 港 元	-120,976,117.36 港元	-116,880,173.41 港元

## (二) 参股公司

单位：元 币种：人民币

公司名称	公司类型	主要业务	注册资本	总资产	净资产	营业收入	营业利润	净利润
富国基金管理 有限公司	联营企业	公开募集证券投资 基金管理、基金销 售、特定客户资产管 理	520,000,000	12,243,844,069.95	6,786,968,824.17	3,772,562,283.29	1,470,190,792.91	1,122,213,277.60

## (三) 报告期内取得和处置子公司、分公司、营业部情况

## 1. 报告期内，公司取得和处置子公司、分公司情况

报告期内，公司无取得和处置子公司、分公司情况。

## 2. 报告期内，公司所属子公司申万宏源证券取得和处置子公司、分公司、营业部情况：

## (1) 报告期内，申万宏源证券子公司新设和处置情况。

报告期内，申万宏源证券不存在一级子公司设立和处置情况。报告期内申万宏源证券所属申万宏源（香港）有限公司完成旗下 3 家子公司清理注销，包括 Rise Hope Holdings Limited、申万宏源基金管理（香港）有限公司、申万宏源船务（香港）有限公司。

## (2) 报告期内，申万宏源证券分公司、证券营业部设立和撤销情况：

报告期内，申万宏源证券新设完成申万宏源证券九江分公司，为营业部翻牌成立。

报告期内，申万宏源证券新设新设成立 1 家证券营业部，为申万宏源证券有限公司海南儋州洋浦开发区迎宾路证券营业部。另有山西省运城市（1 家）、湖北省十堰市（1 家）等 2 家营业部新批准设立；广东省深圳市（2 家）、湖北省武汉市（1 家）、浙江省绍兴市（1 家）等 4 家证券营业部正在筹建中。

(3) 报告期内，申万宏源证券撤销完成 2 家证券营业部，分别是：申万宏源证券有限公司浙江嘉兴平湖新华南路证券营业部和申万宏源证券有限公司河南新乡平原路证券营业部。另有申万宏源证券有限公司海口国兴大道证券营业部获批准撤销，申万宏源证券有限公司湖北宜城中华大道证券营业部撤销工作正在进行中。

## 十、公司控制的结构化主体情况

公司管理或投资多个结构化主体，主要包括基金、银行理财产品、资产管理计划与信托计划。为判断是否控制该类结构化主体，公司主要评估其通过参与设立相关结构化主体时的决策和参与度及相关合同安排等所享有的对该类结构化主体的整体经济利益（包括直接持有产生的收益以及预期管理费）以及对该类结构化主体的决策权范围。若公司通过投资合同等安排同时对该类结构化主体拥有权力、通过参与该结构化主体的相关活动而享有可变回报以及有能力运用本集团对该类结构化主体的权力影响可变回报，则公司认为能够控制该类结构化主体，并将此类结构化主体纳入合并财务报表范围。

截至 2022 年 6 月 30 日，公司纳入合并范围的结构化主体包括本集团发行及管理的资产管理计划和直接投资在第三方发起设立的信托计划。上述纳入合并范围的结构化主体净资产账面价值为人民币 242.66 亿元，本公司及其子公司在上述结构化主体中的权益体现在其各自资产负债表中交易性金融资产和长期股权投资为人民币 131.13 亿元。

## 十一、公司面临的风险和应对措施

结合对宏观经济形势、行业发展趋势、监管环境和公司自身情况的分析，公司面临的重大风险因素主要有市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、政策风险、法律合规风险和创新业务风险等。在新冠肺炎疫情反复对全球经济和资本市场带来巨大冲击的情况下，公司积极做好各类风险的应对。

### （一）市场风险

公司市场风险敞口主要集中在自营投资业务、自有资金参与的资产管理业务等业务领域。报告期内，各项投资业务总体经受住了市场下跌的考验。报告期末，申万宏源证券（含其子公司）自营投资业务 VaR(1 天，95%) 为人民币 1.92 亿元。

全球经济因疫情反复和国际政治环境的不稳定导致增长动力减弱，我国经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力，各种不确定性因素增多，市场风险管理面临较大挑战。

公司应对措施包括但不限于：1. 密切关注后疫情时代经济、金融演变趋势，加强

对宏观经济形势及市场趋势的跟踪分析及研判,加强对大类资产风险特征及未来变化趋势的研究,及时做好主动应对。2.严格执行自营投资、自有资金参与资产管理等业务的风险容忍度和风险限额指标。3.优化量化风险指标评估体系,包含在险价值、贝塔、波动率、希腊字母、利率基点价值、久期和投资集中度等风险计量指标,结合压力测试和敏感性分析等多种方法或工具进行计量评估。4.规范模型全流程管理机制,强化模型验证和模型风险评估,采用 VaR 和压力测试等方法分析和评估市场风险并定期对模型有效性进行回测。5.对风控指标进行动态监控和分级预警,逐日计量和监控市场风险限额相关指标,对公司整体市场风险进行全面评估,及时采取有效应对措施。6.在重大投资项目开展前,严格进行项目可行性分析,并由风险管理部门独立出具风险评估报告。

## （二）信用风险

公司信用风险敞口主要分布在融资类业务（融资融券和股票质押式回购业务）、固定收益自营业务、场外衍生品交易业务和非标投资等领域。

国内经济下行压力持续加大,加之疫情反复的影响,企业面临较大经营压力,在违约常态化背景下,信用风险管理工作面临较大挑战。

公司应对措施包括但不限于:1.持续优化公司及子公司统一的内部评级体系,加强对业务主体的准入管理,具有信用风险敞口的业务主体均需满足公司统一内评准入标准。2.实行统一的、以实控人为主体的同一客户管控机制,实现了公司及子公司范围内的同一客户统一授信。3.对全市场负面舆情信息进行监控,结合二级市场价格、主体利差、隐含评级等信息建立违约预警机制,并将监控预警结果运用到评级结果更新、授信额度调整、负面清单准入限制等信用风险管理实践中。4.对重点业务采取针对性的信用风险管控措施:(1)融资类业务方面,持续优化融资类业务结构,注重融资主体信用状况、还款能力分析,控制融资标的集中度,加强动态盯市,完善风险处置流程;(2)债券投资业务方面,配置信用等级较高、流动性良好的债券,提升债券信用等级中枢,并持续跟踪债券主体评级和流动性状况变化等;(3)场外衍生品业务方面,完善风险限额指标及事前审批标准,优化授信、保证金计量等金融模型,精准度量信用风险敞口,并加强保证金动态盯市;(4)资产证券化业务方面,健全尽职调查机制,重点核实原始权益人真实的经营状况、信用资质、关联关系等,以及

基础资产的合法性、真实性、现金流稳定性等，强化审核决策，严格落实项目实施的前置条件，持续跟踪项目存续期状况，发现风险隐患时，及时采取应对措施，防范信用违约风险。5.建立风险资产违约处置管理流程，根据违约事项的具体情况，通过担保品追加、担保品变现、提前了结合约、诉讼追偿等多种方式，及时处置、处理和化解信用风险。

### （三）流动性风险

针对流动性风险，一方面，公司不断完善流动性储备管理体系，加强对优质流动性资产的总量和结构管理，流动性储备较为充足；另一方面，在考虑宏观市场环境基础上，通过合理调整各期限资产比例、平衡债务到期分布、提升融资渠道多样性、优化负债期限结构、动态监测现金流缺口、开展流动性风险应急计划演练等，有效防范了流动性风险的发生。报告期内，申万宏源证券流动性覆盖率（LCR）和净稳定资金率（NSFR）两项流动性监管指标均符合监管标准。

欧美等主要发达经济体为应对疫情冲击下经济衰退而实施的宽松货币政策带来的通胀等负面影响日益显现，已逐步开始推动货币政策正常化，包括退出量化宽松、加息等政策，给国内宏观政策带来不确定性。受全球和国内资本市场剧烈波动的影响，公司及时动态调整大类资产配置，业务条线资金使用波动性加大，公司流动性风险管理工作面临较大挑战。

公司的应对措施包括但不限于：1.加强金融市场行情研判，紧跟央行货币政策动态，做好全面资本规划，不断优化公司优质流动性资产结构，保障公司业务资金需求及债务到期偿付。2.在保持现有融资渠道畅通基础上，积极探索融资新模式，拓宽融资新渠道，不断提升公司债务融资管理能力。3.加强流动性风险状况动态监控，持续跟踪和评估流动性监管指标、现金流缺口、流动性储备等信息，开展流动性风险预警工作。4.优化流动性风险计量模型，提升对公司业务现金流的变动预判和缺口分析能力。5.定期开展流动性风险压力测试，评估业务规模大幅扩张、市场极端变化等情况下的流动性压力，提前做好流动性冲击的应对预案。6.开展流动性风险应急演练，将公司对境外子公司的担保事项、可能引发的声誉风险等情景纳入演练，评估公司对流动性风险的应对能力，不断完善流动性应急预案，增强公司应对流动性危机的能力。7.下达子公司流动性风险限额指标，有效监测子公司流动性风险，强化子公司流动性风

险管理。

#### （四）操作风险

操作风险分布于公司各项业务流程和经营管理中，主要源于人员操作差错、系统缺陷、流程不完善及外部事件等因素。报告期内，公司因人员操作差错、系统缺陷和外部事件等因素引发了一些操作风险事件，个别事件引发客户投诉及索赔。在风险事件发生后，公司积极采取应对措施，努力化解风险，较好地保证了公司业务的正常开展。同时，通过优化复核机制、规范业务流程、完善系统缺陷、开展业务培训等措施，防范同类事件再次发生。

业务种类的不断丰富、业务规模的持续扩张、信息系统的广泛运用等，给操作风险的管理带来了较大挑战。

公司应对措施包括但不限于：1.持续健全操作风险管理机制，进一步强化操作风险管理要求。2.深入开展各单位的操作风险自评估工作，及时发现风险隐患，优化完善关键风险指标体系，提升对风险事件的识别、防范能力。3.不断完善业务系统前端控制功能，加强信息系统风险评估、功能验证及日常监测，并制定信息系统安全应急预案、开展应急演练。4.持续开展典型风险案例宣导及业务培训，不断提升员工业务能力和风险管控意识。

#### （五）政策风险

公司整体经营和各项业务发展受政策影响较大。一方面，国家宏观经济政策、利率政策等的变动会影响证券市场的走势，从而对证券经营机构的经营和业务发展产生直接而重要的影响；另一方面，监管机构发布一系列监管政策，不断完善资本市场管理规则，对证券经营机构提升专业服务能力和风险管理水平提出了新要求。

公司应对措施包括但不限于：1.加强对宏观经济形势、行业动态的研究与分析，并采取主动应对措施，适时调整风控政策和业务策略。2.密切关注监管政策变动趋势，加强与监管机构的沟通和联系，针对主要业务相关的监管政策进行分析解读，并开展专题培训，提升员工的政策敏锐度。3.严格落实并执行监管有关规定，完善相关业务的制度建设和系统建设，加强风险管控力度，保障业务健康发展。

#### （六）法律合规风险

监管机构不断完善资本市场管理规则，出台了多项重要监管新规；同时，在监管

“零容忍”的背景下，监管处罚持续从严从重，法律合规管理工作面临较大的挑战。

公司应对措施包括但不限于：1.积极关注法律法规变化并贯彻落实，健全完善法律合规机制。2.进一步强化法律合规审查、合规监测、合规检查、反洗钱、信息隔离墙、利益冲突、关联交易管理等工作，妥善做好投诉纠纷等风险事件的应对化解。3.修订公司授权管理制度，优化完善授权管理机制，确保经营活动受到制衡和监督。4.持续加强合规文化建设，加强法律合规培训和案例警示教育，健全合规考核机制，强化责任追究，提高从业人员法律合规意识，有效防范法律合规风险。

#### （七）创新业务风险

公司积极开展业务创新，持续加大业务创新力度，创新业务结构和产品类型日趋复杂，创新业务风险进一步显现，相应的风险管控机制、标准等需要加强。

公司的应对措施包括但不限于：1.申万宏源证券设立产品与创新业务委员会，负责公司创新业务的审核，并协调跨条线的创新业务开展。2.修订完善与创新业务配套的相关制度，防范创新业务风险。3.将子公司新业务、新模式、新产品等事项纳入公司分级评审决策体系，在子公司一级评估的基础上，由公司风险管理等部门进行二级评估审核。4.将创新业务的风险监测和预警纳入日常的风险管理工作中，并不断根据业务运行情况，动态调整控制阈值。5.建立创新业务回溯评估机制，对创新业务发展目标、运行情况、风险管控措施有效性等进行跟踪回溯评估，不断提升创新业务风险管理能力，推动创新业务稳健开展。

#### （八）汇率风险

公司开展跨境衍生品业务和大类资产指数业务，在香港设立了子公司持有以港币为结算货币的资产，香港子公司在经营活动中持有外币或以外币计价的资产，均面临一定的汇率方向性风险或波动率风险。公司通过加强对汇率走势的分析和研判、设定外汇风险敞口限额，探索采用外汇远期、期货、期权、掉期等方式进行汇率风险对冲，有效控制汇率风险。报告期末公司外币净敞口占总业务敞口的比例较低，汇率风险总体较小，可控。

## 十二、下一报告期的经营计划及相关措施

公司将坚持以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导，继续以全面贯彻落实

党的十九大和十九届六中全会精神、迎接和学习宣传贯彻党的二十大为统领，以落实中央延伸巡视整改为契机，以全面落实创新、协调、绿色、开放、共享的新发展理念为根本，深入贯彻党中央、中投公司和董事会各项决策部署，坚持稳中求进工作总基调，正确认识和把握公司发展新形势新任务，加强战略引领、科学辩证施策，乘势而上、不断丰富与改善盈利模式，深化专业化、市场化改革，全面构建核心竞争力，不断强化完善合规风控体系建设，实现公司新发展格局迈出新步伐、高质量发展取得新成效。

## 第四节 公司治理

### 一、公司治理情况

公司作为 A+H 上市公司, 严格按照股票上市地法律、法规及规范性文件的要求, 持续完善公司治理结构, 公司股东大会、董事会、监事会、管理层各司其职, 尽职尽责; 不断深化公司合规运作, 保障公司各项业务的持续规范发展, 包括建立健全相应的制度体系、优化完善内部组织架构与授权管理机制等。

目前, 公司根据《公司法》《证券法》、股票上市地规则等法律法规以及公司《章程》, 制定有《股东大会议事规则》《董事会议事规则》《监事会议事规则》《关联交易管理制度》《内部控制制度》《内部控制评价制度》《内部审计制度》《财务管理制度》《会计制度》以及董事会下设各委员会工作细则等制度。报告期内, 公司严格遵守《企业管治守则》全部条文, 并达到了《企业管治守则》中所列的大多数建议最佳常规条文的要求。本公司已采纳《标准守则》, 作为董事及监事进行证券交易的行为守则。本报告期末, 根据对本公司董事及监事作出的专门查询, 各董事及监事在本报告期内均已严格遵守《标准守则》所订之标准。

### 二、截至本报告披露日, 公司召开年度股东大会和临时股东大会情况

会议届次	召开日期	投资者参与比例	会议议案名称	决议情况	披露日期及披露索引
2021 年度股东大会	2022-06-10	65.17%	1.关于审议《公司 2021 年度董事会工作报告》的议案	通过	会议决议事项详见公司于 2022 年 6 月 11 日《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》、巨潮资讯网 www.cninfo.com.cn 及于 2022 年 6 月 10 日香港联交所披露易网站 www.hkexnews.hk 披露的相关公告
			2.关于审议《公司 2021 年度监事会工作报告》的议案	通过	
			3.关于审议《公司 2021 年度财务决算报告》的议案	通过	
			4.关于公司 2021 年度利润分配方案的议案	通过	
			5.关于审议《公司 2021 年年度报告》的议案	通过	
			6.关于预计 2022 年度日常关联交易的议案 (逐项表决)	通过	

会议届次	召开日期	投资者参与比例	会议议案名称	决议情况	披露日期及披露索引
			7.关于授予董事会增发公司 A 股、H 股股份一般性授权的议案	通过	
			8. 关于申万宏源集团股份有限公司公开发行公司债券的议案(逐项表决)	通过	
			9. 关于续聘公司 2022 年度审计机构的议案	通过	
2022 年第一次临时股东大会	2022-08-26	62.87%	关于选举公司董事的议案(刘健先生)	通过	会议决议事项详见公司于 2022 年 8 月 27 日《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》、巨潮资讯网 www.cninfo.com.cn 及于 2022 年 8 月 26 日香港联交所披露易网站 www.hkexnews.hk 披露的相关公告

### 三、公司董事会、监事会组成

截至本报告披露日，公司第五届董事会由 11 位董事组成：

执行董事：刘健先生（董事长）、黄昊先生（总经理）

非执行董事：葛蓉蓉女士、任晓涛先生、张宜刚先生、朱志龙先生、张英女士

独立非执行董事：杨小雯女士、武常岐先生、陈汉文先生、赵磊先生

公司第五届监事会由 5 位监事组成：

监事：方荣义先生（监事会主席）、陈燕女士、姜杨先生

职工监事：李艳女士、周洁女士

### 四、公司执行委员会组成

执行委员会成员：黄昊先生（主任）、任全胜女士、刘跃先生

## 五、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

(一) 报告期内，公司董事、监事和高级管理人员没有发生变动。

(二) 截至本报告披露日，公司董事变动情况

姓名	担任的职务	类型	日期	原因
刘健	执行董事	股东大会选举	2022 年 8 月 26 日	股东大会选举
	董事长	董事会选举	2022 年 8 月 26 日	董事会选举
储晓明	执行董事、董事长	离任	2022 年 8 月 26 日	工作安排原因

1.2022 年 8 月 5 日，公司第五届董事会第十次会议同意《关于提名董事候选人的议案》，提名刘健先生为公司第五届董事会执行董事候选人。2022 年 8 月 26 日，公司 2022 年第一次临时股东大会审议通过《关于选举公司董事的议案》，选举刘健先生为公司第五届董事会董事（执行董事）。

2022 年 8 月 26 日，因工作安排原因，储晓明先生递交书面辞呈，申请辞去本公司第五届董事会董事长、执行董事、董事会战略委员会主任委员、董事会薪酬与提名委员会委员以及《香港上市规则》第 3.05 条项下所规定的本公司授权代表（“授权代表”）职务，其辞任自辞职报告于 2022 年 8 月 26 日送达董事会时生效。

2.2022 年 8 月 26 日，公司召开第五届董事会第十一次会议，审议通过（其中包括）如下议案：

(1)《关于选举第五届董事会董事长的议案》，选举刘健董事为公司第五届董事会董事长。任期自 2022 年 8 月 26 日起至第五届董事会任期届满。

(2)《关于调整董事会专门委员会委员的议案》，同意调整董事会战略委员会、董事会薪酬与提名委员会成员。相关委员会成员调整情况如下：

董事会战略委员会：

调整前：

主任委员：储晓明

委员：黄昊、葛蓉蓉、武常岐、任晓涛

调整后：

主任委员：刘健

委员：黄昊、葛蓉蓉、武常岐、任晓涛

董事会薪酬与提名委员会：

调整前：

主任委员：武常岐

委员：储晓明、陈汉文、赵磊、张英

调整后：

主任委员：武常岐

委员：刘健、陈汉文、赵磊、张英

以上情况请详见公司于2022年8月6日、8月27日在《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》、巨潮资讯网 [www.cninfo.com.cn](http://www.cninfo.com.cn) 及于2022年8月5日、8月26日在香港联交所披露易 [www.hkexnews.hk](http://www.hkexnews.hk) 披露的相关公告）

## 六、董事、监事及高级管理人员简历变动情况

截至本报告披露日，公司部分董事、监事变动后简历如下：

### 1. 董事

张宜刚先生，现任申万宏源集团股份有限公司非执行董事。主要工作经历包括：自1983年8月至1998年5月先后任职于四川省盐亭县政府多种经营办公室、四川省盐亭县委政策研究室、县委办公室、四川省绵阳市委办公室；自1998年5月至2007年12月任四川省委办公厅办公室副处级秘书、正处级秘书（其间：自2001年12月至2007年1月挂任四川省国有资产投资管理有限责任公司副总经理）；自2007年12月至2009年3月任四川省国资委办公室调研员（其间：2007年1月至2009年3月挂任四川省国有资产投资管理有限责任公司董事长、党委书记、纪委书记）；自2009年3月至2019年7月历任四川发展（控股）有限责任公司副总经理，董事、副总经理，党委委员、董事、副总经理，党委副书记、董事、副总经理；自2015年4月至2018年12月任四川晟天新能源发展有限公司董事；自2015年12月至2019年8月任四川发展国瑞矿业投资有限公司执行董事；自2015年2月至今任四川城乡建设投资有限责任公司董事长；自2019年7月至2020年6月任四川发展（控股）有限责任公司党委副书记、董事；自2020年6月至2022年7月任四川发展（控股）有限责任公司党委副书记、副董事长、总经理；2022年7月至今任四川发展（控股）有限责

任公司党委书记、董事长；自 2020 年 6 月至今任申万宏源集团股份有限公司非执行董事。张宜刚先生于 1983 年 8 月毕业于西南农学院（2005 年更名为西南大学）农学专业，取得农学学士学位，于 2005 年 6 月毕业于电子科技大学高级管理人员工商管理专业，取得工商管理硕士学位。

武常岐先生，现任申万宏源集团股份有限公司独立非执行董事。主要工作经历包括：自 1990 年 2 月至 1991 年 7 月任比利时鲁汶大学中国研究中心研究员；自 1991 年 8 月至 2001 年 6 月任香港科技大学商学院经济学系助理教授；自 1997 年 8 月至 1998 年 1 月任美国西北大学凯洛格管理学院访问学者；自 1998 年 9 月至 1998 年 12 月任比利时鲁汶天主教大学应用经济学系访问教授；自 2001 年 7 月至 2004 年 6 月任香港科技大学商学院瑞安中国经管中心副主任及经济学系兼任副教授；自 2001 年 9 月至 2011 年 1 月任北京大学光华管理学院战略管理学系主任；自 2002 年 8 月至 2010 年 12 月任北京大学光华管理学院 EMBA 学位项目中心主任；自 2003 年 2 月至 2010 年 12 月任北京大学光华管理学院副院长；自 2005 年至 2011 年任香港科技大学商学院经济学系兼任教授；自 2007 年 5 月至 2020 年 12 月任北京大学国家高新技术产业开发区发展战略研究院院长；自 2011 年 3 月至 2020 年 12 月任北京大学光华领导力研究中心主任；自 2012 年至 2018 年任香港大学经济金融学院访问教授；自 2001 年 9 月至今任北京大学光华管理学院战略管理学教授；自 2019 年 10 月至今任山东大学管理学院院长、讲席教授；自 2006 年 9 月至今任北京大学国际经营管理研究所常务副所长；自 2021 年 1 月至今任北京大学国家高新技术产业开发区发展战略研究院常务副院长；自 2014 年 9 月至今兼任中国企业管理研究会第五届常务副理事长；自 2019 年 8 月至今兼任国家知识产权局十四五国家知识产权规划编制指导专家组专家；自 2015 年 2 月至今兼任中国贸易促进委员会专家委员会专家委员；自 2016 年 9 月至今兼任中国管理科学学会战略管理专业委员会主任委员；自 2019 年 11 月至今兼任中国国际经济合作学会常务理事；自 2012 年 12 月至 2019 年 6 月担任北京电子城高科技集团股份有限公司（600658.SH）的独立董事；自 2013 年 4 月至 2022 年 6 月任海尔智家股份有限公司（600690.SH，690D，6690.HK）外部董事；自 2015 年 5 月至 2021 年 11 月任华夏银行股份有限公司（600015.SH）外部监事；自 2016 年 8 月至今任亿嘉和科技股份有限公司（603666.SH）独立董事；自 2017 年 7 月至今任爱心人寿保险

股份有限公司独立董事；自 2016 年 6 月至 2021 年 11 月任北青传媒股份有限公司（1000.HK）独立非执行董事；自 2019 年 2 月至今任天能股份有限公司（688819.SH）独立董事；自 2021 年 5 月至今任申万宏源集团股份有限公司独立非执行董事；自 2022 年 4 月至今任万华化学集团股份有限公司（600309.SH）独立董事。武常岐先生于 1990 年 10 月获比利时鲁汶大学应用经济学博士学位；于 1986 年 2 月获比利时鲁汶大学企业工商管理硕士（MBA）学位；于 1982 年 7 月获山东大学经济学学士学位。

## 2. 监事：

方荣义先生，现任申万宏源集团股份有限公司监事、监事会主席。主要工作经历包括：自 1990 年 11 月至 1992 年 8 月任北京用友电子财务技术有限公司研究所信息中心副主任；自 1992 年 9 月至 1995 年 9 月在厦门大学会计系就读博士研究生；自 1995 年 11 月至 1997 年 3 月在厦门大学工商管理教育中心任副教授；自 1997 年 3 月至 2003 年 1 月先后任中国人民银行深圳市中心支行会计处员工、助理调研员（副处级）、副处长；自 2003 年 1 月至 2003 年 10 月任中国人民银行深圳市中心支行非银行金融机构监管处处长；自 2003 年 10 月至 2006 年 10 月任中国银监会深圳监管局财务会计处处长；自 2006 年 10 月至 2007 年 9 月任中国银监会深圳监管局国有银行监管处处长；自 2007 年 9 月至 2008 年 3 月任申银万国证券股份有限公司拟任财务总监；自 2008 年 3 月至 2014 年 12 月任申银万国证券股份有限公司财务总监（其间：2011 年 6 月至 2011 年 11 月兼任计划财会管理总部总经理）；自 2014 年 12 月至 2015 年 7 月任申万宏源证券有限公司副总经理、财务总监；自 2014 年 12 月至今兼任富国基金管理有限公司副董事长；自 2014 年 12 月至今兼任证通股份有限公司监事；自 2015 年 7 月至 2017 年 12 月任申万宏源证券有限公司副总经理、财务总监、董事会秘书；自 2017 年 12 月至 2021 年 1 月任申万宏源证券有限公司副总经理、财务总监、董事会秘书、首席风险官；自 2018 年 5 月至今兼任中国证券业协会财务会计专业委员会副主任委员；自 2018 年 5 月至今兼任华东政法大学兼职/客座教授；自 2021 年 1 月至 2021 年 9 月任申万宏源证券有限公司副总经理、执行委员会成员、财务总监、董事会秘书；自 2021 年 9 月至今任申万宏源证券有限公司监事、监事会主席；自 2021 年 10 月至今任申万宏源集团股份有限公司监事、监事会主席；自 2021 年 11 月至今

兼任中国上市公司协会监事会专业委员会副主任委员；自 2021 年 12 月至 2022 年 7 月任上海申万宏源公益基金会（筹）理事长；自 2022 年 7 月至今任上海申万宏源公益基金会理事长。方荣义先生于 1987 年 7 月在厦门大学取得经济学学士学位；于 1990 年 7 月在厦门大学取得经济学硕士学位；于 1995 年 9 月在厦门大学取得经济学博士学位。

陈燕女士，现任申万宏源集团股份有限公司监事。主要工作经历包括：自 1997 年 8 月至 2000 年 2 月任中国人民保险公司北京市分公司职员；自 2000 年 2 月至 2007 年 10 月任经济日报报业集团助理编辑、编辑；自 2007 年 10 月至 2012 年 3 月历任经济日报社企业新闻编辑室副主任、总编室主任助理、总编室办公室主任（副高级编辑）；自 2012 年 3 月至 2017 年 7 月任中央汇金投资有限责任公司综合管理部/银行机构管理二部高级经理（期间挂职中国建设银行北京分行）；自 2017 年 7 月至 2020 年 1 月任中央汇金投资有限责任公司综合管理部/银行机构管理二部政策性金融机构股权管理处处长；自 2020 年 1 月至今任中央汇金投资有限责任公司综合管理部政策研究处处长；自 2021 年 5 月至今任申万宏源证券有限公司监事、申万宏源集团股份有限公司监事。陈燕女士于 1997 年 7 月在中央财经大学国际金融专业取得经济学学士学位；于 2004 年 7 月在北京大学金融学专业取得经济学硕士学位。

姜杨先生，现任申万宏源集团股份有限公司监事。主要工作经历包括：自 2001 年 7 月至 2010 年 6 月任宏源证券股份有限公司零售服务管理总部员工（其间：2008 年 10 月至 2010 年 6 月借调新疆维吾尔自治区金融工作办公室）；自 2010 年 7 月至 2013 年 3 月任新疆金融投资有限公司办公室主任；自 2013 年 3 月至 2014 年 2 月任新疆金融投资有限公司投资管理部经理；自 2013 年 6 月至 2020 年 3 月任新疆凯迪投资有限责任公司职工董事；自 2014 年 2 月至 2016 年 11 月任新疆金融投资有限公司总经理助理、新疆凯迪投资有限责任公司总经理助理；自 2015 年 1 月至今任申万宏源证券有限公司监事；自 2015 年 4 月至今任新疆交易市场投资建设集团股份有限公司董事；自 2016 年 8 月至今任新疆天山毛纺织股份有限公司董事；自 2016 年 9 月至 2018 年 10 月任新疆天山产业投资基金管理有限公司董事长；自 2016 年 11 月至 2018 年 3 月任新疆凯迪投资有限责任公司投资总监；自 2017 年 12 月至今任新疆天山泰富股权投资基金管理有限公司董事长；自 2018 年 3 月至 2021 年 12 月任新疆小额再贷

款股份有限公司董事；自 2018 年 3 月至 2019 年 6 月任新疆小额再贷款股份有限公司常务副总经理；自 2019 年 6 月至 2021 年 4 月任新疆小额再贷款股份有限公司总经理；自 2019 年 12 月至今任新疆金融投资有限公司副总经理；自 2020 年 3 月至今任新疆凯迪投资有限责任公司董事、副总经理；自 2020 年 3 月至今任新疆凯迪矿业投资股份有限公司董事；自 2021 年 5 月至今任申万宏源集团股份有限公司监事。姜杨先生于 2001 年 7 月在新疆财经学院银行货币专业取得经济学学士学位；于 2014 年 12 月获得新疆财经大学高级管理人员工商管理硕士学位。

除本节相关披露外，报告期内本公司的董事、监事及高级管理人员未有其他须要根据《香港上市规则》第 13.51B(1)条于本报告中披露的资料变更。

## 七、授权代表变动情况

2022 年 8 月 26 日，公司第五届董事会第十一次会议审议同意委任刘健先生为授权代表，该委任自董事会审议通过之日起生效。储晓明先生因工作安排原因，辞去授权代表职务，其辞任自辞职报告于 2022 年 8 月 26 日送达董事会时生效。（相关情况请详见公司于 2022 年 8 月 27 日在《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》、巨潮资讯网 [www.cninfo.com.cn](http://www.cninfo.com.cn) 及于 2022 年 8 月 26 日在香港联交所披露易 [www.hkexnews.hk](http://www.hkexnews.hk) 披露的相关公告）

## 八、员工及薪酬政策

### （一）员工人数

截至 2022 年 6 月 30 日，公司共有员工 11,547 人，其中：申万宏源集团 97 人，申万宏源证券 10,870 人（含证券经纪人 742 人），其他子公司 580 人。

### （二）薪酬政策

公司根据发展战略，按照市场化原则，以保障与激励相结合的薪酬分配制度为核心，建立兼顾内具公平性和外具竞争力的薪酬体系。公司薪酬包括基本薪酬、年度绩效薪酬、福利、特殊津贴和长期激励等。基于公司的支付能力，公司对人力成本进行

总体管控，并严格执行财政部关于国有金融企业工资总额管理的有关规定，使公司人力成本的增长有效支持经营业绩，以促进公司持续、稳定、健康发展。根据员工在资历、能力等方面的差异，公司建立以职位的任职要求及绩效标准为核心的员工基本薪酬体系，并通过绩效评估将员工的薪酬与公司、部门以及员工的绩效表现直接挂钩，体现责任、风险与收益相匹配的激励导向。员工薪酬、福利水平结合公司的战略定位和实际支付能力，参照社会平均工资及市场薪酬适时进行调整。

### （三）培训情况

培训工作紧紧围绕公司新一轮发展战略，紧扣员工教育培训工作新要求，坚持战略导向、支持业务的工作原则，聚焦人才培养要求和服务公司经营所需的知识和能力，结合公司“投行+投资”的发展战略需要，重点开展财富管理、投资顾问、国际化人才、投资银行、投研交易、财富机构和合规风控等条线员工业务能力提升培训；组织开展导师带教工作，初步建立公司导师库；启动公司经营管理案例征集工作，持续完善公司全员执证上岗体系和“领航”、“远航”和“启航”计划体系内容，持续运营并创新实施“汇创论坛”业务交流、风险管理系列主题讲座等重点培训项目，确保教育培训和业务发展相互配合，服务公司发展大局，防范金融风险，服务实体经济。

## 九、本报告期利润分配及资本公积金转增股本方案

公司计划 2022 年半年度不派发现金红利，不送红股，不以公积金转增股本。

## 十、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的实施情况

公司报告期内无股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施及其实施情况。

## 第五节 环境和社会责任

### 一、保护生态、防治污染、履行环境责任的相关信息

公司积极响应国家绿色发展的号召，依托自身的业务特点和优势，着力推动绿色金融发展，广泛推行环保理念并付诸于行动，践行“绿水青山就是金山银山”的发展理念，助力实现“碳达峰、碳中和”。

**（一）围绕“双碳”战略开展金融业务。**申万宏源证券成立“碳中和”债券业务小组，通过深化绿色金融全面合作、支持绿色企业债券融资等方式，先后与国家能源集团、中国大唐、中国华能、中铁投资等多家央企实现了“碳中和”金融业务合作，通过债券融资引导资金流向绿色行业；成功助力发行了多个市场“第一单”碳中和创新类债券。通过挂钩关键绩效目标，有效促进能源类碳密集型企业低碳转型。2022年5月19日，公司成功助力发行交易所第一单低碳转型债券——中国华能2022年可续期公司债券（第一期），在行业内率先实现了运用债券工具，助力产业实体实现绿色可持续发展的有益探索；5月20日，又成功助力发行交易所第一单低碳转型挂钩债券、宝钢股份历史上首单绿色债券——宝山钢铁2022年绿色公司债券（第一期），本期债券也是全国首批、钢铁行业首单低碳转型挂钩公司债券，募集资金全部用于宝钢湛江钢铁低碳转型项目建设。

**（二）积极参与绿色研究。**深入研究绿色发展方向，成功入选中国绿色碳汇基金会副理事长单位；加强“碳达峰、碳中和”的政策研究和理论研究，围绕“碳达峰、碳中和”国家战略制订具体行动方案；合作设立“碳中和”产业并购基金，彰显有信仰、有担当国有金融企业形象。

**（三）助力定点帮扶县绿色发展。**2022年7月3日，在公司绿色双碳工作小组、帮扶办公室、研究所的共同推进下，甘肃省会宁县通宁建设发展有限公司与岳阳林纸股份有限公司全资子公司森海碳汇成功签署《温室气体自愿减排项目林业碳汇资源开发合作合同》，这也是券商推动帮扶点林业碳汇资源开发的首例项目。

**（四）切实践行低碳运营。**公司严格遵循《中华人民共和国环境保护法》《中华人民共和国节约能源法》等重要法律法规，不断完善绿色运营的相关措施，推广低碳服务，倡导员工节约能源，积极推进气候变化管理，为应对气候变化贡献力量。绿色会议方面，通过网络视频会议减少公共资源占用、降低碳排放量；绿色办公方面，公

司贯彻实施多类环保措施，包括节约照明用电、禁止私自接电改电、公共区域空调温度节能设置、洗手间节水、推行无纸化办公等；绿色出行方面，鼓励员工使用公共交通的出行方式，针对公车使用制定了《车辆管理暂行办法》，明确了公车使用过程中的申请及审批流程、费用开支要求等，禁止公车私用。办公场所内工作时间和非工作时间一律禁止吸烟，禁烟场所包括办公室、会议室、档案室、食堂、楼道、走廊、卫生间等有顶建筑物，禁烟区内，张贴禁烟标志，一律不得摆设烟具，营造绿色环保的办公环境。

## 二、社会责任情况

为落实好中央关于牢牢守住不发生返贫底线和全面推进乡村振兴的工作要求，申万宏源 2022 年计划在甘肃省会宁县直接投入帮扶资金人民币 3,450 万元。帮扶项目分为两大方面，一是巩固拓展脱贫攻坚成果项目，出资人民币 1,529 万元；二是乡村振兴方面，出资人民币 1,921 万元。截至 2022 年 6 月底，公司已在甘肃省会宁县投入帮扶资金人民币 2,837 万元，在新疆投入帮扶资金人民币 50 万元。

**（一）巩固脱贫攻坚成果方面：**2022 年公司在会宁县持续开展“防返贫综合险”，截至 2022 年 6 月底，防返贫险在全县已受理 980 起，累计赔付近 238.59 余万元，实现了“阻致贫、防返贫”的成效；2022 年针对全县“三类户”（脱贫不稳定户、边缘易致贫户、突发严重困难户）猪、牛、羊养殖及种植玉米、苹果的农户持续开展“保险+期货”，帮助更多“三类户”的种养殖户规避农产品价格的波动风险。

**（二）推进乡村振兴方面：**2022 年，公司加大重点产业帮扶力度，进一步推进帮扶模式由“输血型”向“造血型”转变。一是**支持农业、养殖业发展**，加大对肉羊全产业链建设项目的支持力度，根据甘肃省发展寒旱农业特色产业、扩大养殖规模的发展要求，会宁县规划大力引进种羊养殖企业，带动本地良种培育和优化。二是**扶持会宁特色村集体产业**，对刘寨的百合、老君坡小杂粮以及丁沟镇梁庄村肉羊产业等，通过“村集体+致富带头人+农户”的合作模式，充分发挥致富带头人的带头作用，为村集体经济和村民增收。三是**支持会宁助农馆建设**，帮助提升会宁县电商运营、营销能力，打造拳头产品，定期开展直播带货宣传活动，促进农产品销售。四是**发力教育帮扶**，帮扶对象由小学、初中，扩展至高中，以达到从幼儿到高中全年龄段帮扶，助力会宁教育发展；设立的“乐学奖”，获奖范围由原“脱贫户”转变为全部成绩优异，在德智体美劳方面全面发展的学生。五是**推进文化振兴**，通过“充实村级图书室书籍

引导文明乡风”项目，充实百姓业余生活，加强文化建设，发挥村级图书室在新农村建设的文化宣传阵地作用。**六是助力生态振兴**，通过对特色村庄实施美丽乡村建设，如道路维修、排水边沟、夜间照明、卫生设施、环境改善等系列手段，使百姓得实惠，助力会宁向现代乡村发展。**七是帮助组织振兴**，新建 27 个村级阵地，进一步夯实村级阵地在乡村振兴中的重要作用；针对县各乡镇、村班子成员党员干部开展培训，不断提升党员干部基层治理能力和水平。

**（三）疫情防控方面：**今年上半年，全国多地疫情爆发，公司高度重视，认真履行国有企业社会责任，捐资捐物支持抗疫，紧急采购 8 万套防护服，捐赠给上海市徐汇区政府用于支持抗疫工作；向吉林省慈善总会捐赠人民币 30 万元，用于吉林省长春市抗疫工作，为坚决打赢疫情防控攻坚战贡献力量。

## 第六节 重要事项

### 一、承诺事项

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不存在履行完毕及截至报告期末超期未履行完毕的承诺事项。

### 二、控股股东及其他关联方对本公司非经营性占用资金情况

报告期内，公司不存在控股股东及其他关联方对本公司的非经营性占用资金。

### 三、违规对外担保

报告期内，公司无违规对外担保情况。

### 四、聘任、解聘会计师事务所情况

#### （一）公司 2022 年半年度财务报告审计情况

公司 2022 年半年度财务报告未经审计。

#### （二）续聘会计师事务所情况

2022 年 4 月 29 日，公司第五届董事会第八次会议审议同意《关于续聘公司 2022 年度审计机构的议案》，同意续聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）（以下简称“普华永道中天”）、罗兵咸永道会计师事务所（以下简称“罗兵咸永道”）担任公司 2022 年度审计机构，分别按照中国企业会计准则和国际财务报告准则提供相关境内、境外审计、审阅等服务；同意续聘普华永道中天担任公司 2022 年度内部控制审计机构；2022 年度含内部控制的审计费用为人民币 598 万元。

根据有关法律、法规规定及公司制度要求，公司董事会审计委员会对普华永道中天和罗兵咸永道从事公司 2021 年度审计工作进行了审查，认为普华永道中天和罗兵咸永道具备从事财务审计、内部控制审计的资质和能力，符合相关独立性政策和专业守则的独立性要求，满足公司审计工作要求。普华永道中天和罗兵咸永道在对公司 2021 年度财务报表审计、内部控制审计和其他专业工作的过程中，能够遵照独立、客观、公正的执业准则履行职责，工作恪尽职守，以严谨的独立性审查态度以及高效的质量控制系统为公司提供专业审计服务。

董事会审计委员会于 2022 年 4 月 22 日召开 2022 年第四次会议，审议同意续聘普华永道中天、罗兵咸永道担任公司 2022 年度审计机构，并提请公司董事会审议。独立董事对本次续聘会计师事务所事项出具了相关事前认可意见及独立意见。

2022 年 6 月 10 日，公司 2021 年度股东大会审议通过上述续聘公司 2022 年度审计机构事项。

## 五、董事会、监事会对会计师事务所本报告期“非标准审计报告”的说明

不适用

## 六、董事会对上年度“非标准审计报告”相关情况的说明

不适用

## 七、破产重整相关事项

不适用

## 八、诉讼事项

### （一）整体情况

报告期内，公司未发生涉案金额占公司最近一期经审计净资产绝对值 10% 以上且绝对金额超过一千万元的重大诉讼、仲裁事项，公司过去十二个月发生的诉讼、仲裁事项累计金额不超过最近一期经审计净资产绝对值 10%。

### （二）报告期内，公司及子公司（不含申万宏源证券）发生的诉讼事项

#### 1. 宏源恒利（上海）实业有限公司诉浙江康运仓储有限公司仓储合同纠纷案

因开展基差贸易、仓单服务业务需要，宏源恒利于 2021 年 12 月 30 日与浙江康运仓储有限公司（以下简称“浙江康运”）签署《仓储保管合同》，约定了仓储保管的权利义务。2022 年 6 月 1 日，宏源恒利发现存储于浙江康运仓库的铝锭无法提货。为维护自身合法权益，宏源恒利向浙江省杭州市中级人民法院提起诉讼，请求法院判决浙江康运向宏源恒利交付铝锭 6,993.239 吨（或赔偿货值损失人民币 141,962,751.7 元）及相关利息、违约金等。截至目前，本案尚未判决。

#### 2. 宏源恒利（上海）实业有限公司诉佛山市中金圣源仓储管理有限公司仓储合同纠纷案

因开展基差贸易、仓单服务业务需要，宏源恒利于2022年1月1日与佛山市中金圣源仓储管理有限公司（以下简称“佛山中金圣源”）签署《仓储保管合同》，约定了仓储保管的权利义务。2022年5月30日，宏源恒利发现储存于佛山中金圣源仓库的铝锭无法提货。为维护自身合法权益，宏源恒利向上海市虹口区人民法院提起诉讼，请求法院判决佛山中金圣源向宏源恒利交付铝锭4,125.1323吨（或赔偿货值损失人民币85,637,746.55元）及相关利息、违约金等。截至目前，本案尚未判决。

（三）报告期内，公司所属子公司申万宏源证券及其子公司（为便于清晰简要表述，本节申万宏源证券简称“公司”）有关诉讼、仲裁事项

#### 1.湖北襄阳农村商业银行股份有限公司诉公司等委托理财合同纠纷案

湖北襄阳农村商业银行股份有限公司（以下简称“申请人”）因委托理财合同纠纷在武汉仲裁委员会对公司及资产管理计划托管人提起仲裁。申请人为公司管理的资产管理计划委托人，因对资产管理计划的运作存在争议，要求公司赔偿本金、预期利息损失及管理费合计人民币7,600余万元，并要求托管人承担补充责任。2022年3月4日，公司收到武汉仲裁委员会仲裁通知书。截至目前，本案尚未裁决。

#### 2.山东莱州农村商业银行股份有限公司与公司资产管理合同纠纷案

山东莱州农村商业银行股份有限公司（以下简称“申请人”）因资产管理合同纠纷在上海国际经济贸易仲裁委员会对我公司提起仲裁。申请人为公司管理的资产管理计划委托人，因对资产管理计划的运作存在争议，要求公司退还委托资金、赔偿投资损失、管理费托管费损失合计人民币7,600余万元。2022年3月15日，公司收到仲裁通知书。截至目前，本案尚未裁决。

#### 3.公司诉科瑞天诚投资控股有限公司、宁波科瑞金鼎投资合伙企业（有限合伙）质押式证券回购合同纠纷案

2017年3月，公司与科瑞天诚投资控股有限公司（以下简称“科瑞天诚”）签订《股票质押式回购交易业务协议》，其后又签订七份《股票质押式回购交易协议书》，科瑞天诚向公司融入资金。后双方对上述交易合约进行了延期。宁波科瑞金鼎投资合伙企业（有限合伙）（以下简称“宁波金鼎”）承担连带保证责任。2020年8月，公司与科瑞天诚签订《补充协议》，并由双方与宁波金鼎等签订《应收账款质押三方协议》。2022年1月，科瑞天诚未按照公司要求提高履约保障比例或提前购回，构成违约。为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼，请求科瑞天诚向公司支付未偿还本金人民币180,000万元及相关利息、违约金、利息滞纳金，宁波金鼎对

上述债务承担连带清偿责任等。2022年3月，上海金融法院受理本案。截至目前，本案尚未判决。

4.公司（代表证券行业支持民企发展之申万宏源15号单一资产管理计划）诉明泰汇金资本投资有限公司质押式证券回购合同纠纷系列案

（1）2019年12月，公司代表证券行业支持民企发展之申万宏源15号单一资产管理计划与明泰汇金资本投资有限公司（以下简称“明泰汇金”）签订《股票质押式回购交易业务协议》，其后又签订两份《股票质押式回购交易协议书》，明泰汇金向资产管理计划融入资金。2021年3月，因质押股票被司法冻结，明泰汇金未按公司通知要求提前购回，构成违约。为维护自身合法权益，公司代表资产管理计划向上海金融法院提起诉讼，请求明泰汇金支付未偿还本金人民币43,000万元及相关利息、违约金等。

（2）2017年3月，公司与明泰汇金签订《股票质押式回购交易业务协议》，其后又签订一份《股票质押式回购交易协议书》，明泰汇金向公司融入资金。2021年3月，因质押股票被司法冻结，明泰汇金未按公司通知要求提前购回，构成违约。为维护自身合法权益，我司向上海金融法院提起诉讼，请求明泰汇金向公司支付未偿还本金人民币12,500万元及相关利息、违约金等。2022年5月，上海金融法院受理上述案件。

截至目前，上述案件尚未判决。

（四）报告期内，公司所属子公司申万宏源证券及其子公司（为便于清晰简要表述，本节申万宏源证券简称“公司”）已披露且有进展的诉讼、仲裁事项

#### 1.公司诉刘祥代融资融券交易纠纷案

2019年12月，公司与刘祥代签订《融资融券合同》。刘祥代开展融资购买股票业务期间，信用账户维持担保比例低于平仓线，且未采取有效措施提高维持担保比例，后经公司强制平仓，尚欠公司融资本金人民币10,763.24万元未还。经催讨未果，为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼，要求刘祥代履行还款义务。2021年1月，上海金融法院受理公司起诉。2021年10月，上海金融法院作出一审判决，支持公司诉讼请求。一审判决生效后，刘祥代未履行支付义务，公司向法院申请执行。2022年6月，法院出具裁定书，经穷尽财产调查措施，未发现刘祥代有其他可供执行财产，依法裁定终结本次执行程序。本案结案。

#### 2.中来光伏与泓盛资产管理公司、公司基金合同纠纷案

2019 年 10 月，公司与苏州中来光伏新材股份有限公司（以下简称“中来光伏”）、泓盛资产管理（深圳）有限公司（以下简称“泓盛资产”）签订《泓盛腾龙 4 号私募证券投资基金基金合同》。中来光伏为基金委托人、泓盛资产为基金管理人，公司为基金托管人。中来光伏认为泓盛资产未按诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务；认为公司未尽托管人的相应义务，向上海仲裁委员会申请仲裁，要求（1）泓盛资产赔偿投资本金损失人民币 5,000 万元及相关利息损失；（2）公司作为托管人承担连带责任。2021 年 1 月，上海仲裁委员会受理了本案。2022 年 7 月，上海仲裁委员会作出裁决，仲裁裁决泓盛资产向申请人承担部分赔偿责任，公司作为托管人无需承担任何赔偿责任，本案结案。

### 3. 子公司申银万国创新证券投资有限公司与上海世联行股权投资管理有限公司合同争议仲裁案

2015 年 11 月，申万创新投与上海世联行股权投资管理有限公司（以下简称“上海世联行”）等签署了《上海祺浩投资合伙企业（有限合伙）合伙协议》。2016 年 11 月，申万创新投与上海世联行签署了《关于上海祺浩投资合伙企业（有限合伙）的补充协议》。后上海世联行未按照协议约定履行相关义务。为维护公司的合法权益，申万创新投向上海国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁，要求上海世联行履行收购义务，支付投资款及协议约定的回购利息合计人民币 6,178.5 万元。2021 年 4 月，上海国际经济贸易仲裁委员会已受理本案。申万创新投与上海世联行于 2022 年 6 月就本案争议事项达成和解并签署《和解协议》，仲裁庭根据生效的《和解协议》于 2022 年 7 月作出裁决书，裁决上海世联行将依照《和解协议》约定的付款方式，分期向申万创新投支付履行回购义务的款项。截至目前，《和解协议》正在履行中。

### 4. 公司诉 RAAS CHINA LIMITED、深圳莱士凯吉投资咨询有限公司、科瑞天诚投资控股有限公司质押式证券回购合同纠纷案

2017 年 10 月，公司与 RAAS CHINA LIMITED 签订《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，RAAS CHINA LIMITED 向公司融入资金，科瑞天诚承担连带保证责任。2018 年 3 月，公司、RAAS CHINA LIMITED、深圳莱士、科瑞天诚签订了《补充协议》。2018 年 9 月，深圳莱士未按照合同约定履行义务。为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼，要求 RAAS CHINA LIMITED 向公司支付未偿还本金人民币 20,000 万元及相关利息、违约金，深圳莱士向公司支付相关利息，科瑞天诚承担连带清偿责任等。2021 年 4 月，上海金融法院

受理本案。2021 年 11 月，上海金融法院作出一审判决，支持公司主要诉讼请求。截至目前，本案判决已生效，公司已向法院申请执行。

5.公司（代表资产管理计划）诉安吉聚龙企业管理咨询合伙企业（有限合伙）、柳永铨、张奈、柳长庆质押式证券回购合同纠纷系列案

（1）2019 年 12 月，公司代表申万宏源聚龙 1 号集合资产管理计划与安吉聚龙企业管理咨询合伙企业（有限合伙）（以下简称“安吉聚龙”）签订《股票质押式回购交易业务协议》及《公司股票质押式回购交易协议书》，安吉聚龙向资管计划融入资金合计人民币 12,260 万元。柳永铨及其配偶张奈提供连带保证，柳长庆提供质押担保。期间，安吉聚龙偿还了部分本金。因安吉聚龙未采取措施维持约定的履约保障比例，未按照公司要求提前购回，构成违约。为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼，要求安吉聚龙支付待偿还本金人民币 10,682.50 万元及利息、违约金，柳永铨、张奈、柳长庆承担相应担保责任等。2021 年 7 月，上海金融法院受理本案。2022 年 6 月，上海金融法院作出一审判决，支持公司诉讼请求。截至目前，上述判决尚未生效。

（2）2019 年 12 月，公司代表申万宏源聚龙 1 号集合资产管理计划与柳永铨签订《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，柳永铨向资管计划融入资金合计人民币 37,540 万元，其配偶张奈承担连带责任，安吉聚龙提供连带保证，柳长庆提供质押担保。期间，柳永铨未采取措施维持约定的履约保障比例，未按照公司要求提前购回，构成违约。为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼，要求柳永铨、张奈共同支付待偿还本金人民币 37,540 万元及相关利息、违约金，安吉聚龙和柳长庆承担相应担保责任等。2021 年 7 月，上海金融法院受理本案。2022 年 6 月，上海金融法院作出一审判决，支持公司诉讼请求。截至目前，上述判决尚未生效。

（3）2020 年 4 月，公司代表申万宏源 15 号单一资产管理计划与柳永铨签订《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，柳永铨向资管计划融入资金合计人民币 15,820.76 万元，其配偶张奈承担连带责任并提供质押担保，柳长庆提供质押担保。期间，柳永铨未采取措施维持约定的履约保障比例，未按照公司要求提前购回，在合约到期时也未履行购回义务。为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼，要求柳永铨、张奈共同支付待偿还本金人民币 15,820.76 万元及相关利息、违约金，柳长庆承担相应担保责任等。2021 年 7 月，上海金融法院受理

本案。2022 年 6 月，上海金融法院作出一审判决，支持公司诉讼请求。截至目前，上述判决尚未生效。

(4) 2020 年 4 月，公司代表申万宏源 15 号单一资产管理计划与周素芹签订《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，周素芹向资管计划融入资金合计人民币 16,076.52 万元，其配偶柳长庆承担连带责任并提供质押担保，张奈提供质押担保。期间，周素芹未采取措施维持约定的履约保障比例，未按照公司要求提前购回，在合约到期时也未履行购回义务。为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼，要求周素芹、柳长庆共同支付待偿还本金人民币 16,076.52 万元及相关利息、违约金，张奈承担相应担保责任等。2021 年 7 月，上海金融法院受理本案。2022 年 6 月，上海金融法院作出一审判决，支持公司诉讼请求。截至目前，上述判决尚未生效。

#### 6. 公司诉柯宗贵、陈色琴等质押式证券回购系列纠纷案

(1) 2017 年 3 月，公司与柯宗贵签订了《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，柯宗贵向公司融入人民币 8,300 万元，其配偶陈色琴承担连带责任，中经汇通有限责任公司、马美容提供质押担保。柯宗贵自 2020 年 3 月起未按照协议约定支付利息，亦未完成回购交易等，构成违约。为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼。2020 年 8 月，上海金融法院受理本案。2021 年 10 月，上海金融法院作出一审判决，支持公司诉讼请求。后柯宗贵一方向上海高级人民法院提起上诉。截至目前，本案尚未判决。

(2) 2017 年 3 月，公司与柯宗贵签订了《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，柯宗贵向公司融入人民币 10,000 万元，其配偶陈色琴承担连带责任，中经汇通有限责任公司、马美容提供质押担保，期间柯宗贵向公司归还了人民币 4,000 万元本金。柯宗贵自 2020 年 3 月起未按照协议约定支付利息，亦未完成回购交易等，构成违约。为维护自身合法权益，公司向上海金融法院提起诉讼。2020 年 8 月，上海金融法院受理本案。2021 年 10 月，公司收到上海金融法院一审判决书，支持公司诉讼请求。后柯宗贵一方向上海高级人民法院提起上诉。截至目前，本案尚未判决。

(3) 2017 年 7 月，公司与柯宗贵签订了《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，柯宗贵向公司融入人民币 9,000 万元，其配偶陈色琴承担连带责任，马美容提供质押担保，期间柯宗贵归还了部分本金，后柯宗贵后续未按

照协议约定支付利息，亦未完成回购交易等，构成违约。为维护自身合法权益，公司向上海市徐汇区人民法院提起诉讼，要求支付本金人民币 2,173 万元及相应利息、违约金等。2020 年 8 月，上海市徐汇区人民法院受理本案。2021 年 8 月，上海市徐汇区人民法院作出一审判决，支持公司诉讼请求，后柯宗贵提起上诉。2022 年 6 月，上海金融法院作出二审判决，驳回上诉，维持原判。截至目前，公司已向法院申请执行。

#### 7. 公司诉中信国安集团有限公司质押式证券回购纠纷案

2018 年，公司与中信国安集团有限公司（以下简称中信国安）签订了《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，中信国安向公司融入资金，2018 年 10 月，履约保障比例低于约定，中信国安未依约履行相关义务，构成违约。2019 年 12 月，公司向上海金融法院起诉并获得受理，要求支付本金人民币 45,000 万元及相应利息、违约金等。后本案移送北京市三中院处理。2021 年 12 月，北京市三中院做出一审判决，支持公司主要诉讼请求。2022 年 1 月，北京市一中院裁定受理中信国安重整申请。截至目前，本案判决已生效，公司正向管理人申报债权。

#### 8. 公司诉中信国安投资有限公司、中信国安集团有限公司质押式证券回购纠纷案

2018 年 3 月，公司与中信国安投资有限公司（以下简称“国安投资”）签订了《股票质押式回购交易业务协议》及《股票质押式回购交易协议书》，国安投资向公司融入资金，中信国安承担连带保证责任。2018 年 10 月，履约保障比例低于约定，国安投资未依约履行相关义务，中信国安亦未承担相应担保责任，构成违约。2019 年 12 月，公司向上海金融法院起诉并获得受理，要求支付本金人民币 32,896 万元及相应利息、违约金等。后本案移送至北京市第三中级人民法院处理。2021 年 12 月，北京市三中院做出一审判决，支持公司主要诉讼请求。2022 年 1 月，北京市一中院裁定受理中信国安重整申请。2022 年 6 月，中信国安投资被法院裁定与中信国安合并重整。截至目前，本案判决已生效，公司正向管理人申报债权。

### 九、处罚及整改情况

报告期内，公司不存在涉嫌犯罪被依法立案调查情况，公司的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在涉嫌犯罪被依法采取强制措施情况。公司以及公司的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在受到刑事处罚，涉嫌违法违规被中国证监会立案调查或者受到中国证监会行政处罚，或者受到其他有

权机关重大行政处罚情况。公司的控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在涉嫌严重违纪违法或者职务犯罪被纪检监察机关采取留置措施且影响其履行职责情况。公司董事、监事、高级管理人员不存在因涉嫌违法违规被其他有权机关采取强制措施且影响其履行职责情况。

报告期内，公司或者公司的控股股东、实际控制人不存在被中国证监会采取行政监管措施和被证券交易所采取纪律处分的情况。

报告期内，香港联交所对公司独立非执行董事武常岐先生在任职北青传媒股份有限公司（于香港联交所上市的公司，股份代号：1000）（以下简称“北青传媒”）独立非执行董事期间有关事项作出公开批评，指其未有确保北青传媒维持充分及有效的内部控制，因而违反《香港上市规则》第3.08(f)条及彼以《香港上市规则》附录五H所载表格形式向香港联交所作出的《董事的声明及承诺》。武常岐先生已于2021年11月25日辞任北青传媒之独立非执行董事，并按照香港联交所的要求完成了24小时有关监管及法律议题（包括《香港上市规则》合规事宜）的培训。相关情况请详见公司于2022年2月14日在巨潮资讯网 [www.cninfo.com.cn](http://www.cninfo.com.cn) 及香港联交所披露易 [www.hkexnews.hk](http://www.hkexnews.hk) 披露的相关公告及香港联交所于2022年2月10日在香港联交所网站登载的监管通讯。

除前述披露外，公司其他董事、监事和高级人员不存在被中国证监会采取行政监管措施和被证券交易所采取纪律处分的情况。

## 十、公司及其控股股东、实际控制人的诚信情况

报告期内，公司及控股股东中国建投、实际控制人中央汇金不存在未履行法院生效法律文书、所负数额较大的债务到期未清偿等情况。

## 十一、重大关联交易

### （一）报告期与公司日常经营相关的关联交易

报告期内，公司严格按照经 2021 年度股东大会审议通过的《关于预计 2022 年度日常关联交易的议案》，开展日常关联交易，执行情况如下表：

单位：万元 币种：人民币

关联交易类别	关联人	关联交易内容	关联交易定价原则	预计交易上限及说明	截至 2022 年 6 月 30 日已发生金额	占同类交易金额的比例(%)

关联交易类别	关联人	关联交易内容	关联交易定价原则	预计交易上限及说明	截至 2022 年 6 月 30 日已发生金额	占同类交易金额的比例(%)
证 券 和 金 融 服 务	中国建银投资有限责任公司及其所属公司	向关联方提供证券经纪、投资银行、资产管理、代销、出租交易单元等证券和金融服务产生的收入	参照市场费率、行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	1,259.75	0.3078
		接受关联方提供的基金管理等服务和金融服务产生的支出			0.00	-
	上海汽车集团财务有限责任公司	向关联方提供资产管理、经纪服务等证券和金融服务产生的收入	参照市场费率、行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	0.90	0.0004
	上汽通用汽车金融有限责任公司	向关联方提供投资银行服务等证券和金融服务产生的收入	参照市场费率、行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	488.50	0.7057
	上海汽车集团股份有限公司	向关联方提供资产管理、经纪服务、投资银行服务等证券和金融服务产生的收入	参照市场费率、行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	6.51	0.0027
	上海汽车集团金控管理有限公司	向关联方提供资产管理、经纪服务、投资银行服务等证券和金融服务产生的收入	参照市场费率、行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	0.96	0.0004
	四川发展（控股）有限责任公司	向关联方提供投资银行服务、证券经纪、咨询、培训等证券和金融服务产生的收入	参照市场费率、行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	0.00	-
	上海银行股份有限公司	存款利息、向关联方提供资产管理、代销等证券和金融服务产生的收入	参照市场费率、行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	5,163.87	3.4591
		接受关联方提供的资产托管、财务顾问、资金托管等证券和金融服务产生的支出			26.61	0.0414
	上海久事（集团）有限公司	向关联方提供证券经纪服务等证券和金融服务产生的收入	参照市场费率、行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	5.01	0.0021
新疆凯迪投资有限责任公司	向关联方提供资产管理、经纪服务、投资银行服务等证券和金融服务产生的收入	参照市场费率、行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	0.00	-	

关联交易类别	关联人	关联交易内容	关联交易定价原则	预计交易上限及说明	截至 2022 年 6 月 30 日已发生金额	占同类交易金额的比例(%)
	新疆金融投资有限公司	向关联方提供投资银行、证券经纪、代办证券质押等证券和金融服务产生的收入	参照市场费率、行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	94.20	0.1361
	富国基金管理有限公司	向关联方提供代销、出租交易单元等证券和金融服务产生的收入	参照市场费率、行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	7,983.80	12.1097
	上海国际信托有限公司	向关联方提供代销、咨询服务、投资银行服务等证券和金融服务产生的收入	参照市场费率、行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	0.00	-
	除前述列明之外的公司其他关联方	与关联方相互提供证券和金融服务产生的收入或支出	参照市场费率、行业惯例，经公平协商确定	因业务的发生及规模的不确定性，按实际发生额计算	0.00	--
证券和金融产品交易	中国建银投资有限责任公司及其所属公司	收取回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、债券交易、同业拆借、衍生品交易、关联方认购公司非公开发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流入总额	参照市场价格或市场费率，经双方公平协商确定	由于证券市场情况无法预计，交易量无法预计，按实际发生额计算	121,040.33	0.0160
		支付回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、同业拆借、债券交易、衍生品交易、认购关联方非公开发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流出总额			3,031.41	0.0034
	上海银行股份有限公司	收取回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、债券交易、同业拆借、衍生品交易、关联方认购公司非公开发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流入总额	参照市场价格或市场费率，经双方公平协商确定	由于证券市场情况无法预计，交易量无法预计，按实际发生额计算	766,769.08	0.0875
		支付回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、同业拆借、债券交易、衍生品交易、认购关联方非公开发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流出总额			151,481.51	0.1676

关联交易类别	关联人	关联交易内容	关联交易定价原则	预计交易上限及说明	截至 2022 年 6 月 30 日已发生金额	占同类交易金额的比例(%)
	上海汽车集团财务有限责任公司	收取回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、债券交易、同业拆借、衍生品交易、关联方认购公司非公开发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流入总额	参照市场价格或市场费率，经双方公平协商确定	由于证券市场情况无法预计，交易量无法预计，按实际发生额计算	0.00	-
		支付回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、同业拆借、债券交易、衍生品交易、认购关联方非公开发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流出总额			4,998.44	0.0064
	富国基金管理 有限公司	收取回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、债券交易、同业拆借、衍生品交易、关联方认购公司非公开发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流入总额	参照市场价格或市场费率，经双方公平协商确定	由于证券市场情况无法预计，交易量无法预计，按实际发生额计算	0.00	-
		支付回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、同业拆借、债券交易、衍生品交易、认购关联方非公开发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流出总额			0.00	-
	上海国际信托 有限公司	收取回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、债券交易、同业拆借、衍生品交易、关联方认购公司非公开发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流入总额	参照市场价格或市场费率，经双方公平协商确定	由于证券市场情况无法预计，交易量无法预计，按实际发生额计算	340,946.29	0.0450
		支付回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、同业拆借、债券交易、衍生品交易、认购关联方非公开发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流出总额			74.64	0.0762
	新疆金融投资 有限公司	支付回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、同业拆借、债券交易、衍生品交易、认购关联方非公开发行或管理的金融产品等现金流出总额	参照市场价格或市场费率，经双方公平协商确定	由于证券市场情况无法预计，交易量无法预计，按实际发生额计算	6,000.00	0.1708

关联交易类别	关联人	关联交易内容	关联交易定价原则	预计交易上限及说明	截至 2022 年 6 月 30 日已发生金额	占同类交易金额的比例(%)
	除前述列明之外的公司其他关联方	收取回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、债券交易、同业拆借、衍生品交易、关联方认购公司非公开发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流入总额	参照市场价格或市场费率，经双方公平协商确定	由于证券市场情况无法预计，交易量无法预计，按实际发生额计算	0.00	-
		支付回购交易和同业拆借利息、与关联方进行回购交易、同业拆借、债券交易、衍生品交易、认购关联方非公开发行或管理的金融产品等证券和金融产品交易现金流出总额			0.00	-
租赁	中国建银投资有限责任公司	租赁关联方的房屋产生的支出	参照市场租金，经双方公平协商确定	70.00	0.00	-
综合服务	中国建银投资有限责任公司	接受关联方提供的机房维护等服务产生的支出	参照市场价格，经双方公平协商确定	960.00	0.00	-

(二) 资产或股权收购、出售发生的关联交易

报告期内，公司未发生资产或股权收购、出售的关联交易。

(三) 共同对外投资的关联交易

报告期内，公司未发生共同对外投资的关联交易。

(四) 关联债权债务往来

报告期内，公司不存在关联债权债务往来。

(五) 与存在关联关系的财务公司的往来情况

不适用。

(六) 公司控股的财务公司与关联方的往来情况

不适用。

### （七）其他重大关联交易

报告期内，公司无其他重大关联交易。

## 十二、重大合同及其履行情况

### （一）重大托管、承包、租赁情况

报告期内，公司未发生重大托管、承包、租赁事项。

### （二）重大担保

公司未发生合并报表范围外担保事项。公司及公司所属子公司担保事项如下：

#### 1. 公司有关担保事项：

2021 年 3 月 30 日，公司第四届董事会第六十次会议审议通过了《关于为宏源恒利（上海）实业有限公司提供担保的议案》，同意公司在不超过人民币 10 亿元的额度内（含已生效未到期的银行授信金额），为宏源恒利对外融资提供担保。2021 年 5 月 28 日，公司股东大会审议通过前述议案，该担保事项及授权有效期为股东大会审议通过之日起 24 个月内签订的担保均视同有效。

#### （1）报告期内发生的担保事项

2022 年 3 月 7 日，公司与中国建设银行股份有限公司上海第二支行为宏源恒利办理综合授信业务签署了《本金最高额保证合同》，为宏源恒利提供人民币壹亿元整的连带责任保证担保。

#### （2）截至报告期末仍在有效期的担保事项

2021 年 9 月 23 日，公司分别与交通银行股份有限公司上海普陀支行、中国银行股份有限公司上海市徐汇支行为宏源恒利办理综合授信业务签署了相关担保合同，最高债权额均为人民币壹亿元整。2021 年 10 月 29 日，公司与中信银行股份有限公司上海分行为宏源恒利办理综合授信业务签署了相关担保合同，最高债权额为人民币壹亿元整。2021 年 11 月 11 日，公司与上海银行股份有限公司卢湾支行为宏源恒利办理综合授信业务签署了相关担保合同，最高债权额为人民币壹亿贰仟万元整。2021 年 12 月 17 日，公司与兴业银行股份有限公司上海虹口支行为宏源恒利办理综合授信业务签署了相关担保合同，最高债权额为人民币壹亿元整。截至报告期末，上述担保合同仍在有效期。

## 2. 公司子公司申万宏源证券担保事项

为满足业务发展需要，公司所属全资子公司申万宏源证券，同意其境外全资子公司申万宏源（国际）集团有限公司（以下简称“国际集团”）下设境外特殊目的机构（以下简称“SPV”）Shenwan Hongyuan International Finance Limited 作为发行主体，发行总金额不超过 8 亿美元（或等值外币）的债券，债券期限不超过 5 年（含 5 年），同意其为前述债券发行提供连带责任保证担保。

### （1）报告期内发生的担保事项

2022 年 3 月 16 日，申万宏源证券与中国建设银行（亚洲）股份有限公司就上述发行主体发行金额为 3 亿美元、期限为 3 年，票面利率为 2.625% 的境外债券事项签署了相关担保协议。

### （2）截至报告期末仍在有效期的担保事项

2021 年 7 月 14 日，申万宏源证券与中国建设银行（亚洲）股份有限公司就上述发行主体发行金额为 5 亿美元、期限为 5 年、票面利率为 1.800% 的境外债券事项签署了相关担保协议。

截至报告期末，公司及其控股子公司实际担保总额为人民币 579,007.74 万元，占公司归属于母公司净资产的 6.04%。逾期担保累计金额人民币 0 万元，涉及诉讼的担保金额为人民币 0 万元，因担保被判决败诉而应承担的损失金额为人民币 0 万元。

相关担保情况请详见公司于 2021 年 7 月 17 日、9 月 28 日、11 月 3 日、11 月 16 日、12 月 22 日、2022 年 3 月 9 日、3 月 19 日在《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》、巨潮资讯网 [www.cninfo.com.cn](http://www.cninfo.com.cn) 及于 2021 年 7 月 16 日、9 月 27 日、11 月 2 日、11 月 15 日、12 月 21 日、2022 年 3 月 8 日、3 月 18 日在香港联交所披露易 [www.hkexnews.hk](http://www.hkexnews.hk) 披露的相关公告。

### （三）委托理财

报告期内，公司无累计和当期委托理财事项。

### （四）日常经营重大合同

不适用

### （五）其他重大合同

根据《香港上市规则》第 14A 章对于关联交易的规定，2021 年 12 月 6 日，公司第五届董事会第五次会议审议同意《关于与中国建银投资有限责任公司续签证券与金融类产品、交易及服务框架协议的议案》并提交公司股东大会审议。2021 年 12 月 30 日，公司 2021 年第二次临时股东大会审议通过了相关议案。公司与中国建投续签了《证券与金融类产品、交易及服务框架协议》，期限为 2022 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，并设定 2022 至 2024 年度的证券及金融产品和交易以及证券及金融服务的各年度上限。相关续签框架协议事宜请详见公司于 2021 年 12 月 7 日、12 月 31 日刊登在《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》、巨潮资讯网 [www.cninfo.com.cn](http://www.cninfo.com.cn) 及于 2021 年 12 月 6 日、12 月 30 日在香港联交所披露易网站 [www.hkexnews.hk](http://www.hkexnews.hk) 刊登的公司公告。

### 十三、报告期内公司单项业务资格变化情况

报告期内，公司所属子公司申万宏源证券新增上海期货交易所铝期权做市业务资格、郑州商品交易所 PTA 期货做市业务资格、郑州商品交易所菜粕、棉花期权主做市商资格、郑州商品交易所白糖期权一般做市商资格、上海期货交易所商品互换业务自营结算商资格。公司所属子公司宏源期货新增上海期货交易所铝期权、石油沥青期货和郑州商品交易所 PTA 期货做市商业资格。

### 十四、报告期内监管部门对公司的行政许可决定

序号	日期	监管部门	文件名称	文号
1	2022 年 6 月 20 日	中国证监会	关于同意申万宏源证券有限公司向专业投资者公开发行永续次级公司债券注册的批复	证监许可（2022）1286 号

### 十五、报告期内，公司所属子公司申万宏源证券风险控制指标情况

报告期内，申万宏源证券以净资本和流动性为核心的主要风险控制指标均符合监管规定。

### 十六、报告期内，公司接待调研和采访的情况

报告期内，公司接待调研和采访情况如下：

接待时间	接待地点	接待方式	接待对象类型	接待对象	谈论的主要内容及提供
------	------	------	--------	------	------------

					的资料
2022 年 4 月 13 日	-	网络	个人、机构	参加公司 2021 年度业绩说明会的投资者	公司经营发展情况
2022 年 4 月 15 日	-	电话沟通	机构	长江证券分析师及国寿养老、德邦基金、长城证券、英大证券、中天证券、玖歌投资、混沌投资等机构投资者	公司经营发展情况
2022 年 6 月 24 日	-	网络	个人、机构	参加 2022 年新疆辖区上市公司投资者网上集体接待日活动的投资者	公司经营发展情况

注：公司接待上述投资者的投资者关系活动记录表已在深交所网站 [www.szse.cn](http://www.szse.cn) 及巨潮资讯网 [www.cninfo.com.cn](http://www.cninfo.com.cn) 披露。

## 十七、其他重要事项

### 实施 2021 年度利润分配方案

公司 2021 年度利润分配方案为：以公司截至 2021 年 12 月 31 日 A 股和 H 股总股本 25,039,944,560 股为基数，向股权登记日登记在册的 A 股和 H 股股东每 10 股派发现金股利人民币 1.00 元（含税）。

对于 A 股股东，公司以 2022 年 8 月 4 日为股权登记日，以 2022 年 8 月 5 日为除权除息日，于 2022 年 8 月 5 日实施完成公司 2021 年度利润分配方案。（相关情况请详见公司于 2022 年 8 月 1 日刊登在《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》以及巨潮资讯网 [www.cninfo.com.cn](http://www.cninfo.com.cn) 的《公司 2021 年度 A 股利润分配实施公告》）

对于 H 股股东，本公司向于 2022 年 6 月 30 日名列本公司股东名册的股东派发 2021 年度的现金股利，每 10 股派发现金股利人民币 1.00 元（含税）。2021 年现金股利于 2022 年 8 月 5 日派发，所派 2021 年现金股利以人民币计值和宣布，以港币向 H 股股东支付。港币实际发放金额按照 2022 年 6 月 10 日（年度股东大会召开日）前五个工作日中国人民银行公布的人民币兑换港币平均基准汇率（人民币 0.85103 元兑港币 1.00 元）计算，即每 10 股 H 股派发现金股利港币 1.17505 元（含税）。（相关情况请详见公司于 2022 年 6 月 10 日在香港联交所披露易 [www.hkexnews.hk](http://www.hkexnews.hk) 披露的《2021 年度股东大会之投票表决结果及派发现金股利》）

## 十八、报告期已披露重要信息索引

报告期内，公司依规履行信息披露义务，在《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》和巨潮资讯网 [www.cninfo.com.cn](http://www.cninfo.com.cn) 披露的 A 股信息如下（不含《H 股公告》）：

序号	公告事项	刊登日期
1	华泰联合证券有限责任公司关于申万宏源集团股份有限公司债券重大事项受托管理事务临时报告	2022-01-04
2	关于所属子公司涉及重大诉讼进展的公告	2022-01-04
3	财信证券股份有限公司关于申万宏源集团股份有限公司重大事项受托管理事务临时报告	2022-01-04
4	关于申万宏源证券有限公司 19 申证 01,20 申证 01 公司债券兑付兑息并摘牌的公告	2022-01-19
5	关于申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)发行结果的公告	2022-01-22
6	关于申万宏源证券有限公司 2022 年度第一期短期融资券发行结果的公告	2022-01-28
7	关于申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)在深圳证券交易所上市的公告	2022-01-28
8	关于申万宏源证券有限公司 17 申证 01 兑付兑息并摘牌及 22 申万宏源 CP002 发行结果的公告	2022-02-19
9	关于申万宏源证券有限公司 2020 年非公开发行公司债券(第二期)(品种一)兑付兑息并摘牌的公告	2022-02-23
10	关于申万宏源证券有限公司 2022 年向专业投资者公开发行公司债券(第二期)发行结果的公告	2022-02-24
11	申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)信用评级报告	2022-03-02
12	申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)募集说明书	2022-03-02
13	申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)募集说明书摘要	2022-03-02
14	申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)发行公告	2022-03-02
15	申万宏源集团股份有限公司关于公开发行公司债券更名的公告	2022-03-02
16	关于申万宏源证券有限公司 2022 年向专业投资者公开发行公司债券(第二期)在深圳证券交易所上市的公告	2022-03-03
17	申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)票面利率公告	2022-03-04
18	关于延长申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)簿记建档时间的公告	2022-03-04
19	申万宏源集团股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)(品种一)2022 年付息公告	2022-03-04
20	申万宏源集团股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)(品种二)2022 年付息公告	2022-03-04

序号	公告事项	刊登日期
21	关于延长申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)簿记建档时间的公告	2022-03-04
22	申万宏源集团股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券(第一期)2022 年兑付兑息及摘牌的公告	2022-03-05
23	申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)发行结果公告	2022-03-08
24	关于所属子公司涉及仲裁事项的公告	2022-03-09
25	财信证券股份有限公司关于申万宏源集团股份有限公司重大事项受托管理事务临时报告	2022-03-09
26	华泰联合证券有限责任公司关于申万宏源集团股份有限公司债券重大事项受托管理事务临时报告	2022-03-09
27	关于为全资子公司提供担保事项进展的公告	2022-03-09
28	申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)在深圳证券交易所上市的公告	2022-03-11
29	关于申万宏源证券有限公司拟发行债券事项的公告	2022-03-15
30	关于申万宏源证券有限公司 2019 年面向合格投资者公开发行公司债券(第二期)(品种一)兑付兑息及摘牌的公告	2022-03-15
31	财信证券股份有限公司关于申万宏源集团股份有限公司重大事项受托管理事务临时报告	2022-03-17
32	华泰联合证券有限责任公司关于申万宏源集团股份有限公司债券重大事项受托管理事务临时报告	2022-03-17
33	关于所属子公司涉及仲裁事项的公告	2022-03-17
34	关于申万宏源证券有限公司为境外子公司发行债券提供担保进展的公告	2022-03-19
35	关于所属子公司涉及诉讼事项的公告	2022-03-23
36	华泰联合证券有限责任公司关于申万宏源集团股份有限公司债券重大事项受托管理事务临时报告	2022-03-23
37	财信证券股份有限公司关于申万宏源集团股份有限公司重大事项受托管理事务临时报告	2022-03-23
38	关于申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)发行结果的公告	2022-03-26
39	关于申万宏源证券有限公司 2022 年度第三期短期融资券发行结果的公告	2022-03-30
40	2021 年社会责任报告	2022-03-31
41	年度关联方资金占用专项审计报告	2022-03-31
42	2021 年年度审计报告	2022-03-31
43	内部控制鉴证报告	2022-03-31
44	申万宏源集团股份有限公司 2021 年度董事会工作报告	2022-03-31
45	申万宏源集团股份有限公司 2021 年度监事会工作报告	2022-03-31
46	关于预计 2022 年度日常关联交易的公告	2022-03-31
47	独立董事对担保等事项的独立意见	2022-03-31

序号	公告事项	刊登日期
48	独立董事年度述职报告	2022-03-31
49	2021 年年度报告	2022-03-31
50	内部控制自我评价报告	2022-03-31
51	第五届董事会第七次会议决议公告	2022-03-31
52	第五届监事会第六次会议决议公告	2022-03-31
53	2021 年年度报告摘要	2022-03-31
54	关于申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)在深圳证券交易所上市的公告	2022-04-01
55	关于召开 2021 年度业绩说明会的公告	2022-04-02
56	申万宏源集团股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券(第二期)(品种一)2022 年兑付兑息及摘牌的公告	2022-04-09
57	申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)募集说明书	2022-04-20
58	申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)发行公告	2022-04-20
59	申万宏源集团股份有限公司关于公开发行公司债券更名的公告	2022-04-20
60	申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)募集说明书摘要	2022-04-20
61	申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)信用评级报告	2022-04-20
62	关于延长申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)簿记建档时间的公告	2022-04-22
63	关于延长申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)簿记建档时间的公告	2022-04-22
64	申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)票面利率公告	2022-04-25
65	申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)发行结果公告	2022-04-26
66	关于申万宏源证券有限公司 2022 年度第四期短期融资券发行结果的公告	2022-04-26
67	关于申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行次级债券(第一期)发行结果的公告	2022-04-29
68	关于申万宏源证券有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行短期公司债券(第二期)(品种一)兑付兑息并摘牌的公告	2022-04-29
69	独立董事独立意见	2022-04-30
70	2022 年一季度报告	2022-04-30
71	第五届董事会第八次会议决议公告	2022-04-30
72	关于续聘会计师事务所的公告	2022-04-30
73	申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)在深圳证券交易所上市的公告	2022-05-05

序号	公告事项	刊登日期
74	关于申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行次级债券(第一期)在深圳证券交易所上市的公告	2022-05-11
75	关于申万宏源证券有限公司 2019 年面向合格投资者公开发行公司债券(第三期)(品种一)兑付兑息及摘牌的公告	2022-05-11
76	财信证券股份有限公司关于申万宏源集团股份有限公司重大事项受托管理事务临时报告	2022-05-12
77	华泰联合证券有限责任公司关于申万宏源集团股份有限公司债券重大事项受托管理事务临时报告	2022-05-12
78	关于所属子公司涉及诉讼事项的公告	2022-05-12
79	申万宏源集团股份有限公司 2021 年度股东大会材料	2022-05-20
80	关于召开公司 2021 年度股东大会的通知	2022-05-20
81	关于申万宏源证券有限公司 2022 年向专业投资者公开发行公司债券(第四期)发行结果的公告	2022-05-25
82	申万宏源集团股份有限公司及其发行的 18 申宏 01 与 18 申宏 02 跟踪评级报告	2022-05-30
83	申万宏源集团股份有限公司公开发行债券 2022 年跟踪评级报告	2022-05-30
84	关于申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第四期)在深圳证券交易所上市的公告	2022-05-31
85	华泰联合证券有限责任公司关于申万宏源集团股份有限公司债券重大事项受托管理事务临时报告	2022-06-10
86	财信证券股份有限公司关于申万宏源集团股份有限公司重大事项受托管理事务临时报告	2022-06-10
87	关于所属子公司诉讼事项进展公告	2022-06-10
88	2021 年度股东大会会议决议公告	2022-06-11
89	关于申万宏源集团股份有限公司 2021 年度股东大会法律意见书	2022-06-11
90	财信证券股份有限公司关于申万宏源集团股份有限公司重大事项受托管理事务临时报告	2022-06-22
91	华泰联合证券有限责任公司关于申万宏源集团股份有限公司债券重大事项受托管理事务临时报告	2022-06-22
92	关于所属子公司涉及诉讼事项的公告	2022-06-22
93	关于参加 2022 年新疆辖区上市公司投资者网上集体接待日活动的公告	2022-06-22
94	申万宏源集团股份有限公司 2019 年非公开发行公司债券(第三期)受托管理事务报告(2021 年度)	2022-06-28
95	申万宏源集团股份有限公司 2018 年面向合格投资者公开发行公司债券(第一期)受托管理事务报告(2021 年度)	2022-06-28
96	申万宏源集团股份有限公司公司债券受托管理事务报告(2021 年度)	2022-06-28
97	关于申万宏源证券有限公司向专业投资者公开发行永续次级公司债券获得中国证监会注册批复的公告	2022-06-29

报告期内，公司在香港联交所披露易 [www.hkexnews.hk](http://www.hkexnews.hk) 披露的 H 股信息如下（不含海外监管公告）：

序号	公告事项	刊登日期
1	截至 2021 年 12 月 31 日止月份之股份发行人的证券变动月报表	2022-01-05
2	截至 2022 年 1 月 31 日止月份之股份发行人的证券变动月报表	2022-02-07
3	根据上市规则第 13.51B(2) 及 13.51(2) 条作出的公布	2022-02-14
4	截至 2022 年 2 月 28 日止月份之股份发行人的证券变动月报表	2022-03-02
5	董事会召开日期	2022-03-16
6	截至 2021 年 12 月 31 日止年度的末期股息	2022-03-30
7	2021 年度社会责任报告/环境、社会及管治报告	2022-03-30
8	截至 2021 年 12 月 31 日止年度之业绩公告	2022-03-31
9	截至 2022 年 3 月 31 日止月份之股份发行人的证券变动月报表	2022-04-01
10	2021 年度报告	2022-04-19
11	董事会召开日期	2022-04-19
12	2022 年第一季度报告	2022-04-29
13	截至 2022 年 4 月 30 日止月份之股份发行人的证券变动月报表	2022-05-05
14	截至 2021 年 12 月 31 日止年度的末期股息（更新）	2022-05-19
15	2021 年度股东大会通函	2022-05-19
16	2022 年 6 月 10 日举行的年度股东大会 H 股股东代表委任表格	2022-05-19
17	2021 年度股东大会通告	2022-05-19
18	截至 2022 年 5 月 31 日止月份之股份发行人的证券变动月报表	2022-06-01
19	截至 2021 年 12 月 31 日止年度的末期股息（更新）	2022-06-10
20	2021 年度股东大会之投票表决结果及派发现金股利	2022-06-10
21	2021 年度企业年度报告书	2022-06-16

## 十九、公司子公司重要事项

### （一）公司所属子公司申万宏源证券公司债券情况

#### 1. 公司债券基本信息

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额 (人民币 万元)	利率	还本付息方式	交易场所
申万宏源证券有限公司公开发行 2017 年公司债券（第一期）（品种二）	17 申证 02	136981	2017/2/17	2017/2/17	2024/2/17	50,000.00	4.50%	采用单利按年计息，不	上海证 券交易 所
申万宏源证券有限公司 2018 年面向合格投资者公开发行公司债券（第一期）（品种一）	18 申证 03	112812	2018/12/10	2018/12/10	2023/12/10	150,000.00	4.08%	计复利，每年付息一次，	深圳证 券交易 所
申万宏源证券有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种二）	20 申证 06	149173	2020/7/27	2020/7/27	2023/7/27	410,000.00	3.49%	到期一次还本，最后一	

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额 (人民币 万元)	利率	还本付息方式	交易场所
申万宏源证券有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期)(品种二)	20 申证 08	149230	2020/9/10	2020/9/10	2023/9/10	320,000.00	3.76%	期利息 随本金 的兑付 一起支 付	
申万宏源证券有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期)(品种二)	20 申证 10	149274	2020/10/26	2020/10/26	2023/10/26	570,000.00	3.68%		
申万宏源证券有限公司 2020 年面向专业投资者公开发行公司债券(第四期)(品种二)	20 申证 12	149299	2020/11/16	2020/11/16	2022/11/16	170,000.00	3.55%		
申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券(面向专业投资者)(第一期)(品种一)	21 申证 01	149425	2021/4/29	2021/4/29	2024/4/29	250,000.00	3.45%		
申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券(面向专业投资者)(第一期)(品种二)	21 申证 02	149431	2021/4/29	2021/4/29	2031/4/29	200,000.00	4.05%		
申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券(面向专业投资者)(第二期)	21 申证 03	149479	2021/5/24	2021/5/24	2026/5/24	260,000.00	3.63%		
申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券(面向专业投资者)(第三期)(品种一)	21 申证 04	149490	2021/5/28	2021/5/28	2024/5/28	200,000.00	3.27%		
申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券(面向专业投资者)(第三期)(品种二)	21 申证 05	149491	2021/5/28	2021/5/28	2031/5/28	250,000.00	4.00%		
申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券(面向专业投资者)(第四期)(品种一)	21 申证 06	149559	2021/7/21	2021/7/21	2024/7/21	200,000.00	3.13%		
申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券(面向专业投资者)(第四期)(品种二)	21 申证 07	149560	2021/7/21	2021/7/21	2031/7/21	300,000.00	3.77%		
申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券(面向专业投资者)(第五期)(品种一)	21 申证 08	149574	2021/7/28	2021/7/28	2024/7/28	280,000.00	3.04%		
申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券(面向专业投资者)(第五期)(品种二)	21 申证 09	149575	2021/7/28	2021/7/28	2026/7/28	420,000.00	3.38%		
申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行公司债券(面向专业投资者)(第六期)(品种一)	21 申证 10	149614	2021/8/26	2021/8/26	2024/8/26	300,000.00	3.02%		
申万宏源证券有限公司 2021 年公	21 申证 11	149615	2021/8/26	2021/8/26	2031/8/26	300,000.00	3.75%		

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额 (人民币 万元)	利率	还本付息方式	交易场所
开发行公司债券（面向专业投资者）（第六期）（品种二）									
申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行人公司债券（面向专业投资者）（第七期）（品种一）	21 申证 12	149626	2021/9/9	2021/9/9	2024/9/9	480,000.00	3.05%		
申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行人公司债券（面向专业投资者）（第七期）（品种二）	21 申证 13	149627	2021/9/9	2021/9/9	2026/9/9	100,000.00	3.40%		
申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行人公司债券（面向专业投资者）（第八期）（品种一）	21 申证 14	149595	2021/9/22	2021/9/22	2023/9/22	230,000.00	2.95%		
申万宏源证券有限公司 2021 年公开发行人公司债券（面向专业投资者）（第八期）（品种二）	21 申证 15	149640	2021/9/22	2021/9/22	2024/9/22	230,000.00	3.10%		
申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行人公司债券（第一期）（品种一）	22 申证 01	149789	2022/1/21	2022/1/21	2025/1/21	500,000.00	2.80%		
申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行人公司债券（第一期）（品种二）	22 申证 02	149790	2022/1/21	2022/1/21	2032/1/21	240,000.00	3.60%		
申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行人公司债券（第二期）（品种一）	22 申证 03	149809	2022/2/23	2022/2/23	2025/2/23	220,000.00	2.95%		
申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行人公司债券（第三期）（品种一）	22 申证 05	149852	2022/3/24	2022/3/24	2025/3/24	350,000.00	3.18%		
申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行人公司债券（第三期）（品种二）	22 申证 06	149853	2022/3/24	2022/3/24	2027/3/24	210,000.00	3.53%		
申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行人公司债券（第四期）（品种一）	22 申证 07	112904	2022/5/23	2022/5/23	2025/5/23	180,000.00	2.78%		
申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行人公司债券（第四期）（品种二）	22 申证 08	149252	2022/5/23	2022/5/23	2027/5/23	220,000.00	3.20%		
申万宏源证券有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行人短期公司债券（第二期）（品种二）	21 申证D3 <sup>註</sup>	149681	2021/10/27	2021/10/27	2022/7/27	280,000.00	2.78%	采用单利计息，不计复利。到期	
申万宏源证券有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行人短期公司	21 申证D4 <sup>註</sup>	149735	2021/12/8	2021/12/8	2022/8/8	330,000.00	2.64%	一次	

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额 (人民币 万元)	利率	还本付息方式	交易场所
债券（第三期）（品种一）								还本付息，利息随本金的兑付一起支付	
申万宏源证券有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行短期公司债券（第三期）（品种二）	21 申证 D5	149736	2021/12/8	2021/12/8	2022/12/8	470,000.00	2.68%	还本付息，利息随本金的兑付一起支付	
申万宏源证券有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行次级债券（第一期）	21 申证 C1	149360	2021/1/21	2021/1/21	2024/1/21	300,000.00	3.93%	采用单利按年计息，不计复利。	
申万宏源证券有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行次级债券（第二期）	21 申证 C2	149405	2021/3/11	2021/3/11	2024/3/11	380,000.00	3.94%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	
申万宏源证券有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行次级债券（第三期）（品种一）	21 申证 C3	149761	2021/12/27	2021/12/27	2023/12/27	180,000.00	3.08%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	
申万宏源证券有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行次级债券（第三期）（品种二）	21 申证 C4	149762	2021/12/27	2021/12/27	2024/12/27	120,000.00	3.20%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	
申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行次级债券（第一期）	22 申证 C1	149904	2022/4/27	2022/4/27	2025/4/27	300,000.00	3.19%	每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付	
申万宏源证券有限公司公开发行 2021 年永续次级债券（第一期）	21 申证 Y1	149529	2021/6/24	2021/6/24	于本期债券第 5 个和其后每个付息日，发行人有权按面值加应付利息（包括所有递延支付的利息及其孳息）赎回本期债券	200,000.00	4.10%	采用单利按年计息，在发行人不行使递延支付利息权的情况下，每年付息一次	
申万宏源证券有限公司公开发行 2021 年永续次级债券（第二期）	21 申证 Y2	149605	2021/8/19	2021/8/19	于本期债券第 5 个和其后每个付息日，发行人有权按面值加应付利息	330,000.00	3.70%	采用单利按年计息，在发行人不行使递延支付利息权的情况下，每年付息一次	

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额 (人民币 万元)	利率	还本付息方式	交易场所
					(包括所有递延支付的利息及其孳息) 赎回本期债券				
申万宏源证券有限公司公开发行 2021 年永续次级债券 (第三期)	21 申证 Y3	149700	2021/11/15	2021/11/15	于本期债券第 5 个和其后每个付息日, 发行人有权按面值加应付利息 (包括所有递延支付的利息及其孳息) 赎回本期债券	470,000.00	3.88%		
申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行永续次级债券 (第一期)	22 申证 Y1	148005	2022/7/27	2022/7/27	以每 5 个计息年度为 1 个重定价周期。在每个重定价周期末, 公司有权选择将本期债券期限延长 1 个重定价周期 (即延续 5 年), 或全额兑付本期债券	500,000.00	3.45%		
申万宏源证券有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行永续次级债券 (第二期)	22 申证 Y2	148040	2022/8/25	2022/8/25	以每 5 个计息年度为 1 个重定价周期。在每个重定价周期末, 公司有权选择将本期债券期限延长 1 个重定价周期 (即延续 5	480,000.00	3.28%		

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额 (人民币 万元)	利率	还本付息方式	交易场所
					年), 或全额 兑付本期债 券				
申万宏源证券有限公司 2020 年非 公开发行公司债券 (第一期) (品 种二)	20 申证 02	114653	2020/1/16	2020/1/16	2023/1/16	200,000.00	3.55%	采用单 利按年 计息, 不 计复利, 每年付 息一次, 到期一 次还本, 最后一 期利息 随本金 的兑付 一起支 付	
申万宏源证券有限公司 2020 年非 公开发行公司债券 (第二期) (品 种二)	20 申证 04	114666	2020/2/21	2020/2/21	2023/2/21	300,000.00	3.20%	采用单 利按年 计息, 不 计复利。 每年付 息一次, 到期一 次还本, 最后一 期利息 随本金 的兑付 一起支 付	
申万宏源证券有限公司 2020 年证 券公司次级债券 (第一期) (品种 二)	20 申证 C2	115112	2020/4/23	2020/4/23	2023/4/23	600,000.00	3.18%	采用单 利按年 计息, 不 计复利。 每年付 息一次, 到期一 次还本, 最后一 期利息 随本金 的兑付 一起支 付	
申万宏源证券有限公司 2020 年证 券公司次级债券 (第二期)	20 申证 C3	115114	2020/5/25	2020/5/25	2023/5/25	600,000.00	3.25%	采用单 利按年 计息, 不 计复利。 每年付 息一次, 到期一 次还本, 最后一 期利息 随本金 的兑付 一起支 付	
<b>投资者适当性安排</b>	17 申证 02、18 申证 03、20 申证 06、20 申证 08、20 申证 10、20 申证 12、21 申证 01、21 申证 02、21 申证 03、21 申证 04、21 申证 05、21 申证 06、21 申证 07、21 申证 08、21 申证 09、21 申证 10、21 申证 11、21 申证 12、21 申证 13、21 申证 14、21 申证 15、21 申证 D3、21 申证 D4、21 申证 D5、22 申证 01、22 申证 02、22 申证 03、22 申证 05、22 申证 06、22 申证 07、22 申证 08 面向专业投资者交易。 20 申证 02、20 申证 04、20 申证 C2、20 申证 C3、21 申证 C1、21 申证 C2、21 申证 C3、21 申证 C4、22 申证 C1、21 申证 Y1、21 申证 Y2、21 申证 Y3、22 申证 Y1、22 申证 Y2 面向专业机构投资者交易。								
<b>适用的交易机制</b>	17 申证 02、18 申证 03、20 申证 06、20 申证 08、20 申证 10、20 申证 12、21 申证 01、21 申证 02、21 申证 03、21 申证 04、21 申证 05、21 申证 06、21 申证 07、21 申证 08、								

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额 (人民币 万元)	利率	还本付息方式	交易场所
		21 申证 09、21 申证 10、21 申证 11、21 申证 12、21 申证 13、21 申证 14、21 申证 15、21 申证 C1、21 申证 C2、21 申证 C3、21 申证 C4、22 申证 C1、21 申证 Y1、21 申证 Y2、21 申证 Y3、21 申证 D3、21 申证 D4、21 申证 D5、22 申证 01、22 申证 02、22 申证 03、22 申证 05、22 申证 06、22 申证 07、22 申证 08、22 申证 Y1、22 申证 Y2 采用匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交五种交易方式。 20 申证 02、20 申证 04、20 申证 C2、20 申证 C3 采用点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交四种交易方式。							
是否存在终止上市交易的风险（如有）和应对措施		不适用							

注：21 申证 D3、21 申证 D4 已分别于 2022 年 7 月 27 日，8 月 8 日完成本息兑付并摘牌。

报告期内，发行人发行的公司债券不存在逾期未偿还情况。

#### 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

报告期内，申万宏源证券未触发发行人或投资者选择权条款、投资者保护条款。

#### 3. 报告期内信用评级结果调整情况

报告期内，信用评级结果不存在调整情况。

#### 4. 公司债券担保情况、增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施

申万宏源证券发行公司债券不存在担保情况。报告期内，申万宏源证券已发债券无增信安排，偿债计划及其他偿债保障措施与募集说明书的相关承诺一致，没有重大变化。申万宏源证券能够按照相关约定执行偿债计划及偿债保障措施，切实保障债券持有人的利益。申万宏源证券为已发债券设置了专项账户，报告期内专项账户资金的提取情况与募集说明书的相关承诺一致。

#### 5. 其他债券事项

报告期内，申万宏源证券不存在企业债券、非金融企业债券融资工具、可转换公司债券。

报告期内，申万宏源证券不存在合并报表范围亏损超过上年末净资产 10% 情况。

## （二）相关监管措施情况

2022 年 4 月，申万宏源证券被上海证监局责令增加合规检查次数，同时相关责任人分别被上海证监局采取监管谈话、出具警示函

2022 年 4 月 24 日，中国证监会上海监管局向申万宏源证券出具《关于对申万宏源证券有限公司采取责令增加合规检查次数措施的决定》，主要内容为：申万宏源证券与蚂蚁财富（上海）金融信息服务有限公司（以下简称“蚂蚁财富”）合作开展线上投资顾问业务时，未独立开展适当性管理，未全面了解投资者情况，未获取客户的住址、职业、财务状况、投资经验、诚信记录等信息，相关信息系统运行不处于申万宏源证券自身控制范围，未能本地保存客户信息、适当性管理以及相关服务记录等资料。相关人员对上述问题负有领导或直接责任。

针对上述问题，申万宏源证券已终止与所有存量客户的线上投资顾问服务协议，联系蚂蚁财富获取并保存所有存量客户的相关数据，终止与蚂蚁财富的线上投资顾问业务合作，并积极配合蚂蚁财富做好合作终止的善后工作。

## 第七节 股份变动及股东情况

### 一、股份变动情况

#### (一) 股份变动情况表

单位:股

	本次变动前		本次变动增减(+,-)					本次变动后	
	数量	比例	发行新股	送股	公积金转股	其他	小计	数量	比例
一、有限售条件股份	437,244	0.0017%	0	0	0	0	0	437,244	0.0017%
1.国家持股	0	0.0000%	0	0	0	0	0	0	0.0000%
2.国有法人持股	0	0.0000%	0	0	0	0	0	0	0.0000%
3.其他内资持股	437,244	0.0017%	0	0	0	0	0	437,244	0.0017%
其中:境内法人持股	0	0.0000%	0	0	0	0	0	0	0.0000%
境内自然人持股	437,244	0.0017%	0	0	0	0	0	437,244	0.0017%
4.外资持股	0	0.0000%	0	0	0	0	0	0	0.0000%
其中:境外法人持股	0	0.0000%	0	0	0	0	0	0	0.0000%
境外自然人持股	0	0.0000%	0	0	0	0	0	0	0.0000%
二、无限售条件股份	25,039,507,316	99.9983%	0	0	0	0	0	25,039,507,316	99.9983%
1.人民币普通股	22,535,507,316	89.9983%	0	0	0	0	0	22,535,507,316	89.9983%
2.境内上市的外资股	0	0.0000%	0	0	0	0	0	0	0.0000%
3.境外上市的外资股	2,504,000,000	10.0000%	0	0	0	0	0	2,504,000,000	10.0000%
4、其他	0	0.0000%	0	0	0	0	0	0	0.0000%
三、股份总数	25,039,944,560	100.0000%	0	0	0	0	0	25,039,944,560	100.0000%

#### (二) 限售股份变动情况

报告期内, 公司限售股份无变动。

### 二、证券发行与上市情况

报告期内, 公司无股票类、可转换公司债券、分离交易的可转换公司债券及其他衍生证券等证券发行与上市情况。

公司发行公司债券情况请见本报告“第八节债券相关情况”; 本公司所属子公司发行债券事项请见本报告“第六节重要事项”之“十九 公司子公司重要事项”。

### 三、公司股东数量和持股情况

## (一) 截至 2022 年 6 月 30 日股东数量和持股情况

单位：股

报告期末普通股股东总数	303,917 位（其中 A 股股东 303,852 位、H 股股东 65 位）		报告期末表决权恢复的优先股股东总数（如有）	无				
<b>前 10 名普通股股东持股情况</b>								
股东名称	股东性质	持股比例 (%)	报告期末持有的普通股数量	报告期内增减变动情况	持有有限售条件的普通股数量	持有无限售条件的普通股数量	质押或冻结情况	
							股份状态	数量
中国建银投资有限责任公司	国有法人	26.34	6,596,306,947	0	0	6,596,306,947	-	0
中央汇金投资有限责任公司	国家股	20.05	5,020,606,527	0	0	5,020,606,527	-	0
香港中央结算（代理人）有限公司	境外法人	10.00	2,503,795,370	-4,800	0	2,503,795,370	不适用	不适用
上海久事（集团）有限公司	国有法人	4.82	1,206,983,489	-5,826,900	0	1,206,983,489	-	0
四川发展（控股）有限责任公司	国有法人	4.49	1,124,543,633	52,500,000	0	1,124,543,633	-	0
中国光大集团股份公司	国有法人	3.99	999,000,000	0	0	999,000,000	质押	67,500,000
中国证券金融股份有限公司	境内一般法人	2.54	635,215,426	0	0	635,215,426	-	0
新疆金融投资有限公司	国有法人	1.84	460,642,216	0	0	460,642,216	质押	217,000,000
香港中央结算有限公司	境外法人	1.38	345,349,927	-1,966,963	0	345,349,927	-	0
中央汇金资产管理有限责任公司	国有法人	0.79	197,390,385	0	0	197,390,385	-	0
战略投资者或一般法人因配售新股成为前 10 名普通股股东的情况				无				
上述股东关联关系或一致行动的说明		中央汇金有限责任公司持有中国建银投资有限责任公司 100% 股权，持有中央汇金资产管理有限责任公司 100% 股权，持有中国光大集团股份公司 63.16% 股权。						
上述股东涉及委托/受托表决权、放弃表决权情况的说明		无						
前 10 名股东中存在回购专户的特别说明		无						
<b>前 10 名无限售条件普通股股东持股情况</b>								
股东名称	报告期末持有无限售条件普通股股份数量		股份种类					
	股份种类	数量	股份种类	数量				
中国建银投资有限责任公司	人民币普通股	6,596,306,947	人民币普通股	6,596,306,947				

中央汇金投资有限责任公司	5,020,606,527	人民币普通股	5,020,606,527
香港中央结算（代理人）有限公司	2,503,795,370	境外上市外资股	2,503,795,370
上海久事（集团）有限公司	1,206,983,489	人民币普通股	1,206,983,489
四川发展（控股）有限责任公司	1,124,543,633	人民币普通股	1,124,543,633
中国光大集团股份公司	999,000,000	人民币普通股	999,000,000
中国证券金融股份有限公司	635,215,426	人民币普通股	635,215,426
新疆金融投资有限公司	460,642,216	人民币普通股	460,642,216
香港中央结算有限公司	345,349,927	人民币普通股	345,349,927
中央汇金资产管理有限责任公司	197,390,385	人民币普通股	197,390,385
前 10 名无限售条件普通股股东之间，以及前 10 名无限售条件普通股股东和前 10 名普通股股东之间关联关系或一致行动的说明	中央汇金有限责任公司持有中国建银投资有限责任公司 100% 股权，持有中央汇金资产管理有限责任公司 100% 股权，持有中国光大集团股份公司 63.16% 股权。		
前 10 名普通股股东参与融资融券业务股东情况说明	因参与转融通业务，公司股东上海久事（集团）有限公司报告期末持股数量较 2021 年 12 月末减少 5,826,900 股。因参与转融通业务合约到期归还等原因，公司股东四川发展（控股）有限责任公司报告期末持股数量较 2021 年 12 月末增加 52,500,000 股。		

注：1. 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；

2. 上表中，香港中央结算（代理人）有限公司所持股份种类为境外上市外资股（H股），其他股东所持股份种类均为人民币普通股（A股）。

#### 四、董事、监事和高级管理人员持股变动

不适用。

#### 五、截至报告期末公司控股股东和实际控制人变更

截至报告期末，公司控股股东和实际控制人未发生变更。

#### 六、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，概无本公司董事、监事或最高行政人员于本公司或其任何相联法团（按《证券及期货条例》第XV部之涵义）的股份、相关股份及债权证中拥有或视为拥有根据《证券及期货条例》第XV部第7及第8分部须知会本公司及香港联交所的权益或淡仓，或根据《证券及期货条例》第352条记录于本公司须予备存的登记的权益或淡仓；或根据《标准守则》须知会本公司及香港联交所的权益或淡仓。

#### 七、主要股东于本公司股份及相关股份中拥有的权益及淡仓

于2022年6月30日，据本公司合理查询所知，以下人士（并非本公司董事、监事

或最高行政人员)于本公司股份或相关股份中,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的权益或淡仓,或根据《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:

单位:股

	主要股东名称	股份类别	权益性质	持有的股份数目(股) <sup>注3</sup>	占本公司已发行股份总数的比例% <sup>注4</sup>	占本公司已发行A股/H股总数的比例%	好仓淡仓
1	中央汇金投资有限责任公司 <sup>注1</sup>	A股	实益拥有人	5,020,606,527	20.05	22.28	好仓
		A股	受控法团权益	7,792,697,332	31.12	34.58	好仓
		H股	受控法团权益	756,472,000	3.02	30.21	好仓
		H股	受控法团权益	64,193,600	0.26	2.56	淡仓
2	中国建银投资有限责任公司	A股	实益拥有人	6,596,306,947	26.34	29.27	好仓
3	中国工商银行股份有限公司	H股	实益拥有人	648,404,800	2.59	25.89	好仓
4	光大保德信基金管理有限公司(代表光大保德信-华夏人寿1号单一资产管理计划)	H股	受托人	216,134,400	0.86	8.63	好仓
5	华夏人寿保险股份有限公司 <sup>注2</sup>	H股	实益拥有人	216,134,000	0.86	8.63	好仓
6	中国人寿保险(集团)公司	H股	实益拥有人	172,907,200	0.69	6.91	好仓

注1:中央汇金持有中国建投100%的股份,持有中央汇金资产管理有限责任公司100%的股份,持有中国光大集团股份公司63.16%的股份,中国建投、中央汇金资产管理有限责任公司和中国光大集团股份公司合计持有本公司7,792,697,332股A股股票。中央汇金透过其受控法团中国工商银行股份有限公司、中国再保险(集团)公司间接持有本公司756,472,000股H股股票,其中通过中国工商银行股份有限公司持股648,404,800股,通过中国再保险(集团)股份有限公司持股108,067,200股。

注2:华夏人寿保险股份有限公司已委聘经中国相关监管机构批准的合格境内机构投资者光大保德信基金管理有限公司为资产管理人,以光大保德信—华夏人寿1号单一资产管理计划名义代表华夏人寿股份有限公司认购持有本公司的H股。

注3:根据《证券及期货条例》第XV部,倘若若干条件达成,则本公司股东须呈交披露权益表格。倘该等股东未根据《证券及期货条例》呈交披露权益表格,则彼等截至报告期末于本公司之实际持股量可能与呈交予联交所的持股量不同。倘股东于本公司的持股量变更,除非若干条件已达成,否则股东毋须知会本公司及香港联交所,故主要股东截至报告期末于本公司之实际持股量可能与呈交予香港联交所的持股量不同。

注4:于2022年6月30日,本公司全部已发行A股股份数为22,535,944,560股,H股股份数为2,504,000,000股,合计为25,039,944,560股。

除上述披露者外,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 XV 部第 2 及第 3 分部须向本公司披露的权益或淡仓,或根据《证券及期货条例》第 336 条记录于本公司须存置的登记册内的权益或淡仓。

#### **八、足够的公众持股数量**

根据本公司可公开获得的资料,及本公司董事所知,于本报告期内直至本报告日期,公众人士持有本公司已发行股份不少于 10%,符合本公司上市时获得的公众持有量豁免函的规定,详情请参考本公司于 2019 年 4 月 12 日刊发的 H 股招股说明书及于 2019 年 5 月 20 日发布的有关稳定价格行动、稳定价格期结束及超额配股权失效的公告。

#### **九、购回、出售或赎回本公司的上市证券**

报告期内,本公司或附属公司未发生购回、出售或赎回本公司上市证券情况。

## 第八节 债券相关情况

### 一、公司债券

#### (一) 公司债券基本信息

##### 1.2018年公开发行公司债券

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额 (人民币万元)	利率	还本付息方式	交易场所
申万宏源集团股份有限公司2018年面向合格投资者公开发行公司债券(第一期)(品种一)	18申宏01	112728	2018-07-13	2018-07-17	2023-07-17	3,250	2018.07.17-2021.07.16: 4.40%; 2021.07.17-2023.07.16: 3.20%	按年计息、到期一次还本付息。每年付息一次,最后一期随本付息。	深交所 圳券易
申万宏源集团股份有限公司2018年面向合格投资者公开发行公司债券(第一期)(品种二)	18申宏02	112729	2018-07-13	2018-07-17	2023-07-17	650,000	4.80%	按年计息、到期一次还本付息。每年付息一次,最后一期随本付息。	深交所 圳券易
投资者适当性安排(如有)	发行对象为持有中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司A股证券账户且符合《公司债券发行与交易管理办法》及相关法律法规规定的合格投资者(法律、法规禁止购买者除外)。投资者不得非法利用他人账户或资金账户进行认购,也不得违规融资或替代违规融资认购。投资者认购本期债券应遵守相关法律法规和中国证券监督管理委员会的有关规定,并自行承担相应的法律责任。								
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交								
是否存在终止上市交易的风险(如有)和应对措施	无								

##### 2.2019年非公开发行公司债券

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额 (人民币)	利率 (%)	还本付息方式	交易场所
------	------	------	-----	-----	-----	---------------	-----------	--------	------

						万元)			
申万宏源集团股份有限公司2019年非公开发行公司债券(第一期)	19申宏01	114443	2019-03-06	2019-03-08	2022-03-08	100,000	4.18	按年计息、到期一次还本。利息每年支付一次,最后一期利息随本金一起支付。	深圳证券交易所
申万宏源集团股份有限公司2019年非公开发行公司债券(第二期)(品种一)	19申宏02	114461	2019-04-09	2019-04-12	2022-04-12	320,000	4.27		深圳证券交易所
申万宏源集团股份有限公司2019年非公开发行公司债券(第三期)	19申宏04	114590	2019-10-23	2019-10-25	2024-10-25	580,000	3.94		深圳证券交易所
投资者适当性安排(如有)			发行对象为持有中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司A股证券账户且符合《公司债券发行与交易管理办法》及相关法律法规规定的合格投资者(法律、法规禁止购买者除外)。投资者不得非法利用他人账户或资金账户进行认购,也不得违规融资或替代违规融资认购。投资者认购本期债券应遵守相关法律法规和中国证券监督管理委员会的有关规定,并自行承担相应的法律责任。						
适用的交易机制			点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交						
是否存在终止上市交易的风险(如有)和应对措施			无						

注:申万宏源集团股份有限公司2019年非公开发行公司债券(第一期)、申万宏源集团股份有限公司2019年非公开发行公司债券(第二期)(品种一)已分别于2022年3月8日、2022年4月12日完成兑付并摘牌。

### 3.2021年公开发行公司债券

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额(人民币万元)	利率(%)	还本付息方式	交易场所
申万宏源集团股份有限公司2021年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期)(品种一)	21申宏01	149393	2021-03-04	2021-03-08	2026-03-08	150,000	3.68	按年计息、到期一次还本。利息每年支付一次,最后一	深圳证券交易所

申万宏源集团股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第一期）（品种二）	21 申宏 02	149394	2021-03-04	2021-03-08	2028-03-08	50,000	3.95	期利息随本金一起支付。	深圳证券交易所
申万宏源集团股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第二期）（品种二）	21 申宏 04	149553	2021-07-13	2021-07-15	2028-07-15	300,000	3.65		深圳证券交易所
申万宏源集团股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）（品种一）	21 申宏 05	149578	2021-08-02	2021-08-04	2024-08-04	50,000	2.99		深圳证券交易所
申万宏源集团股份有限公司 2021 年面向专业投资者公开发行公司债券（第三期）（品种二）	21 申宏 06	149579	2021-08-02	2021-08-04	2026-08-04	250,000	3.38		深圳证券交易所
投资者适当性安排（如有）	发行对象为持有中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司 A 股证券账户且符合《公司债券发行与交易管理办法》及相关法律法规规定的专业投资者（法律、法规禁止购买者除外）。投资者不得非法利用他人账户或资金账户进行认购，也不得违规融资或替代违规融资认购。投资者认购本期债券应遵守相关法律法规和中国证券监督管理委员会的有关规定，并自行承担相应的法律责任。								
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交								
是否存在终止上市交易的风险（如有）和应对措施	无								

#### 4.2022 年公开发行公司债券

债券名称	债券简称	债券代码	发行日	起息日	到期日	债券余额 (人民币 万元)	利率 (%)	还本付息 方式	交易 场所
申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期) (品种一)	22 申宏 01	149825	2022-03-04	2022-03-08	2025-03-08	180,000	3.11	按 年 计 息、到 期 一 次 还 本。利 息 每 年 支 付 一 次，最 后 一 期 利 息 随 本 金 一 起 支 付。	深圳证 券交易 所
申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第一期) (品种二)	22 申宏 02	149826	2022-03-04	2022-03-08	2027-03-08	120,000	3.50		深圳证 券交易 所
申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期) (品种一)	22 申宏 03	149898	2022-04-22	2022-04-26	2025-04-26	300,000	3.06		深圳证 券交易 所
申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第二期) (品种二)	22 申宏 04	149899	2022-04-22	2022-04-26	2027-04-26	100,000	3.45		深圳证 券交易 所
申万宏源集团股份有限公司 2022 年面向专业投资者公开发行公司债券(第三期) (品种二)	22 申宏 06	148054	2022-08-26	2022-08-30	2032-08-30	255,000	3.56		深圳证 券交易 所
投资者适当性安排(如有)	发行对象为持有中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司 A 股证券账								

	户且符合《公司债券发行与交易管理办法》及相关法律法规规定的专业投资者（法律、法规禁止购买者除外）。投资者不得非法利用他人账户或资金账户进行认购，也不得违规融资或替代违规融资认购。投资者认购本期债券应遵守相关法律法规和中国证券监督管理委员会的有关规定，并自行承担相应的法律责任。
适用的交易机制	匹配成交、点击成交、询价成交、竞买成交、协商成交
是否存在终止上市交易的风险（如有）和应对措施	无

报告期内，公司债券不存在逾期未偿还情况。

## （二）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

### 1. 发行人或投资者选择权条款情况

报告期内，公司债券未发生发行人或投资者选择权条款触发情况

### 2. 投资者保护条款的触发和执行情况

报告期内，公司债券未发生投资者保护条款的触发情况。

## （三）公司债券信用评级调整情况

报告期内，上海新世纪资信评估投资服务有限公司继续对公司公开发行的公司债券（“18 申宏 01”、“18 申宏 02”）资信情况进行跟踪评级，联合资信评估股份有限公司对公司债券（“21 申宏 01”、“21 申宏 02”、“21 申宏 04”、“21 申宏 05”、“21 申宏 06”、“22 申宏 01”、“22 申宏 02”）进行跟踪评级，相关信用评级级别、评级展望、信用评级结果未发生变化，评级机构维持公司主体信用等级为 AAA，维持“18 申宏 01”、“18 申宏 02”、“21 申宏 01”、“21 申宏 02”、“21 申宏 04”、“21 申宏 05”、“21 申宏 06”、“22 申宏 01”、“22 申宏 02” 债券信用等级为 AAA，评级展望维持稳定。（详见 2022 年 5 月 30 日在巨潮资讯网 <http://www.cninfo.com.cn> 及于 2022 年 5 月 30 日在香港联交所披露易 [www.hkexnews.hk](http://www.hkexnews.hk) 披露的公司公告）

## （四）担保情况、债券偿债计划及其他偿债保障措施在报告期内的执行情况和变化情况及对债券投资者权益的影响

### 1. 2018 年公开发行公司债券

为了充分、有效地维护债券持有人的利益，本公司为 2018 年公司债券的按时、

足额偿付做出了一系列安排，包括确定专门部门与人员、安排偿债资金、制定并严格执行资金管理计划、做好组织协调、严格履行信息披露义务等，形成一套确保债券安全付息、兑付的保障措施。公司偿债保障措施包括：制定《债券持有人会议规则》；设立专门的偿付工作小组；制定并严格执行资金管理计划；聘请债券受托管理人；严格的信息披露。报告期上述公司债券的增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施未发生变更。

公司从专项偿债账户中按时兑付“18 申宏 01”和“18 申宏 02”各期应付利息，2022 年 7 月，公司从专项偿债账户中按时兑付了“18 申宏 01”和“18 申宏 02”在 2021 年 7 月 17 日至 2022 年 7 月 16 日期间的应付利息。

### 2.2019 年非公开发行公司债券

为了充分、有效地维护债券持有人的利益，本公司为 2019 年公司债券的按时、足额偿付做出了一系列安排，包括确定专门部门与人员、安排偿债资金、制定并严格执行资金管理计划、做好组织协调、严格履行信息披露义务等，形成一套确保债券安全付息、兑付的保障措施。公司偿债保障措施包括：制定《债券持有人会议规则》；设立专门的偿付工作小组；制定并严格执行资金管理计划；聘请债券受托管理人；严格的信息披露。报告期上述公司债券的增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施未发生变更。

公司设置了专项偿债账户，公司从专项偿债账户中按时兑付“19 申宏 01”、“19 申宏 02”和“19 申宏 04”各期应付利息和本金，2022 年 3 月，公司从专项偿债账户中按时兑付“19 申宏 01”在 2021 年 3 月 8 日至 2022 年 3 月 7 日期间的应付利息以及全部本金。2022 年 4 月，公司从专项偿债账户按时兑付“19 申宏 02”在 2021 年 4 月 12 至 2022 年 4 月 11 日期间的利息以及全部本金。

### 3.2021 年公开发行公司债券

为了充分、有效地维护债券持有人的利益，本公司为 2021 年公司债券的按时、足额偿付做出了一系列安排，包括确定专门部门与人员、安排偿债资金、制定并严格执行资金管理计划、做好组织协调、严格履行信息披露义务等，形成一套确保债券安全付息、兑付的保障措施。公司偿债保障措施包括：制定《债券持有人会议规则》；设立专门的偿付工作小组；制定并严格执行资金管理计划；聘请债券受托管理人；严格的信息披露。报告期上述公司债券的增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施未发生变更。

公司设置了专项偿债账户，公司从专项偿债账户中按时兑付“21 申宏 01”、“21 申宏 02”、“21 申宏 04”、“21 申宏 05”和“21 申宏 06”各期应付利息和本金，2022 年 3 月，公司从专项偿债账户中按时兑付“21 申宏 01”和“21 申宏 02”在 2021 年 3 月 8 日至 2022 年 3 月 7 日期间的应付利息。2022 年 7 月，公司从专项偿债账户中按时兑付“21 申宏 04”在 2021 年 7 月 15 日至 2022 年 7 月 14 日期间的应付利息。2022 年 8 月，公司从专项偿债账户中按时兑付“21 申宏 05”和“21 申宏 06”在 2021 年 8 月 4 日至 2022 年 8 月 3 日期间的应付利息。

#### 4.2022年公开发行公司债券

为了充分、有效地维护债券持有人的利益，本公司为2022年公司债券的按时、足额偿付做出了一系列安排，包括确定专门部门与人员、安排偿债资金、制定并严格执行资金管理计划、做好组织协调、严格履行信息披露义务等，形成一套确保债券安全付息、兑付的保障措施。公司偿债保障措施包括：制定《债券持有人会议规则》；设立专门的偿付工作小组；制定并严格执行资金管理计划；聘请债券受托管理人；严格的信息披露。报告期内，上述公司债券的增信机制、偿债计划及其他偿债保障措施未发生变更。

公司发行公司债券不存在担保情况。

## 二、其他债券事项

报告期内，公司不存在企业债券、非金融企业债券融资工具、可转换公司债券。报告期内，公司不存在合并报表范围亏损超过上年末净资产10%情况。

本公司所属子公司申万宏源证券发行债券事项请见本报告“第六节重要事项”之“十九 公司子公司重要事项”。

## 三、截至报告期末公司近两年的主要会计数据和财务指标

项目	本报告期末	上年末	本报告期末比上年末增减
流动比率	1.67	1.57	增加 0.10
资产负债率	78.75%	78.43%	增加 0.32 个百分点
速动比率	1.66	1.56	增加 0.10
项目	本报告期	上年同期	本报告期比上年同期增减
扣除非经常性损益后净利润 (人民币元)	3,483,732,413.47	4,555,276,966.55	-23.52%

EBITDA 全部债务比	0.04	0.06	减少 0.02
利息保障倍数	1.88	2.20	-14.55%
现金利息保障倍数	7.25	-5.02	不适用
EBITDA 利息保障倍数	1.96	2.28	-14.04%
贷款偿还率	100%	100%	-
利息偿付率	100%	100%	-

注：流动比率、资产负债率、速动比率均剔除代理买卖证券款和代理承销证券款。

## 第九节 财务报告

申万宏源集团股份有限公司

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
财务报表(未经审计)及审阅报告

## 申万宏源集团股份有限公司

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
财务报表(未经审计)及审阅报告

	页码
审阅报告	110
截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间	
合并及公司资产负债表	111-113
合并及公司利润表	114-116
合并及公司现金流量表	117-120
合并及公司股东权益变动表	121-122
财务报表附注	123-280
未经审阅补充财务信息	281-282

## 审阅报告

普华永道中天阅字(2022)第 0070 号

申万宏源集团股份有限公司全体股东：

我们审阅了后附的申万宏源集团股份有限公司(以下简称“申万宏源集团”)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申万宏源集团管理层的责任，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对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

叶少宽

中国·上海市  
2022年8月30日

注册会计师

单峰

申万宏源集团股份有限公司

合并资产负债表

2022年6月30日

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	附注五	本集团	
		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	129,810,200,675.82	108,580,453,632.49
其中：客户存款		92,345,402,417.97	77,541,617,392.65
结算备付金	2	23,887,122,744.96	24,343,165,506.63
其中：客户备付金		8,279,710,283.21	9,081,223,853.06
融出资金	3	67,378,075,125.46	76,296,755,210.91
衍生金融资产	4	6,302,754,939.03	2,800,299,619.84
存出保证金	5	31,148,219,336.93	29,113,660,023.59
应收款项	6	7,900,778,736.56	4,093,736,594.48
买入返售金融资产	7	29,461,463,942.51	25,398,184,483.40
金融投资：			
交易性金融资产	8	268,043,439,543.04	272,576,458,805.60
债权投资	9	4,586,626,251.96	5,021,564,425.53
其他债权投资	10	40,604,245,017.50	37,125,399,149.14
其他权益工具投资	11	3,018,386,382.93	2,623,807,751.94
长期股权投资	13	4,562,330,436.17	4,512,057,679.62
投资性房地产	14	50,222,968.17	52,465,794.00
固定资产	15	1,113,309,777.00	1,126,484,508.82
在建工程	16	203,660,829.17	227,067,332.24
使用权资产	58	912,039,002.73	948,606,204.58
无形资产	17	231,338,904.83	250,180,959.41
递延所得税资产	18	2,674,863,925.98	2,570,403,334.75
其他资产	19	3,068,884,694.80	3,350,716,236.12
<b>资产总计</b>		<b>624,957,963,235.55</b>	<b>601,011,467,253.09</b>

申万宏源集团股份有限公司

合并资产负债表(续)

2022年6月30日

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	附注五	本集团	
		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	21	3,089,108,001.74	3,229,797,786.23
应付短期融资款	22	36,032,626,484.09	29,586,843,198.81
拆入资金	23	3,337,755,264.73	4,366,724,506.15
交易性金融负债	24	4,959,070,430.38	6,166,995,391.55
衍生金融负债	4	8,010,149,615.46	7,309,855,457.95
卖出回购金融资产款	25	130,220,011,282.10	137,977,519,780.54
代理买卖证券款	26	116,768,953,955.58	104,738,358,649.63
代理承销证券款		19,909,120.00	-
应付职工薪酬	27	6,675,269,633.09	6,226,949,469.47
应交税费	28	888,936,303.69	2,689,015,801.16
应付款项	29	27,852,018,147.57	16,950,753,669.24
应付债券	30	161,899,437,257.60	160,486,724,010.28
租赁负债	58	951,302,234.52	969,215,294.92
递延所得税负债	18	4,731,819.62	27,297,930.73
合同负债	31	112,812,838.90	140,220,205.93
其他负债	32	16,166,221,135.65	13,090,602,080.24
<b>负债合计</b>		<b>516,988,313,524.72</b>	<b>493,956,873,232.83</b>
<b>股东权益</b>			
股本	33	25,039,944,560.00	25,039,944,560.00
资本公积	34	19,367,146,136.46	19,367,146,136.46
其他综合收益	35	(760,608,328.50)	(640,305,705.98)
盈余公积	36	3,860,338,868.32	3,860,338,868.32
一般风险准备	37	16,270,655,717.86	16,236,742,750.91
未分配利润	38	32,155,624,056.20	31,358,141,449.76
归属于母公司股东权益合计		95,933,101,010.34	95,222,008,059.47
少数股东权益		12,036,548,700.49	11,832,585,960.79
归属于普通股少数股东的权益		1,742,700,060.01	1,733,218,087.43
归属于少数股东其他权益工具持有者的权益	39	10,293,848,640.48	10,099,367,873.36
<b>股东权益合计</b>		<b>107,969,649,710.83</b>	<b>107,054,594,020.26</b>
<b>负债和股东权益总计</b>		<b>624,957,963,235.55</b>	<b>601,011,467,253.09</b>

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

第 111 页至第 122 页的财务报表由下列负责人签署：

黄昊  
法定代表人

任全胜  
主管会计工作的公司负责人

张艳  
会计机构负责人

此财务报表已于 2022 年 8 月 30 日获董事会批准。

申万宏源集团股份有限公司

公司资产负债表

2022年6月30日

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	附注十七	本公司	
		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		4,592,775,609.68	344,130,171.90
金融投资：			
交易性金融资产		11,801,559,773.13	11,795,825,358.49
债权投资		2,433,323,677.00	1,932,293,539.01
长期股权投资	1	63,329,357,797.64	63,316,665,941.15
投资性房地产		137,224,083.32	140,846,727.26
固定资产		328,781,260.97	339,287,708.39
无形资产		978,658.45	1,107,691.71
递延所得税资产		160,442,279.13	171,856,162.32
其他资产	2	7,404,905,041.82	6,028,896,787.13
<b>资产总计</b>		<b>90,189,348,181.14</b>	<b>84,070,910,087.36</b>
<b>负债</b>			
应付职工薪酬		166,115,163.10	145,236,606.63
应交税费		4,906,164.21	11,033,655.24
应付债券	3	28,042,365,170.35	24,992,277,584.49
其他负债		2,537,651,995.07	8,674,221.16
<b>负债合计</b>		<b>30,751,038,492.73</b>	<b>25,157,222,067.52</b>
<b>股东权益</b>			
股本		25,039,944,560.00	25,039,944,560.00
资本公积		23,811,448,219.46	23,811,448,219.46
盈余公积		3,269,867,265.89	3,269,867,265.89
一般风险准备		3,849,860,528.88	3,849,860,528.88
未分配利润		3,467,189,114.18	2,942,567,445.61
<b>股东权益合计</b>		<b>59,438,309,688.41</b>	<b>58,913,688,019.84</b>
<b>负债和股东权益总计</b>		<b>90,189,348,181.14</b>	<b>84,070,910,087.36</b>

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

申万宏源集团股份有限公司

合并利润表

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	附注五	本集团	
		截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年 (未经审计)	2021 年 (未经审计)
一 营业收入		12,818,884,641.34	16,079,341,984.03
手续费及佣金净收入	40	4,330,998,801.83	4,203,503,209.16
其中：经纪业务手续费净收入		2,787,646,691.29	2,853,807,249.26
投资银行业务手续费净收入		813,411,847.55	713,506,925.30
资产管理及基金管理业务手 续费净收入		662,923,224.03	605,028,588.57
利息净(支出)/收入	41	(34,757,761.87)	947,157,687.22
其中：利息收入		4,965,236,357.51	5,579,695,329.44
利息支出		4,999,994,119.38	4,632,537,642.22
投资收益	42	287,286,300.50	5,050,962,743.49
其中：对联营及合营企业的投资收益		371,721,706.17	398,967,076.21
以摊余成本计量的金融资产终 止确认产生的损失		(19,341,172.21)	-
其他收益	43	245,950,181.61	47,578,932.82
公允价值变动收益/(损失)	44	4,465,678,262.92	(16,937,898.39)
汇兑损失		(21,640,698.57)	(29,706,496.78)
其他业务收入	45	3,544,556,615.55	5,874,790,613.18
资产处置收益	46	812,939.37	1,993,193.33
二 营业支出		8,681,617,338.81	10,697,462,149.48
税金及附加	47	77,310,542.61	86,652,414.22
业务及管理费	48	4,318,682,835.50	4,582,402,501.13
信用减值损失	49	684,361,499.00	226,075,733.80
其他资产减值转回	50	(24,267,341.62)	(1,357,625.55)
其他业务成本	51	3,625,529,803.32	5,803,689,125.88
三 营业利润		4,137,267,302.53	5,381,879,834.55
加：营业外收入	52	3,297,084.89	6,268,856.96
减：营业外支出	53	51,647,908.36	41,009,847.16
四 利润总额		4,088,916,479.06	5,347,138,844.35
减：所得税费用	54	456,342,313.33	780,731,889.26
五 净利润		<u>3,632,574,165.73</u>	<u>4,566,406,955.09</u>
(一)按持续经营分类			
1. 持续经营净利润		3,632,574,165.73	4,566,406,955.09
2. 终止经营净利润		-	-
(二)按所有权归属分类			
1. 归属于母公司股东的净利润		3,361,795,635.20	4,520,909,978.30
2. 少数股东损益		270,778,530.53	45,496,976.79

申万宏源集团股份有限公司

合并利润表(续)

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	附注五	本集团	
		截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年 (未经审计)	2021 年 (未经审计)
六 其他综合收益的税后净额	35	(131,524,019.16)	(226,372,911.61)
归属于母公司股东的其他综合收益的税后净额		(146,708,228.33)	(212,253,397.20)
(一)不能重分类进损益的其他综合收益			
1.其他权益工具投资公允价值变动		(214,775,589.37)	(342,653,196.77)
(二)将重分类进损益的其他综合收益			
1.权益法下可转损益的其他综合收益		4,365,114.58	(696,896.41)
2.其他债权投资公允价值变动		(139,652,557.46)	1,514,590.07
3.其他债权投资信用减值准备		30,385,774.48	147,281,377.80
4.外币报表折算差额		172,969,029.44	(17,699,271.89)
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		15,184,209.17	(14,119,514.41)
七 综合收益总额		3,501,050,146.57	4,340,034,043.48
归属于母公司股东的综合收益总额		3,215,087,406.87	4,308,656,581.10
归属于少数股东的综合收益总额		285,962,739.70	31,377,462.38
八 每股收益	55		
(一)基本每股收益		0.13	0.18
(二)稀释每股收益		0.13	0.18

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

申万宏源集团股份有限公司

公司利润表

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	附注十七	本公司	
		截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年 (未经审计)	2021 年 (未经审计)
一 营业收入		3,129,381,972.49	3,244,943,747.77
手续费及佣金净收入		2,460,800.97	91,729.13
利息净支出	4	(308,847,158.02)	(315,286,168.96)
其中：利息收入		202,554,956.15	190,711,472.33
利息支出		511,402,114.17	505,997,641.29
投资收益	5	3,300,151,560.36	3,487,198,453.58
其中：对联营及合营企业的投资 投资收益		19,591,856.49	50,179,211.24
其他收益		1,287,473.59	517,219.89
公允价值变动收益	6	109,513,572.56	77,401,820.14
汇兑收益/(损失)		1.89	(29,667,680.62)
其他业务收入		24,815,721.14	24,688,374.61
二 营业支出		89,353,564.73	80,084,911.22
税金及附加		7,079,699.60	7,248,305.52
业务及管理费	7	78,487,456.27	69,197,747.21
信用减值损失		139,628.42	1,005.09
其他业务成本		3,646,780.44	3,637,853.40
三 营业利润		3,040,028,407.76	3,164,858,836.55
加：营业外收入		1,600.00	2,070.00
减：营业外支出		-	-
四 利润总额		3,040,030,007.76	3,164,860,906.55
减：所得税费用		11,413,883.19	(8,426,428.81)
五 净利润		3,028,616,124.57	3,173,287,335.36
六 其他综合收益的税后净额		-	-
七 综合收益总额		3,028,616,124.57	3,173,287,335.36

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

# 申万宏源集团股份有限公司

## 合并现金流量表

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	附注五	本集团	
		截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年 (未经审计)	2021 年 (未经审计)
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
为交易目的而持有的金融工具净减少额		12,220,572,908.60	-
收取利息、手续费及佣金的现金		12,178,490,855.51	12,669,422,757.47
回购业务资金净增加额		-	19,910,824,459.60
代理买卖证券收到的现金净额		10,449,920,407.51	604,124,050.62
融出资金净减少额		9,157,546,929.35	-
收到其他与经营活动有关的现金	56(1)	4,743,826,314.77	7,041,510,116.61
<b>经营活动现金流入小计</b>		<b>48,750,357,415.74</b>	<b>40,225,881,384.30</b>
为交易目的而持有的金融工具净增加额		-	42,317,955,132.37
融出资金净增加额		-	5,473,169,207.93
拆入资金净减少额		1,026,775,020.00	550,409,940.00
回购业务资金净减少额		6,325,945,309.14	-
支付利息、手续费及佣金的现金		2,813,995,721.72	2,652,708,293.43
支付给职工及为职工支付的现金		2,977,497,887.64	2,335,495,131.37
支付的各项税费		2,280,800,194.35	3,422,166,138.15
支付其他与经营活动有关的现金	56(2)	7,807,821,484.62	11,817,055,120.27
<b>经营活动现金流出小计</b>		<b>23,232,835,617.47</b>	<b>68,568,958,963.52</b>
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>	<b>56(3)</b>	<b>25,517,521,798.27</b>	<b>(28,343,077,579.22)</b>
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		-	31,857,412,912.03
取得投资收益收到的现金		630,473,411.31	3,243,267,891.77
处置固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金净额		2,096,353.75	15,956,531.33
<b>投资活动现金流入小计</b>		<b>632,569,765.06</b>	<b>35,116,637,335.13</b>
投资所支付的现金		6,683,094,269.29	-
购建固定资产、无形资产和其他长期资产所支付的现金		106,736,160.11	147,505,501.16
<b>投资活动现金流出小计</b>		<b>6,789,830,429.40</b>	<b>147,505,501.16</b>
<b>投资活动产生的现金流量净额</b>		<b>(6,157,260,664.34)</b>	<b>34,969,131,833.97</b>

申万宏源集团股份有限公司

合并现金流量表(续)

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

		本集团	
		截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	附注五	2022 年 (未经审计)	2021 年 (未经审计)
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
发行债券收到的现金		67,680,923,613.50	54,294,808,048.00
吸收投资收到的现金		-	2,049,541,927.63
取得借款收到的现金		2,500,158,919.52	7,750,925,426.85
筹资活动现金流入小计		<u>70,181,082,533.02</u>	<u>64,095,275,402.48</u>
偿还债务支付的现金		62,759,450,804.62	58,604,727,423.14
分配股利、利润或偿付利息 支付的现金		2,853,486,767.48	2,841,703,177.61
支付租赁负债的现金		191,629,518.71	169,777,369.63
筹资活动现金流出小计		<u>65,804,567,090.81</u>	<u>61,616,207,970.38</u>
筹资活动产生的现金流量净额		<u>4,376,515,442.21</u>	<u>2,479,067,432.10</u>
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>			
		<u>(21,640,698.57)</u>	<u>(29,706,496.78)</u>
五、现金及现金等价物的变动净额	56(3)(c)	23,715,135,877.57	9,075,415,190.07
加：期初现金及现金等价物余额		<u>146,061,433,215.75</u>	<u>123,198,978,108.43</u>
六、期末现金及现金等价物余额	56(4)	<u>169,776,569,093.32</u>	<u>132,274,393,298.50</u>

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

申万宏源集团股份有限公司

公司现金流量表

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	附注十七	本公司	
		截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年 (未经审计)	2021 年 (未经审计)
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
为交易目的而持有的金融工具净减少额		147,938,678.71	-
收取利息、手续费及佣金的现金		155,793,127.13	12,997,583.45
收到其他与经营活动有关的现金		52,428,652.50	48,538,289.50
经营活动现金流入小计		<u>356,160,458.34</u>	<u>61,535,872.95</u>
为交易目的而持有的金融工具净增加额		-	1,075,642,591.00
支付给职工及为职工支付的现金		41,953,910.70	36,077,141.55
支付的各项税费		22,570,765.46	32,065,327.42
支付其他与经营活动有关的现金		7,012,740.65	5,438,306.11
经营活动现金流出小计		<u>71,537,416.81</u>	<u>1,149,223,366.08</u>
经营活动使用的现金流量净额	8(1)	<u>284,623,041.53</u>	<u>(1,087,687,493.13)</u>
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
收回投资收到的现金		-	1,491,999,211.24
取得投资收益收到的现金		88,819,288.27	3,332,931,328.48
处置固定资产、无形资产和 其他长期资产支付的现金净额		-	4,513,525.50
收到其他与投资活动有关的现金		1,838,323,638.79	5,882,516,977.53
投资活动现金流入小计		<u>1,927,142,927.06</u>	<u>10,711,961,042.75</u>
投资所支付的现金		500,250,000.00	6,802,020,000.00
购建固定资产、无形资产和 其他长期资产所支付的 现金		1,556,004.39	8,089,894.18
支付其他与投资活动有关的现金		-	3,240,000,000.00
投资活动现金流出小计		<u>501,806,004.39</u>	<u>10,050,109,894.18</u>
投资活动产生的现金流量净额		<u>1,425,336,922.67</u>	<u>661,851,148.57</u>

申万宏源集团股份有限公司

公司现金流量表(续)

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	附注十七	本公司	
		截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年 (未经审计)	2021 年 (未经审计)
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
发行债券收到的现金		7,000,000,000.00	2,000,000,000.00
筹资活动现金流入小计		7,000,000,000.00	2,000,000,000.00
偿还债务支付的现金		4,200,000,000.00	2,020,800,000.00
分配股利、利润或偿付利息 支付的现金		261,314,528.31	255,473,750.94
筹资活动现金流出小计		4,461,314,528.31	2,276,273,750.94
筹资活动产生的现金流量净额		2,538,685,471.69	(276,273,750.94)
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>			
		1.89	(29,667,680.62)
<b>五、现金及现金等价物的变动净额</b>			
	8(2)	4,248,645,437.78	(731,777,776.12)
加：期初现金及现金等价物余额		344,130,171.90	1,883,758,978.74
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>			
		4,592,775,609.68	1,151,981,202.62

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

申万宏源集团股份有限公司  
合并股东权益变动表  
截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	归属于母公司股东权益							少数股东权益		股东权益合计
	股本 五、33	资本公积 五、34	其他综合收益 五、35	盈余公积 五、36	一般风险准备 五、37	未分配利润 五、38	小计	其他权益工具持有者 五、39	普通股股东	
2022 年 1 月 1 日余额(经审计)	25,039,944,560.00	19,367,146,136.46	(640,305,705.98)	3,860,338,868.32	16,236,742,750.91	31,358,141,449.76	95,222,008,059.47	10,099,367,873.36	1,733,218,087.43	107,054,594,020.26
<b>本期增减变动金额</b>										
一综合收益总额	-	-	(146,708,228.33)	-	-	3,361,795,635.20	3,215,087,406.87	276,480,767.12	9,481,972.58	3,501,050,146.57
二股东投入资本和减少资本	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
三利润分配										
1 提取一般风险准备	-	-	-	-	33,912,966.95	(33,912,966.95)	-	-	-	-
2 对股东的分配	-	-	-	-	-	(2,503,994,456.00)	(2,503,994,456.00)	-	-	(2,503,994,456.00)
3 对其他权益工具持有者的分配	-	-	-	-	-	-	-	(82,000,000.00)	-	(82,000,000.00)
四股东权益内部结转										
1 其他综合收益结转留存收益	-	-	26,405,605.81	-	-	(26,405,605.81)	-	-	-	-
2022 年 6 月 30 日余额(未经审计)	25,039,944,560.00	19,367,146,136.46	(760,608,328.50)	3,860,338,868.32	16,270,655,717.86	32,155,624,056.20	95,933,101,010.34	10,293,848,640.48	1,742,700,060.01	107,969,649,710.83
	归属于母公司股东权益							少数股东权益		股东权益合计
	股本 五、33	资本公积 五、34	其他综合收益 五、35	盈余公积 五、36	一般风险准备 五、37	未分配利润 五、38	小计	其他权益工具持有者 五、39	普通股股东	
2021 年 1 月 1 日余额(经审计)	25,039,944,560.00	19,367,146,136.46	(930,712,658.95)	3,563,550,860.40	14,240,706,517.92	27,183,981,098.98	88,464,616,514.81	-	1,625,972,943.33	90,090,589,458.14
<b>本期增减变动金额</b>										
一综合收益总额	-	-	(212,253,397.20)	-	-	4,520,909,978.30	4,308,656,581.10	-	31,377,462.38	4,340,034,043.48
二股东投入资本和减少资本										
1 股东投入的普通股	-	-	-	-	-	-	-	-	55,250,000.00	55,250,000.00
2 股东减少的普通股	-	-	-	-	-	-	-	-	(5,708,072.37)	(5,708,072.37)
3 发行永续债	-	-	-	-	-	-	-	2,000,000,000.00	-	2,000,000,000.00
三利润分配										
1 提取一般风险准备	-	-	-	-	31,025,687.09	(31,025,687.09)	-	-	-	-
2 对股东的分配	-	-	-	-	-	(2,503,994,456.00)	(2,503,994,456.00)	-	(12,861,903.17)	(2,516,856,359.17)
2021 年 6 月 30 日余额(未经审计)	25,039,944,560.00	19,367,146,136.46	(1,142,966,056.15)	3,563,550,860.40	14,271,732,205.01	29,169,870,934.19	90,269,278,639.91	2,000,000,000.00	1,694,030,430.17	93,963,309,070.08

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

# 申万宏源集团股份有限公司

## 公司股东权益变动表

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	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
2022 年 1 月 1 日余额(经审计)	25,039,944,560.00	23,811,448,219.46	-	3,269,867,265.89	3,849,860,528.88	2,942,567,445.61	58,913,688,019.84
<b>本期增减变动金额</b>							
一综合收益总额	-	-	-	-	-	3,028,616,124.57	3,028,616,124.57
二利润分配							
1 对股东的分配	-	-	-	-	-	(2,503,994,456.00)	(2,503,994,456.00)
2022 年 6 月 30 日余额(未经审计)	25,039,944,560.00	23,811,448,219.46	-	3,269,867,265.89	3,849,860,528.88	3,467,189,114.18	59,438,309,688.41
	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
2021 年 1 月 1 日余额(经审计)	25,039,944,560.00	23,811,448,219.46	-	2,973,079,257.97	3,849,860,528.88	2,775,469,830.34	58,449,802,396.65
<b>本期增减变动金额</b>							
一综合收益总额	-	-	-	-	-	3,173,287,335.36	3,173,287,335.36
二利润分配							
1 对股东的分配	-	-	-	-	-	(2,503,994,456.00)	(2,503,994,456.00)
2021 年 6 月 30 日余额(未经审计)	25,039,944,560.00	23,811,448,219.46	-	2,973,079,257.97	3,849,860,528.88	3,444,762,709.70	59,119,095,276.01

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

申万宏源集团股份有限公司  
财务报表附注  
截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
(除特别注明外，金额单位为人民币元)

一 公司基本情况

申万宏源集团股份有限公司(以下简称“本公司”)前身系申银万国证券股份有限公司(以下简称“申银万国”)。申银万国是由原上海申银证券有限公司与原上海万国证券公司于 1996 年新设合并而组建成立的股份制证券公司，于 2015 年 1 月 16 日更名为“申万宏源集团股份有限公司”。

原上海申银证券有限公司于 1988 年在上海注册成立，1992 年改制为股份有限公司，注册资本为人民币 60,000 万元。原上海万国证券公司于 1988 年在上海注册成立，注册资本为人民币 3,500 万元，后增资为人民币 65,208 万元。经中国人民银行银复[1996]200 号文批准，由上海申银证券有限公司原股东及上海万国证券公司原股东共同作为发起人，通过新设合并的方式设立申银万国，注册资本为人民币 132,000 万元，业经会计师事务所验证确认并出具验资报告。

经 2002 年 3 月 4 日中国证券监督管理委员会(以下简称“证监会”)《关于核准申银万国证券股份有限公司增资扩股的批复》(证监机构字[2002]61 号)核准，本公司的注册资本增加为人民币 421,576 万元，业经会计师事务所验证确认并出具验资报告。

经 2005 年 9 月 28 日证监会《关于同意申银万国证券股份有限公司增资扩股及修改公司章程的批复》(证监机构字[2005]100 号)核准，中央汇金投资有限责任公司(以下简称“中央汇金”)以人民币 25 亿元认购本公司新增 25 亿股股份，业经会计师事务所验证确认并出具验资报告。增资后，本公司的注册资本增加为人民币 671,576 万元，并取得上海市工商行政管理局颁发的 310000000046991 号企业法人营业执照。

经 2012 年 2 月 24 日证监会上海证监局《关于核准申银万国证券股份有限公司变更持有 5%以上股权的股东的批复》(沪证监机构字[2012]42 号)核准，中央汇金受让上海国际集团有限公司、上海国有资产经营有限公司、上海国际信托有限公司、上海国际集团资产管理有限公司四家公司所持本公司合计 1,218,967,798 股股份。股权变更完成后，中央汇金所持本公司股份数增加至 3,718,967,798 股。

申万宏源集团股份有限公司  
财务报表附注  
截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
(除特别注明外, 金额单位为人民币元)

一 公司基本情况(续)

于 2014 年 7 月 25 日, 本公司与宏源证券股份有限公司(以下简称“宏源证券”)订立《申银万国证券股份有限公司与宏源证券股份有限公司换股吸收合并协议》(以下简称“换股吸收合并协议”)。根据换股吸收合并协议, 本公司向宏源证券全体股东发行 A 股股票, 以取得该等股东持有的宏源证券全部股票。于 2014 年 12 月 1 日, 证监会印发《关于核准申银万国证券股份有限公司发行股票吸收合并宏源证券股份有限公司的批复》(证监许可[2014]1279 号), 核准本公司发行股份吸收合并宏源证券。

于 2015 年 1 月 15 日, 证监会印发《关于核准设立申万宏源证券有限公司及其 2 家子公司的批复》(证监许可[2015]95 号), 核准本公司以吸收合并宏源证券后的全部证券类资产及负债出资设立全资证券子公司申万宏源证券有限公司; 核准申万宏源证券有限公司设立申万宏源证券承销保荐有限责任公司及申万宏源西部证券有限公司。同日, 本公司出资设立申万宏源证券有限公司。此外, 根据本公司第三届董事会第二十三次会议决议, 本公司更名为“申万宏源集团股份有限公司”, 并于 2015 年 1 月 16 日取得了上海市工商行政管理局换发的营业执照。

于 2015 年 1 月 20 日, 本公司迁址新疆维吾尔自治区, 并取得了新疆维吾尔自治区工商行政管理局换发的营业执照。同日, 申万宏源证券有限公司以货币出资人民币 10 亿元, 成立申万宏源证券承销保荐有限责任公司; 以货币及非货币资产出资人民币 12 亿元, 成立申万宏源西部证券有限公司。

于 2015 年 1 月 23 日, 即换股交易股权登记日收市后, 宏源证券股票按 1: 2.049 比例转换成本公司发行的普通股股票。本次合并中, 本公司共增发 8,140,984,977 股普通股股票。本次换股交易完成后, 本公司的注册资本增加为人民币 14,856,744,977 元, 股份总数为 14,856,744,977 股。

于 2015 年 1 月 26 日, 本公司发行的普通股股票在深圳证券交易所挂牌交易, 证券简称为“申万宏源”, 证券代码为“000166”。

于 2016 年 7 月 6 日, 本公司以 2015 年 12 月 31 日总股本 14,856,744,977 股为基数, 向全体股东每 10 股派送股票股利 3.50 股, 增加注册资本人民币 5,199,860,741 元, 本公司总股本增至 20,056,605,718 股, 并于 2016 年 11 月 1 日取得了新疆维吾尔自治区工商行政管理局换发的营业执照。

于 2018 年 1 月 16 日, 本公司非公开发行股票募集资金净额人民币 11,972,900,760.32 元, 其中实收股本人民币 2,479,338,842.00 元, 股本溢价人民币 9,493,561,918.32 元。本公司变更后累计实收股本为人民币 22,535,944,560.00 元, 占变更后注册资本的 100%。

申万宏源集团股份有限公司  
财务报表附注  
截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
(除特别注明外, 金额单位为人民币元)

一 公司基本情况(续)

于 2019 年 4 月 26 日, 本公司在香港联合交易所有限公司(“香港联交所”)主板共发售 2,504,000,000 股 H 股。本次发售后本公司的股份总数为 25,039,944,560 股。

本公司及下属子公司(以下简称“本集团”)主要从事证券经纪业务、融资融券业务、证券自营业务、证券承销与保荐业务、证券资产管理业务、基金管理业务、股票期权做市业务、期货经纪业务、直接投资业务和创新投资业务等。

于 2022 年 6 月 30 日, 本集团共有员工人数为 11,547 人(含证券经纪人 742 人), 其中本公司董事、监事及高级管理人员人数为 19 人。

本财务报表由本公司董事会于 2022 年 8 月 30 日批准报出。

二 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发的《企业会计准则第 32 号—中期财务报告》和中国证券监督管理委员会颁布的《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 2022 年 6 月 30 日的合并及公司财务状况以及截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间的合并及公司经营成果和现金流量。

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

四 企业合并及合并财务报表

1 子公司情况

(1) 通过自行设立方式取得的主要子公司

子公司名称	主要经营地/ 注册地	实收资本	业务性质	本公司 持有权益比例(注)		本公司 表决权比例(注)	
				直接	间接	直接	间接
申万宏源证券有限公司	上海	人民币 535 亿元	证券经纪及投资咨询、融资融券、 证券自营、资产管理及其他业务	100%	-	100%	-
申万宏源西部证券有限公司	新疆乌鲁木齐	人民币 57 亿元	证券经纪和融资融券	-	100%	-	100%
申万宏源证券承销保荐有限责任公司	新疆乌鲁木齐	人民币 10 亿元	证券承销与保荐业务	-	100%	-	100%
申万菱信基金管理有限公司	上海	人民币 1.5 亿元	基金管理业务	-	67%	-	67%
上海申银万国证券研究所有限公司	上海	人民币 2,000 万元	证券投资研究	-	90%	-	90%
申银万国创新证券投资咨询有限公司	深圳	人民币 20 亿元	投资管理和投资咨询服务	-	100%	-	100%
申银万国投资有限公司	上海	人民币 10 亿元	投资咨询和财富管理业务	-	100%	-	100%
宏源恒利(上海)实业有限公司	上海	人民币 5 亿元	风险管理服务	-	100%	-	100%
宏源循环能源投资管理(北京)有限公司	北京	人民币 1,000 万元	投资管理服务	-	100%	-	100%
申万宏源发展成都股权投资管理有限公司	四川成都	人民币 3,000 万元	投资管理服务	-	51%	-	51%
四川申万宏源长虹股权投资管理有限公司	四川绵阳	人民币 2,000 万元	投资管理服务	-	60%	-	60%
申银万国交投产融(上海)投资管理有限公司	上海	人民币 1,000 万元	投资管理服务	-	51%	-	51%
申万宏源投资有限公司	新疆乌鲁木齐	-	投资管理服务	100%	-	100%	-
申万宏源产业投资管理有限责任公司	新疆乌鲁木齐	人民币 2 亿元	投资咨询服务	100%	-	100%	-
申万宏源(国际)集团有限公司	香港	港币 40.71 亿元	投资控股	-	100%	-	100%
ShenwanHongyuan(International)Holdings Limited	香港	港币 40.71 亿元	投资控股	-	100%	-	100%
四川川投信产申万宏源股权投资管理有限公司	四川成都	人民币 1,000 万元	投资管理服务	-	51%	-	51%
成都申宏峨影股权投资基金管理有限公司	四川成都	人民币 200 万元	投资管理服务	-	51%	-	51%
湖南湘汇私募股权基金管理有限公司	湖南长沙	人民币 612 万元	投资管理服务	-	100%	-	100%

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

四 企业合并及合并财务报表(续)

1 子公司情况(续)

(2) 同一控制下企业合并取得的子公司

子公司名称	主要经营地/ 注册地	实收资本	业务性质	本公司 持有权益比例(注)		本公司 表决权比例(注)	
				直接	间接	直接	间接
				宏源期货有限公司	北京	人民币 10 亿元	期货经纪业务
宏源汇富创业投资有限公司	北京	人民币 5 亿元	创业投资业务	100%	-	100%	-
宏源汇智投资有限公司	北京	人民币 20 亿元	投资管理业务	100%	-	100%	-

(3) 非同一控制下企业合并取得的主要子公司

子公司名称	主要经营地/ 注册地	实收资本	业务性质	本公司 持有权益比例(注)		本公司 表决权比例(注)	
				直接	间接	直接	间接
				申银万国期货有限公司	上海	人民币 14.42 亿元	期货经纪业务
申万宏源(香港)有限公司 ShenwanHongyuan(H.K.)Limited	香港	港币 27.82 亿元	证券经纪、企业金融、资产管理、 融资和贷款及其他业务	-	64.90%	-	75.00%

注：上表持有权益比例为本公司直接持有权益比例与通过各层控股关系之持有权益比例相乘得出的间接持有权益比例之和；表决权比例为本公司直接持有的表决权比例和通过各层控股关系间接持有的表决权比例之和。

申万宏源集团股份有限公司  
财务报表附注  
截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
(除特别注明外，金额单位为人民币元)

#### 四 企业合并及合并财务报表(续)

##### 2 结构化主体或通过受托经营等方式形成控制权的经营实体

本集团管理或投资多个结构化主体。为判断是否控制该类结构化主体，本集团主要评估其通过参与设立相关结构化主体时的决策和参与度及相关合同安排等所享有的对该类结构化主体的整体经济利益(包括直接持有产生的收益以及预期管理费)以及对该类结构化主体的决策权范围。若本集团通过投资合同等安排同时对该类结构化主体拥有权力、通过参与该结构化主体的相关活动而享有可变回报以及有能力运用本集团对该类结构化主体的权力影响可变回报，则本集团认为能够控制该类结构化主体，并将此类结构化主体纳入合并财务报表范围。

于 2022 年 6 月 30 日，本集团纳入合并范围的结构化主体包括本集团发行及管理的资产管理计划和直接投资在第三方发起设立的信托计划等。上述纳入合并范围的结构化主体净资产账面价值为人民币 24,266,005,735.58 元(2021 年 12 月 31 日：人民币 30,791,999,362.63 元)。于 2022 年 6 月 30 日，本公司及其子公司在上述结构化主体中的权益体现在其各自资产负债表中交易性金融资产和长期股权投资为人民币 13,112,776,960.82 元(2021 年 12 月 31 日：人民币 19,888,387,936.45 元)。

于 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 12 月 31 日，本集团认为上述结构化主体均受本集团控制，故将其纳入合并财务报表范围。

##### 3 纳入合并财务报表范围但母公司拥有其半数或半数以下表决权的子公司

于 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 12 月 31 日，本集团均无纳入合并财务报表范围但母公司拥有其半数或半数以下表决权的重要子公司。

##### 4 公司拥有半数以上表决权但未能对其形成控制的被投资单位

于 2022 年 6 月 30 日，本集团无拥有半数以上表决权但未能对其形成控制的重要被投资单位(2021 年 12 月 31 日：无)。

##### 5 合并范围发生变更的说明

于 2022 年 6 月 30 日，共有 49 只产品因本集团享有的可变回报重大而纳入本集团财务报表的合并范围(2021 年 12 月 31 日：44 只)。

## 申万宏源集团股份有限公司

### 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

#### 四 企业合并及合并财务报表(续)

##### 6 本期合并范围发生变动的子公司

###### (1) 本期新纳入合并范围重要的子公司

本期本集团无新纳入合并范围的重要子公司。

###### (2) 本期不再纳入合并范围的子公司

本期本集团无不再纳入合并范围的重要子公司。

##### 7 本期发生的同一控制下企业合并

本期本集团未发生重大同一控制下企业合并。

##### 8 本期发生的非同一控制下企业合并

本期本集团未发生重大非同一控制下企业合并。

##### 9 境外经营实体主要报表项目的折算汇率

本集团主要境外经营实体记账本位币为港币，编制合并财务报表时，折算外币财务报表所采用的资产负债表日的即期汇率和交易发生日的即期汇率的近似汇率分别为：

	即期汇率		即期汇率的近似汇率	
	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
港币	0.85519	0.81760	0.82836	0.83000

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注

1 货币资金

(1) 按币种列示

	2022 年 6 月 30 日		
	原币金额	折算汇率	人民币金额
现金			
人民币	4,521.96	1.00000	4,521.96
美元	71.45	6.71140	479.53
港币	77,898.80	0.85519	66,618.28
小计			<u>71,619.77</u>
银行存款			
自有资金			
人民币	35,280,034,772.90	1.00000	35,280,034,772.90
美元	69,966,943.65	6.71140	469,576,145.63
港币	1,221,160,597.92	0.85519	1,044,324,331.74
其他币种			108,586,487.54
小计			<u>36,902,521,737.81</u>
客户资金			
人民币	85,749,862,217.74	1.00000	85,749,862,217.74
美元	441,450,898.17	6.71140	2,962,753,558.01
港币	4,215,725,187.47	0.85519	3,605,246,023.08
其他币种			27,540,619.14
小计			<u>92,345,402,417.97</u>
小计			<u>129,247,924,155.78</u>
其他货币资金			
人民币	563,598,619.83	1.00000	<u>563,598,619.83</u>
小计			<u>129,811,594,395.38</u>
减：减值准备			<u>(1,393,719.56)</u>
合计			<u>129,810,200,675.82</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

1 货币资金(续)

(1) 按币种列示(续)

其中，融资融券业务

	2022 年 6 月 30 日		
	原币金额	折算汇率	人民币金额
客户信用资金			
人民币	9,462,169,599.76	1.00000	9,462,169,599.76
美元	117,933,211.62	6.71140	791,496,956.50
港币	4,019,699,572.02	0.85519	3,437,606,877.00
其他币种			27,540,619.14
小计			<u>13,718,814,052.40</u>
合计			<u>13,718,814,052.40</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

1 货币资金(续)

(1) 按币种列示(续)

	2021 年 12 月 31 日		
	原币金额	折算汇率	人民币金额
现金			
人民币	2,262.00	1.00000	2,262.00
美元	71.45	6.37570	455.54
港币	44,776.20	0.81760	36,609.02
小计			<u>39,326.56</u>
银行存款			
自有资金			
人民币	28,843,916,115.24	1.00000	28,843,916,115.24
美元	83,824,843.14	6.37570	534,442,052.41
港币	1,397,178,037.73	0.81760	1,142,332,763.65
其他币种			169,439,364.86
小计			<u>30,690,130,296.16</u>
客户资金			
人民币	72,484,432,033.26	1.00000	72,484,432,033.26
美元	288,688,691.96	6.37570	1,840,592,493.33
港币	3,787,594,528.89	0.81760	3,096,737,286.82
其他币种			119,855,579.24
小计			<u>77,541,617,392.65</u>
小计			<u>108,231,747,688.81</u>
其他货币资金			
人民币	349,934,907.30	1.00000	349,934,907.30
小计			<u>108,581,721,922.67</u>
减：减值准备			<u>(1,268,290.18)</u>
合计			<u>108,580,453,632.49</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

1 货币资金(续)

(1) 按币种列示(续)

其中，融资融券业务

	2021 年 12 月 31 日		
	原币金额	折算汇率	人民币金额
客户信用资金			
人民币	7,436,622,141.89	1.00000	7,436,622,141.89
美元	92,283,722.16	6.37570	588,373,327.38
港币	3,634,530,000.28	0.81760	2,971,591,728.23
其他币种			119,855,579.24
小计			<u>11,116,442,776.74</u>
合计			<u>11,116,442,776.74</u>

(2) 受限制的货币资金

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
一般风险准备	703,298,705.16	650,076,356.96
在途投资款	<u>13,512,100.00</u>	<u>291,199,958.00</u>
合计	<u>716,810,805.16</u>	<u>941,276,314.96</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

2 结算备付金

	2022 年 6 月 30 日		
	原币金额	折算汇率	人民币金额
公司自有备付金			
人民币	15,545,272,573.88	1.00000	15,545,272,573.88
美元	6,539,225.28	6.71140	43,887,356.54
港币	14,366,494.90	0.85519	12,286,082.77
小计			<u>15,601,446,013.19</u>
公司信用备付金			
人民币	5,966,448.56	1.00000	<u>5,966,448.56</u>
客户普通备付金			
人民币	5,084,562,932.73	1.00000	5,084,562,932.73
美元	48,656,676.13	6.71140	326,554,416.19
港币	237,614,206.01	0.85519	203,205,292.83
小计			<u>5,614,322,641.75</u>
客户信用备付金			
人民币	2,665,387,641.46	1.00000	<u>2,665,387,641.46</u>
合计			<u>23,887,122,744.96</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

2 结算备付金(续)

	2021 年 12 月 31 日		
	原币金额	折算汇率	人民币金额
公司自有备付金			
人民币	15,199,464,120.69	1.00000	15,199,464,120.69
美元	4,800,477.54	6.37570	30,606,404.66
港币	37,706,735.66	0.81760	30,829,027.08
小计			<u>15,260,899,552.43</u>
公司信用备付金			
人民币	1,042,101.14	1.00000	<u>1,042,101.14</u>
客户普通备付金			
人民币	2,711,976,211.91	1.00000	2,711,976,211.91
美元	145,009,484.29	6.37570	924,536,969.00
港币	2,159,960,334.89	0.81760	1,765,983,569.80
小计			<u>5,402,496,750.71</u>
客户信用备付金			
人民币	3,639,074,672.54	1.00000	3,639,074,672.54
港币	48,498,568.75	0.81760	39,652,429.81
小计			<u>3,678,727,102.35</u>
合计			<u>24,343,165,506.63</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

3 融出资金

(1) 按客户类别列示

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
境内		
其中：个人	58,492,560,358.77	64,952,392,428.77
机构	<u>7,721,523,380.93</u>	<u>9,636,581,758.45</u>
小计	<u>66,214,083,739.70</u>	<u>74,588,974,187.22</u>
减：减值准备	<u>(365,972,236.47)</u>	<u>(378,786,450.60)</u>
账面价值小计	<u>65,848,111,503.23</u>	<u>74,210,187,736.62</u>
境外		
其中：个人	908,888,458.81	1,199,246,549.77
机构	<u>621,075,163.42</u>	<u>887,320,924.52</u>
小计	<u>1,529,963,622.23</u>	<u>2,086,567,474.29</u>
减：减值准备	<u>-</u>	<u>-</u>
账面价值小计	<u>1,529,963,622.23</u>	<u>2,086,567,474.29</u>
账面价值合计	<u>67,378,075,125.46</u>	<u>76,296,755,210.91</u>

(2) 融资融券业务担保物公允价值

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
股票	205,557,976,444.88	256,954,344,934.08
资金	9,652,707,729.15	8,412,720,687.20
基金	7,907,565,441.52	8,793,433,754.83
债券	<u>358,225,317.84</u>	<u>224,322,488.06</u>
合计	<u>223,476,474,933.39</u>	<u>274,384,821,864.17</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

4 衍生金融资产和衍生金融负债

	名义金额	2022 年 6 月 30 日	
		非套期工具	
		公允价值	
		资产	负债
权益衍生工具	233,604,144,194.51	5,385,463,094.71	(7,086,345,934.16)
利率衍生工具	300,020,081,572.30	623,872,539.09	(693,695,428.16)
商品衍生工具	85,859,374,801.71	279,260,134.59	(228,213,161.88)
信用衍生工具	4,291,000,000.00	14,159,170.64	(1,895,091.26)
合计	<u>623,774,600,568.52</u>	<u>6,302,754,939.03</u>	<u>(8,010,149,615.46)</u>
		2021 年 12 月 31 日	
		非套期工具	
		公允价值	
		资产	负债
权益衍生工具	218,871,768,877.38	1,516,247,326.12	(6,346,266,633.93)
利率衍生工具	190,193,212,363.69	1,136,210,742.78	(823,572,009.30)
商品衍生工具	67,891,948,753.53	144,969,938.89	(136,012,850.10)
信用衍生工具	820,000,000.00	2,871,612.05	(4,003,964.62)
合计	<u>477,776,929,994.60</u>	<u>2,800,299,619.84</u>	<u>(7,309,855,457.95)</u>

在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本集团所持有的国债期货、股指期货、贵金属期货和其他商品期货产生的公允价值变动金额，而并未反映在上述衍生金融工具科目中。于 2022 年 6 月 30 日，本集团未到期的上述衍生金融工具合约的公允价值为人民币 892,349,688.45 元(2021 年 12 月 31 日：人民币 648,175,712.57 元)。

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

5 存出保证金

	2022 年 6 月 30 日		
	原币金额	折算汇率	人民币金额
交易保证金			
人民币	26,387,501,688.43	1.00000	26,387,501,688.43
美元	540,000.00	6.71140	3,624,156.00
港币	23,694,505.47	0.85519	20,263,304.13
小计			<u>26,411,389,148.56</u>
信用保证金			
人民币	78,123,418.02	1.00000	<u>78,123,418.02</u>
履约保证金			
人民币	3,620,341,055.95	1.00000	3,620,341,055.95
美元	8,966,870.68	6.71140	60,180,255.88
港币	124,867,448.34	0.85519	106,785,393.15
小计			<u>3,787,306,704.98</u>
转融通保证金			
人民币	871,400,065.37	1.00000	<u>871,400,065.37</u>
合计			<u>31,148,219,336.93</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

5 存出保证金(续)

	2021 年 12 月 31 日		
	原币金额	折算汇率	人民币金额
交易保证金			
人民币	20,723,184,337.49	1.00000	20,723,184,337.49
美元	540,000.00	6.37570	3,442,878.00
港币	14,576,398.01	0.81760	11,917,663.01
小计			<u>20,738,544,878.50</u>
信用保证金			
人民币	90,835,244.72	1.00000	90,835,244.72
港币	2,229,003.00	0.81760	1,822,432.85
小计			<u>92,657,677.57</u>
履约保证金			
人民币	3,619,481,717.74	1.00000	3,619,481,717.74
港币	3,204,730,097.24	0.81760	2,620,187,327.50
小计			<u>6,239,669,045.24</u>
转融通保证金			
人民币	2,042,788,422.28	1.00000	<u>2,042,788,422.28</u>
合计			<u>29,113,660,023.59</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

6 应收款项

(1) 按类别列示

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
应收清算款项	6,127,115,835.42	2,840,754,328.73
应收资管业务款	1,488,759,447.58	1,520,015,043.44
应收手续费及佣金	765,957,642.04	336,699,898.01
逾期应收款	151,486,781.84	16,921,142.36
小计	<u>8,533,319,706.88</u>	<u>4,714,390,412.54</u>
减：坏账准备	<u>(632,540,970.32)</u>	<u>(620,653,818.06)</u>
合计	<u>7,900,778,736.56</u>	<u>4,093,736,594.48</u>

(2) 按账龄分析

	2022 年 6 月 30 日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
1 年以内	7,018,919,312.26	82.25	(65,628,500.64)	0.94
1-2 年	100,580,941.80	1.18	(18,669,383.85)	18.56
2-3 年	1,181,226,018.66	13.84	(486,395,877.09)	41.18
3 年以上	232,593,434.16	2.73	(61,847,208.74)	26.59
合计	<u>8,533,319,706.88</u>	<u>100.00</u>	<u>(632,540,970.32)</u>	7.41

	2021 年 12 月 31 日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
1 年以内	3,251,600,074.99	68.97	(56,207,608.80)	1.73
1-2 年	945,036,500.65	20.05	(297,645,285.98)	31.50
2-3 年	420,070,450.21	8.91	(207,723,238.43)	49.45
3 年以上	97,683,386.69	2.07	(59,077,684.85)	60.48
合计	<u>4,714,390,412.54</u>	<u>100.00</u>	<u>(620,653,818.06)</u>	13.17

## 申万宏源集团股份有限公司

### 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

适用于《企业会计准则第 14 号—收入》产生的应收款项，本集团运用预期信用损失简化模型计量其减值准备，本集团采用预期信用损失一般模型计量其余应收款项减值准备。于 2022 年 6 月 30 日，除部分应收资管业务款处于信用减值第三阶段外，其余适用预期信用损失一般模型计量减值准备的应收款项均处于信用减值第一阶段(2021 年 12 月 31 日：第一阶段)。

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

7 买入返售金融资产

(1) 按标的物类别列示

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
债券	23,936,488,494.43	18,060,697,716.48
股票	<u>7,266,067,398.46</u>	<u>8,469,719,452.97</u>
小计	<u>31,202,555,892.89</u>	<u>26,530,417,169.45</u>
减：减值准备	<u>(1,741,091,950.38)</u>	<u>(1,132,232,686.05)</u>
合计	<u>29,461,463,942.51</u>	<u>25,398,184,483.40</u>

(2) 按业务类别列示

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
债券质押式回购	23,936,488,494.43	18,060,697,716.48
股票质押式回购	<u>7,266,067,398.46</u>	<u>8,469,719,452.97</u>
小计	<u>31,202,555,892.89</u>	<u>26,530,417,169.45</u>
减：减值准备	<u>(1,741,091,950.38)</u>	<u>(1,132,232,686.05)</u>
合计	<u>29,461,463,942.51</u>	<u>25,398,184,483.40</u>

于 2022 年 6 月 30 日，股票质押式回购中剩余到期日一年以上的账面余额为人民币 4,658,160,448.08 元(2021 年 12 月 31 日：人民币 5,465,423,376.85 元)。

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

7 买入返售金融资产(续)

(3) 担保物金额

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
担保物	17,874,910,399.97	23,652,228,159.64
其中：可出售或可再次向外 抵押的担保物	-	-
其中：已出售或已再次向 外抵押的担保物	-	-

对于通过交易所操作的国债逆回购交易，因其为交易所自动撮合并保证担保物足值，因此无法获知对手方质押库信息，故上述担保物公允价值未包括交易所国债逆回购所取得的担保物资产的公允价值。于 2022 年 6 月 30 日，上述交易所国债逆回购的金额为人民币 19,167,327,508.47 元(2021 年 12 月 31 日：人民币 11,540,583,985.17 元)。

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

8 金融投资：交易性金融资产

(1) 按类别列示

	2022 年 6 月 30 日					
	初始成本			公允价值		
	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	指定为以公允价值计 量且其变动计入当期 损益的金融资产	初始投资成本合计	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	指定为以公允价值计 量且其变动计入当期 损益的金融资产	公允价值合计
债券	127,884,321,990.01	-	127,884,321,990.01	129,290,906,690.24	-	129,290,906,690.24
公募基金	43,784,343,117.01	-	43,784,343,117.01	43,837,951,174.81	-	43,837,951,174.81
股票	32,746,228,078.67	-	32,746,228,078.67	33,054,394,770.66	-	33,054,394,770.66
券商资管产品	13,363,221,890.07	-	13,363,221,890.07	14,953,211,508.03	-	14,953,211,508.03
银行理财产品	1,829,870,950.45	-	1,829,870,950.45	1,853,974,355.40	-	1,853,974,355.40
信托计划	1,733,908,553.31	-	1,733,908,553.31	1,655,665,982.92	-	1,655,665,982.92
其他	42,727,144,892.82	-	42,727,144,892.82	43,397,335,060.98	-	43,397,335,060.98
合计	<u>264,069,039,472.34</u>	<u>-</u>	<u>264,069,039,472.34</u>	<u>268,043,439,543.04</u>	<u>-</u>	<u>268,043,439,543.04</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

8 金融投资：交易性金融资产(续)

(1) 按类别列示(续)

	2021 年 12 月 31 日					
	初始成本			公允价值		
	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	指定为以公允价值计 量且其变动计入当期 损益的金融资产	初始投资成本合计	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	指定为以公允价值计 量且其变动计入当期 损益的金融资产	公允价值合计
债券	144,889,775,999.26	-	144,889,775,999.26	146,304,116,976.03	-	146,304,116,976.03
公募基金	38,258,622,419.52	-	38,258,622,419.52	38,390,809,808.61	-	38,390,809,808.61
股票	29,360,033,344.90	-	29,360,033,344.90	28,996,263,597.88	-	28,996,263,597.88
券商资管产品	15,809,193,645.71	-	15,809,193,645.71	16,724,613,006.02	-	16,724,613,006.02
银行理财产品	3,626,644,461.34	-	3,626,644,461.34	3,643,068,934.87	-	3,643,068,934.87
信托计划	2,110,421,725.73	-	2,110,421,725.73	1,982,228,365.18	-	1,982,228,365.18
贵金属	22,277,752.18	-	22,277,752.18	22,362,000.00	-	22,362,000.00
其他	36,415,856,236.75	-	36,415,856,236.75	36,512,996,117.01	-	36,512,996,117.01
合计	<u>270,492,825,585.39</u>	<u>-</u>	<u>270,492,825,585.39</u>	<u>272,576,458,805.60</u>	<u>-</u>	<u>272,576,458,805.60</u>

(2) 交易性金融资产中已融出证券情况

本集团交易性金融资产的余额中包含融出证券，详细信息参见附注五、12(1)。本集团融出证券的担保物信息参见附注五、3(2)。

(3) 存在限售期及承诺条件的交易性金融资产

于 2022 年 6 月 30 日，本集团交易性金融资产中有人民币 5,373,066,392.17 元的股票投资存在限售期限(2021 年 12 月 31 日：人民币 5,085,850,569.89 元)。

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

8 金融投资：交易性金融资产(续)

(3) 存在限售期及承诺条件的交易性金融资产(续)

于 2022 年 6 月 30 日，本集团交易性金融资产中有人民币 108,695,094,182.95 元的债券投资为卖出回购业务设定质押(2021 年 12 月 31 日：人民币 108,969,980,678.52 元)。

本集团卖出回购业务的情况参见附注五、25。

于 2022 年 6 月 30 日，本集团交易性金融资产中有人民币 3,166,559,985.00 元的债券投资为债券借贷业务设定质押(2021 年 12 月 31 日：人民币 7,756,397,184.00 元)。

本集团债券借贷业务的情况参见附注十四、3。

9 金融投资：债权投资

	2022 年 6 月 30 日			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值
信托计划	3,551,592,669.5			3,292,507,878.6
	2	29,849,326.16	(288,934,117.07)	1
资产管理计划及其他	1,316,872,734.8			1,046,068,740.1
债券	2	3,648,263.88	(274,452,258.53)	7
	275,582,179.32	12,567,051.26	(40,099,597.40)	248,049,633.18
合计	5,144,047,583.6			4,586,626,251.9
	6	46,064,641.30	(603,485,973.00)	6
	2021 年 12 月 31 日			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值
信托计划	4,257,542,325.3			3,992,107,113.94
	3	23,774,300.29	(289,209,511.68)	
资产管理计划及其他	816,872,734.82			564,576,419.75
债券	484,611,142.40	14,717,144.18	(34,447,394.74)	464,880,891.84
合计	5,559,026,202.5			5,021,564,425.5
	5	39,656,146.72	(577,117,923.74)	3

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

10 金融投资：其他债权投资

(1) 按类别列示

	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
企业债	12,395,391,771.94	269,867,820.18	(227,599,412.32)	12,437,660,179.80	197,470,426.43
公司债	9,595,276,192.16	164,982,764.35	(420,448,432.16)	9,339,810,524.35	323,886,572.57
中期票据	6,182,241,064.94	111,532,150.74	44,156,500.06	6,337,929,715.74	6,233,934.98
地方债	1,914,336,642.42	19,077,634.22	(44,608.42)	1,933,369,668.22	2,618,787.02
金融债	803,955,753.65	17,687,769.85	4,336,761.35	825,980,284.85	621,432.46
国债	109,635,636.43	249,775.34	(232,166.43)	109,653,245.34	-
其他	9,326,224,523.81	268,772,780.80	24,844,094.59	9,619,841,399.20	24,875,436.24
合计	<u>40,327,061,585.35</u>	<u>852,170,695.48</u>	<u>(574,987,263.33)</u>	<u>40,604,245,017.50</u>	<u>555,706,589.70</u>
	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
企业债	13,193,755,959.99	236,362,429.67	(118,278,502.59)	13,311,839,887.07	159,716,141.02
公司债	6,665,877,270.55	86,083,652.07	(303,542,096.57)	6,448,418,826.05	303,122,465.23
中期票据	6,243,558,552.59	112,221,117.82	42,205,587.41	6,397,985,257.82	8,366,306.26
地方债	2,261,609,603.99	33,452,467.09	4,777,431.01	2,299,839,502.09	2,950,873.02
金融债	379,534,233.52	7,326,550.69	1,050,926.48	387,911,710.69	378,804.99
国债	364,520,217.22	1,603,052.01	2,714,692.78	368,837,962.01	-
其他	7,806,222,467.31	134,863,297.23	(30,519,761.13)	7,910,566,003.41	24,679,408.45
合计	<u>36,915,078,305.17</u>	<u>611,912,566.58</u>	<u>(401,591,722.61)</u>	<u>37,125,399,149.14</u>	<u>499,213,998.97</u>

(2) 存在承诺条件的其他债权投资

于 2022 年 6 月 30 日，本集团其他债权投资中有人民币 16,382,819,947.81 元的债券投资为卖出回购业务(附注五、25)设定质押(2021 年 12 月 31 日：人民币 19,395,257,355.15 元)。

于 2022 年 6 月 30 日，本集团其他债权投资中有人民币 6,691,770,993.00 元的债券投资为债券借贷业务设定质押。本集团债券借贷业务的情况参见附注十四、3(2021 年 12 月 31 日：人民币 3,821,390,793.00 元)。

## 申万宏源集团股份有限公司

### 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

#### 五 合并财务报表项目附注(续)

##### 11 金融投资：其他权益工具投资

	2022 年 6 月 30 日		
	初始成本	公允价值	本期确认的股利收入
非交易性权益工具	<u>3,961,902,625.94</u>	<u>3,018,386,382.93</u>	<u>32,279,863.68</u>
	2021 年 12 月 31 日		
	初始成本	公允价值	本年确认的股利收入
非交易性权益工具	<u>3,330,099,469.56</u>	<u>2,623,807,751.94</u>	<u>478,233,226.32</u>

于 2022 年 6 月 30 日，本集团其他权益工具投资中无非交易性权益工具投资为转融通业务(参见附注五、12)设定质押(2021 年 12 月 31 日：无)。

于 2022 年 6 月 30 日，本集团其他权益工具投资中有人民币 494,494,185.33 元的债券投资为卖出回购业务(参见附注五、25)设定质押(2021 年 12 月 31 日：无)。

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间，本集团终止确认的其他权益工具投资累计从其他综合收益转入留存收益的损失金额为人民币 26,405,605.81 元(截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间：无)。

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

12 融出证券

(1) 按项目分析

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
转融通融入证券	2,141,184,033.56	3,455,974,320.80
交易性金融资产	835,442,456.66	1,368,443,360.14
其他权益工具投资	829,563,791.40	1,245,705,168.40
融出证券总额	(a) <u>3,806,190,281.62</u>	<u>6,070,122,849.34</u>
转融通融入证券总额	<u>2,675,614,022.15</u>	<u>4,005,573,443.00</u>

(a) 融出证券的担保物情况参见附注五、3(2)。

(2) 融券业务违约情况

于 2022 年 6 月 30 日，本集团融券业务无重大合约逾期(2021 年 12 月 31 日：无)。

13 长期股权投资

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
合营企业	(1)	
-不重要的合营企业	<u>1,394,501,042.65</u>	<u>1,274,212,711.68</u>
联营企业	(2)	
-重要的联营企业	1,885,080,590.90	1,956,497,862.94
-不重要的联营企业	<u>1,461,033,546.74</u>	<u>1,459,631,849.12</u>
小计	<u>3,346,114,137.64</u>	<u>3,416,129,712.06</u>
小计	<u>4,740,615,180.29</u>	<u>4,690,342,423.74</u>
减：长期股权投资减值准备		
-合营企业	-	-
-联营企业	<u>(178,284,744.12)</u>	<u>(178,284,744.12)</u>
小计	<u>(178,284,744.12)</u>	<u>(178,284,744.12)</u>
合计	<u>4,562,330,436.17</u>	<u>4,512,057,679.62</u>

## 申万宏源集团股份有限公司

### 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

## 五 合并财务报表项目附注(续)

### 13 长期股权投资(续)

#### (1) 合营企业明细情况

被投资单位名称	2022 年 1 月 1 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	其他权 益变动	宣告发放现金 股利或利润	计提 减值准备	其他		
嘉兴宏创建业投资合伙企业(有 限合伙)	262,118,916.11	-	-	5,469,775.19	-	-	-	-	-	267,588,691.30	-
共青城申宏汇创物流产业股权投 资合伙企业(有限合伙)	15,350,370.93	300,000.00	-	9,121,621.39	-	-	-	-	-	24,771,992.32	-
上海申万宏源嘉实股权投资合 伙企业(有限合伙)	990,347.98	51,615.53	-	(435,470.89)	-	-	-	-	-	606,492.62	-
厦门市象屿泓鼎现代物流投资合 伙企业(有限合伙)	155,184.60	-	-	(12,568.97)	-	-	(142,499.60)	-	-	116.03	-
珠海申宏格金医疗健康产业投资 基金合伙企业(有限合伙)	60,334,214.74	-	(98,828.69)	228,571.74	-	-	-	-	-	60,463,957.79	-
辽宁国鑫产业投资基金管理有限 公司	1,974,898.24	-	-	(67,760.28)	-	-	-	-	-	1,907,137.96	-
上海东航申宏股权投资基金管理 有限公司	9,252,168.99	-	-	4,725,006.52	-	-	-	-	-	13,977,175.51	-
金茂投资咨询(深圳)有限公司	35,088,664.94	-	-	16,480,963.11	-	-	-	-	-	51,569,628.05	-

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

13 长期股权投资(续)

(1) 合营企业明细情况(续)

被投资单位名称	2022 年 1 月 1 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	其他权 益变动	宣告发放现金股 利或利润	计提 减值准备	其他		
深圳申万交投西部成长一号股权 投资基金合伙企业(有限合伙)	12,178,902.49	-	-	(3,909,994.44)	-	-	-	-	-	8,268,908.05	-
四川申万宏源长虹股权投资基金 合伙企业(有限合伙)	165,372,598.66	1,692,003.89	-	(882,104.02)	-	-	-	-	-	166,182,498.53	-
韩亚汇创一号(深圳)私募股权投 资基金合伙企业(有限合伙)	410,453.78	-	-	(32.87)	-	-	-	-	-	410,420.91	-
四川发展申万宏源股权投资基金 合伙企业(有限合伙)	104,361,854.67	-	-	(7,881,268.71)	-	-	-	-	-	96,480,585.96	-
宇航一期股权投资基金(上海)合 伙企业(有限合伙)	254,484,409.53	-	-	(5,614,007.31)	-	-	-	-	-	248,870,402.22	-
南京申宏中裕一号股权投资合伙 企业(有限合伙)	351,139,726.02	100,000,000.00	-	15,016,734.02	-	-	(13,753,424.64)	-	-	452,403,035.40	-
贵州优势产业发展股权投资基金 合伙企业(有限合伙)	1,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	1,000,000.00	-
合计	1,274,212,711.68	102,043,619.42	(98,828.69)	32,239,464.48	-	-	(13,895,924.24)	-	-	1,394,501,042.65	-

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

13 长期股权投资(续)

(1) 合营企业明细情况(续)

被投资单位名称	2021 年 1 月 1 日	本年增减变动								2021 年 12 月 31 日	减值准备 年末余额
		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	其他权 益变动	宣告发放现金股 利或利润	计提 减值准备	其他		
嘉兴宏创建业投资合伙企业(有限 合伙)	-	241,720,000.00	-	20,398,916.11	-	-	-	-	-	262,118,916.11	-
共青城申宏汇创物流产业股权投 资合伙企业(有限合伙)	15,040,058.72	310,000.00	-	312.21	-	-	-	-	-	15,350,370.93	-
嘉兴麟茂壹号投资合伙企业(有限 合伙)	235,000,000.00	-	(244,833,351.20)	9,833,351.20	-	-	-	-	-	-	-
上海申万宏源嘉实股权投资合 伙企业(有限合伙)	5,043,215.38	-	(838,189.98)	(1,286,397.98)	-	-	(1,928,279.44)	-	-	990,347.98	-
厦门市象屿泓鼎现代物流投资合 伙企业(有限合伙)	468,400.08	-	-	(313,215.48)	-	-	-	-	-	155,184.60	-
珠海申宏格金医疗健康产业投资 基金合伙企业(有限合伙)	61,767,933.12	-	-	(1,433,718.38)	-	-	-	-	-	60,334,214.74	-
辽宁国鑫产业投资基金管理有限 公司	2,137,630.78	-	-	(162,732.54)	-	-	-	-	-	1,974,898.24	-
上海东航申宏股权投资基金管理 有限公司	3,095,417.26	-	-	6,156,751.73	-	-	-	-	-	9,252,168.99	-
金茂投资咨询(深圳)有限公司	18,540,844.41	-	-	16,547,820.53	-	-	-	-	-	35,088,664.94	-
深圳申万交投西部成长一号股权 投资基金合伙企业(有限合伙)	8,549,855.00	3,698,958.71	-	(69,911.22)	-	-	-	-	-	12,178,902.49	-
四川申万宏源长虹股权投资基金 合伙企业(有限合伙)	170,993,118.67	-	(3,613,525.63)	(2,006,994.38)	-	-	-	-	-	165,372,598.66	-
四川发展证券投资基金管理有限 公司	23,925,642.63	-	(8,000,000.00)	(15,925,642.63)	-	-	-	-	-	-	-
韩亚汇创一号(深圳)私募股权投 资基金合伙企业(有限合伙)	-	1,358,421.00	-	(947,967.22)	-	-	-	-	-	410,453.78	-
四川发展申万宏源股权投资基金 合伙企业(有限合伙)	90,434,603.96	-	-	13,927,250.71	-	-	-	-	-	104,361,854.67	-
宇航一期股权投资基金(上海)合 伙企业(有限合伙)	264,489,923.79	-	-	(10,005,514.26)	-	-	-	-	-	254,484,409.53	-
南京申宏中裕一号股权投资合 伙企业(有限合伙)	250,000,000.00	100,000,000.00	-	23,533,109.32	-	-	(22,393,383.30)	-	-	351,139,726.02	-
贵州优势产业发展股权投资基金 合伙企业(有限合伙)	-	1,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	1,000,000.00	-
合计	1,149,486,643.80	348,087,379.71	(257,285,066.81)	58,245,417.72	-	-	(24,321,662.74)	-	-	1,274,212,711.68	-

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

13 长期股权投资(续)

(2) 联营企业明细情况

被投资单位名称	2022 年 1 月 1 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	其他权 益变动	宣告发放现金股利 或利润	计提 减值准备	其他		
霍尔果斯天山一号产业投资基金有 限合伙企业	91,900,018.25	-	-	(8,076,360.62)	-	-	-	-	-	83,823,657.63	(178,284,744.12)
新疆金投资资产管理股份有限公司	197,521,371.50	-	-	13,552,715.09	-	-	(7,200,000.00)	-	-	203,874,086.59	-
富国基金管理有限公司	1,956,497,862.94	-	-	313,067,613.38	4,365,114.59	-	(388,850,000.00)	-	-	1,885,080,590.91	-
桐乡申万泓鼎成长二号股权投资基 金合伙企业(有限合伙)	52,778,746.70	-	-	129,516.49	-	-	-	-	-	52,908,263.19	-
重庆市富荣股权投资基金合伙企业 (有限合伙)	511,344.55	501,253.65	-	(276.60)	-	-	-	-	-	1,012,321.60	-
河南省国创混改基金管理有限公司	349,553.74	-	-	(53,351.50)	-	-	-	-	-	296,202.24	-
新疆天山产业投资基金管理 有限公司	12,973,756.97	1,140,610.17	-	1,494,899.85	-	-	-	-	-	15,609,266.99	-
南京洛德汇智股权投资合伙企业(有 限合伙)	309,818,699.66	-	-	(164,178.71)	-	-	-	-	-	309,654,520.95	-
泓源股权投资管理(山东)有限公司	400,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	400,000.00	-
宜宾市国资产业投资合伙企业(有限 合伙)	20,024,706.18	-	-	(90,780.90)	-	-	-	-	-	19,933,925.28	-
北京城建(芜湖)股权投资管理有限 公司	36,213,170.57	-	-	189,242.81	-	-	-	-	-	36,402,413.38	-
申宏汇创发展(佛山)股权投资合伙 企业(有限合伙)	25,229,298.53	-	-	(430,911.59)	-	-	-	-	-	24,798,386.94	-
恒禧(嘉兴)股权投资合伙企业(有限 合伙)	503,616,438.35	-	-	19,835,616.44	-	-	(20,054,794.52)	-	-	503,397,260.27	-
共青城申宏汇创二期物流产业股权 投资合伙企业(有限合伙)	30,010,000.00	600,000.00	-	28,497.55	-	-	-	-	-	30,638,497.55	-
合计	3,237,844,967.94	2,241,863.82	-	339,482,241.69	4,365,114.59	-	(416,104,794.52)	-	-	3,167,829,393.52	(178,284,744.12)

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

13 长期股权投资(续)

(2) 联营企业明细情况(续)

被投资单位名称	2021 年 1 月 1 日	本年增减变动								2021 年 12 月 31 日	减值准备 年末余额
		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	其他权 益变动	宣告发放现金股利 或利润	计提 减值准备	其他		
霍尔果斯天山一号产业投资基金有限 合伙企业	90,261,093.86	-	-	1,638,924.39	-	-	-	-	-	91,900,018.25	(178,284,744.12)
新疆金投资产管理股份有限公司	198,448,637.71	-	-	6,272,733.79	-	-	(7,200,000.00)	-	-	197,521,371.50	-
富国基金管理有限公司	1,448,836,624.98	-	-	710,385,561.84	(2,188,823.88)	-	(200,535,500.00)	-	-	1,956,497,862.94	-
桐乡申万泓鼎成长二号股权投资基金 合伙企业(有限合伙)	51,683,752.98	-	-	1,094,993.72	-	-	-	-	-	52,778,746.70	-
重庆市富荣股权投资基金合伙企业 (有限合伙)	498,746.35	-	-	12,598.20	-	-	-	-	-	511,344.55	-
河南省国创混改基金管理有限公司	314,147.45	-	-	35,406.29	-	-	-	-	-	349,553.74	-
新疆天山产业投资基金管理有限公司	13,979,797.75	-	-	(1,006,040.78)	-	-	-	-	-	12,973,756.97	-
南京洛德汇智股权投资合伙企业(有 限合伙)	328,528,956.33	-	-	(616,655.16)	-	-	(18,093,601.51)	-	-	309,818,699.66	-
嘉兴明茂投资合伙企业(有限合伙)	359,947,852.12	-	(363,230,000.00)	3,282,147.88	-	-	-	-	-	-	-
泓源股权投资管理(山东)有限公司	400,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	400,000.00	-
宜宾市国资产业投资合伙企业(有限 合伙)	20,064,394.78	-	-	(39,688.60)	-	-	-	-	-	20,024,706.18	-
北京城建(芜湖)股权投资管理有限公司	37,820,766.39	-	(107,595.82)	1,500,000.00	-	-	(3,000,000.00)	-	-	36,213,170.57	-
申宏汇创发展(佛山)股权投资合伙企 业(有限合伙)	24,808,533.27	-	(275.27)	421,040.53	-	-	-	-	-	25,229,298.53	-
恒禧(嘉兴)股权投资合伙企业(有限 合伙)	503,844,821.92	-	-	(228,383.57)	-	-	-	-	-	503,616,438.35	-
广州洛悦置业有限公司	477,588,951.09	-	(477,588,951.09)	-	-	-	-	-	-	-	-
共青城申宏汇创二期物流产业股权投 资合伙企业(有限合伙)	-	30,010,000.00	-	-	-	-	-	-	-	30,010,000.00	-
合计	3,557,027,076.98	30,010,000.00	(840,926,822.18)	722,752,638.53	(2,188,823.88)	-	(228,829,101.51)	-	-	3,237,844,967.94	(178,284,744.12)

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

13 长期股权投资(续)

(3) 合营企业基本情况

合营企业	主要经营地/ 注册地	业务性质	实收资本	持股比例	
				直接	间接
深圳申万交投西部成长一号股权投资基金合伙企业(有限合伙)	(a) 广东深圳	股权投资	人民币 0.58 亿元	-	17.54%
上海申万宏源嘉实股权投资合伙企业(有限合伙)	上海	股权投资	人民币 1.00 亿元	-	31.00%
厦门市象屿泓鼎现代物流投资合伙企业(有限合伙)	福建厦门	股权投资	人民币 0.40 亿元	-	50.00%
四川申万宏源长虹股权投资基金合伙企业(有限合伙)	(b) 四川绵阳	股权投资	人民币 3.10 亿元	-	51.61%
四川发展申万宏源股权投资基金合伙企业(有限合伙)	四川成都	股权投资	人民币 3.00 亿元	-	34.00%
辽宁国鑫产业投资基金管理有限公司	辽宁沈阳	投资管理	人民币 0.10 亿元	-	26.00%
珠海申宏格金医疗健康产业投资基金合伙企业(有限合伙)	广东珠海	股权投资	人民币 2.51 亿元	-	25.00%
宇航一期股权投资基金(上海)合伙企业(有限合伙)	上海	股权投资	人民币 7.05 亿元	30.00%	-
金茂投资咨询(深圳)有限公司	广东深圳	投资咨询	人民币 0.14 亿元	-	50.00%
上海东航申宏股权投资基金管理有限公司	上海	股权投资	人民币 0.03 亿元	-	40.00%
南京申宏中裕一号股权投资合伙企业(有限合伙)	江苏南京	股权投资	人民币 7.00 亿元	24.99%	0.06%
共青城申宏汇创物流产业股权投资合伙企业(有限合伙)	江西九江	股权投资	人民币 0.41 亿元	37.49%	0.02%
嘉兴宏创建业投资合伙企业(有限合伙)	浙江嘉兴	股权投资	人民币 10.01 亿元	49.95%	-
韩亚汇创一号(深圳)私募股权投资基金合伙企业(有限合伙)	广东深圳	股权投资	人民币 2.00 亿元	40.00%	-
贵州优势产业发展股权投资基金合伙企业(有限合伙)	(a) 贵州贵阳	股权投资	人民币 3.00 亿元	0.33%	-

(4) 联营企业基本情况

联营企业	主要经营地/ 注册地	业务性质	实收资本	持股比例	
				直接	间接
富国基金管理有限公司	上海	基金管理	人民币 5.20 亿元	-	27.775%
北京城建(芜湖)股权投资管理有限公司	安徽芜湖	投资管理	人民币 1.00 亿元	-	30.00%
新疆天山产业投资基金管理有限公司	新疆乌鲁木齐	投资管理	人民币 0.50 亿元	-	30.00%
霍尔果斯天山一号产业投资基金有限合伙企业	新疆霍尔果斯	股权投资	人民币 15.10 亿元	33.11%	-
新疆金投资产管理股份有限公司	(a) 新疆乌鲁木齐	资产管理	人民币 10.00 亿元	18.00%	-
共青城申宏汇创二期物流产业股权投资合伙企业(有限合伙)	(a) 江西九江	股权投资	人民币 1.33 亿元	0.01%	-
河南省国创混改基金管理有限公司	河南郑州	投资管理	人民币 0.05 亿元	-	30.00%
桐乡申万泓鼎成长二号股权投资基金合伙企业(有限合伙)	(a) 浙江嘉兴	股权投资	人民币 3.80 亿元	-	13.16%
重庆市富荣股权投资基金合伙企业(有限合伙)	(a) 重庆	股权投资	人民币 0.50 亿元	-	1.00%
申宏汇创发展(佛山)股权投资合伙企业(有限合伙)	广东佛山	股权投资	人民币 0.80 亿元	30.00%	1.00%
恒禧(嘉兴)股权投资合伙企业(有限合伙)	浙江嘉兴	股权投资	人民币 20.50 亿元	20.40%	0.04%
宜宾市国资产业投资合伙企业(有限合伙)	(a) 四川宜宾	股权投资	人民币 20.20 亿元	-	1.00%
泓源股权投资管理(山东)有限公司	山东烟台	投资管理	人民币 0.02 亿元	-	20.00%
南京洛德汇智股权投资合伙企业(有限合伙)	江苏南京	股权投资	人民币 12.02 亿元	-	20.00%

(a) 本集团于该被投资企业的股权低于 20%，但由于公司章程细则、有限合伙协议及其他公司治理文件载明的相关安排，本集团对该被投资企业拥有重大影响或共同控制。

(b) 本集团于该被投资企业的股权高于 50%，但由于公司章程细则、有限合伙协议及其他公司治理文件载明的相关安排，本集团对该被投资企业拥有重大影响或共同控制。

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

13 长期股权投资(续)

(4) 联营企业基本情况(续)

所有上述联营企业及合营企业均使用权益法进行核算。

(5) 重要联营企业的主要财务信息

下表列示了本集团重要联营企业的主要财务信息。该联营企业的重要会计政策、会计估计与本集团的会计政策、会计估计无重大差异，该联营企业的主要财务信息是在按投资时公允价值为基础调整后的金额。此外，下表还列示了这些财务信息按照权益法调整至本集团对联营企业投资账面价值的调节过程：

	富国基金管理有限公司	
	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
资产总额	12,243,844,069.95	12,646,262,042.10
负债总额	(5,456,875,245.78)	(5,597,222,479.63)
净资产	6,786,968,824.17	7,049,039,562.47
持股比例	27.775%	27.775%
按持股比例计算的净资产份额	1,885,080,590.91	1,957,870,738.47
其他调整	-	(1,372,875.53)
对联营企业投资的账面价值	1,885,080,590.91	1,956,497,862.94
	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
营业收入	3,772,562,283.29	3,998,339,410.40
净利润	1,122,213,277.60	1,241,936,015.26
其他综合收益	15,715,984.10	(2,584,136.61)
其他调整	-	(1,412,972.53)
综合收益总额	1,137,929,261.70	1,237,938,906.12
本期收到的来自联营企业的股利	-	200,535,500.00

于 2022 年 6 月 30 日，本集团重要联营企业为非上市企业，不存在公开市场报价(2021 年 12 月 31 日：同)。

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

13 长期股权投资(续)

(6) 不重要合营企业和联营企业的汇总财务信息

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
合营企业：		
投资账面价值合计	1,394,501,042.65	1,274,212,711.68
下列各项按持股比例计算的合计数		
-净利润	32,239,464.48	58,245,417.72
-其他综合收益	-	-
-综合收益总额	<u>32,239,464.48</u>	<u>58,245,417.72</u>
联营企业：		
投资账面价值合计	1,282,748,802.62	1,281,347,105.00
下列各项按持股比例计算的合计数		
-净利润	26,414,628.31	12,367,076.69
-其他综合收益	-	-
-综合收益总额	<u>26,414,628.31</u>	<u>12,367,076.69</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

14 投资性房地产

房屋及建筑物

成本

2021 年 1 月 1 日余额	81,431,609.47
2021 年 12 月 31 日余额	<u>81,431,609.47</u>
2022 年 6 月 30 日余额	<u>81,431,609.47</u>

减：累计折旧

2021 年 1 月 1 日余额	(24,480,163.77)
本年增加	(4,485,651.70)
2021 年 12 月 31 日余额	<u>(28,965,815.47)</u>
本期增加	(2,242,825.83)
2022 年 6 月 30 日余额	<u>(31,208,641.30)</u>

账面价值

2022 年 6 月 30 日余额	<u>50,222,968.17</u>
2021 年 12 月 31 日余额	<u>52,465,794.00</u>

于 2022 年 6 月 30 日，本集团的投资性房地产无需计提减值准备(2021 年 12 月 31 日：无)。

于 2022 年 6 月 30 日，本集团投资性房地产无尚未办妥产权证的情况(2021 年 12 月 31 日：无)。

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

15 固定资产

(1) 账面价值

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
固定资产	3,080,348,658.46	3,061,018,736.13
减：累计折旧	(1,948,968,574.90)	(1,917,146,324.79)
固定资产减值准备	<u>(18,070,306.56)</u>	<u>(17,387,902.52)</u>
合计	<u>1,113,309,777.00</u>	<u>1,126,484,508.82</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 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

	房屋及建筑物	运输工具	机械动力设备	电子电器设备	其他设备	自有固定资产装修	合计
成本							
2021 年 1 月 1 日余额	1,708,216,391.06	54,960,158.41	19,548,040.13	1,136,441,457.40	86,177,083.68	85,283,090.79	3,090,626,221.47
本年增加							
-本年购置	2,294,694.50	1,544,776.85	197,457.72	127,606,842.94	5,224,959.07	32,934,631.95	169,803,363.03
-在建工程转入	3,368,900.00	-	-	13,553,712.33	1,554,551.75	5,495,662.59	23,972,826.67
本年减少							
-转让和出售	(1,026,144.00)	(214,000.00)	(932,872.30)	(12,697,423.50)	(870,532.50)	-	(15,740,972.30)
-清理报废	(41,515,787.80)	(6,994,048.98)	(962,504.46)	(146,118,416.20)	(10,196,789.70)	(1,855,155.60)	(207,642,702.74)
2021 年 12 月 31 日余额	<u>1,671,338,053.76</u>	<u>49,296,886.28</u>	<u>17,850,121.09</u>	<u>1,118,786,172.97</u>	<u>81,889,272.30</u>	<u>121,858,229.73</u>	<u>3,061,018,736.13</u>
本期增加							
-本期购置	1,228,800.00	1,135,982.31	-	14,521,560.80	11,017,998.66	30,554.67	27,934,896.44
-在建工程转入	-	-	-	51,046,541.99	24,982.30	22,624.92	51,094,149.21
本期减少							
-转让和出售	-	-	(480,525.00)	(3,317,422.40)	(286,065.19)	-	(4,084,012.59)
-清理报废	-	(1,839,096.00)	(538,409.05)	(52,182,901.51)	(1,054,704.17)	-	(55,615,110.73)
2022 年 6 月 30 日余额	<u>1,672,566,853.76</u>	<u>48,593,772.59</u>	<u>16,831,187.04</u>	<u>1,128,853,951.85</u>	<u>91,591,483.90</u>	<u>121,911,409.32</u>	<u>3,080,348,658.46</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 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(续)

	房屋及建筑物	运输工具	机械动力设备	电子电器设备	其他设备	自有固定资产装修	合计
减：累计折旧							
2021 年 1 月 1 日余额	(811,858,219.82)	(46,858,118.02)	(16,695,568.81)	(909,358,257.68)	(73,498,106.18)	(77,067,376.59)	(1,935,335,647.10)
本年计提	(61,981,489.39)	(1,936,489.15)	(561,103.34)	(86,644,077.47)	(4,595,155.61)	(9,401,343.74)	(165,119,658.70)
本年减少	25,651,962.55	6,791,695.21	1,711,817.75	137,395,743.32	9,936,482.38	1,821,279.80	183,308,981.01
2021 年 12 月 31 日余额	(848,187,746.66)	(42,002,911.96)	(15,544,854.40)	(858,606,591.83)	(68,156,779.41)	(84,647,440.53)	(1,917,146,324.79)
本期计提	(27,385,282.63)	(834,730.33)	(107,497.05)	(55,843,021.79)	(1,084,699.41)	(2,555,999.91)	(87,811,231.12)
本期减少	-	1,739,110.17	961,106.64	52,028,672.78	1,260,091.42	-	55,988,981.01
2022 年 6 月 30 日余额	(875,573,029.29)	(41,098,532.12)	(14,691,244.81)	(862,420,940.84)	(67,981,387.40)	(87,203,440.44)	(1,948,968,574.90)
减：减值准备							
2021 年 1 月 1 日余额	(18,153,312.88)	-	-	-	-	-	(18,153,312.88)
本年减少	765,410.36	-	-	-	-	-	765,410.36
2021 年 12 月 31 日余额	(17,387,902.52)	-	-	-	-	-	(17,387,902.52)
本期增加	(682,404.04)	-	-	-	-	-	(682,404.04)
2022 年 6 月 30 日余额	(18,070,306.56)	-	-	-	-	-	(18,070,306.56)
账面价值							
2022 年 6 月 30 日	778,923,517.91	7,495,240.47	2,139,942.23	266,433,011.01	23,610,096.50	34,707,968.88	1,113,309,777.00
2021 年 12 月 31 日	805,762,404.58	7,293,974.32	2,305,266.69	260,179,581.14	13,732,492.89	37,210,789.20	1,126,484,508.82

申万宏源集团股份有限公司  
财务报表附注  
截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

15 固定资产(续)

(3) 暂时闲置的固定资产情况

于 2022 年 6 月 30 日，本集团无闲置的重大固定资产(2021 年 12 月 31 日：无)。

(4) 通过经营租赁租出的固定资产的情况

于 2022 年 6 月 30 日，本集团无通过经营租赁租出的重大固定资产(2021 年 12 月 31 日：无)。

(5) 未办妥产权证书的固定资产情况

于 2022 年 6 月 30 日，本集团尚未办妥产权证书的固定资产账面价值为人民币 25,798,676.84 元(2021 年 12 月 31 日：人民币 26,784,379.95 元)。

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外, 金额单位为人民币元)  
 五 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

	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
无形资产开发支出	108,951,288.94	-	108,951,288.94	109,462,754.74	-	109,462,754.74
自有房产装修工程	44,728,045.14	-	44,728,045.14	42,358,182.95	-	42,358,182.95
租入房产装修工程	41,742,189.60	-	41,742,189.60	28,883,399.92	-	28,883,399.92
其他	8,239,305.49	-	8,239,305.49	46,362,994.63	-	46,362,994.63
合计	<u>203,660,829.17</u>	<u>-</u>	<u>203,660,829.17</u>	<u>227,067,332.24</u>	<u>-</u>	<u>227,067,332.24</u>

(2) 在建工程项目变动

工程名称	资金来源	2022 年		本期转入 固定资产	其他减少	2022 年 6 月 30 日
		1 月 1 日	本期增加			
无形资产开发支出	自有	109,462,754.74	35,812,670.51	-	(36,324,136.31)	108,951,288.94
自有房产装修工程	自有	42,358,182.95	2,392,487.11	(22,624.92)	-	44,728,045.14
租入房产装修工程	自有	28,883,399.92	16,915,042.75	-	(4,056,253.07)	41,742,189.60
其他	自有	46,362,994.63	12,947,835.15	(51,071,524.29)	-	8,239,305.49
合计		<u>227,067,332.24</u>	<u>68,068,035.52</u>	<u>(51,094,149.21)</u>	<u>(40,380,389.38)</u>	<u>203,660,829.17</u>

  

工程名称	资金来源	2021 年		本年转入 固定资产	其他减少	2021 年 12 月 31 日
		1 月 1 日	本年增加			
无形资产开发支出	自有	88,207,746.06	152,332,409.70	-	(131,077,401.02)	109,462,754.74
自有房产装修工程	自有	34,572,571.17	13,281,274.37	(5,495,662.59)	-	42,358,182.95
租入房产装修工程	自有	6,885,302.17	44,370,555.64	-	(22,372,457.89)	28,883,399.92
其他	自有	28,486,303.04	36,353,855.67	(18,477,164.08)	-	46,362,994.63
合计		<u>158,151,922.44</u>	<u>246,338,095.38</u>	<u>(23,972,826.67)</u>	<u>(153,449,858.91)</u>	<u>227,067,332.24</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外, 金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

17 无形资产

	计算机软件	其他	合计
成本			
2021 年 1 月 1 日余额	648,039,875.20	331,965,436.48	980,005,311.68
本年增加	160,592,970.99	1,407,602.00	162,000,572.99
本年减少	-	(57,757.00)	(57,757.00)
2021 年 12 月 31 日余额	808,632,846.19	333,315,281.48	1,141,948,127.67
本期增加	43,601,271.61	13,622.00	43,614,893.61
本期减少	-	(1,872.50)	(1,872.50)
2022 年 6 月 30 日余额	852,234,117.80	333,327,030.98	1,185,561,148.78
减: 累计摊销			
2021 年 1 月 1 日余额	(479,279,110.79)	(312,147,767.59)	(791,426,878.38)
本年增加	(98,288,747.05)	(1,433,719.91)	(99,722,466.96)
本年减少	-	57,757.00	57,757.00
2021 年 12 月 31 日余额	(577,567,857.84)	(313,523,730.50)	(891,091,588.34)
本期增加	(62,070,608.73)	(386,339.46)	(62,456,948.19)
本期减少	-	1,872.50	1,872.50
2022 年 6 月 30 日余额	(639,638,466.57)	(313,908,197.46)	(953,546,664.03)
减: 减值准备			
2021 年 1 月 1 日余额	-	(675,579.92)	(675,579.92)
2021 年 12 月 31 日余额	-	(675,579.92)	(675,579.92)
2022 年 6 月 30 日余额	-	(675,579.92)	(675,579.92)
账面价值			
2022 年 6 月 30 日	212,595,651.23	18,743,253.60	231,338,904.83
2021 年 12 月 31 日	231,064,988.35	19,115,971.06	250,180,959.41

于 2022 年 6 月 30 日, 本集团无用于抵押或担保的重大无形资产(2021 年 12 月 31 日: 无)。

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外, 金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

18 递延所得税资产和递延所得税负债

(1) 递延所得税资产

项目	2022 年 6 月 30 日	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
应付职工薪酬	4,654,149,278.79	1,163,537,319.70
可抵扣亏损	4,341,204,711.52	1,000,677,544.62
资产减值准备	2,935,704,418.87	733,325,231.11
吸收合并重组交易	1,854,339,690.16	463,584,922.54
其他权益工具投资	943,516,243.02	235,444,358.80
其他债权投资	574,987,263.32	120,395,254.11
交易性金融资产	171,453,949.85	40,781,391.66
其他	194,332,031.16	48,562,452.72
合计	<u>15,669,687,586.69</u>	<u>3,806,308,475.26</u>

项目	2021 年 12 月 31 日	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
应付职工薪酬	4,150,924,219.72	1,037,731,054.93
资产减值准备	2,821,238,527.24	704,929,395.33
吸收合并重组交易	1,854,339,690.16	463,584,922.54
衍生金融工具	753,869,420.50	188,467,355.13
其他权益工具投资	706,291,717.62	176,572,929.41
可抵扣亏损	569,565,783.36	142,391,445.84
其他债权投资	542,512,487.86	109,558,023.96
交易性金融资产	182,353,108.75	36,821,327.79
交易性金融负债	21,121,944.13	5,280,486.03
其他	216,231,944.99	51,749,666.59
合计	<u>11,818,448,844.33</u>	<u>2,917,086,607.55</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外, 金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

18 递延所得税资产和递延所得税负债(续)

(2) 递延所得税负债

项目	2022 年 6 月 30 日	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
交易性金融资产	3,071,876,947.46	767,969,236.88
衍生金融工具	1,455,708,773.50	363,927,193.37
交易性金融负债	3,978,921.95	994,730.49
其他	14,384,401.22	3,285,208.16
合计	<u>4,545,949,044.13</u>	<u>1,136,176,368.90</u>

项目	2021 年 12 月 31 日	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
交易性金融资产	1,349,639,445.06	337,251,662.18
其他债权投资	140,920,765.25	23,251,926.27
交易性金融负债	46,323,585.94	7,643,391.68
其他	24,609,681.42	5,834,223.40
合计	<u>1,561,493,477.67</u>	<u>373,981,203.53</u>

(3) 抵销后的递延所得税资产和递延所得税负债净额列示如下:

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
递延所得税资产	2,674,863,925.98	2,570,403,334.75
递延所得税负债	<u>4,731,819.62</u>	<u>27,297,930.73</u>

(4) 未确认递延所得税资产额可抵扣亏损金额

项目	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
可抵扣亏损	<u>739,700,652.85</u>	<u>465,788,592.81</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

19 其他资产

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
大宗商品存货	1,508,434,651.14	2,164,581,412.13
其他应收款 (1)	422,910,667.04	783,815,033.59
应收股利	388,850,000.00	-
待抵扣税项	371,019,029.85	104,473,275.03
预付款项	225,859,463.72	104,747,522.71
长期待摊费用 (2)	77,612,795.91	87,046,191.80
应收利息	38,051,786.25	49,962,013.01
待摊费用	4,276,926.36	16,120,809.23
抵债资产	3,460,129.00	3,460,129.00
其他 (3)	28,409,245.53	36,509,849.62
合计	<u>3,068,884,694.80</u>	<u>3,350,716,236.12</u>

(1) 其他应收款

(a) 按明细列示

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
其他应收款余额	706,959,374.87	1,068,513,917.10
减：坏账准备	<u>(284,048,707.83)</u>	<u>(284,698,883.51)</u>
合计	<u>422,910,667.04</u>	<u>783,815,033.59</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外, 金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

19 其他资产(续)

(1) 其他应收款(续)

(b) 按账龄分析

	2022 年 6 月 30 日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
1 年以内	319,817,049.72	45.24	(9,925,227.68)	3.10
1-2 年	92,567,325.68	13.09	(11,579,943.01)	12.51
2-3 年	26,951,408.06	3.81	(20,100,755.75)	74.58
3 年以上	267,623,591.41	37.86	(242,442,781.39)	90.59
合计	<u>706,959,374.87</u>	<u>100.00</u>	<u>(284,048,707.83)</u>	40.18
	2021 年 12 月 31 日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
1 年以内	750,056,306.78	70.20	(16,484,649.84)	2.20
1-2 年	32,831,246.58	3.07	(16,240,361.67)	49.47
2-3 年	38,545,376.24	3.61	(22,840,739.11)	59.26
3 年以上	247,080,987.50	23.12	(229,133,132.89)	92.74
合计	<u>1,068,513,917.10</u>	<u>100.00</u>	<u>(284,698,883.51)</u>	26.64

(c) 按欠款方归集的期末余额前五名的其他应收款情况

	性质	2022 年 6 月 30 日		
		金额	账龄	占其他应收款 余额的比例(%)
武汉葛化集团有限公司	应收往来款	63,415,529.00	3 年以上	8.97
北海新宏源物业发展有限公 司	应收往来款	30,252,423.87	3 年以上	4.28
中国证券投资者保护基金有 限责任公司	应收往来款	24,974,865.15	3 年以上	3.53
郭熙华	应收往来款	23,810,491.74	3 年以上	3.37
湖北潜江恒达公司	应收往来款	18,186,967.14	3 年以上	2.57
合计		<u>160,640,276.90</u>		<u>22.72</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外, 金额单位为人民币元)  
 五 合并财务报表项目附注(续)

19 其他资产(续)

(1) 其他应收款(续)

(c) 按欠款方归集的期末余额前五名的其他应收款情况(续)

2021 年 12 月 31 日				
	性质	金额	账龄	占其他应收款 余额的比例(%)
武汉葛化集团有限公司	应收往来款	63,415,529.00	3 年以上	5.93
北海新宏源物业发展有限公 司	应收往来款	30,252,423.87	3 年以上	2.83
中国证券投资者保护基金有 限责任公司	应收往来款	24,974,865.15	3 年以上	2.34
郭熙华	应收往来款	23,810,491.74	3 年以上	2.23
湖北潜江恒达公司	应收往来款	18,186,967.14	3 年以上	1.70
合计		<u>160,640,276.90</u>		<u>15.03</u>

(2) 长期待摊费用

	2022 年 1 月 1 日余额	本期购入	在建工程转入	本期摊销	本期转出	2022 年 6 月 30 日余额
经营租赁租入 固定资产改 良支出	75,716,313.66	3,442,470.85	3,534,396.74	(16,932,119.81)	-	65,761,061.44
其他	11,329,878.14	-	521,856.33	-	-	11,851,734.47
合计	<u>87,046,191.80</u>	<u>3,442,470.85</u>	<u>4,056,253.07</u>	<u>(16,932,119.81)</u>	<u>-</u>	<u>77,612,795.91</u>
	2021 年 1 月 1 日余额	本年购入	在建工程转入	本年摊销	本年转出	2021 年 12 月 31 日余额
经营租赁租入 固定资产改 良支出	71,259,316.63	14,560,932.28	21,745,176.83	(31,849,112.08)	-	75,716,313.66
其他	15,098,430.99	201,008.81	627,281.06	(4,596,842.72)	-	11,329,878.14
合计	<u>86,357,747.62</u>	<u>14,761,941.09</u>	<u>22,372,457.89</u>	<u>(36,445,954.80)</u>	<u>-</u>	<u>87,046,191.80</u>

(3) 于 2022 年 6 月 30 日, 其他包括本公司因收购子公司形成的商誉。商誉减值评估每年执行一次。可收回金额根据资产的公允价值减去处置费用后的净额与使用现值两者之间较高者确定。

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

20 资产减值准备

本期确认的损失准备主要受以下多种因素影响：

—本期计提，主要是新增金融资产计提的损失准备和存量业务因市场变化导致违约概率、违约损失率以及现金流回收预期变动，阶段变化对预期信用损失计量的影响，以及模型参数和假设更新导致的减值计提；

—本期转回，包括本期到期赎回或处置金融资产而转回相应的损失准备，以及模型参数和假设更新导致的减值转回；

—阶段转移，是由于金融资产信用风险显著增加(或减少)或发生信用减值，而导致金融资产在第一阶段、第二阶段、第三阶段之间发生转移，以及相应导致损失准备的计量基础在 12 个月和整个存续期之间转换；

—外汇和其他变动，是指外币资产由于外币折算对预期信用损失产生影响，以及其他变动。

	附注	2022 年 1 月 1 日	本期计提	本期转回	本期核销	其他变动	2022 年 6 月 30 日
货币资金	五、1	1,268,290.18	171,160.73	(58,324.00)	-	12,592.65	1,393,719.56
融出资金(1)	五、3	378,786,450.60	49,914,126.62	(61,444,398.10)	-	(1,283,942.65)	365,972,236.47
应收款项	五、6	620,653,818.06	10,442,116.37	-	-	1,445,035.89	632,540,970.32
买入返售金融资产(2)	五、7	1,132,232,686.05	648,329,935.98	(39,470,671.65)	-	-	1,741,091,950.38
债权投资(3)	五、9	577,117,923.74	26,541,575.33	(1,885,283.20)	-	1,711,757.13	603,485,973.00
其他债权投资(4)	五、10	499,213,998.97	115,632,196.07	(66,886,149.31)	-	7,746,543.97	555,706,589.70
其他金融资产		287,873,413.13	3,075,214.16	-	-	(913,986.00)	290,034,641.29
金融工具及其他项目							
信用减值准备小计		3,497,146,580.73	854,106,325.26	(169,744,826.26)	-	8,718,000.99	4,190,226,080.72
长期股权投资	五、13	178,284,744.12	-	-	-	-	178,284,744.12
固定资产	五、15	17,387,902.52	-	-	-	682,404.04	18,070,306.56
无形资产	五、17	675,579.92	-	-	-	-	675,579.92
存货跌价准备		136,691,352.97	-	(24,267,341.62)	-	-	112,424,011.35
其他资产减值准备小计		333,039,579.53	-	(24,267,341.62)	-	682,404.04	309,454,641.95
合计		3,830,186,160.26	854,106,325.26	(194,012,167.88)	-	9,400,405.03	4,499,680,722.67

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

20 资产减值准备(续)

	附注	2021 年 1 月 1 日	本年计提	本年转回	本年核销	其他变动	2021 年 12 月 31 日
货币资金	五、1	3,698,703.83	165,577.00	(2,595,990.65)	-	-	1,268,290.18
融出资金(1)	五、3	340,239,373.24	170,673,905.42	(132,044,107.24)	-	(82,720.82)	378,786,450.60
应收款项	五、6	557,636,633.24	63,017,184.82	-	-	-	620,653,818.06
买入返售金融资产(2)	五、7	988,979,545.22	278,005,905.31	(134,752,764.48)	-	-	1,132,232,686.05
债权投资(3)	五、9	539,661,362.40	51,081,038.85	(12,831,984.42)	-	(792,493.09)	577,117,923.74
其他债权投资(4)	五、10	289,448,326.65	276,000,537.17	(64,698,299.18)	-	(1,536,565.67)	499,213,998.97
其他金融资产		259,627,957.13	29,949,099.71	-	-	(1,703,643.71)	287,873,413.13
金融工具及其他项目 信用减值准备小计		<u>2,979,291,901.71</u>	<u>868,893,248.28</u>	<u>(346,923,145.97)</u>	<u>-</u>	<u>(4,115,423.29)</u>	<u>3,497,146,580.73</u>
长期股权投资	五、13	178,284,744.12	-	-	-	-	178,284,744.12
固定资产	五、15	18,153,312.88	-	-	-	(765,410.36)	17,387,902.52
无形资产	五、17	675,579.92	-	-	-	-	675,579.92
存货跌价准备		<u>19,683,124.89</u>	<u>117,008,228.08</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>136,691,352.97</u>
其他资产减值准备小计		<u>216,796,761.81</u>	<u>117,008,228.08</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>(765,410.36)</u>	<u>333,039,579.53</u>
合计		<u>3,196,088,663.52</u>	<u>985,901,476.36</u>	<u>(346,923,145.97)</u>	<u>-</u>	<u>(4,880,833.65)</u>	<u>3,830,186,160.26</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

20 资产减值准备(续)

(1) 融出资金

	预期信用损失阶段			合计
	第一阶段	第二阶段	第三阶段	
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2022 年 1 月 1 日	114,598,650.34	8,721,031.30	255,466,768.96	378,786,450.60
本期计提	49,689,882.86	-	224,243.76	49,914,126.62
本期转回	(58,114,723.20)	(1,978,078.16)	(1,351,596.74)	(61,444,398.10)
阶段转移:				
第一阶段转移至第二阶段	(4,222,386.67)	4,222,386.67	-	-
第一阶段转移至第三阶段	(356,092.26)	-	356,092.26	-
第二阶段转移至第一阶段	4,581,143.70	(4,581,143.70)	-	-
第二阶段转移至第三阶段	-	(127,867.20)	127,867.20	-
外汇及其他变动	-	-	(1,283,942.65)	(1,283,942.65)
2022 年 6 月 30 日	106,176,474.77	6,256,328.91	253,539,432.79	365,972,236.47

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

20 资产减值准备(续)

(1) 融出资金(续)

	预期信用损失阶段			合计
	第一阶段	第二阶段	第三阶段	
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2021 年 1 月 1 日	140,408,081.20	-	199,831,292.04	340,239,373.24
本年计提	60,682,575.96	6,493,878.82	103,497,450.64	170,673,905.42
本年转回	(83,188,166.87)	(38,681.78)	(48,817,258.59)	(132,044,107.24)
阶段转移:				
第一阶段转移至第二阶段	(2,265,834.26)	2,265,834.26	-	-
第一阶段转移至第三阶段	(1,331,899.01)	-	1,331,899.01	-
第三阶段转移至第一阶段	293,893.32	-	(293,893.32)	-
外汇及其他变动	-	-	(82,720.82)	(82,720.82)
2021 年 12 月 31 日	114,598,650.34	8,721,031.30	255,466,768.96	378,786,450.60

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

20 资产减值准备(续)

(2) 买入返售金融资产

	预期信用损失阶段			合计
	第一阶段	第二阶段	第三阶段	
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2022 年 1 月 1 日	5,632,855.92	2,264,850.00	1,124,334,980.13	1,132,232,686.05
本期计提	-	-	648,329,935.98	648,329,935.98
本期转回	(2,604,304.12)	(614,850.00)	(36,251,517.53)	(39,470,671.65)
阶段转移:				
第一阶段转移至第二阶段	(420,294.81)	420,294.81	-	-
第二阶段转移至第三阶段	-	(1,650,000.00)	1,650,000.00	-
2022 年 6 月 30 日	<u>2,608,256.99</u>	<u>420,294.81</u>	<u>1,738,063,398.58</u>	<u>1,741,091,950.38</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

20 资产减值准备(续)

(2) 买入返售金融资产(续)

	预期信用损失阶段			合计
	第一阶段	第二阶段	第三阶段	
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2021 年 1 月 1 日	47,177,020.33	7,845,314.28	933,957,210.61	988,979,545.22
本年计提	600,916.66	-	277,404,988.65	278,005,905.31
本年转回	(33,264,134.96)	(5,563,326.43)	(95,925,303.09)	(134,752,764.48)
阶段转移:				
第一阶段转移至第三阶段	(3,582,498.89)	-	3,582,498.89	-
第二阶段转移至第三阶段	-	(5,315,585.07)	5,315,585.07	-
第一阶段转移至第二阶段	(5,298,447.22)	5,298,447.22	-	-
2021 年 12 月 31 日	5,632,855.92	2,264,850.00	1,124,334,980.13	1,132,232,686.05

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

20 资产减值准备(续)

(3) 债权投资

	预期信用损失阶段			合计
	第一阶段	第二阶段	第三阶段	
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2022 年 1 月 1 日	6,561,161.65	-	570,556,762.09	577,117,923.74
本期计提	363,685.58	50,863.31	26,127,026.44	26,541,575.33
本期转回	(1,885,283.20)	-	-	(1,885,283.20)
阶段转移:				
第一阶段转移至第二阶段	(172,800.00)	172,800.00	-	-
外汇及其他变动	162,854.12	-	1,548,903.01	1,711,757.13
2022 年 6 月 30 日	5,029,618.15	223,663.31	598,232,691.54	603,485,973.00
	预期信用损失阶段			合计
	第一阶段	第二阶段	第三阶段	
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2021 年 1 月 1 日	19,210,706.29	-	520,450,656.11	539,661,362.40
本年计提	1,445,197.30	-	49,635,841.55	51,081,038.85
本年转回	(12,668,904.42)	-	(163,080.00)	(12,831,984.42)
阶段转移:				
第一阶段转移至第三阶段	(1,102,969.88)	-	1,102,969.88	-
外汇及其他变动	(322,867.64)	-	(469,625.45)	(792,493.09)
2021 年 12 月 31 日	6,561,161.65	-	570,556,762.09	577,117,923.74

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

20 资产减值准备(续)

(4) 其他债权投资

	预期信用损失阶段			合计
	第一阶段	第二阶段	第三阶段	
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2022 年 1 月 1 日	71,727,224.21	84,862,942.40	342,623,832.36	499,213,998.97
本期计提	22,716,087.89	4,654,192.34	88,261,915.84	115,632,196.07
本期转回	(36,202,385.90)	(30,621,475.98)	(62,287.43)	(66,886,149.31)
阶段转移:				
第一阶段转移至第二阶段	(778,055.95)	778,055.95	-	-
第一阶段转移至第三阶段	(13,077,899.54)	-	13,077,899.54	-
第二阶段转移至第一阶段	6,037,243.68	(6,037,243.68)	-	-
第二阶段转移至第三阶段	-	(45,027,993.69)	45,027,993.69	-
外汇及其他变动	822,314.42	317,720.75	6,606,508.80	7,746,543.97
2022 年 6 月 30 日	51,244,528.81	8,926,198.09	495,535,862.80	555,706,589.70

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

20 资产减值准备(续)

(4) 其他债权投资(续)

	预期信用损失阶段			合计
	第一阶段	第二阶段	第三阶段	
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
2021 年 1 月 1 日	56,052,662.76	23,818,358.71	209,577,305.18	289,448,326.65
本年计提	61,190,575.36	81,517,206.19	133,292,755.62	276,000,537.17
本年转回	(48,549,326.48)	(16,148,972.70)	-	(64,698,299.18)
阶段转移:				
第一阶段转移至第二阶段	(2,237,018.73)	2,237,018.73	-	-
第一阶段转移至第三阶段	(251,644.42)	-	251,644.42	-
第二阶段转移至第一阶段	6,132,920.28	(6,132,920.28)	-	-
外汇及其他变动	(610,944.56)	(427,748.25)	(497,872.86)	(1,536,565.67)
2021 年 12 月 31 日	71,727,224.21	84,862,942.40	342,623,832.36	499,213,998.97

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

21 短期借款

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
银行借款	<u>3,089,108,001.74</u>	<u>3,229,797,786.23</u>

于 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 12 月 31 日，本集团短期借款主要系银行信用借款。

于 2022 年 6 月 30 日，短期借款的利率区间为 1.44% - 4.00%(2021 年 12 月 31 日：0.89% - 4.25%)。

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 五 合并财务报表项目附注(续)

#### 22 应付短期融资款

债券名称	面值 人民币亿元	起息日期	债券期限	发行金额 人民币亿元	票面 利率 %	2022 年 1 月 1 日 账面余额 人民币元	本期增加 人民币元	本期减少 人民币元	2022 年 6 月 30 日 账面余额 人民币元
21 申万宏源 CP007	20.00	18/10/2021	12 个月	20.00	2.82	2,011,589,041.10	27,968,219.19	-	2,039,557,260.29
21 申证 D2	52.00	27/10/2021	6 个月	52.00	2.74	5,220,838,978.56	40,056,583.09	(5,260,895,561.65)	-
21 申证 D3	28.00	27/10/2021	9 个月	28.00	2.78	2,810,920,606.24	41,358,455.01	-	2,852,279,061.25
21 申万宏源 CP008	30.00	29/10/2021	12 个月	30.00	2.85	3,014,991,780.83	42,398,630.15	-	3,057,390,410.98
21 申证 D4	33.00	08/12/2021	8 个月	33.00	2.64	3,300,376,507.89	47,625,257.62	-	3,348,001,765.51
21 申证 D5	47.00	08/12/2021	12 个月	47.00	2.68	4,700,380,646.54	66,656,489.66	-	4,767,037,136.20
22 申万宏源 CP001	20.00	26/01/2022	5 个月	20.00	2.37	-	2,016,362,739.71	(2,016,362,739.71)	-
22 申万宏源 CP002	20.00	17/02/2022	12 个月	20.00	2.49	-	2,018,282,739.71	-	2,018,282,739.71
22 申万宏源 CP003	20.00	28/03/2022	12 个月	20.00	2.66	-	2,013,846,575.34	-	2,013,846,575.34
22 申万宏源 CP004	30.00	22/04/2022	7 个月	30.00	2.34	-	3,013,463,013.69	-	3,013,463,013.69
22 申万宏源香港美元债(1)						-	1,348,315,409.16	-	1,348,315,409.16
收益凭证(2)						8,527,745,637.65	18,602,336,793.28	(15,555,629,318.97)	11,574,453,111.96
合计						<u>29,586,843,198.81</u>	<u>29,278,670,905.61</u>	<u>(22,832,887,620.33)</u>	<u>36,032,626,484.09</u>

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 五 合并财务报表项目附注(续)

#### 22 应付短期融资款(续)

债券名称	面值 人民币亿元	起息日期	债券期限	发行金额 人民币亿元	票面 利率 %	2021 年 1 月 1 日 账面余额 人民币元	本年增加 人民币元	本年减少 人民币元	2021 年 12 月 31 日 账面余额 人民币元
20 申证 D5	35.00	27/07/2020	12 个月	35.00	2.97	3,544,997,534.26	51,547,808.24	(3,596,545,342.50)	-
20 申证 D7	33.00	10/09/2020	9 个月	33.00	3.15	3,326,708,009.32	48,477,744.13	(3,375,185,753.45)	-
20 申万宏源 CP008BC	40.00	19/10/2020	3 个月	40.00	2.88	4,023,173,858.20	181,758.24	(4,023,355,616.44)	-
20 申万宏源 CP009BC	40.00	23/11/2020	3 个月	40.00	3.30	4,013,618,320.85	11,696,747.64	(4,025,315,068.49)	-
20 申万宏源 CP010BC	30.00	14/12/2020	3 个月	30.00	2.94	3,004,349,589.04	14,256,986.30	(3,018,606,575.34)	-
20 申证 13	63.00	18/12/2020	9 个月	63.00	3.13	6,290,644,294.91	148,199,074.97	(6,438,843,369.88)	-
21 申万宏源 CP001BC	30.00	25/01/2021	3 个月	30.00	2.48	-	3,013,453,150.68	(3,013,453,150.68)	-
21 申万宏源 CP002BC	30.00	25/02/2021	3 个月	30.00	2.84	-	3,015,172,602.74	(3,015,172,602.74)	-
21 申万宏源 CP003BC	35.00	10/06/2021	3 个月	35.00	2.35	-	4,013,391,780.82	(4,013,391,780.82)	-
21 申证 D1	40.00	26/02/2021	6 个月	40.00	2.97	-	3,544,427,945.22	(3,544,427,945.22)	-
21 申万宏源 CP004BC	40.00	19/07/2021	3 个月	40.00	2.15	-	4,017,435,616.44	(4,017,435,616.44)	-
21 申万宏源 CP005BC	50.00	28/07/2021	3 个月	50.00	2.25	-	5,020,034,246.58	(5,020,034,246.58)	-
21 申万宏源 CP006BC	40.00	12/08/2021	3 个月	40.00	2.20	-	4,019,528,767.12	(4,019,528,767.12)	-
21 申万宏源 CP007	20.00	18/10/2021	12 个月	20.00	2.82	-	2,011,589,041.10	-	2,011,589,041.10
21 申证 D2	52.00	27/10/2021	6 个月	52.00	2.74	-	5,220,838,978.56	-	5,220,838,978.56
21 申证 D3	28.00	27/10/2021	9 个月	28.00	2.78	-	2,810,920,606.24	-	2,810,920,606.24
21 申万宏源 CP008	30.00	29/10/2021	12 个月	30.00	2.85	-	3,014,991,780.83	-	3,014,991,780.83
21 申证 D4	33.00	08/12/2021	8 个月	33.00	2.64	-	3,300,376,507.89	-	3,300,376,507.89
21 申证 D5	47.00	08/12/2021	12 个月	47.00	2.68	-	4,700,380,646.54	-	4,700,380,646.54
收益凭证(2)						16,301,577,417.51	27,922,425,376.93	(35,696,257,156.79)	8,527,745,637.65
合计						40,505,069,024.09	75,899,327,167.21	(86,817,552,992.49)	29,586,843,198.81

于 2022 年 6 月 30 日，以上应付短期融资款没有出现拖欠本金、利息或赎回款项的违约情况(2021 年 12 月 31 日：无)。

- (1) 本公司间接附属公司申万宏源(香港)有限公司于 2022 年 1 月 27 日发行 2 亿美元的债券，期限 1 年，采用固定利率形式，票面利率 1.50%，单利按年计息，每半年付息一次，本期债券为无抵押及无担保债券。
- (2) 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间，本集团共发行 855 期期限一年以内的收益凭证(截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间：435 期)。于 2022 年 6 月 30 日，本集团发行的收益凭证采用固定年利率或与若干股指挂钩的浮动利率两种方式计息，其中固定利率区间为 2.05% - 6.80%(2021 年 12 月 31 日：2.65% - 6.80%)。

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

23 拆入资金

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
银行拆入资金	2,645,000,000.00	1,550,000,000.00
其他拆入资金	692,755,264.73	815,946,728.37
转融通拆入资金	-	2,000,777,777.78
合计	<u>3,337,755,264.73</u>	<u>4,366,724,506.15</u>

转融通拆入资金按剩余期限分析及利率区间如下：

剩余期限	2022 年 6 月 30 日		2021 年 12 月 31 日	
	余额	利率区间	余额	利率区间
3 个月-1 年(含)	-	-	2,000,777,777.78	2.80%

24 交易性金融负债

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
债券	3,404,402,522.62	2,149,718,973.25
结构化票据	1,441,587,334.15	3,630,788,827.06
黄金	58,921,500.00	279,525,000.00
其他	54,159,073.61	65,489,448.99
股票	-	41,473,142.25
合计	<u>4,959,070,430.38</u>	<u>6,166,995,391.55</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

25 卖出回购金融资产款

(1) 按业务类别列示

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
质押式卖出回购	102,785,158,978.39	114,614,486,842.88
质押式报价回购	17,063,903,423.88	13,377,643,556.54
黄金掉期业务	10,370,948,879.83	8,984,975,904.43
买断式卖出回购	-	1,000,413,476.69
合计	<u>130,220,011,282.10</u>	<u>137,977,519,780.54</u>

(2) 按金融资产种类列示

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
债券	102,785,158,978.39	115,614,900,319.57
基金	17,063,903,423.88	13,377,643,556.54
贵金属	10,370,948,879.83	8,984,975,904.43
合计	<u>130,220,011,282.10</u>	<u>137,977,519,780.54</u>

(3) 担保物信息

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
债券	115,411,355,486.07	128,929,089,406.14
贵金属	10,458,390,000.00	8,841,552,500.00
基金	22,813,175,336.37	18,278,273,339.53
合计	<u>148,682,920,822.44</u>	<u>156,048,915,245.67</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

26 代理买卖证券款

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
普通经纪业务		
-个人	57,812,666,174.08	57,094,078,347.07
-机构	46,756,002,878.53	37,230,275,588.82
小计	<u>104,568,669,052.61</u>	<u>94,324,353,935.89</u>
信用业务		
-个人	10,351,948,815.50	8,813,576,250.94
-机构	1,846,897,562.84	1,587,445,533.70
小计	<u>12,198,846,378.34</u>	<u>10,401,021,784.64</u>
加：应付利息	<u>1,438,524.63</u>	<u>12,982,929.10</u>
合计	<u>116,768,953,955.58</u>	<u>104,738,358,649.63</u>

27 应付职工薪酬

		2022 年 1 月 1 日	本期增加	本期减少	2022 年 6 月 30 日
短期薪酬	(1)	2,177,379,727.82	2,664,125,972.13	(2,424,856,640.76)	2,416,649,059.19
离职后福利					
— 设定提存计划	(2)	202,367,534.08	290,435,087.00	(472,184,757.70)	20,617,863.38
辞退福利		8,297,074.35	1,524,561.99	(1,524,561.99)	8,297,074.35
其他长期职工福利					
— 递延奖金		3,838,905,133.22	393,968,050.48	(3,167,547.53)	4,229,705,636.17
合计		<u>6,226,949,469.47</u>	<u>3,350,053,671.60</u>	<u>(2,901,733,507.98)</u>	<u>6,675,269,633.09</u>
		2021 年 1 月 1 日	本年增加	本年减少	2021 年 12 月 31 日
短期薪酬	(1)	2,038,286,908.86	6,605,453,718.82	(6,466,360,899.86)	2,177,379,727.82
离职后福利					
— 设定提存计划	(2)	87,656,550.24	693,456,233.89	(578,745,250.05)	202,367,534.08
辞退福利		8,297,074.35	2,168,605.55	(2,168,605.55)	8,297,074.35
其他长期职工福利					
— 递延奖金		3,044,380,471.72	940,427,536.84	(145,902,875.34)	3,838,905,133.22
合计		<u>5,178,621,005.17</u>	<u>8,241,506,095.10</u>	<u>(7,193,177,630.80)</u>	<u>6,226,949,469.47</u>

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 五 合并财务报表项目附注(续)

#### 27 应付职工薪酬(续)

##### (1) 短期薪酬

	2022 年 1 月 1 日	本期增加	本期减少	2022 年 6 月 30 日
工资、奖金、津贴和补贴	2,001,647,647.43	2,260,262,608.65	(2,021,299,558.07)	2,240,610,698.01
职工福利费	176,660.00	48,014,894.42	(48,041,554.42)	150,000.00
社会保险费	976,755.94	124,844,421.30	(124,536,900.73)	1,284,276.51
其中：医疗保险费	851,526.37	120,341,211.37	(120,096,145.98)	1,096,591.76
工伤保险费	15,476.67	2,504,310.06	(2,502,842.42)	16,944.31
生育保险费	109,752.90	1,998,899.87	(1,937,912.33)	170,740.44
住房公积金	3,307,265.91	154,967,689.13	(154,578,768.29)	3,696,186.75
工会经费和职工教育经费	170,187,028.20	54,129,122.66	(55,024,167.60)	169,291,983.26
其他短期薪酬	1,084,370.34	21,907,235.97	(21,375,691.65)	1,615,914.66
合计	<u>2,177,379,727.82</u>	<u>2,664,125,972.13</u>	<u>(2,424,856,640.76)</u>	<u>2,416,649,059.19</u>

	2021 年 1 月 1 日	本年增加	本年减少	2021 年 12 月 31 日
工资、奖金、津贴和补贴	1,892,187,938.43	5,785,339,606.34	(5,675,879,897.34)	2,001,647,647.43
职工福利费	760,180.00	133,105,212.66	(133,688,732.66)	176,660.00
社会保险费	866,870.90	221,191,151.43	(221,081,266.39)	976,755.94
其中：医疗保险费	645,766.74	213,339,141.77	(213,133,382.14)	851,526.37
工伤保险费	18,928.51	3,769,983.56	(3,773,435.40)	15,476.67
生育保险费	202,175.65	4,082,026.10	(4,174,448.85)	109,752.90
住房公积金	2,835,353.04	283,534,895.66	(283,062,982.79)	3,307,265.91
工会经费和职工教育经费	140,826,118.92	140,112,624.56	(110,751,715.28)	170,187,028.20
其他短期薪酬	810,447.57	42,170,228.17	(41,896,305.40)	1,084,370.34
合计	<u>2,038,286,908.86</u>	<u>6,605,453,718.82</u>	<u>(6,466,360,899.86)</u>	<u>2,177,379,727.82</u>

##### (2) 离职后福利-设定提存计划

	2022 年 1 月 1 日	本期增加	本期减少	2022 年 6 月 30 日
基本养老保险	2,655,963.76	195,095,857.05	(194,371,856.31)	3,379,964.50
失业保险费	8,223,995.20	5,993,602.09	(13,990,145.45)	227,451.84
企业年金缴费	191,487,575.12	89,345,627.86	(263,822,755.94)	17,010,447.04
合计	<u>202,367,534.08</u>	<u>290,435,087.00</u>	<u>(472,184,757.70)</u>	<u>20,617,863.38</u>

  

	2021 年 1 月 1 日	本年增加	本年减少	2021 年 12 月 31 日
基本养老保险	2,316,950.28	344,653,194.81	(344,314,181.33)	2,655,963.76
失业保险费	163,061.72	42,629,126.35	(34,568,192.87)	8,223,995.20
企业年金缴费	85,176,538.24	306,173,912.73	(199,862,875.85)	191,487,575.12
合计	<u>87,656,550.24</u>	<u>693,456,233.89</u>	<u>(578,745,250.05)</u>	<u>202,367,534.08</u>

## 申万宏源集团股份有限公司

### 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

#### 五 合并财务报表项目附注(续)

#### 27 应付职工薪酬(续)

按照中国有关法规，本集团境内公司的职工参加了由当地劳动和社会保障部门组织实施的社会基本养老保险和失业保险，本集团境内公司以当地规定的社会基本养老保险和失业保险的缴纳基数和比例，向当地社会基本养老保险和失业保险经办机构缴纳保险费。

除了以上基本养老保险和失业保险计划外，本集团境内公司为符合条件的职工设立了企业年金计划，按上年职工工资总额的一定比例提取年金计划供款。

本集团境外公司符合资格的职工参加当地的福利供款计划。境外公司按照当地政府机构的规定为职工供款。

本集团应付职工薪酬中并无属于拖欠性质的余额。

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间，本公司董事、监事及高级管理人员从公司领取的薪酬为人民币 5,752,046.21 元(截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间：人民币 8,097,090.15 元)。

本集团以当地劳动和社会保障部门规定的缴纳基数和比例，按月向相关经办机构缴纳养老保险费及失业保险费，且缴纳后不可用于抵减本集团未来期间应为员工交存的款项。

#### 28 应交税费

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
代扣代缴个人所得税	526,006,747.69	1,343,631,149.56
应交企业所得税	228,377,626.35	851,040,131.45
应交增值税	109,612,644.98	429,278,098.74
应交城市维护建设税	8,115,256.20	30,659,557.51
应交教育费附加及地方教育附加	5,806,459.58	21,224,135.79
其他	11,017,568.89	13,182,728.11
合计	<u>888,936,303.69</u>	<u>2,689,015,801.16</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

29 应付款项

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
应付履约保证金	26,527,801,088.56	14,482,542,313.32
应付手续费及佣金	699,407,295.79	741,595,073.94
应付证券清算款	469,824,172.36	1,578,230,588.50
应付销售服务费	107,297,427.43	84,013,087.69
应付证券、期货投资者保护基金	39,853,933.28	54,428,420.22
应付经纪人佣金	7,834,230.15	9,944,185.57
	<hr/>	<hr/>
合计	<u>27,852,018,147.57</u>	<u>16,950,753,669.24</u>

于 2022 年 6 月 30 日，本集团无账龄超过 1 年的大额应付款项(2021 年 12 月 31 日：无)。

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

30 应付债券

	面值 人民币亿元	起息日期	债券期限	发行金额 人民币亿元	票面 利率 %	2022 年 1 月 1 日 账面余额 人民币元	本期增加 人民币元	本期减少 人民币元	2022 年 6 月 30 日 账面余额 人民币元
17 申证 01	75.00	2017/02/17	60 个月	75.00	4.40	7,787,506,849.32	28,027,397.26	(7,815,534,246.58)	-
17 申证 02	5.00	2017/02/17	84 个月	5.00	4.50	519,602,739.71	10,039,246.10	(21,513,698.61)	508,128,287.20
18 申宏 01	5.00	2018/07/17	60 个月	5.00	3.20	32,976,572.12	515,757.75	-	33,492,329.87
18 申宏 02	65.00	2018/07/17	60 个月	65.00	4.80	6,644,437,754.40	154,722,402.73	-	6,799,160,157.13
18 申证 03	15.00	2018/12/10	60 个月	15.00	4.08	1,503,688,767.12	30,144,288.70	-	1,533,833,055.82
19 申宏 01	10.00	2019/03/08	36 个月	10.00	4.18	1,034,226,375.77	7,573,624.23	(1,041,800,000.00)	-
19 申宏 02	32.00	2019/04/12	36 个月	32.00	4.27	3,298,830,027.49	37,809,972.51	(3,336,640,000.00)	-
19 申宏 04	58.00	2019/10/25	60 个月	58.00	3.94	5,842,573,589.08	113,320,876.72	-	5,955,894,465.80
19 申证 01	22.00	2019/01/16	36 个月	22.00	3.55	2,274,890,410.92	-	(2,274,890,410.92)	-
19 申证 03	62.00	2019/03/11	36 个月	62.00	3.68	6,385,028,383.54	36,880,657.53	(6,421,909,041.07)	-
19 申证 05	81.00	2019/05/09	36 个月	81.00	3.88	8,304,066,739.73	103,324,931.50	(8,407,391,671.23)	-
19 申万宏源金 融债 01	60.00	2019/09/18	36 个月	60.00	3.43	6,058,194,304.27	102,756,272.81	-	6,160,950,577.08
20 申证 01	40.00	2020/01/16	24 个月	40.00	3.40	4,130,372,434.67	38,524.22	(4,130,410,958.89)	-
20 申证 02	20.00	2020/01/16	36 个月	20.00	3.55	2,067,755,202.33	32,275,017.68	(68,082,191.80)	2,031,948,028.21
20 申证 03	10.00	2020/02/21	24 个月	10.00	3.03	1,026,066,301.39	2,573,424.66	(1,028,639,726.05)	-
20 申证 04	30.00	2020/02/21	36 个月	30.00	3.20	3,082,586,301.39	42,041,786.53	(90,739,726.05)	3,033,888,361.87
20 申证 06	41.00	2020/07/27	36 个月	41.00	3.49	4,161,940,328.79	70,266,384.25	-	4,232,206,713.04
20 申证 08	32.00	2020/09/10	36 个月	32.00	3.76	3,229,595,062.28	61,911,075.72	-	3,291,506,138.00

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

30 应付债券(续)

	面值 人民币亿元	起息日期	债券期限	发行金额 人民币亿元	票面 利率 %	2022 年 1 月 1 日 账面余额 人民币元	本期增加 人民币元	本期减少 人民币元	2022 年 6 月 30 日 账面余额 人民币元
20 申证 10	57.00	2020/10/26	36 个月	57.00	3.68	5,723,852,430.12	108,017,843.40	-	5,831,870,273.52
20 申证 12	17.00	2020/11/16	24 个月	17.00	3.55	1,704,452,031.54	31,716,402.17	-	1,736,168,433.71
20 申证 C2	60.00	2020/04/23	36 个月	60.00	3.18	6,128,554,520.52	83,754,024.28	(179,299,726.05)	6,033,008,818.75
20 申证 C3	60.00	2020/05/25	36 个月	60.00	3.25	6,116,095,115.04	83,730,679.78	(182,178,082.22)	6,017,647,712.60
21 申宏 01	15.00	2021/03/08	60 个月	15.00	3.68	1,545,067,397.26	27,373,150.69	(55,200,000.00)	1,517,240,547.95
21 申宏 02	5.00	2021/03/08	84 个月	5.00	3.95	516,124,657.53	9,793,835.61	(19,750,000.00)	506,168,493.14
21 申宏 04	30.00	2021/07/15	84 个月	30.00	3.65	3,050,400,000.00	54,300,000.00	-	3,104,700,000.00
21 申宏 05	5.00	2021/08/04	36 个月	5.00	2.99	506,102,876.71	7,413,561.65	-	513,516,438.36
21 申宏 06	25.00	2021/08/04	60 个月	25.00	3.38	2,534,494,520.55	41,902,739.73	-	2,576,397,260.28
21 申证 01	25.00	2021/04/29	36 个月	25.00	3.45	2,553,695,077.73	37,140,830.93	(79,633,561.69)	2,511,202,346.97
21 申证 02	20.00	2021/04/29	120 个月	20.00	4.05	2,050,346,774.32	34,190,324.22	(74,786,301.35)	2,009,750,797.19
21 申证 03	26.00	2021/05/24	60 个月	26.00	3.63	2,652,080,429.38	41,452,452.08	(88,432,767.13)	2,605,100,114.33
21 申证 04	20.00	2021/05/28	36 个月	20.00	3.27	2,035,197,258.60	28,382,801.69	(60,562,191.81)	2,003,017,868.48
21 申证 05	25.00	2021/05/28	120 个月	25.00	4.00	2,554,094,926.63	42,487,905.27	(92,602,739.69)	2,503,980,092.21
21 申证 06	20.00	2021/07/21	36 个月	20.00	3.13	2,023,634,629.13	31,915,209.08	-	2,055,549,838.21
21 申证 07	30.00	2021/07/21	120 个月	30.00	3.77	3,043,248,871.92	56,477,960.00	-	3,099,726,831.92
21 申证 08	28.00	2021/07/28	36 个月	28.00	3.04	2,833,266,846.21	42,844,290.04	-	2,876,111,136.25
21 申证 09	42.00	2021/07/28	60 个月	42.00	3.38	4,248,283,216.22	71,782,465.23	-	4,320,065,681.45
21 申证 10	30.00	2021/08/26	36 个月	30.00	3.02	3,021,940,075.74	46,766,088.82	-	3,068,706,164.56
21 申证 11	30.00	2021/08/26	120 个月	30.00	3.75	3,028,710,150.64	56,339,397.87	-	3,085,049,548.51
21 申证 12	48.00	2021/09/09	36 个月	48.00	3.05	4,834,126,671.56	74,736,120.98	-	4,908,862,792.54
21 申证 13	10.00	2021/09/09	60 个月	10.00	3.40	1,008,090,732.24	17,127,592.13	-	1,025,218,324.37
21 申证 14	23.00	2021/09/22	24 个月	23.00	2.95	2,310,361,711.05	36,067,138.82	-	2,346,428,849.87

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

30 应付债券(续)

	面值 人民币亿元	起息日期	债券期限	发行金额 人民币亿元	票面 利率 %	2022 年 1 月 1 日 账面余额 人民币元	本期增加 人民币元	本期减少 人民币元	2022 年 6 月 30 日 账面余额 人民币元
21 申证 15	23.00	2021/09/22	36 个月	23.00	3.10	2,310,865,236.68	36,969,496.63	-	2,347,834,733.31
21 申证 C1	30.00	2021/01/21	36 个月	30.00	3.93	3,102,716,541.73	54,110,400.61	(111,439,726.04)	3,045,387,216.30
21 申证 C2	38.00	2021/03/11	36 个月	38.00	3.94	3,909,641,529.59	72,806,942.03	(145,618,082.20)	3,836,830,389.42
21 申证 C3	18.00	2021/12/27	24 个月	18.00	3.08	1,793,170,281.73	29,386,840.02	-	1,822,557,121.75
21 申证 C4	12.00	2021/12/27	36 个月	12.00	3.20	1,195,454,928.38	19,883,501.48	-	1,215,338,429.86
22 申宏 01	18.00	2022/03/08	36 个月	18.00	3.11	-	1,817,484,164.38	-	1,817,484,164.38
22 申宏 02	12.00	2022/03/08	60 个月	12.00	3.50	-	1,213,117,808.21	-	1,213,117,808.21
22 申宏 03	30.00	2022/04/26	36 个月	30.00	3.06	-	3,016,347,945.21	-	3,016,347,945.21
22 申宏 04	10.00	2022/04/26	60 个月	10.00	3.45	-	1,006,143,835.62	-	1,006,143,835.62
22 申证 01	50.00	2022/01/21	36 个月	50.00	2.80	-	5,051,530,119.49	-	5,051,530,119.49
22 申证 02	24.00	2022/01/21	120 个月	24.00	3.60	-	2,432,612,104.47	-	2,432,612,104.47
22 申证 03	22.00	2022/02/23	36 个月	22.00	2.95	-	2,216,980,594.62	-	2,216,980,594.62
22 申证 05	35.00	2022/03/24	36 个月	35.00	3.18	-	3,521,063,314.46	-	3,521,063,314.46
22 申证 06	21.00	2022/03/24	60 个月	21.00	3.53	-	2,114,411,858.01	-	2,114,411,858.01
22 申证 07	18.00	2022/05/23	36 个月	18.00	2.78	-	1,800,692,962.44	-	1,800,692,962.44
22 申证 08	22.00	2022/05/23	60 个月	22.00	3.20	-	2,201,749,160.70	-	2,201,749,160.70
22 申证 C1	30.00	2022/04/27	36 个月	30.00	3.19	-	3,005,027,634.35	-	3,005,027,634.35
21 申万宏源 国际金融 美元债(1)						3,198,233,307.37	168,760,572.68	-	3,366,993,880.05
22 申万宏源 国际金融 美元债(2)						-	2,021,162,552.87	-	2,021,162,552.87
收益凭证(3)						11,570,083,119.84	4,702,076,444.24	(1,262,484,611.19)	15,009,674,952.89
合计						<u>160,486,724,010.28</u>	<u>38,402,252,707.89</u>	<u>(36,989,539,460.57)</u>	<u>161,899,437,257.60</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

30 应付债券(续)

	面值 人民币亿元	起息日期	债券期限	发行金额 人民币亿元	票面 利率 %	2021 年 1 月 1 日 账面余额 人民币元	本年增加 人民币元	本年减少 人民币元	2021 年 12 月 31 日 账面余额 人民币元
16 申宏 01	20.21	2016/04/26	60 个月	50.00	3.70	2,072,216,903.00	23,352,697.00	(2,095,569,600.00)	-
16 申宏 03	55.00	2016/09/09	60 个月	55.00	3.20	5,555,452,054.84	120,547,945.16	(5,676,000,000.00)	-
17 申证 01	75.00	2017/02/17	60 个月	75.00	4.40	7,788,410,958.90	315,534,246.58	(316,438,356.16)	7,787,506,849.32
17 申证 02	5.00	2017/02/17	84 个月	5.00	4.50	519,664,383.54	21,513,698.61	(21,575,342.44)	519,602,739.71
18 申宏 01	5.00	2018/07/17	60 个月	5.00	3.20	510,184,374.13	12,290,197.99	(489,498,000.00)	32,976,572.12
18 申宏 02	65.00	2018/07/17	60 个月	65.00	4.80	6,644,428,816.55	312,008,937.85	(312,000,000.00)	6,644,437,754.40
18 申证 02	30.00	2018/11/19	36 个月	30.00	4.20	3,014,843,835.61	104,942,465.72	(3,119,786,301.33)	-
18 申证 03	15.00	2018/12/10	60 个月	15.00	4.08	1,503,688,767.12	59,690,958.92	(59,690,958.92)	1,503,688,767.12
18 申证 C2	46.00	2018/04/12	36 个月	46.00	5.35	4,778,001,095.92	60,682,191.78	(4,838,683,287.70)	-
19 申宏 01	10.00	2019/03/08	36 个月	10.00	4.18	1,034,210,110.29	41,816,265.48	(41,800,000.00)	1,034,226,375.77
19 申宏 02	32.00	2019/04/12	36 个月	32.00	4.27	3,298,830,027.44	136,640,000.05	(136,640,000.00)	3,298,830,027.49
19 申宏 04	58.00	2019/10/25	60 个月	58.00	3.94	5,842,573,589.06	228,520,000.02	(228,520,000.00)	5,842,573,589.08
19 申证 01	22.00	2019/01/16	36 个月	22.00	3.55	2,275,104,383.52	74,890,410.92	(75,104,383.52)	2,274,890,410.92
19 申证 03	62.00	2019/03/11	36 个月	62.00	3.68	6,385,028,383.54	221,909,041.07	(221,909,041.07)	6,385,028,383.54
19 申证 05	81.00	2019/05/09	36 个月	81.00	3.88	8,304,066,739.73	307,391,671.23	(307,391,671.23)	8,304,066,739.73
19 申证 07	10.00	2019/06/14	24 个月	10.00	3.90	1,021,476,712.35	16,134,246.58	(1,037,610,958.93)	-
19 申万宏源 金融债 01	60.00	2019/09/18	36 个月	60.00	3.43	6,056,778,615.99	197,630,482.79	(196,214,794.51)	6,058,194,304.27
20 申证 01	40.00	2020/01/16	24 个月	40.00	3.40	4,129,802,739.27	131,353,257.03	(130,783,561.63)	4,130,372,434.67
20 申证 02	20.00	2020/01/16	36 个月	20.00	3.55	2,067,635,443.93	68,396,470.76	(68,276,712.36)	2,067,755,202.33
20 申证 03	10.00	2020/02/21	24 个月	10.00	3.03	1,026,149,315.09	28,639,726.05	(28,722,739.75)	1,026,066,301.39
20 申证 04	30.00	2020/02/21	36 个月	30.00	3.20	3,082,849,315.09	90,739,726.05	(91,002,739.75)	3,082,586,301.39
20 申证 06	41.00	2020/07/27	36 个月	41.00	3.49	4,161,940,328.79	132,897,287.71	(132,897,287.71)	4,161,940,328.79

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

30 应付债券(续)

	面值 人民币亿元	起息日期	债券期限	发行金额 人民币亿元	票面 利率 %	2021 年 1 月 1 日 账面余额 人民币元	本年增加 人民币元	本年减少 人民币元	2021 年 12 月 31 日 账面余额 人民币元
20 申证 08	32.00	2020/09/10	36 个月	32.00	3.76	3,225,066,760.40	121,881,507.34	(117,353,205.46)	3,229,595,062.28
20 申证 09	22.00	2020/10/26	12 个月	22.00	3.16	2,207,647,243.22	63,015,551.32	(2,270,662,794.54)	-
20 申证 10	57.00	2020/10/26	36 个月	57.00	3.68	5,715,786,392.36	203,458,914.51	(195,392,876.75)	5,723,852,430.12
20 申证 12	17.00	2020/11/16	24 个月	17.00	3.55	1,700,843,540.97	61,478,353.59	(57,869,863.02)	1,704,452,031.54
20 申证 C2	60.00	2020/04/23	36 个月	60.00	3.18	6,125,724,331.86	182,129,914.71	(179,299,726.05)	6,128,554,520.52
20 申证 C3	60.00	2020/05/25	36 个月	60.00	3.25	6,114,680,020.69	183,593,176.57	(182,178,082.22)	6,116,095,115.04
21 申宏 01	15.00	2021/03/08	60 个月	15.00	3.68	-	1,545,067,397.26	-	1,545,067,397.26
21 申宏 02	5.00	2021/03/08	84 个月	5.00	3.95	-	516,124,657.53	-	516,124,657.53
21 申证 01	25.00	2021/04/29	36 个月	25.00	3.45	-	2,553,695,077.73	-	2,553,695,077.73
21 申证 02	20.00	2021/04/29	120 个月	20.00	4.05	-	2,050,346,774.32	-	2,050,346,774.32
21 申证 03	26.00	2021/05/24	60 个月	26.00	3.63	-	2,652,080,429.38	-	2,652,080,429.38
21 申证 04	20.00	2021/05/28	36 个月	20.00	3.27	-	2,035,197,258.60	-	2,035,197,258.60
21 申证 05	25.00	2021/05/28	120 个月	25.00	4.00	-	2,554,094,926.63	-	2,554,094,926.63
21 申证 06	20.00	2021/07/21	36 个月	20.00	3.13	-	2,023,634,629.13	-	2,023,634,629.13
21 申证 07	30.00	2021/07/21	120 个月	30.00	3.77	-	3,043,248,871.92	-	3,043,248,871.92
21 申证 08	28.00	2021/07/28	36 个月	28.00	3.04	-	2,833,266,846.21	-	2,833,266,846.21
21 申证 09	42.00	2021/07/28	60 个月	42.00	3.38	-	4,248,283,216.22	-	4,248,283,216.22
21 申证 10	30.00	2021/08/26	36 个月	30.00	3.02	-	3,021,940,075.74	-	3,021,940,075.74
21 申证 11	30.00	2021/08/26	120 个月	30.00	3.75	-	3,028,710,150.64	-	3,028,710,150.64
21 申证 12	48.00	2021/09/09	36 个月	48.00	3.05	-	4,834,126,671.56	-	4,834,126,671.56
21 申证 13	10.00	2021/09/09	60 个月	10.00	3.40	-	1,008,090,732.24	-	1,008,090,732.24
21 申证 14	23.00	2021/09/22	24 个月	23.00	2.95	-	2,310,361,711.05	-	2,310,361,711.05
21 申证 15	23.00	2021/09/22	36 个月	23.00	3.10	-	2,310,865,236.68	-	2,310,865,236.68

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

30 应付债券(续)

	面值 人民币亿元	起息日期	债券期限	发行金额 人民币亿元	票面 利率 %	2021 年 1 月 1 日 账面余额 人民币元	本年增加 人民币元	本年减少 人民币元	2021 年 12 月 31 日 账面余额 人民币元
21 申证 C1	30.00	2021/01/21	36 个月	30.00	3.93	-	3,102,716,541.73	-	3,102,716,541.73
21 申证 C2	38.00	2021/03/11	36 个月	38.00	3.94	-	3,909,641,529.59	-	3,909,641,529.59
21 申证 C3	18.00	2021/12/27	24 个月	18.00	3.08	-	1,793,170,281.73	-	1,793,170,281.73
21 申证 C4	12.00	2021/12/27	36 个月	12.00	3.20	-	1,195,454,928.38	-	1,195,454,928.38
21 申宏 04	30.00	2021/07/15	84 个月	30.00	3.65	-	3,050,400,000.00	-	3,050,400,000.00
21 申宏 05	5.00	2021/08/04	36 个月	5.00	2.99	-	506,102,876.71	-	506,102,876.71
21 申宏 06	25.00	2021/08/04	60 个月	25.00	3.38	-	2,534,494,520.55	-	2,534,494,520.55
21 申万宏源 国际金融美元债(1)						-	3,198,233,307.37	-	3,198,233,307.37
收益凭证(3)						12,004,860,139.19	25,612,101,694.55	(26,046,878,713.90)	11,570,083,119.84
合计						118,167,945,322.39	90,994,529,686.84	(48,675,750,998.95)	160,486,724,010.28

- (1) Shenwan Hongyuan International Finance Limited 于 2021 年 7 月 14 日发行 5 亿美元的债券，期限 5 年，采用固定利率形式，票面利率 1.80%，单利按年计息，每半年付息一次，申万宏源证券有限公司提供连带责任保证担保。
- (2) Shenwan Hongyuan International Finance Limited 于 2022 年 3 月 16 日发行 3 亿美元的债券，期限 3 年，采用固定利率形式，票面利率 2.63%，单利按年计息，每半年付息一次，申万宏源证券有限公司提供连带责任保证担保。
- (3) 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间，本集团共发行 113 期期限超过一年的收益凭证(截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间：78 期)。于 2022 年 6 月 30 日，本集团发行的收益凭证采用固定年利率或与若干股指挂钩的浮动利率两种方式计息，其中固定利率区间为 2.60%-3.60%(2021 年 12 月 31 日：3.25% - 3.65%)。

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

31 合同负债

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
仓单交易合同	95,785,864.42	123,043,009.32
保荐及财务顾问合同	15,952,662.29	15,749,056.61
资产管理合同	1,074,312.19	1,428,140.00
合计	<u>112,812,838.90</u>	<u>140,220,205.93</u>

合同负债主要涉及本集团销售货物收取的预收款。该预收款在合同签订时收取，该合同的相关收入在本集团履行履约义务后确认。

32 其他负债

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
合并结构化主体形成的其他金融负债		
应付股利	(1) 11,337,377,559.66	10,798,291,948.27
其他应付款	(2) 2,620,406,368.01	135,730,742.88
期货风险准备	(3) 1,702,120,713.95	1,743,419,457.19
预提费用	(4) 267,633,057.81	248,626,237.21
递延收益	166,710,538.36	89,629,501.05
合计	<u>71,972,897.86</u>	<u>74,904,193.64</u>
合计	<u>16,166,221,135.65</u>	<u>13,090,602,080.24</u>

(1) 合并结构化主体形成的其他金融负债

合并结构化主体形成的其他金融负债为本集团纳入合并范围内结构化主体产生的应付其他权益持有人持有的权益。纳入合并范围的结构化主体信息参见附注四、2。

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

32 其他负债(续)

(2) 应付股利

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
一年以上应付股利	<u>134,387,715.75</u>	<u>135,730,742.88</u>

本集团应付股利为应付普通股股利，主要是相应股权质押冻结或股权转让等历史原因导致的。

(3) 其他应付款

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
应付保证金及押金	1,079,501,844.17	738,962,438.06
长期应付款	177,311,399.98	152,106,358.26
资管产品增值税合并纳税结余	153,594,114.89	141,636,098.85
代理兑付债券款	6,579,569.27	6,579,569.27
应付供应商款项(a)	50,489,717.31	463,378,278.40
其他	<u>234,644,068.33</u>	<u>240,756,714.35</u>
合计	<u>1,702,120,713.95</u>	<u>1,743,419,457.19</u>

于 2022 年 6 月 30 日，除长期应付款和资管产品增值税合并纳税结余外，本集团无账龄超过 1 年的重要其他应付款(2021 年 12 月 31 日：无)。

(a) 应付供应商款项主要包括应付货款和应付工程款。

(4) 期货风险准备

本集团子公司申银万国期货有限公司和宏源期货有限公司根据《商品期货交易财务管理暂行规定》按商品和金融期货经纪业务手续费收入的 5% 计提期货风险准备并计入当期损益。动用风险准备金弥补因自身原因造成的损失或是按规定核销难以收回的垫付风险损失款时，冲减期货风险准备金余额。

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

33 股本

	2022 年 1 月 1 日 余额	发行新股	送股	公积金转股	其他	2022 年 6 月 30 日 余额
股份总数	<u>25,039,944,560.00</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>25,039,944,560.00</u>
	2021 年 1 月 1 日 余额	发行新股	送股	公积金转股	其他	2021 年 12 月 31 日 余额
股份总数	<u>25,039,944,560.00</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>25,039,944,560.00</u>

于 2022 年 6 月 30 日，持有本公司股份比例超过 5%的股东如下：

股东名称	持股比例
中国建银投资有限责任公司(以下简称“中建投”)	<b>26.34%</b>
中央汇金	<b>20.05%</b>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

34 资本公积

	2022 年 1 月 1 日	本期增加	本期减少	2022 年 6 月 30 日
资本溢价	<u>19,367,146,136.46</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>19,367,146,136.46</u>
	2021 年 1 月 1 日	本年增加	本年减少	2021 年 12 月 31 日
资本溢价	<u>19,367,146,136.46</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>19,367,146,136.46</u>

35 其他综合收益

(1) 资产负债表中归属于母公司的其他综合收益情况表

	2022 年 1 月 1 日	税后归属于 母公司	其他综合收益转 留存收益	2022 年 6 月 30 日
其他债权投资公允价值变动	(265,749,049.13)	(139,652,557.46)	-	(405,401,606.59)
其他债权投资信用减值准备	357,083,590.27	30,385,774.48	-	387,469,364.75
其他权益工具投资公允价值变动	(529,718,788.21)	(214,775,589.37)	26,405,605.81	(718,088,771.77)
权益法下可转损益的其他综合收益	(4,416,624.33)	4,365,114.58	-	(51,509.75)
外币报表折算差额	<u>(197,504,834.58)</u>	<u>172,969,029.44</u>	<u>-</u>	<u>(24,535,805.14)</u>
合计	<u>(640,305,705.98)</u>	<u>(146,708,228.33)</u>	<u>26,405,605.81</u>	<u>(760,608,328.50)</u>
	2021 年 1 月 1 日	税后归属于 母公司	其他综合收益转留 存收益	2021 年 12 月 31 日
其他债权投资公允价值变动	(342,924,986.70)	77,175,937.57	-	(265,749,049.13)
其他债权投资信用减值准备	216,592,837.11	140,490,753.16	-	357,083,590.27
其他权益工具投资公允价值变动	(693,727,610.47)	(262,942,860.77)	426,951,683.03	(529,718,788.21)
权益法下可转损益的其他综合收益	(2,227,800.45)	(2,188,823.88)	-	(4,416,624.33)
外币报表折算差额	<u>(108,425,098.44)</u>	<u>(89,079,736.14)</u>	<u>-</u>	<u>(197,504,834.58)</u>
合计	<u>(930,712,658.95)</u>	<u>(136,544,730.06)</u>	<u>426,951,683.03</u>	<u>(640,305,705.98)</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

35 其他综合收益(续)

(2) 利润表中归属于母公司的其他综合收益情况表

项目	截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间				
	本期所得税前发生额	减：前期计入其他综合收益本期转出	减：所得税费用	减：税后归属于少数股东	税后归属于母公司
将重分类进损益的其他综合收益					
其他债权投资公允价值变动	(246,112,899.99)	49,956,184.22	37,844,750.31	18,659,408.00	(139,652,557.46)
其他债权投资信用减值准备	48,746,046.76	-	(9,477,235.32)	(8,883,036.96)	30,385,774.48
权益法下可转损益的其他综合收益	4,365,114.58	-	-	-	4,365,114.58
外币报表折算差额	197,929,609.65	-	-	(24,960,580.21)	172,969,029.44
不能重分类进损益的其他综合收益					
其他权益工具投资公允价值变动	(281,605,054.13)	-	66,829,464.76	-	(214,775,589.37)
合计	(276,677,183.13)	49,956,184.22	95,196,979.75	(15,184,209.17)	(146,708,228.33)
项目	截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间				
	本期所得税前发生额	减：前期计入其他综合收益本期转出	减：所得税费用	减：税后归属于少数股东	税后归属于母公司
将重分类进损益的其他综合收益					
其他债权投资公允价值变动	(136,450,182.37)	138,849,302.18	(607,111.09)	(277,418.65)	1,514,590.07
其他债权投资信用减值准备	195,225,991.13	-	(48,806,497.78)	861,884.45	147,281,377.80
权益法下可转损益的其他综合收益	(696,896.41)	-	-	-	(696,896.41)
外币报表折算差额	(31,234,320.50)	-	-	13,535,048.61	(17,699,271.89)
不能重分类进损益的其他综合收益					
其他权益工具投资公允价值变动	(456,870,929.02)	-	114,217,732.25	-	(342,653,196.77)
合计	(430,026,337.17)	138,849,302.18	64,804,123.38	14,119,514.41	(212,253,397.20)

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 五 合并财务报表项目附注(续)

#### 36 盈余公积

	2022 年 1 月 1 日	本期提取	本期减少	2022 年 6 月 30 日
法定盈余公积金	3,754,182,290.54	-	-	3,754,182,290.54
任意盈余公积金	<u>106,156,577.78</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>106,156,577.78</u>
合计	<u>3,860,338,868.32</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>3,860,338,868.32</u>
	2021 年 1 月 1 日	本年提取	本年减少	2021 年 12 月 31 日
法定盈余公积金	3,457,394,282.62	296,788,007.92	-	3,754,182,290.54
任意盈余公积金	<u>106,156,577.78</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>106,156,577.78</u>
合计	<u>3,563,550,860.40</u>	<u>296,788,007.92</u>	<u>-</u>	<u>3,860,338,868.32</u>

#### 37 一般风险准备

	2022 年 1 月 1 日	本期增加	本期减少	2022 年 6 月 30 日
一般风险准备	8,569,144,070.68	26,151,741.30	-	8,595,295,811.98
交易风险准备	<u>7,667,598,680.23</u>	<u>7,761,225.65</u>	<u>-</u>	<u>7,675,359,905.88</u>
合计	<u>16,236,742,750.91</u>	<u>33,912,966.95</u>	<u>-</u>	<u>16,270,655,717.86</u>
	2021 年 1 月 1 日	本年增加	本年减少	2021 年 12 月 31 日
一般风险准备	7,536,687,939.73	1,032,456,130.95	-	8,569,144,070.68
交易风险准备	<u>6,704,018,578.19</u>	<u>963,580,102.04</u>	<u>-</u>	<u>7,667,598,680.23</u>
合计	<u>14,240,706,517.92</u>	<u>1,996,036,232.99</u>	<u>-</u>	<u>16,236,742,750.91</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

38 未分配利润

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
期初未分配利润	31,358,141,449.76	27,183,981,098.98
加：本期归属于母公司股东的净利润	3,361,795,635.20	4,520,909,978.30
减：提取一般风险准备	(1) (26,151,741.30)	(31,025,687.09)
提取交易风险准备	(1) (7,761,225.65)	-
向股东分配股利	(2) (2,503,994,456.00)	(2,503,994,456.00)
其他综合收益转出	(26,405,605.81)	-
期末未分配利润	(3) <u>32,155,624,056.20</u>	<u>29,169,870,934.19</u>

(1) 提取各项盈余公积和风险准备

本集团按照相关法律法规及公司章程规定提取截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间的法定盈余公积、一般风险准备及交易风险准备。

(2) 向股东分配现金股利

经本公司 2022 年 6 月 10 日股东大会批准，本公司以 2021 年 12 月 31 日总股本 25,039,944,560 股为基数，向全体股东每 10 股派发现金股利 1.00 元(含税)，共分配利润 2,503,994,456.00 元(含税)。

经本公司 2021 年 5 月 28 日股东大会批准，本公司以 2020 年 12 月 31 日总股本 25,039,944,560 股为基数，向全体股东每 10 股派发现金股利 1.00 元(含税)，共分配利润 2,503,994,456.00 元(含税)。

(3) 期/年末未分配利润的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本集团的未分配利润余额中包括子公司提取的盈余公积归属于母公司部分人民币 4,380,963,054.21 元(2021 年 12 月 31 日：人民币 4,380,848,993.19 元)，以及吸收合并宏源证券取得的同一控制下股东所享有部分人民币 2,184,620,646.10 元(2021 年 12 月 31 日：人民币 2,184,620,646.10 元)。

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

39 其他权益工具

	2022 年 1 月 1 日		本期增加		本期减少		2022 年 6 月 30 日	
	数量	账面价值	数量	账面价值	数量	账面价值	数量	账面价值
永续债 (1)								
	<u>100,000,000.00</u>	<u>10,099,367,873.36</u>	<u>-</u>	<u>276,480,767.12</u>	<u>-</u>	<u>(82,000,000.00)</u>	<u>100,000,000.00</u>	<u>10,293,848,640.48</u>

(1) 经中国证券监督管理委员会证券基金机构监管部机构部函[2020]3544 号文核准，本公司的子公司：申万宏源证券有限公司(以下简称“申万宏源证券”)于 2021 年 6 月 24 日、2021 年 8 月 19 日、2021 年 11 月 15 日分别发行了三期永续次级债券(以下统称“永续债”)，即 21 申证 Y1、21 申证 Y2 及 21 申证 Y3，债券面值均为人民币 100 元，票面利率分别为 4.10%、3.70%及 3.88%，面值总额为人民币 10,000,000,000.00 元。永续债的其他主要条款如下：

- (a) 利率在债券存续的前五个计息年度内按票面利率保持不变，自第六个计息年度起每五年重置一次，每次重置票面利率以当期基准利率加上初始利差再加上 300 个基点确定。
- (b) 除非发生强制付息事件，该永续债的每个付息日，申万宏源证券可自行选择将当期利息以及按照合同条款已经递延的所有利息及其孳息推迟至下一个付息日支付，且不受到任何递延支付利息次数的限制，前述利息递延不构成申万宏源证券未能按照约定足额支付利息。每笔递延利息在递延期间应按当期票面利率累计计息。
- (c) 当存在递延支付利息的情形时，申万宏源证券在已递延利息及其孳息全部清偿完毕前不得向普通股股东分红和减少注册资本。
- (d) 清偿顺序在本公司的普通债务和次级债务之后，除非公司清算，投资者不能要求公司加速偿还本次债券的本金。

由于该永续债未构成申万宏源证券无法避免的支付现金或其他金融资产的合同义务，因此分类为权益工具，列示为其他权益工具。

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外, 金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

40 手续费及佣金净收入

(1) 按收入类别列示

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
证券经纪业务净收入	2,465,888,246.86	2,505,956,256.88
—证券经纪业务收入	3,046,905,481.81	3,164,950,413.58
—代理买卖证券业务	2,387,616,890.34	2,554,417,991.00
—交易单元席位租赁	526,527,283.36	404,734,758.05
—代销金融产品业务	132,761,308.11	205,797,664.53
—证券经纪业务支出	(581,017,234.95)	(658,994,156.70)
—代理买卖证券业务	(581,017,234.95)	(658,994,156.70)
期货经纪业务净收入	321,758,444.43	347,850,992.38
—期货经纪业务收入	788,787,925.34	573,917,348.58
—期货经纪业务支出	(467,029,480.91)	(226,066,356.20)
投资银行业务净收入	813,411,847.55	713,506,925.30
—投资银行业务收入	821,224,402.54	735,200,633.62
—证券承销业务	692,237,476.01	586,956,896.98
—证券保荐业务	52,147,576.69	45,503,773.72
—财务顾问业务	76,839,349.84	102,739,962.92
—投资银行业务支出	(7,812,554.99)	(21,693,708.32)
—证券承销业务	(7,750,541.23)	(20,938,774.33)
—财务顾问业务	(62,013.76)	(754,933.99)
资产管理业务净收入	353,356,731.00	329,307,773.11
—资产管理业务收入	353,887,536.66	330,085,395.05
—资产管理业务支出	(530,805.66)	(777,621.94)
基金管理业务净收入	309,566,493.03	275,720,815.46
—基金管理业务收入	309,566,493.03	275,720,815.46
投资咨询业务净收入	67,017,038.96	31,160,446.03
—投资咨询业务收入	75,174,430.61	54,825,192.33
—投资咨询业务支出	(8,157,391.65)	(23,664,746.30)
合计	4,330,998,801.83	4,203,503,209.16
其中：手续费及佣金收入合计	5,395,546,269.99	5,134,699,798.62
手续费及佣金支出合计	(1,064,547,468.16)	(931,196,589.46)

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外, 金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

40 手续费及佣金净收入(续)

(1) 按收入类别列示(续)

(a) 财务顾问业务净收入

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
其他财务顾问业务净收入	69,876,392.67	95,116,157.21
并购重组财务顾问业务净收入-境内上市公司	6,900,943.41	6,868,871.72
合计	<u>76,777,336.08</u>	<u>101,985,028.93</u>

(2) 手续费及佣金收入的分解

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间及 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间本集团手续费及佣金收入按收入确认时点分解后的信息如下:

	截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间	
	在某一时点 确认收入	在一段时间内 确认收入
证券经纪及期货经纪业务收入	3,835,693,407.15	-
投资咨询业务收入	75,174,430.61	-
投资银行业务收入	769,076,825.85	52,147,576.69
资产管理及基金管理业务收入	-	663,454,029.69
合计	<u>4,679,944,663.61</u>	<u>715,601,606.38</u>

	截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间	
	在某一时点 确认收入	在一段时间内 确认收入
证券经纪及期货经纪业务收入	3,738,867,762.16	-
投资咨询业务收入	54,825,192.33	-
投资银行业务收入	735,200,633.62	-
资产管理及基金管理业务收入	-	605,806,210.51
合计	<u>4,528,893,588.11</u>	<u>605,806,210.51</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

41 利息净(支出)/收入

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
利息收入		
其中：货币资金及结算备付金利息收入	1,492,834,034.80	1,173,921,408.64
融出资金利息收入	2,365,590,474.46	2,729,597,782.24
买入返售金融资产利息收入	159,619,449.05	356,906,078.04
其中：股票质押回购利息收入	52,593,746.39	293,774,070.58
债权投资利息收入	134,021,611.95	176,712,187.22
其他债权投资利息收入	813,170,787.25	1,142,557,873.30
利息收入小计	<u>4,965,236,357.51</u>	<u>5,579,695,329.44</u>
利息支出		
其中：短期借款利息支出	(24,957,597.53)	(56,097,871.10)
应付短期融资款利息支出	(404,676,137.35)	(467,238,053.45)
拆入资金利息支出	(144,426,622.15)	(220,326,154.58)
其中：转融通利息支出	(76,110,850.87)	(14,988,888.87)
卖出回购金融资产款利息支出	(1,457,155,598.76)	(1,247,322,362.70)
其中：报价回购利息支出	(238,270,188.09)	(111,163,275.31)
代理买卖证券款利息支出	(238,784,563.57)	(185,096,197.72)
应付债券利息支出	(2,617,968,785.60)	(2,269,260,203.63)
其中：次级债券利息支出	(398,868,717.25)	(325,621,205.51)
合并结构化主体形成的		
其他金融负债利息支出	(59,621,657.66)	(118,318,234.60)
租赁负债的利息支出	(19,151,276.71)	(17,939,526.53)
其他	(33,251,880.05)	(50,939,037.91)
利息支出小计	<u>(4,999,994,119.38)</u>	<u>(4,632,537,642.22)</u>
利息净(支出)/收入	<u>(34,757,761.87)</u>	<u>947,157,687.22</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

42 投资收益

(1) 按类别列示

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
权益法核算的长期股权投资收益	371,721,706.17	398,967,076.21
金融工具投资收益	(84,435,405.67)	4,651,995,667.28
其中：持有期间取得的收益	3,254,360,249.57	3,962,705,989.76
其中：交易性金融工具(a)	3,222,080,385.89	3,550,115,043.96
其他权益工具投资	32,279,863.68	412,590,945.80
处置金融工具的收益	(3,338,795,655.24)	689,289,677.52
其中：交易性金融工具(a)	(4,200,922,281.33)	706,787,880.05
其他债权投资	6,321,405.18	35,137,076.23
衍生金融工具	875,146,393.12	(52,635,278.76)
债权投资	(19,341,172.21)	-
合计	287,286,300.50	5,050,962,743.49

(a) 交易性金融工具投资收益明细如下：

		截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年	2021 年
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	持有期间收益	3,242,019,514.34	3,550,115,043.96
	处置取得收益	(4,214,448,717.31)	783,301,784.77
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	持有期间收益	(19,939,128.45)	-
	处置取得收益	13,526,435.98	(76,513,904.72)

(2) 对联营企业和合营企业的投资收益

参见附注五、13(1)和(2)。

(3) 投资收益汇回有无重大限制

以上投资收益汇回均无重大限制。

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

43 其他收益

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间		与资产相关/ 与收益相关
	2022 年	2021 年	
政府补助	245,950,181.61	47,578,932.82	与收益相关

44 公允价值变动收益/(损失)

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
衍生金融工具	2,279,877,157.35	(564,814,318.86)
交易性金融资产	1,460,913,583.46	552,730,576.25
交易性金融负债	724,887,522.11	(4,854,155.78)
合计	4,465,678,262.92	(16,937,898.39)

45 其他业务收入

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
大宗商品销售收入	3,487,315,773.18	5,838,287,314.54
资产出租和保管收入	11,196,600.24	8,781,499.31
其他	46,044,242.13	27,721,799.33
合计	3,544,556,615.55	5,874,790,613.18

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

46 资产处置收益

项目	截至 6 月 30 日止 6 个月期间		计入
	2022 年	2021 年	截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间非经常性损益的金额
固定资产处置收益	812,939.37	1,993,193.33	812,939.37

47 税金及附加

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
城市维护建设税	36,327,757.61	40,508,468.00
教育费附加及地方教育附加	26,006,433.01	28,762,821.40
其他	14,976,351.99	17,381,124.82
合计	77,310,542.61	86,652,414.22

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

48 业务及管理费

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
职工费用	3,350,053,671.60	3,499,090,830.24
使用权资产折旧费	191,132,383.45	167,348,307.72
电子设备运转费	97,620,191.91	103,499,828.67
固定资产折旧	87,811,231.12	79,180,845.38
办公运营费	75,327,252.09	71,574,730.48
租赁费及物业费	69,921,821.52	66,121,268.52
无形资产摊销	62,456,948.19	48,185,064.52
专业服务及咨询费	51,100,753.09	76,814,750.30
差旅费	34,459,274.58	44,329,938.28
邮电通信费	30,617,164.82	93,534,440.53
其他	268,182,143.13	332,722,496.49
合计	<u>4,318,682,835.50</u>	<u>4,582,402,501.13</u>

49 信用减值损失

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
买入返售金融资产	608,859,264.33	(105,936,335.85)
其他债权投资	48,746,046.76	195,225,991.13
债权投资	24,656,292.13	13,650,476.64
应收款项	10,442,116.37	20,059,961.39
其他金融资产	3,075,214.16	26,152,108.51
货币资金	112,836.73	(639,871.45)
融出资金	(11,530,271.48)	77,563,403.43
合计	<u>684,361,499.00</u>	<u>226,075,733.80</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

50 其他资产减值转回

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
大宗商品存货	<u>(24,267,341.62)</u>	<u>(1,357,625.55)</u>

51 其他业务成本

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
大宗商品销售成本	3,623,129,875.90	5,799,377,983.01
资产出租和保管支出	2,242,825.83	2,657,786.65
其他	<u>157,101.59</u>	<u>1,653,356.22</u>
合计	<u>3,625,529,803.32</u>	<u>5,803,689,125.88</u>

52 营业外收入

项目	截至 6 月 30 日止 6 个月期间		计入截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间非经常性损益的金额
	2022 年	2021 年	
其他收入	<u>3,297,084.89</u>	<u>6,268,856.96</u>	<u>3,297,084.89</u>

53 营业外支出

项目	截至 6 月 30 日止 6 个月期间		计入截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间非经常性损益的金额
	2022 年	2021 年	
对外捐赠及赞助支出	35,406,000.00	33,571,198.95	35,406,000.00
违约金及赔偿毁损	13,594,776.39	1,246,595.23	13,594,776.39
报废非流动资产损失	2,505,627.80	1,796,800.73	2,505,627.80
其他	<u>141,504.17</u>	<u>4,395,252.25</u>	<u>141,504.17</u>
合计	<u>51,647,908.36</u>	<u>41,009,847.16</u>	<u>51,647,908.36</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

54 所得税费用

(1) 本期所得税费用组成

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
按税法及相关规定计算的当期所得税	393,332,771.82	840,262,887.48
递延所得税	74,058,316.65	(79,735,290.93)
汇算清缴差异	(11,048,775.14)	20,204,292.71
合计	<u>456,342,313.33</u>	<u>780,731,889.26</u>

(2) 所得税费用与会计利润的关系

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
利润总额	<u>4,088,916,479.06</u>	<u>5,347,138,844.35</u>
按税率 25%计算的预期所得税	1,022,229,119.77	1,336,784,711.09
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	9,706,839.96	20,162,722.23
非应纳税收入的影响	(622,477,115.66)	(575,372,605.49)
子公司适用不同税率的影响	7,701,888.10	(5,137,454.39)
当期未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异或可抵扣亏损的影响	63,347,944.51	3,972,389.21
汇算清缴差异调整	(11,048,775.14)	20,204,292.71
其他	(13,117,588.21)	(19,882,166.10)
所得税费用	<u>456,342,313.33</u>	<u>780,731,889.26</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

55 每股收益

基本每股收益按照归属于本公司普通股股东的当期净利润，除以发行在外的普通股的加权平均数计算。于2022年6月30日，本公司已发行股份按加权平均计算的股数为25,039,944,560股(2021年12月31日：25,039,944,560股)。基本每股收益的具体计算如下：

项目	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
收益：		
归属于本公司普通股股东的当年净利润	3,361,795,635.20	4,520,909,978.30
股份：		
本公司发行在外普通股的加权平均数	25,039,944,560.00	25,039,944,560.00
基本每股收益	0.13	0.18

本公司无稀释性潜在普通股。

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

56 现金流量表相关情况

(1) 收到的其他与经营活动有关的现金

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
大宗商品贸易收到的现金	3,905,793,665.96	6,950,342,041.12
合并结构化主体净增加的现金	479,463,953.73	-
收到的政府补助	246,050,181.61	47,616,017.49
房屋租赁收入	11,785,894.99	9,243,683.48
其他	100,732,618.48	34,308,374.52
合计	<u>4,743,826,314.77</u>	<u>7,041,510,116.61</u>

(2) 支付的其他与经营活动有关的现金

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
大宗商品贸易支付的现金	3,401,758,700.02	5,887,531,157.94
往来款项支付的现金	1,714,876,162.94	2,653,592,756.45
支付的存出保证金	2,034,743,347.96	1,711,077,586.73
支付运营和管理费用	451,944,189.48	714,406,562.18
支付租赁费及物业费用	69,921,821.52	66,121,268.52
支付专业服务及咨询费	51,100,753.09	76,814,750.30
支付证券投资者保护基金	22,755,230.30	26,196,684.04
资管业务款支付的现金	-	44,747,345.00
其他	60,721,279.31	636,567,009.11
合计	<u>7,807,821,484.62</u>	<u>11,817,055,120.27</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

56 现金流量表相关情况(续)

(3) 现金流量表补充资料

(a) 将净利润调节为经营活动现金流量

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
净利润	3,632,574,165.73	4,566,406,955.09
加：信用/其他资产减值损失	660,094,157.38	224,718,108.25
固定资产折旧	87,811,231.12	79,180,845.38
投资性房地产折旧	2,242,825.83	2,657,786.65
无形资产摊销	62,456,948.19	48,185,064.52
长期待摊费用摊销	16,932,119.81	32,994,610.87
使用权资产折旧	191,132,383.45	167,348,307.72
处置或报废固定资产、无形资产和其他长期资产的损益	1,613,788.56	(202,606.81)
公允价值变动损益	(4,465,678,262.92)	16,937,898.39
利息净支出	2,120,884,119.78	1,497,053,825.67
汇兑损失	21,640,698.57	29,706,496.78
投资收益	(390,981,802.82)	(846,695,098.24)
递延所得税资产增加	(104,460,591.23)	(144,176,104.34)
递延所得税负债减少	(22,566,111.11)	(373,084.82)
交易性金融资产的减少/(增加)	5,582,110,813.90	(41,707,442,220.34)
经营性应收项目的减少/(增加)	4,695,802,348.65	(6,993,116,881.69)
经营性应付项目的增加	13,425,912,965.38	14,683,738,517.70
经营活动产生的现金流量净额	<u>25,517,521,798.27</u>	<u>(28,343,077,579.22)</u>

(b) 不涉及现金收支的重大经营、投资和筹资活动

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间，本集团无不涉及现金收支的重大投资和筹资活动。

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

56 现金流量表相关情况(续)

(3) 现金流量表补充资料(续)

(c) 现金及现金等价物净变动情况

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
现金的期末余额	145,845,270,771.84	119,150,284,952.89
减：现金的期初余额	(128,019,732,142.01)	(111,534,514,752.59)
加：现金等价物的期末余额	23,931,298,321.48	13,124,108,345.61
减：现金等价物的期初余额	(18,041,701,073.74)	(11,664,463,355.84)
现金及现金等价物的变动净额	<u>23,715,135,877.57</u>	<u>9,075,415,190.07</u>

(4) 现金及现金等价物的构成

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 6 月 30 日
货币资金	129,640,199,832.04	100,129,390,711.82
其中：库存现金	71,619.77	71,099.17
可随时用于支付的银行存款	121,407,989,887.28	96,695,319,212.88
可随时用于支付的 其他货币资金	550,086,519.83	206,336,276.03
三个月以上定期存款	6,965,241,000.00	2,637,500,000.00
受限制的货币资金	716,810,805.16	590,164,123.74
结算备付金	23,887,122,744.96	22,248,558,364.81
三个月以内的债券逆回购	23,931,298,321.48	13,124,108,345.61
期末货币资金、结算备付金及现金等价物	177,458,620,898.48	135,502,057,422.24
其中：三个月以上定期存款	(6,965,241,000.00)	(2,637,500,000.00)
受限制的货币资金	(716,810,805.16)	(590,164,123.74)
期末现金及现金等价物余额	<u>169,776,569,093.32</u>	<u>132,274,393,298.50</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

57 外币货币性项目

	2022 年 6 月 30 日		
	外币余额	折算汇率	人民币余额
货币资金			
其中：美元	511,417,913.28	6.71140	3,432,330,183.17
港币	5,436,963,684.20	0.85519	4,649,636,973.10
其他币种			136,127,106.68
合计			<u>8,218,094,262.95</u>
结算备付金			
其中：美元	55,195,901.41	6.71140	370,441,772.73
港币	251,980,700.90	0.85519	215,491,375.60
合计			<u>585,933,148.33</u>
融出资金			
其中：港币	1,789,033,574.10	0.85519	<u>1,529,963,622.23</u>
应收款项			
其中：港币	5,970,823,381.08	0.85519	<u>5,106,188,447.27</u>
存出保证金			
其中：美元	9,506,870.68	6.71140	63,804,411.88
港币	148,561,953.81	0.85519	127,048,697.28
合计			<u>190,853,109.16</u>
其他资产			
其中：美元	2,365,156.36	6.71140	15,873,510.39
港币	273,849,877.70	0.85519	234,193,676.91
合计			<u>250,067,187.30</u>
短期借款			
其中：港币	3,002,910,136.21	0.85519	<u>2,568,058,719.39</u>
代理买卖证券款			
其中：美元	653,865,827.78	6.71140	4,388,355,116.56
港币	7,233,740,141.90	0.85519	6,186,222,231.95
其他币种			160,887,806.04
合计			<u>10,735,465,154.55</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

57 外币货币性项目(续)

	2022 年 6 月 30 日		
	外币余额	折算汇率	人民币余额
应付债券			
其中：美元	802,836,432.48	6.71140	<u>5,388,156,432.92</u>
应付短期融资款			
其中：美元	200,899,277.22	6.71140	<u>1,348,315,409.16</u>
应付款项			
其中：港币	538,558,679.46	0.85519	<u>460,569,997.09</u>
其他负债			
其中：港币	352,172,664.45	0.85519	<u>301,174,540.91</u>
	2021 年 12 月 31 日		
	外币余额	折算汇率	人民币余额
货币资金			
其中：美元	372,513,606.56	6.37570	2,375,035,001.28
港币	5,184,817,342.82	0.81760	4,239,106,659.49
其他币种			<u>289,294,944.10</u>
合计			<u>6,903,436,604.87</u>
结算备付金			
其中：美元	149,809,961.83	6.37570	955,143,373.66
港币	2,246,165,639.30	0.81760	<u>1,836,465,026.69</u>
合计			<u>2,791,608,400.35</u>
融出资金			
其中：港币	2,552,063,936.26	0.81760	<u>2,086,567,474.29</u>
应收款项			
其中：港币	2,780,658,710.26	0.81760	<u>2,273,466,561.51</u>
存出保证金			
其中：美元	540,000.00	6.37570	3,442,878.00
港币	3,221,535,498.25	0.81760	<u>2,633,927,423.36</u>
合计			<u>2,637,370,301.36</u>
其他资产			
其中：港币	348,166,932.84	0.81760	<u>284,661,284.29</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

57 外币货币性项目(续)

	2021 年 12 月 31 日		
	外币余额	折算汇率	人民币余额
短期借款			
其中：美元	405,129,522.20	6.37570	2,582,984,294.69
港币	350,201,544.66	0.81760	<u>286,324,782.91</u>
合计			<u>2,869,309,077.60</u>
代理买卖证券款			
其中：美元	341,754,260.26	6.37570	2,178,922,637.14
港币	8,382,400,124.58	0.81760	<u>6,853,450,341.86</u>
合计			<u>9,032,372,979.00</u>
应付债券			
其中：美元	501,628,575.27	6.37570	<u>3,198,233,307.37</u>
应付款项			
其中：港币	2,674,008,617.19	0.81760	<u>2,186,269,445.41</u>
其他负债			
其中：港币	395,786,843.85	0.81760	<u>323,595,323.53</u>

境外经营实体说明

本集团主要境外经营实体为本公司子公司申万宏源(香港)有限公司，其经营地在香港，记账本位币为港币。记账本位币依据境外经营实体的主要经济环境决定，报告期内未发生变化。

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

58 租赁

(1) 本集团及本公司作为承租人的租赁情况

本集团租用房屋及建筑物作为其办公场所，办公租赁通常为期 1 年 - 5 年。

(2) 使用权资产

项目	房屋及建筑物
原值	
2021 年 1 月 1 日余额	1,335,344,252.16
本年增加	450,578,429.37
本年减少	(300,386,740.41)
2021 年 12 月 31 日余额	<u>1,485,535,941.12</u>
本期增加	156,264,514.35
本期减少	(107,568,262.01)
2022 年 6 月 30 日余额	<u>1,534,232,193.46</u>
减：累计折旧	
2021 年 1 月 1 日余额	(470,662,606.55)
本年计提	(349,184,325.84)
本年减少	282,917,195.85
2021 年 12 月 31 日余额	<u>(536,929,736.54)</u>
本期计提	(191,132,383.45)
本期减少	105,868,929.26
2022 年 6 月 30 日余额	<u>(622,193,190.73)</u>
减：减值准备	
2021 年 1 月 1 日余额	<u>-</u>
2021 年 12 月 31 日余额	<u>-</u>
2022 年 6 月 30 日余额	<u>-</u>
账面价值	
2022 年 6 月 30 日	<u>912,039,002.73</u>
2021 年 12 月 31 日	<u>948,606,204.58</u>

申万宏源集团股份有限公司  
财务报表附注  
截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
(除特别注明外，金额单位为人民币元)

五 合并财务报表项目附注(续)

58 租赁(续)

(3) 租赁负债

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
一年以上的非流动租赁负债	558,843,841.57	663,779,179.78
一年以内到期的租赁负债	<u>392,458,392.95</u>	<u>305,436,115.14</u>
合计	<u>951,302,234.52</u>	<u>969,215,294.92</u>

(4) 未纳入租赁负债计量的未来潜在现金流出

本集团未纳入租赁负债计量的未来潜在现金流出主要来源于已承诺但尚未开始的租赁等风险敞口。本集团已承诺但尚未开始的租赁预计未来年度现金流出不重大。

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

六 在其他主体中的权益

1 在子公司中的权益

(1) 本集团的构成

子公司及纳入合并财务报表范围的结构化主体情况参见附注四、1 及附注四、2。

(2) 重要的非全资子公司

子公司名称	2022 年 6 月 30 日			
	少数股东的持股比例 (a)	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
申万宏源(香港)有限公司	35.10%	(35,888,059.43)	-	1,054,847,005.62
申万菱信基金管理有限公司	33.00%	41,367,002.16	-	366,001,706.73
子公司名称	2021 年 12 月 31 日			
	少数股东的持股比例 (a)	本年 归属于少数 股东的损益	本年向少 数股东宣告 分派的股利	年末 少数股东 权益余额
申万宏源(香港)有限公司	35.10%	(27,894,628.44)	12,848,262.36	1,100,505,964.67
申万菱信基金管理有限公司	33.00%	41,367,002.16	-	366,001,706.73

(a) 该比例为于 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 12 月 31 日，扣除本公司直接持有权益比例与通过各层控股关系之持有权益比例相乘得出的间接持有权益比例之和之后的比例。

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外, 金额单位为人民币元)

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

下表列示了上述子公司的主要财务信息, 这些子公司的主要财务信息是集团内部交易抵销前的金额, 但是经过了相关合并日公允价值以及统一会计政策的调整:

	申万宏源(香港)有限公司		申万菱信基金管理有限公司	
	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
资产总额	19,379,951,947.78	21,180,871,606.77	1,593,124,268.70	1,455,088,860.00
负债总额	16,220,026,565.02	18,075,388,785.95	406,065,351.32	345,992,779.00
	截至 6 月 30 日止 6 个月期间		截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年	2022 年	2021 年
营业收入	141,367,518.64	268,203,679.27	315,455,082.36	326,598,683.34
净利润	(102,245,183.57)	46,653,465.14	77,962,836.38	72,512,005.97
综合收益总额	(130,082,504.41)	40,887,952.28	77,962,836.38	72,512,005.97
经营活动现金流量	6,411,954.38	(3,875,132,673.27)	109,193,575.51	33,424,061.39

2 在合营企业和联营企业中的权益

(1) 合营企业或联营企业

参见附注五、13(3)和附注五、13(4)。

(2) 重要合营企业的主要财务信息

于 2022 年 6 月 30 日, 本集团不存在重要合营企业(2021 年 12 月 31 日: 无)。

(3) 重要联营企业的主要财务信息

参见附注五、13(5)。

(4) 不重要合营企业和联营企业的汇总财务信息

参见附注五、13(6)。

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

七 在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

1 在第三方机构发起设立的结构化主体中享有的权益

于 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 12 月 31 日，本集团通过直接投资在第三方机构发起设立的结构化主体中享有的权益在本集团资产负债表中的相关资产负债项目账面价值及最大风险敞口金额一致，列示如下：

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
交易性金融资产	94,829,768,653.64	89,336,267,766.31
债权投资	<u>4,189,635,655.80</u>	<u>4,556,683,533.69</u>
合计	<u>99,019,404,309.44</u>	<u>93,892,951,300.00</u>

2 在本集团作为发起人但未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的权益

本集团发起设立的未纳入合并财务报表范围的结构化主体，主要包括本集团发起设立的资产管理计划及投资基金。作为这些结构化主体的管理人，本集团代理客户将募集到的资金根据产品合同的约定投入相关基础资产。本集团在这些未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的权益主要包括直接持有投资和/或通过管理这些结构化主体收取管理费收入、手续费收入及业绩报酬。本集团所承担的与这些结构化主体收益相关的可变回报表明本集团为该结构化主体的代理人而非主要责任人。因此，本集团未合并此类结构化主体。

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间，本集团发起设立但未纳入合并财务报表范围的结构化主体中获得的管理费净收入为人民币 662,923,224.03 元(截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间：人民币 605,028,588.57 元)，具体信息参见附注五、40。

于 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 12 月 31 日，本集团通过直接持有本集团发起设立的未纳入合并财务报表范围的结构化主体中享有的权益在本集团资产负债表中的相关资产负债项目账面价值及最大风险敞口金额一致，列示如下：

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
交易性金融资产	<u>1,984,759,152.83</u>	<u>3,464,559,601.13</u>

申万宏源集团股份有限公司  
财务报表附注  
截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
(除特别注明外，金额单位为人民币元)

八 分部报告

管理层根据业务性质和提供的服务按照下列分部管理业务经营：

—企业金融分部主要包括向企业提供投资银行服务和使用自有资金进行对外投资(即本金投资)。投资银行业务提供股票保荐及承销、债券承销及结构性融资、并购重组财务顾问以及新三板业务等服务；此外通过各类金融工具进行股权和债权的本金投资；

—个人金融分部主要向个人及非专业机构投资者提供证券经纪、期货经纪、融资融券、股票质押式融资、金融产品代销和投资顾问等服务；

—机构服务及交易分部主要包括为专业机构投资者提供主经纪商服务与研究咨询等服务，以及进行二级市场上的固定收益类、权益类、权益挂钩证券类投资与投资交易，并以此为基础为机构客户提供销售、交易、对冲和场外衍生品服务；

—投资管理分部主要包括资产管理、公募基金管理和私募基金管理业务。

编制分部报告所采用的会计政策与编制本集团财务报表所采用的会计政策一致。

分部间转移价格参照向第三方销售所采用的价格确定。

资产根据分部的经营以及资产的所在位置进行分配，负债根据分部的经营进行分配。

分部资本性支出是指在会计期间内分部购入的固定资产、无形资产和其他长期资产所发生的支出总额。

本集团主要在中国内地和香港地区提供服务，全部的对外交易收入主要来源于中国内地和香港地区，本集团金融资产及递延所得税资产之外的非流动资产均位于中国内地和香港地区。

由于本集团业务并不向特定客户开展，因此不存在对单一客户的重大依存。

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

八 分部报告(续)

	截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间					
	企业金融		个人金融	机构服务及交易	投资管理	合计
	投资银行	本金投资				
营业收入	840,288,100.28	416,569,162.38	4,409,664,822.36	6,367,147,411.31	785,215,145.01	12,818,884,641.34
手续费及佣金净收入	813,411,847.55	10,442,758.23	2,163,351,687.41	678,868,408.22	664,924,100.42	4,330,998,801.83
利息净支出	6,584,345.04	(351,583,391.45)	2,203,377,532.50	(1,860,474,730.80)	(32,661,517.16)	(34,757,761.87)
投资收益	41,678,801.53	654,032,533.31	69,423,765.09	(469,956,170.99)	(7,892,628.44)	287,286,300.50
公允价值变动收益	(23,840,367.20)	(51,240,879.06)	(129,861,896.90)	4,500,807,187.23	169,814,218.85	4,465,678,262.92
其他	2,453,473.36	154,918,141.35	103,373,734.26	3,517,902,717.65	(8,969,028.66)	3,769,679,037.96
营业支出	489,237,196.37	157,222,230.29	3,114,407,249.92	4,535,352,852.79	385,397,809.44	8,681,617,338.81
营业利润	351,050,903.91	259,346,932.09	1,295,257,572.44	1,831,794,558.52	399,817,335.57	4,137,267,302.53
利润总额	351,198,780.69	223,966,165.88	1,282,435,477.96	1,831,616,238.16	399,699,816.37	4,088,916,479.06
	2022 年 6 月 30 日					
分部资产	2,213,948,170.35	48,542,070,050.96	216,058,166,566.30	337,160,788,001.71	18,308,126,520.25	622,283,099,309.57
递延所得税资产						2,674,863,925.98
资产总额						624,957,963,235.55
分部负债	773,780,028.34	42,200,897,919.27	178,373,754,055.70	278,082,899,669.41	17,552,250,032.38	516,983,581,705.10
递延所得税负债						4,731,819.62
负债总额						516,988,313,524.72
补充信息						
折旧与摊销费用	21,937,298.87	13,003,973.13	230,643,398.44	81,822,905.88	13,167,932.08	360,575,508.40
资本性支出	2,440,062.48	51,772,038.49	39,946,308.13	8,654,762.17	3,922,988.84	106,736,160.11
信用减值损失	3,753,713.48	(943,345.85)	597,328,992.85	75,499,383.01	8,722,755.51	684,361,499.00
其他资产减值转回	-	-	-	(24,267,341.62)	-	(24,267,341.62)

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

八 分部报告(续)

	截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间					
	企业金融		个人金融	机构服务及交易	投资管理	合计
	投资银行	本金投资				
营业收入	734,447,060.00	574,738,005.72	4,173,564,985.04	9,928,153,901.93	668,438,031.34	16,079,341,984.03
手续费及佣金净收入	689,484,624.01	13,385,556.08	1,956,627,394.28	933,154,550.43	610,851,084.36	4,203,503,209.16
利息净收入	10,662,590.17	(353,765,926.70)	2,009,822,218.86	(717,424,515.79)	(2,136,679.32)	947,157,687.22
投资收益	19,609,461.44	814,911,539.95	42,748,651.95	3,663,228,235.35	510,464,854.80	5,050,962,743.49
公允价值变动损失	13,668,190.03	121,761,191.27	106,751,186.10	209,212,965.75	(468,331,431.54)	(16,937,898.39)
其他	1,022,194.35	(21,554,354.88)	57,615,533.85	5,839,982,666.19	17,590,203.04	5,894,656,242.55
营业支出	399,707,033.17	137,583,721.40	2,125,869,604.39	7,552,371,837.19	481,929,953.33	10,697,462,149.48
营业利润	334,740,026.83	437,154,284.32	2,047,695,380.65	2,375,782,064.74	186,508,078.01	5,381,879,834.55
利润总额	334,644,026.83	404,736,926.43	2,045,197,946.03	2,376,091,865.40	186,468,079.66	5,347,138,844.35
	2021 年 12 月 31 日					
分部资产	3,266,222,261.63	39,078,752,759.63	173,192,125,317.27	357,756,802,682.00	25,147,160,897.81	598,441,063,918.34
递延所得税资产						2,570,403,334.75
资产总额						601,011,467,253.09
分部负债	650,560,220.94	32,070,863,127.06	143,663,715,685.61	294,674,488,624.05	22,869,947,644.44	493,929,575,302.10
递延所得税负债						27,297,930.73
负债总额						493,956,873,232.83
补充信息						
折旧与摊销费用	19,427,809.11	3,088,521.37	177,814,667.05	113,090,575.68	16,945,041.93	330,366,615.14
资本性支出	2,753,040.79	71,714,684.55	49,187,600.44	16,648,932.35	7,201,243.03	147,505,501.16
信用减值损失	436,117.27	713,518.25	(14,543,799.60)	208,104,628.29	31,365,269.59	226,075,733.80
其他资产减值损失	-	-	-	(1,357,625.55)	-	(1,357,625.55)

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

九 关联方关系及其交易

1 母公司情况

(1) 母公司基本情况

	注册地	业务性质	注册资本 人民币
中央汇金	北京	金融投资	8,282.09 亿元

中央汇金其职能是经国务院授权进行股权投资，不从事其他商业性经营活动。

(2) 母公司对本公司的持股比例和表决权比例

	2022 年 6 月 30 日		2021 年 12 月 31 日	
	持股比例	表决权比例	持股比例	表决权比例
中央汇金				
直接持有	20.05%	20.05%	20.05%	20.05%
间接持有	29.65%	31.12%	29.65%	31.12%
合计	49.70%	51.17%	49.70%	51.17%

上表持股比例为本公司的母公司直接持有权益比例与通过各层控股关系之持有权益比例相乘得出的间接持有权益比例之和；表决权比例为本公司的母公司直接持有的表决权比例和通过各层控股关系间接持有的表决权比例之和。

2 子公司情况

子公司的基本情况及相关信息见附注四。

申万宏源集团股份有限公司  
财务报表附注  
截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
(除特别注明外, 金额单位为人民币元)

九 关联方关系及其交易(续)

3 合营企业和联营企业情况

本集团的合营企业和联营企业情况参见附注五、13(3)和附注五、13(4)。

4 其他关联方情况

(1) 持有本公司 5%以上股份的法人

于 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 12 月 31 日, 除本公司母公司外, 其他持有本公司 5%以上股份的法人股东情况如下:

其他关联方名称	其他关联方与本公司的关系	组织机构代码
中建投	持有本公司 5%以上股份的股东	911100007109328650

(2) 中央汇金旗下公司

除中建投外, 中央汇金对部分其他企业拥有股权。中央汇金旗下公司包括其子公司、联营企业及合营企业。

(3) 其他

除上述关联方外, 本集团其他关联方包括《上市公司信息披露管理办法》定义的上市公司关联法人。

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)  
 九 关联方关系及其交易(续)

5 关联交易

下列本公司和合并范围内子公司与关联方进行的交易是按一般正常商业条款或按相关协议进行。

(1) 手续费及佣金收入

本集团

关联方	关联交易类型	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年	2021 年
富国基金管理有限公司	手续费及佣金收入	79,837,931.88	87,923,176.76
中央汇金及其旗下公司	手续费及佣金收入	122,856,525.47	40,634,583.34
其他关联方	手续费及佣金收入	7,330,391.55	14,449,256.82
合计		<u>210,024,848.90</u>	<u>143,007,016.92</u>

本公司

无

(2) 手续费及佣金支出

本集团

关联方	关联交易类型	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年	2021 年
中央汇金及其旗下公司	代理买卖证券业务支出	37,398,945.84	35,599,358.34
其他关联方	代理买卖证券业务支出	2,389,260.47	14,949.47
中央汇金及其旗下公司	资产管理业务支出	964.63	1,139,011.46
其他关联方	资产管理业务支出	248,267.54	436,906.70
中央汇金及其旗下公司	投资银行业务支出	-	84,905.66
合计		<u>40,037,438.48</u>	<u>37,275,131.63</u>

本公司

关联方	关联交易类型	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年	2021 年
申万宏源证券有限公司	投资银行业务支出	<u>7,924,528.31</u>	<u>-</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

九

关联方关系及其交易(续)

5 关联交易(续)

(3) 利息收入

本集团

关联方	关联交易类型	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年	2021 年
中央汇金及其旗下公司	存放金融同业利息收入	181,092,616.28	501,728,926.36
其他关联方	存放金融同业利息收入	18,666,191.58	21,326,616.92
中央汇金及其旗下公司	债券利息收入	1,301,834.81	3,801,408.43
中央汇金及其旗下公司	买入返售金融资产利息收入	16,016.17	40,518.19
合计		<u>201,076,658.84</u>	<u>526,897,469.90</u>

本公司

关联方	关联交易类型	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年	2021 年
中央汇金及其旗下公司	存放金融同业利息收入	216,116.58	9,233,443.76
其他关联方	存放金融同业利息收入	2,298.70	153,042.55
宏源汇智投资有限公司	借款利息收入	74,310,581.82	64,017,307.02
宏源恒利(上海)实业有限公司	借款利息收入	18,190,953.82	25,308,555.28
申万宏源证券有限公司	借款利息收入	7,463,168.82	22,751,357.02
宏源期货有限公司	借款利息收入	6,582,243.51	-
申万宏源产业投资管理有限 责任公司	借款利息收入	1,100,398.02	5,167,935.90
合计		<u>107,865,761.27</u>	<u>126,631,641.53</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

九 关联方关系及其交易(续)

5 关联交易(续)

(4) 利息支出

本集团

关联方	关联交易类型	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年	2021 年
中央汇金及其旗下公司	卖出回购金融资产利息支出	81,870,557.19	96,195,924.45
其他关联方	卖出回购金融资产利息支出	4,653,152.18	24,429,392.62
中央汇金及其旗下公司	拆入资金利息支出	227,500.00	4,651,388.94
中央汇金及其旗下公司	短期借款利息支出	1,721,736.93	1,745,495.52
其他关联方	短期借款利息支出	3,328.60	-
中央汇金及其旗下公司	租赁负债利息支出	408,700.74	370,559.41
合计		<u>88,884,975.64</u>	<u>127,392,760.94</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外, 金额单位为人民币元)

九 关联方关系及其交易(续)

5 关联交易(续)

(4) 利息支出(续)

本公司

关联方	关联交易类型	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年	2021 年
申万宏源承销保荐有限责任公司	应付债券利息支出	3,594,691.70	4,511,285.48

(5) 投资收益

本集团

关联方	关联交易类型	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年	2021 年
富国基金管理有限公司	长期股权投资持有损益	313,067,613.38	344,534,427.58
中央汇金及其旗下公司	处置金融工具的损益	42,698,527.94	60,076,705.01
富国基金管理有限公司	处置金融工具的损益	10,271,677.51	-
其他关联方	处置金融工具的损益	1,415,414.83	655,275.21
中央汇金及其旗下公司	持有金融工具的损益	14,716,552.30	20,091,220.39
其他关联方	持有金融工具的损益	438,377.81	6,060,463.92
合计		382,608,163.77	431,418,092.11

本公司

关联方	关联交易类型	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年	2021 年
中央汇金及其旗下公司	处置金融工具的损益	2,074,986.43	-
申万宏源证券有限公司	子公司分红收入	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
宏源汇智投资有限公司	子公司分红收入	100,000,000.00	150,000,000.00
宏源汇富创业投资有限公司	子公司分红收入	-	25,000,000.00
宏源期货有限公司	子公司分红收入	8,000,000.00	20,000,000.00
合计		3,110,074,986.43	3,195,000,000.00

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外, 金额单位为人民币元)

九 关联方关系及其交易(续)

5 关联交易(续)

(6) 其他业务收入

本集团

关联方	关联交易类型	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年	2021 年
中央汇金及其旗下公司	房屋租赁收入	5,397,981.66	4,527,339.46
中央汇金及其旗下公司	其他收入	48,129.77	48,129.77
合计		<u>5,446,111.43</u>	<u>4,575,469.23</u>

本公司

关联方	关联交易类型	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年	2021 年
申万宏源证券有限公司	房屋租赁收入	14,304,617.87	15,090,021.58
中央汇金及其旗下公司	房屋租赁收入	5,397,981.66	4,527,339.46
申万宏源证券承销保荐 有限责任公司	房屋租赁收入	3,207,044.04	3,207,044.04
宏源汇智投资有限公司	房屋租赁收入	1,000,468.32	1,000,468.33
申万宏源证券有限公司	其他收入	608,113.12	588,474.32
申万宏源证券承销保荐 有限责任公司	其他收入	136,304.84	119,606.21
中央汇金及其旗下公司	其他收入	48,129.77	48,129.77
宏源汇智投资有限公司	其他收入	42,490.09	40,000.10
宏源汇富创业投资有限公司	其他收入	39,860.76	37,537.03
申万宏源产业投资管理 有限责任公司	其他收入	22,507.13	21,182.32
宏源期货有限公司	其他收入	8,203.54	7,783.27
申万宏源西部证券有限公司	其他收入	-	788.18
合计		<u>24,815,721.14</u>	<u>24,688,374.61</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)  
 九 关联方关系及其交易(续)

5 关联交易(续)

(7) 业务及管理费

本集团

关联方	关联交易类型	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年	2021 年
中央汇金及其旗下公司	电子设备运转费	6,618,113.20	8,744,000.00
中央汇金及其旗下公司	使用权资产折旧	5,328,487.59	3,145,133.02
中央汇金及其旗下公司	租赁费及物业费	-	550,184.76
中央汇金及其旗下公司	专业服务及咨询费	-	373,919.05
其他关联方	其他	-	16,006.60
合计		<u>11,946,600.79</u>	<u>12,829,243.43</u>

本公司

关联方	关联交易类型	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
		2022 年	2021 年
中央汇金及其旗下公司	专业服务及咨询费	-	<u>373,919.05</u>

(8) 关键管理人员报酬

参见附注五、27。

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外, 金额单位为人民币元)

九 关联方关系及其交易(续)

6 关联方应收、应付款项余额

(1) 应收关联方款项

		2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
应收款项			
本集团			
应收手续费及佣金	中央汇金及其旗下公司	37,844,156.39	34,794,330.29
应收手续费及佣金	富国基金管理有限公司	35,554,013.56	43,770,075.04
应收手续费及佣金	其他关联方	5,820,234.95	5,971,472.36
合计		<u>79,218,404.90</u>	<u>84,535,877.69</u>
本公司			
无			
其他资产			
本集团			
预付款项	中央汇金及其旗下公司	3,561,790.57	6,142,991.41
预付款项	其他关联方	194,382.95	227,922.71
其他应收款	其他关联方	94,938.33	629.05
合计		<u>3,851,111.85</u>	<u>6,371,543.17</u>
本公司			
其他应收款	申万宏源证券有限公司	-	1,500,719,178.08
其他应收款	宏源汇智投资有限公司	3,244,787,079.38	3,245,099,528.71
其他应收款	宏源恒利(上海)实业有限公 司	700,945,095.93	901,325,589.06
其他应收款	宏源期货有限公司	300,424,027.41	300,192,739.73
其他应收款	申万宏源产业投资管理 有限责任公司	50,063,233.98	73,100,050.17
合计		<u>4,296,219,436.70</u>	<u>6,020,437,085.75</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外, 金额单位为人民币元)

九 关联方关系及其交易(续)

6 关联方应收、应付款项余额(续)

(1) 应收关联方款项(续)

		2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
货币资金			
本集团			
存放关联方款项	中央汇金及其旗下公司	23,151,052,101.09	51,090,398,405.31
存放关联方款项	其他关联方	2,320,254,781.27	11,129,701,225.41
合计		<u>25,471,306,882.36</u>	<u>62,220,099,630.72</u>
本公司			
存放关联方款项	中央汇金及其旗下公司	40,625,070.30	32,984,420.50
存放关联方款项	申万宏源证券有限公司	24,031,660.00	789,100.00
存放关联方款项	其他关联方	432,103.92	431,756.18
合计		<u>65,088,834.22</u>	<u>34,205,276.68</u>
衍生金融资产			
本集团			
衍生金融资产	中央汇金及其旗下公司	121,805,365.24	117,983,917.40
衍生金融资产	其他关联方	8,822,899.74	12,080,986.11
合计		<u>130,628,264.98</u>	<u>130,064,903.51</u>
本公司			
无			
交易性金融资产			
本集团			
交易性金融资产	中央汇金及其旗下公司	4,302,711,576.01	9,539,534,125.23
交易性金融资产	富国基金管理有限公司	347,814,281.93	241,386,777.88
交易性金融资产	其他关联方	3,185,921,504.47	2,592,471,384.71
合计		<u>7,836,447,362.41</u>	<u>12,373,392,287.82</u>
本公司			
交易性金融资产	中央汇金及其旗下公司	194,824,535.64	190,279,976.19
交易性金融资产	宏源汇富创业投资有限公司	54,621,270.09	54,423,684.13
交易性金融资产	宏源期货有限公司	69,023,499.98	68,726,411.74
交易性金融资产	申万宏源证券有限公司	722,287.07	26,091,924.12
交易性金融资产	申万菱信基金管理有限公司	3,518,050,724.87	3,450,524,006.30
交易性金融资产	申银万国创新资本管理有限 公司	1,279,587,281.94	1,548,859,812.32
合计		<u>5,116,829,599.59</u>	<u>5,338,905,814.80</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

九 关联方关系及其交易(续)

6 关联方应收、应付款项余额(续)

(1) 应收关联方款项(续)

		2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
其他权益工具投资			
本集团			
非交易性权益工具	中央汇金及其旗下公司	420,972,102.86	290,946,571.01
非交易性权益工具	其他关联方	141,949,584.56	140,907,469.88
合计		<u>562,921,687.42</u>	<u>431,854,040.89</u>
本公司			
无			
使用权资产			
本集团			
使用权资产	中央汇金及其旗下公司	<u>21,631,438.10</u>	<u>17,129,439.83</u>
本公司			
无			
债权投资			
本集团			
债权投资	中央汇金及其旗下公司	<u>133,374,612.13</u>	<u>191,035,264.25</u>
本公司			
无			
其他债权投资			
本集团			
金融债	中央汇金及其旗下公司	560,114,874.93	32,917,918.83
公司债	其他关联方	323,706,050.41	-
合计		<u>883,820,925.34</u>	<u>32,917,918.83</u>
本公司			
无			

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外, 金额单位为人民币元)

九 关联方关系及其交易(续)

6 关联方应收、应付款项余额(续)

(2) 应付关联方款项

		2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
衍生金融负债			
本集团			
衍生金融负债	中央汇金及其旗下公司	55,845,267.96	62,872,035.17
衍生金融负债	其他关联方	18,024,727.65	22,009,023.70
合计		<u>73,869,995.61</u>	<u>84,881,058.87</u>
本公司			
无			
卖出回购金融资产款			
本集团			
卖出回购金融资产款	中央汇金及其旗下公司	9,685,927,957.64	20,108,447,882.14
卖出回购金融资产款	其他关联方	3,530,630,202.34	200,106,849.32
合计		<u>13,216,558,159.98</u>	<u>20,308,554,731.46</u>
本公司			
无			
		2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
应付款项			
本集团			
应付手续费及佣金	中央汇金及其旗下公司	17,515,607.36	7,741,147.74
应付手续费及佣金	其他关联方	989,706.03	989,706.03
合计		<u>18,505,313.39</u>	<u>8,730,853.77</u>
本公司			
无			

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外, 金额单位为人民币元)

九 关联方关系及其交易(续)

6 关联方应收、应付款项余额(续)

(2) 应付关联方款项(续)

		2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
代理买卖证券款			
本集团			
代理买卖证券款	中央汇金及其旗下公司	166,893,119.03	1,072,202,005.30
代理买卖证券款	其他关联方	361,649,585.84	49,452,633.76
合计		<u>528,542,704.87</u>	<u>1,121,654,639.06</u>
本公司			
无			
租赁负债			
本集团			
租赁负债	中央汇金及其旗下公司	<u>22,401,288.16</u>	<u>18,041,592.90</u>
本公司			
无			
其他负债			
本集团			
其他应付款	中央汇金及其旗下公司	<u>6,500,795.10</u>	<u>18,252,289.13</u>
本公司			
无			
应付债券			
本集团			
无			
本公司			
应付债券	申万宏源证券有限公司 申万宏源证券承销保荐有 限 责任公司	14,903,332.07	-
应付债券		2,394,943.53	8,257,014.71
合计		<u>17,298,275.60</u>	<u>8,257,014.71</u>

申万宏源集团股份有限公司  
财务报表附注  
截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十 或有事项

截至2022年6月30日，本集团并无涉及任何可能对本集团财务状况或经营业绩造成重大不利影响的单个重大的法律诉讼，仲裁或行政处罚事项。

十一 承诺事项

截至 2022 年 6 月 30 日，本集团无重大承诺事项。

十二 资产负债表日后事项

1 利润分配情况说明

于 2022 年 8 月 5 日，本公司 2021 年度 A 股和 H 股现金股利派发完毕。

2 发行长期债券、短期债券和收益凭证

自 2022 年 7 月 1 日起至财务报表报出日，本集团发行长期债券、短期债券和多项收益凭证，固定利率区间为 1.89%至 6.80%，金额合计约为人民币 248.06 亿元。

3 归还长期债券、短期债券和收益凭证

自 2022 年 7 月 1 日起至财务报表报出日，本集团偿还长期债券、短期债券和多项收益凭证，固定利率区间为 1.10%至 6.80%，金额合计约为人民币 156.37 亿元。

十三 比较数字

比较期间财务报表的部分项目已按本期财务报表的披露方式进行了重分类。

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

十四 其他重要事项说明

1 履行社会责任

本集团为履行社会责任，在公益广告、救灾捐款、教育资助、慈善捐赠等方面的支出如下：

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
慈善捐赠	35,406,000.00	33,571,198.95

2 融资融券业务

于 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 12 月 31 日，本集团融资融券业务规模如下：

	附注	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
融出资金		64,154,060,371.95	74,677,697,689.48
融出证券	五、12	3,806,190,281.62	6,070,122,849.34
合计		67,960,250,653.57	80,747,820,538.82

3 债券借贷

于 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 12 月 31 日，本集团在银行间债券市场交易平台向商业银行借入债券的类别及公允价值具体如下：

债券类别	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
国债	12,421,787,170.00	11,481,448,725.00
金融债	1,302,098,700.00	325,570,500.00
地方政府债	-	3,310,989,480.00
合计	13,723,885,870.00	15,118,008,705.00

于 2022 年 6 月 30 日，本集团通过借入方式取得的债券中为卖出回购业务而设定质押的债券公允价值为人民币 2,782,789,000.00 元(2021 年 12 月 31 日：人民币 10,713,902,655.00 元)。

申万宏源集团股份有限公司  
财务报表附注  
截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十五 金融工具及其风险

本集团的经营生活会面临各种金融风险，主要包括市场风险(主要为外汇风险、利率风险和其他价格风险)、信用风险和流动性风险。上述金融风险以及本集团为降低这些风险所采取的风险管理政策如下所述：

董事会负责规划并建立本集团的风险管理架构，制定本集团的风险管理政策和相关指引并监督风险管理措施的执行情况。本集团已制定风险管理政策以识别和分析本集团所面临的风险，这些风险管理政策对特定风险进行了明确规定，涵盖了市场风险、信用风险和流动性风险管理等诸多方面。本集团定期评估市场环境及本集团经营活动的变化以决定是否对风险管理政策及系统进行更新。本集团的风险管理由风险管理委员会按照董事会批准的政策开展。风险管理委员会通过与本集团其他业务部门的紧密合作来识别、评价和规避相关风险。本集团内部审计部门就风险管理控制及程序进行定期的审核，并将审核结果上报本集团的审计委员会。

1 市场风险

(1) 外汇风险

本集团的主要经营位于中国境内，主要业务以人民币结算。本集团已确认的外币资产和负债及未来的外币交易(外币资产和负债及外币交易的计价货币主要为美元和港币)存在外汇风险。本集团持续监控集团外币交易和外币资产及负债的规模，以最大程度降低面临的外汇风险；为此，本集团通过签署远期外汇合约或货币互换合约的方式来达到规避外汇风险的目的(附注五、4)。

假设所有其他风险变量保持不变且不考虑本集团采用的风险管理措施，于 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 12 月 31 日，人民币对美元、港币及其他币种的汇率变动使人民币升值 10%将导致本集团的股东权益及净利润的变动情况如下：

	股东权益的敏感性	
	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
港币	(421,837,888.66)	945,992,862.72
美元	(261,107,165.05)	(106,880,670.19)
其他货币	(30,637,238.62)	21,619,183.52
合计	<u>(713,582,292.33)</u>	<u>860,731,376.05</u>

申万宏源集团股份有限公司  
 财务报表附注  
 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间  
 (除特别注明外，金额单位为人民币元)

十五 金融工具及其风险(续)

1 市场风险(续)

(1) 外汇风险(续)

	净利润的敏感性	
	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
港币	(372,181,459.12)	602,243,758.41
美元	47,056,668.48	(106,880,670.19)
其他货币	(30,637,238.62)	21,619,183.52
合计	<u>(355,762,029.26)</u>	<u>516,982,271.74</u>

于 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 12 月 31 日，在假定其他变量保持不变的前提下，人民币对美元、港币及其他币种的汇率变动使人民币贬值 10%将导致本集团股东权益和净利润的变化和上表列示的金额相同但方向相反。

上述敏感性分析是假设资产负债表日汇率发生变动，以变动后的汇率对资产负债表日本集团持有的、面临汇率风险的金融工具进行重新计量得出的。上述分析不包括外币财务报表折算差额。

(2) 利率风险

利率风险是指本集团的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本集团的生息资产主要包括货币资金、结算备付金、融出资金、交易性金融资产、买入返售金融资产、存出保证金、债权投资及其他债权投资等，付息负债主要包括短期借款、应付短期融资款、拆入资金、交易性金融负债、卖出回购金融资产款、代理买卖证券款、长期借款、应付债券等。

对于资产负债表日持有的使本集团面临公允价值利率风险的金融工具，本集团利用利率重定价敞口分析和敏感性分析作为监控利率风险的主要方法。其中敏感性分析衡量在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，将对净利润和股东权益产生的影响。

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 十五 金融工具及其风险(续)

#### 1 市场风险(续)

#### (2) 利率风险(续)

下表列示于各资产负债表日本集团的利率风险。表内的金融资产和金融负债项目，按合约重新定价日与到期日两者较早者分类，以账面价值列示：

	2022 年 6 月 30 日					合计
	3 个月内	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	
金融资产						
货币资金	123,318,493,492.71	6,220,241,000.00	100,000,000.00	-	171,466,183.11	129,810,200,675.82
结算备付金	23,887,122,744.96	-	-	-	-	23,887,122,744.96
融出资金	20,460,536,143.23	44,857,515,614.48	-	-	2,060,023,367.75	67,378,075,125.46
交易性金融资产	5,011,564,227.39	37,162,590,167.12	84,441,372,910.99	5,200,380,918.78	136,227,531,318.76	268,043,439,543.04
衍生金融资产	-	-	-	-	6,302,754,939.03	6,302,754,939.03
买入返售金融资产	24,595,290,321.48	199,400,000.00	-	-	4,666,773,621.03	29,461,463,942.51
应收款项	-	-	-	-	7,900,778,736.56	7,900,778,736.56
存出保证金	27,562,713,893.42	-	-	-	3,585,505,443.51	31,148,219,336.93
债权投资	-	101,082,369.84	120,807,560.87	-	4,364,736,321.25	4,586,626,251.96
其他债权投资	543,036,268.70	2,477,209,567.24	31,360,328,779.12	5,201,433,370.65	1,022,237,031.79	40,604,245,017.50
其他权益工具投资	-	-	-	-	3,018,386,382.93	3,018,386,382.93
其他资产(金融资产)	-	-	-	-	589,214,186.12	589,214,186.12
金融资产合计	225,378,757,091.89	91,018,038,718.68	116,022,509,250.98	10,401,814,289.43	169,909,407,531.84	612,730,526,882.82

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十五 金融工具及其风险(续)

1 市场风险(续)

(2) 利率风险(续)

下表列示于各资产负债表日本集团的利率风险。表内的金融资产和金融负债项目，按合约重新定价日与到期日两者较早者分类，以账面价值列示(续)：

	2022 年 6 月 30 日					合计
	3 个月内	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	
金融负债						
短期借款	(729,037,800.80)	(2,348,812,985.92)	-	-	(11,257,215.02)	(3,089,108,001.74)
应付短期融资款	(11,019,601,180.63)	(24,662,481,183.68)	-	-	(350,544,119.78)	(36,032,626,484.09)
拆入资金	(2,889,757,250.00)	(433,483,840.00)	-	-	(14,514,174.73)	(3,337,755,264.73)
交易性金融负债	(4,679,918,474.22)	-	-	-	(279,151,956.16)	(4,959,070,430.38)
衍生金融负债	-	-	-	-	(8,010,149,615.46)	(8,010,149,615.46)
卖出回购金融资产款	(116,266,208,676.17)	(13,633,534,500.00)	-	-	(320,268,105.93)	(130,220,011,282.10)
代理买卖证券款	(116,767,515,430.95)	-	-	-	(1,438,524.63)	(116,768,953,955.58)
代理承销证券款	-	-	-	-	(19,909,120.00)	(19,909,120.00)
应付款项	-	-	-	-	(27,852,018,147.57)	(27,852,018,147.57)
应付债券	(6,265,345,590.78)	(19,204,146,259.26)	(116,587,182,082.63)	(17,064,429,955.22)	(2,778,333,369.71)	(161,899,437,257.60)
租赁负债	(88,422,098.51)	(304,036,294.44)	(533,605,506.72)	(25,238,334.85)	-	(951,302,234.52)
其他负债(金融负债)	(113,899,711.10)	-	-	-	(15,883,686,945.11)	(15,997,586,656.21)
金融负债合计	<u>(258,819,706,213.16)</u>	<u>(60,586,495,063.30)</u>	<u>(117,120,787,589.35)</u>	<u>(17,089,668,290.07)</u>	<u>(55,521,271,294.10)</u>	<u>(509,137,928,449.98)</u>
净敞口	<u>(33,440,949,121.27)</u>	<u>30,431,543,655.38</u>	<u>(1,098,278,338.37)</u>	<u>(6,687,854,000.64)</u>	<u>114,388,136,237.74</u>	<u>103,592,598,432.84</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十五 金融工具及其风险(续)

1 市场风险(续)

(2) 利率风险(续)

下表列示于各资产负债表日本集团的利率风险。表内的金融资产和金融负债项目，按合约重新定价日与到期日两者较早者分类，以账面价值列示(续)：

	2021 年 12 月 31 日					合计
	3 个月内	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	
金融资产						
货币资金	105,271,354,625.93	2,965,867,039.00	100,000,000.00	-	243,231,967.56	108,580,453,632.49
结算备付金	24,338,346,214.30	-	-	-	4,819,292.33	24,343,165,506.63
融出资金	24,410,059,658.59	49,888,574,054.02	-	-	1,998,121,498.30	76,296,755,210.91
交易性金融资产	4,839,195,901.61	44,323,080,230.32	92,349,534,242.59	8,515,972,676.93	122,548,675,754.15	272,576,458,805.60
衍生金融资产	-	-	-	-	2,800,299,619.84	2,800,299,619.84
买入返售金融资产	18,594,465,291.24	1,322,897,004.45	-	-	5,480,822,187.71	25,398,184,483.40
应收款项	-	-	-	-	4,093,736,594.48	4,093,736,594.48
存出保证金	19,223,671,568.78	-	-	-	9,889,988,454.81	29,113,660,023.59
债权投资	203,907,085.06	225,204,149.39	-	-	4,592,453,191.08	5,021,564,425.53
其他债权投资	669,170,938.01	2,760,557,555.03	26,463,585,358.99	6,586,323,702.56	645,761,594.55	37,125,399,149.14
其他权益工具投资	-	-	-	-	2,623,807,751.94	2,623,807,751.94
其他资产(金融资产)	-	-	-	-	954,645,378.54	954,645,378.54
金融资产合计	197,550,171,283.52	101,486,180,032.21	118,913,119,601.58	15,102,296,379.49	155,876,363,285.29	588,928,130,582.09

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十五 金融工具及其风险(续)

1 市场风险(续)

(2) 利率风险(续)

下表列示于各资产负债表日本集团的利率风险。表内的金融资产和金融负债项目，按合约重新定价日与到期日两者较早者分类，以账面价值列示(续)：

	2021 年 12 月 31 日					合计
	3 个月内	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上	不计息	
金融负债						
短期借款	(1,814,445,639.01)	(1,407,928,509.78)	-	-	(7,423,637.44)	(3,229,797,786.23)
应付短期融资款	(5,830,167,528.00)	(23,656,512,005.08)	-	-	(100,163,665.73)	(29,586,843,198.81)
拆入资金	(3,716,200,000.00)	(633,816,110.00)	-	-	(16,708,396.15)	(4,366,724,506.15)
交易性金融负债	(6,093,115,123.61)	-	-	-	(73,880,267.94)	(6,166,995,391.55)
衍生金融负债	-	-	-	-	(7,309,855,457.95)	(7,309,855,457.95)
卖出回购金融资产款	(125,266,710,111.21)	(12,448,483,200.00)	-	-	(262,326,469.33)	(137,977,519,780.54)
代理买卖证券款	(103,337,192,480.53)	-	-	-	(1,401,166,169.10)	(104,738,358,649.63)
代理承销证券款	-	-	-	-	-	-
应付款项	-	-	-	-	(16,950,753,669.24)	(16,950,753,669.24)
应付债券	(22,057,346,914.88)	(19,766,248,842.69)	(101,717,501,894.06)	(14,022,914,470.88)	(2,922,711,887.77)	(160,486,724,010.28)
租赁负债	(81,804,498.31)	(228,167,091.25)	(630,656,516.40)	(28,587,188.96)	-	(969,215,294.92)
其他负债(金融负债)	(134,593,891.23)	-	-	-	(12,820,539,701.37)	(12,955,133,592.60)
金融负债合计	<u>(268,331,576,186.78)</u>	<u>(58,141,155,758.80)</u>	<u>(102,348,158,410.46)</u>	<u>(14,051,501,659.84)</u>	<u>(41,865,529,322.02)</u>	<u>(484,737,921,337.90)</u>
净敞口	<u>(70,781,404,903.26)</u>	<u>43,345,024,273.41</u>	<u>16,564,961,191.12</u>	<u>1,050,794,719.65</u>	<u>114,010,833,963.27</u>	<u>104,190,209,244.19</u>

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 十五 金融工具及其风险(续)

#### 1 市场风险(续)

#### (2) 利率风险(续)

本集团采用敏感性分析衡量利率变化对本集团股东权益和净利润的可能影响。下表列示了本集团股东权益和净利润在其他变量固定的情况下对于可能发生的合理利率变动的敏感性。对贵集团股东权益和净利润的影响包括：(1)一定利率变动对资产负债表日持有的固定利率金融资产进行重估所产生的公允价值变动对股东权益和净利润的影响；(2)一定利率变动对资产负债表日持有的浮动利率非衍生工具产生的年化现金流量变动对股东权益和净利润的影响。

假设收益率曲线平行移动 25 个基点，对本集团各资产负债表日的股东权益和净利润的潜在影响分析如下：

	2022 年 6 月 30 日		2021 年 12 月 31 日	
	股东权益	净利润	股东权益	净利润
收益率曲线向上平移 25 个基点	<u>(517,161,309.91)</u>	<u>(368,205,138.57)</u>	<u>(713,806,156.45)</u>	<u>(564,294,710.18)</u>
收益率曲线向下平移 25 个基点	<u>522,091,040.19</u>	<u>371,866,324.31</u>	<u>724,202,837.69</u>	<u>572,576,177.83</u>

上述预测假设收益率平行上移或下移，因此，不反映仅某些利率变动而剩余利率不变所可能带来的影响。这种预测还基于其他简化的假设，包括所有头寸将持有到期等。

#### (3) 其他价格风险

其他价格风险是指本集团所持有的股票和基金类金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本集团主要投资于证券交易所上市的股票、基金等，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

假设上述工具的市价上升或下降 10%，其他变量不变的情况下，基于资产负债表日的上述资产对本集团股东权益和净利润的影响如下：

	2022 年 6 月 30 日		2021 年 12 月 31 日	
	股东权益	净利润	股东权益	净利润
市场价格上升 10%	6,336,495,927.90	6,179,348,378.72	5,539,224,274.23	5,362,013,692.83
市场价格下降 10%	<u>(6,336,495,927.90)</u>	<u>(6,179,348,378.72)</u>	<u>(5,539,224,274.23)</u>	<u>(5,362,013,692.83)</u>

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 十五 金融工具及其风险(续)

#### 2 信用风险

信用风险是指因融资方、交易对手或债券发行人无法履行其约定的财务义务而使本集团面临的风险。本集团信用风险敞口主要分布在个人金融、销售和交易及本金投资业务。

本集团主要采取下列措施，识别、报告及管理信用风险：

—搭建信用风险内部评级体系，对客户开展集中度管理；

—完善对客户和担保品的风险评估和分析工作，加强存续管理。优化信用风险管理系统，建立了公司级交易对手负面列表库，对资信不良客户名单进行收集和管理以及统一管理客户负面信息机制；

—针对销售及交易业务严格设定债券和发行人等准入标准，并对交易行为、证券信用等级和类型以及债券规模和集中度等方面进行交易前审核，交易后监控与跟踪；

—完善衍生品交易的办法和政策，设定交易对手评级及准入标准，改进风险限额指针及交易前审批标准；

—在客户评估、集中度控制及业务规模方面加强对股票质押式融资及本金投资业务等部分业务的审查管理工作，并持续密切监控项目状况。

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 十五 金融工具及其风险(续)

#### 2 信用风险(续)

##### 预期信用损失的计量

对于以摊余成本计量的金融资产(包括融出资金、买入返售金融资产等)和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益(包括其他债权投资)的金融资产，其预期信用损失计量使用了模型和假设。这些模型和假设涉及未来的宏观经济情况和客户的信用行为(例如客户违约的可能性及相应损失)。

对纳入预期信用损失计量的金融资产，本集团运用自金融资产初始确认之后信用质量发生“三阶段”变化的减值模型计量其预期信用损失，具体包括：

—自初始确认后信用风险未发生显著增加的金融工具进入“第一阶段”，本集团对其信用风险进行持续监控；

—如果识别出自初始确认后信用风险发生显著增加，但并未将其视为已发生信用减值的工具，则本集团将其转移至“第二阶段”；

—对于已发生信用减值的金融工具，则划分为“第三阶段”。

第一阶段金融工具按照相当于该金融工具未来 12 个月预期信用损失的金额计量损失准备，第二阶段和第三阶段金融工具按照相当于该金融工具整个存续期预期信用损失的金额计量损失准备。购入或源生已发生信用减值的金融资产是指在初始确认时即存在信用减值的金融资产，这些金融资产按照相当于该金融资产整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备。

对于第一阶段和第二阶段的融资类业务金融资产(包括融出资金及买入返售金融资产中的股票质押式回购)和债券投资业务金融资产(包括其他债权投资)，管理层运用包含考虑前瞻性影响的违约概率、违约损失率、损失率比率及违约风险敞口等关键参数的风险参数模型法评估损失准备。对于第三阶段已发生信用减值的上述金融资产，管理层通过预估未来与该金融资产相关的现金流，计量损失准备。

根据会计准则的要求在预期信用损失计量中所包含的重大管理层判断和假设主要包括：

—选择恰当的预期信用损失模型并确定相关参数；

—信用风险显著增加的判断标准以及违约和已发生信用减值的定义；

—用于计量预期信用损失的前瞻性信息及其权重的采用；

—第三阶段金融资产的未來现金流预测。

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 十五 金融工具及其风险(续)

#### 2 信用风险(续)

##### 预期信用损失计量的模型和参数

根据信用风险是否显著增加以及是否发生信用减值，本集团对不同的金融资产分别以 12 个月或整个存续期的预期信用损失计量减值准备。

对债券投资业务金融资产，预期信用损失为考虑了前瞻性影响的违约概率(PD)、违约风险敞口(EAD)、违约损失率(LGD)三者乘积折现后的结果；对融资类业务金融资产，预期信用损失为违约风险敞口(EAD)及考虑前瞻性影响的损失率比率(LR)二者乘积折现后的结果：

—违约概率是指借款人在未来 12 个月或在整个剩余存续期，无法履行其偿付义务的可能性。本集团计算违约概率考虑的主要因素有：债券投资业务经评估后的外部信用评级信息等。

—违约损失率是指本集团对违约风险敞口发生损失程度作出的预期。本集团计算违约损失率考虑的主要因素有：债券投资业务的发行人和债券的类型等。

—违约风险敞口是指，在未来 12 个月或在整个剩余存续期中，在违约发生时，本公司应被偿还的金额。

—违约损失率比率是指本集团对违约风险敞口发生损失金额作出的预期。本集团使用基于公开市场数据测算的历史损失率并评估其适当性。本集团计算融资类业务金融资产损失率比率考虑的主要因素有：担保物价值与融资类债务之间的比例(以下简称“维持担保比”)及担保证券的波动特征、担保证券变现价值等。

##### 信用风险显著增加的标准

本集团于每个资产负债表日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本集团在进行金融资产损失准备阶段划分时，充分考虑了反映金融工具的信用风险是否发生显著变化的各种合理且有依据的信息，包括前瞻性信息。当触发以下一个或多个定量和定性指标时，本集团认为金融工具的信用风险已发生显著增加。

针对融资类业务金融资产，本集团充分考虑融资主体的信用资质、经营情况、融资合约期限、担保证券波动性及流动性、以往履约情况等综合因素，为不同融资主体或合约设置不同的预警线及追保平仓线，其中追保平仓线一般不低于 130%。

针对融资类业务，维持担保比低于追保平仓线表明作为抵押的担保品价值或第三方担保质量显著下降，本集团认为该类融资类业务的信用风险显著增加。于 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，本集团超过 90%的融资类业务维持担保比不低于追保平仓线。

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 十五 金融工具及其风险(续)

#### 2 信用风险(续)

##### 信用风险显著增加的标准(续)

针对债券投资业务，违约概率的估算方法采用了公开市场的信用评级。若初始评级在 AA 级(含)以上的债券评级发生下调，且下调后等级在 AA 级(不含)以下；或初始评级在 AA 级以下的债券评级发生下调；或债券在预警清单列表中，本集团认为该类债券投资业务的信用风险显著增加。于 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，本集团的债券投资业务均为投资等级及以上，且不存在信用风险显著增加的情况。

如果借款人或债务人在合同付款日后逾期超过 30 天仍未付款，则视为该金融工具已经发生信用风险显著增加。

如果金融工具的违约风险较低，借款人在短期内履行其合同现金流量义务的能力很强，即便较长时期内经济形势和经营环境存在不利变化但未必一定降低借款人履行其合同现金流量义务的能力，该金融工具被视为具有较低的信用风险。

本集团将货币资金、结算备付金、存出保证金以及买入返售金融资产中的债券逆回购等金融工具视为具有较低信用风险，而不再比较资产负债表日的信用风险与初始确认时相比是否显著增加。

##### 违约和已发生信用减值资产的定义

判断金融工具是否已发生信用减值时，本集团所采用的界定标准，与内部针对相关金融工具的信用风险管理目标保持一致，同时考虑定性、定量和上限指标。当金融工具符合以下一项或多项条件时，本集团将该金融资产界定为已发生信用减值，其标准与已发生违约的定义一致：

- 债务人在合同付款日后逾期超过90天仍未付款；
- 融资类业务采取强制平仓措施且担保物价值已经不能覆盖融资金额；
- 债券发行人或债券的最新外部评级存在违约级别；
- 债务人、债券发行人或交易对手发生重大财务困难；
- 由于债务人财务困难导致相关金融资产的活跃市场消失；
- 债权人由于债务人、债券发行人或交易对手的财务困难作出让步；
- 债务人、债券发行人或交易对手很可能破产或其他财务重组等。

金融资产发生信用减值时，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。

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 十五 金融工具及其风险(续)

#### 2 信用风险(续)

##### 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。

对于债券投资类业务金融资产，本集团通过历史数据分析，识别出影响信用风险及预期信用损失的关键经济指标，主要包括国内生产总值增长率、固定资产投资完成额累计同比、生产价格指数、消费者物价指数等。本集团通过进行回归分析确定这些经济指标与宏观因子之间的关系，对债券投资业务的预期信用损失进行前瞻性调整。

对于融资类业务金融资产，本集团基于对产品特性进行分析，识别出于融资类业务金融资产风险相关的经济指标，即：上证综指和深证成指的波动率。通过构建这些经济指标与业务风险特征之间的关系，对融资类业务金融资产的预期信用损失进行前瞻性调整。

除了提供基本经济情景外，本集团的管理层专家小组也提供了其他可能的情景及情景权重。针对每一个主要产品类型分析、设定不同的情景，以确保考虑到指标非线性发展特征。本集团在每一个资产负债表日重新评估情景的数量及其特征。

于 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，本集团认为所有资产组合均应当考虑应用三种不同情景来恰当反映关键经济指标发展的非线性特征。本集团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，目前本集团采用的基准情景权重超过非基准情景权重之和。本集团在每一个资产负债表日重新评估情景的数量及特征。

本集团在判断信用风险是否发生显著增加时，使用了基准及其他情景下的整个存续期违约概率乘以情景权重，并考虑了定性、定量和上限指标。本集团以加权的 12 个月预期信用损失或加权的整个存续期预期信用损失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。

于 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，本集团综合考虑当期经济情况、疫情影响及政府等采取的各类支持性政策，根据最新经济预测情况更新了用于前瞻性计量的相关经济指标。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。本集团认为这些预测体现了对可能结果的最佳估计。

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 十五 金融工具及其风险(续)

#### 2 信用风险(续)

##### 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。本集团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，本期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。

本集团对前瞻性计量所使用的经济指标进行了敏感性分析，当乐观情景权重增加 10%，基准情景权重减少 10%；或者悲观情景权重增加 10%，基准情景权重减少 10%；对本集团已计提的预期信用损失的影响均不重大。

同时，本集团还对信用风险阶段分类进行了敏感性分析。于 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，假设信用风险自初始确认后未发生显著变化，导致第二阶段的金融工具全部进入第一阶段，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

本集团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。本集团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。对于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。本集团管理层会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。

##### 融资类业务的损失率及减值计提情况

本集团充分考虑融资主体的信用状况，合同期限，以及担保证券所属板块、流动性、限售情况、集中度、波动性、履约保障情况、发行人经营情况等因素，为不同融资主体或合约设置不同的预警线和平仓线，其中预警线一般不低于 140%，平仓线一般不低于 130%。

- 一对于维持担保比例大于平仓线，并且本金或利息逾期 30 日及以内的融资类金融资产，属于“第一阶段”；
- 一对于维持担保比例大于 100%，小于等于平仓线的融资类金融资产，或者本金或利息发生逾期，且逾期天数超过 30 日且未超 90 日的，属于“第二阶段”；
- 一对于维持担保比例小于等于 100%的融资类金融资产，或者本金或利息发生逾期，且逾期天数超过 90 日的，属于“第三阶段”。

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 十五 金融工具及其风险(续)

#### 2 信用风险(续)

##### 融资类业务的损失率及减值计提情况(续)

本集团的融资类金融资产不同阶段对应的损失率比率如下：

第一阶段：资产根据不同的维持担保比例，损失率区间为 0.2%~0.5%；

第二阶段：资产损失率不低于 0.5%；

第三阶段：根据逐项折现现金流量模型，计算预期损失率。

##### 信用风险敞口分析

于 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，本集团融资类业务客户资产质量良好，大部分融资类业务维持担保比不低于追保平仓线，且存在充分的抵押物信息表明资产预期不会发生违约。债券投资业务采用公开市场信用评级，于 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，本集团持有的绝大部分债券投资外部评级均为投资等级以上。

#### (a) 信用风险敞口分析

在不考虑担保物或其他信用增级措施的情况下，于资产负债表日最大信用风险敞口是指相关金融资产扣除减值准备后的账面价值。本集团最大信用风险敞口金额列示如下：

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
货币资金	129,810,129,056.05	108,580,414,305.93
结算备付金	23,887,122,744.96	24,343,165,506.63
融出资金	67,378,075,125.46	76,296,755,210.91
交易性金融资产	134,831,948,446.36	152,418,406,062.49
衍生金融资产	6,302,754,939.03	2,800,299,619.84
买入返售金融资产	29,461,463,942.51	25,398,184,483.40
应收款项	7,900,778,736.56	4,093,736,594.48
存出保证金	31,148,219,336.93	29,113,660,023.59
债权投资	4,586,626,251.96	5,021,564,425.53
其他债权投资	40,604,245,017.50	37,125,399,149.14
其他金融资产	589,214,186.12	954,645,378.54
最大信用风险敞口合计	<u>476,500,577,783.44</u>	<u>466,146,230,760.48</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十五 金融工具及其风险(续)

2 信用风险(续)

信用风险敞口分析(续)

(b) 按照预期信用损失阶段划分的重大信用风险敞口

	2022 年 6 月 30 日			合计
	第一阶段 未来 12 个月预期信用损失	第二阶段 整个存续期预期信用损失	第三阶段 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
融出资金	66,600,958,415.74	777,116,709.72	-	67,378,075,125.46
其他债权投资	38,122,930,024.68	2,200,971,049.37	280,343,943.45	40,604,245,017.50
	2021 年 12 月 31 日			合计
	第一阶段 未来 12 个月预期信用损失	第二阶段 整个存续期预期信用损失	第三阶段 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
融出资金	75,170,211,588.67	1,126,543,622.24	-	76,296,755,210.91
其他债权投资	32,763,419,219.02	4,076,498,067.57	285,481,862.55	37,125,399,149.14

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 十五 金融工具及其风险(续)

#### 3 流动性风险

流动性风险指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。

于管理流动性风险过程中，本集团考虑短期、中期及长期资金需求和流动资金管理需求，通过完善流动性储备管理体系，加强对优质流动性资产的总量和结构管理，保持充足的流动性储备。本集团亦采用风险指标分析方法管理整体流动性风险，通过对流动性覆盖率、净稳定资金比率、流动性缺口及资产负债集中度等关键风险指标进行分析、评估及衡量整体流动性风险状况。

针对流动性风险，本集团主要采取了下列措施：

- 制定全面资本规划，保持足够的流动性储备；
- 积极拓宽合作金融机构范围，提升债务融资管理能力，丰富流动性管理手段；
- 加强流动性风险状况动态监控，持续跟踪和评估流动性监管指标、现金流缺口、流动性储备、公司短期融资能力等信息；
- 开展流动性风险压力测试工作，提高对流动性冲击的测算能力，并提出有效应对措施；
- 通过开展流动性风险应急演练，提高对流动性风险应急报告和处理的能力，增强应对流动性危机的能力。

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 十五 金融工具及其风险(续)

#### 3 流动性风险(续)

于资产负债表日，本集团各项金融负债按未折现的合同现金流量(包括按合同利率(如果是浮动利率则按 6 月 30 日的现行利率)计算的利息)的剩余合约期限，以及被要求支付的最早日期如下：

	2022 年 6 月 30 日						合计	资产负债表账面价值
	即期偿还	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上		
短期借款	-	326,731,278.54	411,371,173.25	2,393,318,219.44	-	-	3,131,420,671.23	3,089,108,001.74
应付短期融资款	-	4,830,325,946.40	6,341,200,043.46	25,134,275,609.70	-	-	36,305,801,599.56	36,032,626,484.09
拆入资金	-	2,797,107,095.26	102,115,087.50	446,343,371.34	-	-	3,345,565,554.10	3,337,755,264.73
衍生金融负债	-	2,330,850,032.12	1,146,312,894.26	2,992,811,633.52	1,520,670,017.70	19,505,037.86	8,010,149,615.46	8,010,149,615.46
卖出回购金融资产款	-	114,317,791,088.20	2,192,048,226.54	14,012,627,042.07	-	-	130,522,466,356.81	130,220,011,282.10
交易性金融负债	-	4,959,070,430.38	-	-	-	-	4,959,070,430.38	4,959,070,430.38
代理买卖证券款	116,768,953,955.58	-	-	-	-	-	116,768,953,955.58	116,768,953,955.58
代理承销证券款	19,909,120.00	-	-	-	-	-	19,909,120.00	19,909,120.00
应付款项	27,748,628,523.05	39,853,933.28	63,535,691.24	-	-	-	27,852,018,147.57	27,852,018,147.57
应付债券	-	1,031,270,748.68	7,217,870,124.53	22,201,513,266.88	126,220,788,103.44	20,197,932,367.09	176,869,374,610.62	161,899,437,257.60
租赁负债	-	40,108,710.51	57,606,527.63	327,866,536.19	562,828,137.81	26,226,802.06	1,014,636,714.20	951,302,234.52
其他负债(金融负债)	14,812,197,230.52	-	-	-	1,185,389,425.69	-	15,997,586,656.21	15,997,586,656.21
合计	159,349,688,829.15	130,673,109,263.37	17,532,059,768.41	67,508,755,679.14	129,489,675,684.64	20,243,664,207.01	524,796,953,431.72	509,137,928,449.98
以净额交割的衍生金融负债：	-	2,330,850,032.12	1,146,312,894.26	2,992,811,633.52	1,520,670,017.70	19,505,037.86	8,010,149,615.46	8,010,149,615.46
以总额交割的衍生金融负债：								
应收合约条款	-	-	-	-	-	-	-	-
应付合约条款	-	-	-	-	-	-	-	-

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十五 金融工具及其风险(续)

3 流动性风险(续)

	2021 年 12 月 31 日						合计	资产负债表账面价值
	即期偿还	1 个月内	1 个月至 3 个月	3 个月至 1 年	1 年至 5 年	5 年以上		
短期借款	-	790,599,066.03	1,031,094,914.18	1,426,559,398.30	-	-	3,248,253,378.51	3,229,797,786.23
应付短期融资款	-	827,932,661.23	5,013,961,489.08	24,161,382,070.33	-	-	30,003,276,220.64	29,586,843,198.81
拆入资金	-	1,551,054,083.33	2,186,239,806.17	654,894,628.46	-	-	4,392,188,517.96	4,366,724,506.15
衍生金融负债	-	1,761,788,516.76	1,307,331,598.77	2,778,922,276.02	1,390,858,200.41	70,954,865.99	7,309,855,457.95	7,309,855,457.95
卖出回购金融资产款	-	124,245,689,005.98	2,591,949,593.88	11,164,403,866.41	-	-	138,002,042,466.27	137,977,519,780.54
交易性金融负债	-	2,979,863,679.29	11,877,359.05	2,881,773,239.60	293,481,113.61	-	6,166,995,391.55	6,166,995,391.55
代理买卖证券款	104,738,358,649.63	-	-	-	-	-	104,738,358,649.63	104,738,358,649.63
代理承销证券款	-	-	-	-	-	-	-	-
应付款项	16,838,932,936.02	53,409,820.38	57,707,458.04	703,454.80	-	-	16,950,753,669.24	16,950,753,669.24
应付债券	-	6,629,746,145.18	16,809,942,858.85	23,711,481,374.13	110,397,131,293.65	15,987,543,417.62	173,535,845,089.43	160,486,724,010.28
租赁负债	-	38,577,595.26	59,111,771.34	267,918,954.85	643,647,540.81	29,928,335.09	1,039,184,197.35	969,215,294.92
其他负债(金融负债)	12,563,874,734.50	-	14,720,622.11	55,110,826.57	321,427,409.42	-	12,955,133,592.60	12,955,133,592.60
合计	<u>134,141,166,320.15</u>	<u>138,878,660,573.44</u>	<u>29,083,937,471.47</u>	<u>67,103,150,089.47</u>	<u>113,046,545,557.90</u>	<u>16,088,426,618.70</u>	<u>498,341,886,631.13</u>	<u>484,737,921,337.90</u>
以净额交割的衍生金融负债:	-	1,761,788,516.76	1,307,331,598.77	2,778,922,276.02	1,390,858,200.41	70,954,865.99	7,309,855,457.95	7,309,855,457.95
以总额交割的衍生金融负债:								
应收合约条款	-	-	-	-	-	-	-	-
应付合约条款	-	-	-	-	-	-	-	-

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 十五 金融工具及其风险(续)

#### 4 资本管理

本集团资本管理的主要目标是保障本集团的持续经营，能够通过制定与风险水平相当的产品和服务价格并确保以合理融资成本获得融资的方式，持续为股东提供回报。

本集团定期复核和管理自身的资本结构，力求达到最理想的资本结构和股东回报。本集团考虑的因素包括：本集团未来的资金需求、资本效率、现实的及预期的盈利能力、预期的现金流、预期资本支出、风险水平等。如果上述因素发生改变并影响本集团，本集团将会调整资本结构。

于 2020 年 1 月 23 日，中国证监会颁布了《证券公司风险控制指标计算标准规定》(2020)，并要求于 2020 年 6 月 1 日起实施，于 2020 年 3 月 20 日，颁布了《证券公司风险控制指标管理办法》(2020 修正)，并要求于 2020 年 3 月 20 日起实施，对证券公司必须持续符合的风险控制指标体系及标准进行了修改，本集团须就风险控制指标持续达标。核心风险控制指标标准如下：

净资本与各项风险资本准备之和的比率不得低于 100%；核心净资本与表内外资产总额的比率不得少于 8%；优质流动性资产与未来 30 天现金净流出量的比率不得少于 100%；可用稳定资金与所需稳定资金的比率不得少于 100%。

#### 5 金融资产转移

在日常业务中，本集团部分交易将已确认的金融资产转让给第三方或客户，但本集团尚保留该部分已转让金融资产的风险与回报，因此并未于资产负债表终止确认此类金融资产。

本集团通过转让交易性金融资产、其他权益工具投资于交易对手取得款项，并与其签订回购上述资产的协议。根据协议，交易对手拥有收取上述证券协议期间合同现金流和再次将上述证券用于担保的权利，同时承担在协议规定的到期日将上述证券归还本集团的义务。本集团认为上述金融资产的风险与回报均未转移，因此并未于资产负债表终止确认上述金融资产。

本集团通过转让融出资金收益权于交易对手取得款项，并与其签订回购协议。根据回购协议，本集团转让于交易对手的收益权利包括融出本金及约定利息等本集团在融资融券合同项下可能取得的其他任何财产收益，回购期满后交易对手将上述收益权回售本集团。本集团认为上述金融资产的风险与回报均未转移，因此并未于资产负债表终止确认上述金融资产。

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十五 金融工具及其风险(续)

5 金融资产转移(续)

于 2022 年 6 月 30 日，本集团已转移但未终止确认的金融资产及相关负债如下：

	交易性金融资产 融出证券	其他权益工具投资 融出证券	交易性金融资产 买断式卖出回购 金融资产款	其他债权投资 买断式卖出回购 金融资产款	合计
转让的账面价值	835,442,456.66	829,563,791.40	-	-	1,665,006,248.06
相关负债的账面价值	-	-	-	-	-
净头寸资产	<u>835,442,456.66</u>	<u>829,563,791.40</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>1,665,006,248.06</u>

于 2021 年 12 月 31 日，本集团已转移但未终止确认的金融资产及相关负债如下：

	交易性金融资产 融出证券	其他权益工具投资 融出证券	交易性金融资产 买断式卖出回购金 融资产款	其他债权投资 买断式卖出回购 金融资产款	合计
转让的账面价值	1,368,443,360.14	1,245,705,168.40	1,088,693,806.00	-	3,702,842,334.54
相关负债的账面价值	-	-	(1,001,908,565.20)	-	(1,001,908,565.20)
净头寸资产	<u>1,368,443,360.14</u>	<u>1,245,705,168.40</u>	<u>86,785,240.80</u>	<u>-</u>	<u>2,700,933,769.34</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十六 公允价值估计

1 金融工具计量基础分类表

下表汇总披露了本集团所有金融工具项目的计量基础

金融资产项目	2022 年 6 月 30 日账面价值					
	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		
	以摊余成本计量的 金融资产	分类为以公允价值 计量且其变动计入其他综 合收益的金融资产	指定为以公允价值计量 且其变动计入其他综合收 益的非交易性权益工具投 资	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	按照《金融工具确认 和计量》准则指定为以公允 价值计量且其变动计入当 期损益的金融资产	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 损益的金融资产
货币资金	129,810,200,675.82	-	-	-	-	-
结算备付金	23,887,122,744.96	-	-	-	-	-
融出资金	67,378,075,125.46	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	268,043,439,543.04	-	-
衍生金融资产	-	-	-	6,302,754,939.03	-	-
买入返售金融资产	29,461,463,942.51	-	-	-	-	-
应收款项	7,900,778,736.56	-	-	-	-	-
存出保证金	31,148,219,336.93	-	-	-	-	-
债权投资	4,586,626,251.96	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	40,604,245,017.50	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	3,018,386,382.93	-	-	-
其他资产(金融资产)	589,214,186.12	-	-	-	-	-
合计	294,761,701,000.32	40,604,245,017.50	3,018,386,382.93	274,346,194,482.07	-	-

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十六 公允价值估计(续)

1 金融工具计量基础分类表(续)

下表汇总披露了本集团所有金融工具项目的计量基础(续)

金融资产项目	2021 年 12 月 31 日账面价值					
	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当期损益		
		分类为以公允价值 计量且其变动计入其他综 合收益的金融资产	指定为以公允价值计 量且其变动计入其他综 合收益的非交易性权益 工具投资	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	按照《金融工具确 认和计量》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 资产	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 损益的金融资产
货币资金	108,580,453,632.49	-	-	-	-	-
结算备付金	24,343,165,506.63	-	-	-	-	-
融出资金	76,296,755,210.91	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	272,576,458,805.60	-	-
衍生金融资产	-	-	-	2,800,299,619.84	-	-
买入返售金融资产	25,398,184,483.40	-	-	-	-	-
应收款项	4,093,736,594.48	-	-	-	-	-
存出保证金	29,113,660,023.59	-	-	-	-	-
债权投资	5,021,564,425.53	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	37,125,399,149.14	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	2,623,807,751.94	-	-	-
其他资产(金融资产)	954,645,378.54	-	-	-	-	-
合计	273,802,165,255.57	37,125,399,149.14	2,623,807,751.94	275,376,758,425.44	-	-

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 十六 公允价值估计(续)

#### 1 金融工具计量基础分类表(续)

金融负债项目	2022 年 6 月 30 日账面价值			
	以摊余成本计量的 金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		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	按照《金融工具确 认和计量》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	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
短期借款	3,089,108,001.74	-	-	-
应付短期融资款	36,032,626,484.09	-	-	-
拆入资金	3,337,755,264.73	-	-	-
交易性金融负债	-	3,463,324,022.62	1,495,746,407.76	-
衍生金融负债	-	8,010,149,615.46	-	-
卖出回购金融资产款	130,220,011,282.10	-	-	-
代理买卖证券款	116,768,953,955.58	-	-	-
代理承销证券款	19,909,120.00	-	-	-
应付款项	27,852,018,147.57	-	-	-
应付债券	161,899,437,257.60	-	-	-
租赁负债	951,302,234.52	-	-	-
其他负债(金融负债)	15,997,586,656.21	-	-	-
合计	496,168,708,404.14	11,473,473,638.08	1,495,746,407.76	-
金融负债项目	2021 年 12 月 31 日账面价值			
	以摊余成本计量的 金融负债	以公允价值计量且其变动计入当期损益		
		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	按照《金融工具确 认和计量》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	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
短期借款	3,229,797,786.23	-	-	-
应付短期融资款	29,586,843,198.81	-	-	-
拆入资金	4,366,724,506.15	-	-	-
交易性金融负债	-	2,470,717,115.50	3,696,278,276.05	-
衍生金融负债	-	7,309,855,457.95	-	-
卖出回购金融资产款	137,977,519,780.54	-	-	-
代理买卖证券款	104,738,358,649.63	-	-	-
应付款项	16,950,753,669.24	-	-	-
应付债券	160,486,724,010.28	-	-	-
租赁负债	969,215,294.92	-	-	-
其他负债(金融负债)	12,955,133,592.60	-	-	-
合计	471,261,070,488.40	9,780,572,573.45	3,696,278,276.05	-

## 申万宏源集团股份有限公司

### 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

## 十六 公允价值估计(续)

### 2 持续以公允价值计量的资产和负债

公允价值是出售该项资产所能收到或者转移该项负债所需支付的价格。该价格是假定市场参与者在计量日出售资产或者转移负债的交易，是在当前市场条件下的有序交易中进行的。

#### 公允价值层次

本集团根据以下层次确定及披露金融工具的公允价值：

第一层次：输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

当无法从公开市场获取报价时，本集团通过一些估值技术或者询价来确定公允价值。

本集团在估值技术中使用的主要输入值包括目标价格、利率、汇率及波动水平等，均为可观察到的且可从公开市场获取的输入值。

对于本集团持有的未上市股权、未流通股、部分场外衍生合约及信托计划等，管理层从交易对手处询价或使用估值技术确定公允价值。估值技术包括可比公司法、现金流量折现法及布莱克-斯科尔斯期权定价模型等。其公允价值的计量可能采用了对估值产生重大影响的不可观察输入值，因此本集团将这些资产和负债划分至第三层次。

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十六 公允价值估计(续)

2 持续以公允价值计量的资产和负债(续)

对于存在活跃市场的金融资产及负债，一般按照资产负债表日市场报价确定其公允价值，对于不存在活跃市场的金融资产及负债，其公允价值以估值技术确定。

	公允价值计量使用的输入值			合计
	活跃市场报价 第一层次	重要可观察 输入值 第二层次	重要不可观察 输入值 第三层次	
2022 年 6 月 30 日				
金融资产				
交易性金融资产				
债务工具投资	41,884,204,668.56	86,485,098,689.77	921,603,331.91	129,290,906,690.24
权益工具投资	70,035,140,974.09	7,318,284,336.81	6,251,577,927.46	83,605,003,238.36
混合工具投资	11,061,400.20	1,084,018,275.68	1,709,806,412.83	2,804,886,088.71
银行理财产品 资产管理计划与 信托计划等	-	1,853,974,355.40	-	1,853,974,355.40
小计	<u>295,826,172.16</u>	<u>44,988,087,897.46</u>	<u>5,204,755,100.71</u>	<u>50,488,669,170.33</u>
其他债权投资	5,261,950,384.71	34,931,680,569.71	410,614,063.08	40,604,245,017.50
其他权益工具投资	2,095,300,655.74	662,085,727.19	261,000,000.00	3,018,386,382.93
衍生金融资产	<u>324,788,278.00</u>	<u>768,208,115.17</u>	<u>5,209,758,545.86</u>	<u>6,302,754,939.03</u>
持续以公允价值计量的 资产总额	<u>119,908,272,533.46</u>	<u>178,091,437,967.19</u>	<u>19,969,115,381.85</u>	<u>317,968,825,882.50</u>
金融负债				
交易性金融负债	58,921,500.00	4,900,148,930.38	-	4,959,070,430.38
衍生金融负债	<u>287,414,505.00</u>	<u>453,131,156.02</u>	<u>7,269,603,954.44</u>	<u>8,010,149,615.46</u>
持续以公允价值计量的 负债总额	<u>346,336,005.00</u>	<u>5,353,280,086.40</u>	<u>7,269,603,954.44</u>	<u>12,969,220,045.84</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十六 公允价值估计(续)

2 持续以公允价值计量的资产和负债(续)

	公允价值计量使用的的的输入值			合计
	活跃市场报价 第一层次	重要可观察 输入值 第二层次	重要不可观察 输入值 第三层次	
2021 年 12 月 31 日				
金融资产				
交易性金融资产				
债务工具投资	31,549,695,507.52	114,049,033,462.82	705,388,005.49	146,304,116,975.83
权益工具投资	60,123,822,632.81	5,981,407,795.07	6,066,106,616.93	72,171,337,044.81
混合工具投资	-	1,432,895,080.34	1,983,022,801.81	3,415,917,882.15
银行理财产品	-	3,643,068,934.86	-	3,643,068,934.86
贵金属	22,362,000.00	-	-	22,362,000.00
资产管理计划与信托计划等	190,464,253.97	41,082,611,581.32	5,746,580,132.66	47,019,655,967.95
小计	<u>91,886,344,394.30</u>	<u>166,189,016,854.41</u>	<u>14,501,097,556.89</u>	<u>272,576,458,805.60</u>
其他债权投资	4,621,584,051.44	32,072,355,804.28	431,459,293.42	37,125,399,149.14
其他权益工具投资	2,362,807,751.94	-	261,000,000.00	2,623,807,751.94
衍生金融资产	<u>148,180,505.50</u>	<u>660,233,934.92</u>	<u>1,991,885,179.42</u>	<u>2,800,299,619.84</u>
持续以公允价值计量的资产总额	<u>99,018,916,703.18</u>	<u>198,921,606,593.61</u>	<u>17,185,442,029.73</u>	<u>315,125,965,326.52</u>
金融负债				
交易性金融负债	320,998,142.25	5,845,997,249.30	-	6,166,995,391.55
衍生金融负债	<u>120,393,290.88</u>	<u>525,494,672.94</u>	<u>6,663,967,494.13</u>	<u>7,309,855,457.95</u>
持续以公允价值计量的负债总额	<u>441,391,433.13</u>	<u>6,371,491,922.24</u>	<u>6,663,967,494.13</u>	<u>13,476,850,849.50</u>

对于在活跃市场上交易的金融工具，本集团以其活跃市场报价确定其公允价值；对于不在活跃市场上交易的金融工具，本集团采用估值技术确定其公允价值。所使用的估值模型主要为现金流量折现模型和市场可比公司模型等。估值技术的输入值主要包括流动性折扣、波动率、风险调整折扣以及市场乘数等。于 2022 年 6 月 30 日，非上市股权投资、信托计划、其他投资及场外衍生工具等的公允价值对上述不可观察输入值金额的合理变动无重大敏感性(2021 年 12 月 31 日：同)。

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 十六 公允价值估计(续)

#### 2 持续以公允价值计量的资产和负债(续)

下表列示了以公允价值计量的第三层次金融工具各期间的变动情况：

	2022 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间				
	交易性金融资产	其他债权投资	其他权益工具投资	衍生金融资产	衍生金融负债
2022 年 1 月 1 日	14,501,097,556.89	431,459,293.42	261,000,000.00	1,991,885,179.42	6,663,967,494.13
本期计入损益影响合计	1,287,280,720.43	3,397,497.22	-	3,176,368,332.45	940,594,453.25
本期计入其他综合收益影响合计	-	(32,685,640.72)	-	-	-
增加	7,056,680,421.65	9,873,248.21	-	57,939,431.89	(615,112,376.12)
减少	(5,018,015,846.36)	(1,430,335.05)	-	(16,434,397.90)	280,154,383.18
转入第三层次	590,547,199.22	-	-	-	-
转出第三层次	(4,329,847,278.92)	-	-	-	-
2022 年 6 月 30 日	<u>14,087,742,772.91</u>	<u>410,614,063.08</u>	<u>261,000,000.00</u>	<u>5,209,758,545.86</u>	<u>7,269,603,954.44</u>
本期计入损益的					
已实现利得或损失					
-投资收益	1,611,729,966.26	3,397,497.22	-	5,807,049.90	159,729,162.96
本期计入损益的未实现利得或损失					
-公允价值变动损益	<u>(324,449,245.83)</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>3,170,561,282.55</u>	<u>(1,100,323,616.21)</u>
	2021 年度				
	交易性金融资产	其他债权投资	其他权益工具投资	衍生金融资产	衍生金融负债
2021 年 1 月 1 日	9,029,653,467.74	-	260,000,000.00	-	-
本年计入损益影响合计	463,349,034.67	(5,455,965.87)	-	1,366,315,362.16	2,501,066,861.12
本年计入其他综合收益影响合计	-	(104,956,587.46)	-	-	-
增加	9,632,221,535.24	227,709,183.36	1,000,000.00	32,948,148.18	2,118,412,949.45
减少	(5,769,864,327.63)	(1,153,665.38)	-	(1,027,229,688.92)	(67,529,518.45)
转入第三层次	1,236,405,738.42	315,316,328.77	-	1,619,851,358.00	2,112,017,202.01
转出第三层次	(90,667,891.55)	-	-	-	-
2021 年 12 月 31 日	<u>14,501,097,556.89</u>	<u>431,459,293.42</u>	<u>261,000,000.00</u>	<u>1,991,885,179.42</u>	<u>6,663,967,494.13</u>
本年计入损益的					
已实现利得或损失					
-投资收益	725,693,525.63	(5,455,965.87)	-	184,250,660.31	(67,320,417.24)
本年计入损益的未实现利得或损失					
-公允价值变动损益	<u>(262,344,490.96)</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>1,182,064,701.85</u>	<u>(2,433,746,443.88)</u>

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 十六 公允价值估计(续)

#### 2 持续以公允价值计量的资产和负债(续)

就第三层次金融工具而言，价格主要采用可比公司法、现金流量折现法、布莱克-斯科尔斯期权定价模型等方法进行厘定。将公允价值归为第三层次的判断主要是基于不可观察输入值对计量整体公允价值的重要性厘定。其中，重要不可观察输入值主要有流动性折扣、波动率、风险调整折扣以及市场乘数等。

#### 3 第一层次及第二层次之间转换

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间，本集团未发生第一层次及第二层次之间的转换。

于 2021 年度，本集团未发生第一层次及第二层次之间的转换。

#### 4 不以公允价值计量但披露其公允价值的资产和负债

下表列示了在合并资产负债表中不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值以及相应的公允价值。账面价值和公允价值相近的金融资产和金融负债，例如：买入返售金融资产、存出保证金、融出资金、应收款项、货币资金、结算备付金、其他金融资产、代理买卖证券款、卖出回购金融资产款、拆入资金、应付款项、租赁负债、代理承销证券款、短期借款、应付短期融资款和其他金融负债未包括于下表中。

于 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，应付债券的账面价值以及相应的公允价值如下：

	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
应付债券	161,899,437,257.60	163,971,632,668.29	160,486,724,010.28	161,507,504,303.60

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十七 公司财务报表附注

1 长期股权投资

(1) 按类别列示

	2022 年 6 月 30 日		
	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	62,650,785,264.36	-	62,650,785,264.36
对联营企业投资	564,506,593.78	(178,284,744.12)	386,221,849.66
对合营企业投资	292,350,683.62	-	292,350,683.62
合计	<u>63,507,642,541.76</u>	<u>(178,284,744.12)</u>	<u>63,329,357,797.64</u>
	2021 年 12 月 31 日		
	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	62,650,785,264.36	-	62,650,785,264.36
对联营企业投资	566,706,133.87	(178,284,744.12)	388,421,389.75
对合营企业投资	277,459,287.04	-	277,459,287.04
合计	<u>63,494,950,685.27</u>	<u>(178,284,744.12)</u>	<u>63,316,665,941.15</u>

本公司无向投资企业转移资金能力受到重大限制的情况。

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 十七 公司财务报表附注(续)

#### 1 长期股权投资(续)

##### (2) 对子公司投资

被投资单位	2022 年 1 月 1 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
申万宏源证券有限公司	58,478,859,088.23	-	-	58,478,859,088.23	-	-
宏源汇智投资有限公司	2,052,537,521.89	-	-	2,052,537,521.89	-	-
宏源期货有限公司	1,062,170,686.65	-	-	1,062,170,686.65	-	-
宏源汇富创业投资有限公司	693,608,967.59	-	-	693,608,967.59	-	-
申万宏源产业投资管理有限责任公司	200,000,000.00	-	-	200,000,000.00	-	-
结构化主体	163,609,000.00	-	-	163,609,000.00	-	-
合计	62,650,785,264.36	-	-	62,650,785,264.36	-	-
被投资单位	2021 年 1 月 1 日	本年增加	本年减少	2021 年 12 月 31 日	本年计提减值准备	减值准备年末余额
申万宏源证券有限公司	51,978,859,088.23	6,500,000,000.00	-	58,478,859,088.23	-	-
宏源汇智投资有限公司	2,052,537,521.89	-	-	2,052,537,521.89	-	-
宏源期货有限公司	1,062,170,686.65	-	-	1,062,170,686.65	-	-
宏源汇富创业投资有限公司	693,608,967.59	-	-	693,608,967.59	-	-
申万宏源产业投资管理有限责任公司	200,000,000.00	-	-	200,000,000.00	-	-
结构化主体	158,859,000.00	60,000,000.00	(55,250,000.00)	163,609,000.00	-	-
合计	56,146,035,264.36	6,560,000,000.00	(55,250,000.00)	62,650,785,264.36	-	-

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 十七 公司财务报表附注(续)

#### 1 长期股权投资(续)

#### (3) 联营/合营企业投资

被投资单位	2022 年 1 月 1 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	其他 权益变动	宣告发放现金 股利或利润	计提减 值准备	其他		
<b>联营企业投资</b>											
霍尔果斯天山一号产业投资基金 有限合伙企业	91,900,018.25	-	-	(8,076,360.62)	-	-	-	-	-	83,823,657.63	(178,284,744.12)
新疆金投资资产管理股份有限公司	197,521,371.50	-	-	13,552,715.09	-	-	(7,200,000.00)	-	-	203,874,086.59	-
申宏聚信(河南)股权投资基金合 伙企业(有限合伙)	<u>99,000,000.00</u>	-	-	<u>(475,894.56)</u>	-	-	-	-	-	<u>98,524,105.44</u>	-
小计	<u>388,421,389.75</u>	-	-	<u>5,000,459.91</u>	-	-	<u>(7,200,000.00)</u>	-	-	<u>386,221,849.66</u>	<u>(178,284,744.12)</u>
<b>合营企业投资</b>											
共青城申宏汇创物流产业股权投 资合伙企业(有限合伙)	15,340,370.93	300,000.00	-	9,121,621.39	-	-	-	-	-	24,761,992.32	-
嘉兴宏创建业投资合伙企业(有限 合伙)	<u>262,118,916.11</u>	-	-	<u>5,469,775.19</u>	-	-	-	-	-	<u>267,588,691.30</u>	-
小计	<u>277,459,287.04</u>	<u>300,000.00</u>	-	<u>14,591,396.58</u>	-	-	-	-	-	<u>292,350,683.62</u>	-
合计	<u>665,880,676.79</u>	<u>300,000.00</u>	-	<u>19,591,856.49</u>	-	-	<u>(7,200,000.00)</u>	-	-	<u>678,572,533.28</u>	<u>(178,284,744.12)</u>

# 申万宏源集团股份有限公司

## 财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 十七 公司财务报表附注(续)

#### 1 长期股权投资(续)

#### (3) 联营/合营企业投资(续)

被投资单位	2021 年 1 月 1 日	本年增减变动								2021 年 12 月 31 日	减值准备 年末余额
		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	其他 权益变动	宣告发放现金 股利或利润	计提减 值准备	其他		
<b>联营企业投资</b>											
霍尔果斯天山一号产业投资基金 有限合伙企业	90,261,093.86	-	-	1,638,924.39	-	-	-	-	-	91,900,018.25	(178,284,744.12)
新疆金投资资产管理股份有限公司 申宏聚信(河南)股权投资基金合 伙企业(有限合伙)	198,448,637.71	-	-	(927,266.21)	-	-	-	-	-	197,521,371.50	-
	-	99,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	99,000,000.00	-
小计	288,709,731.57	99,000,000.00	-	711,658.18	-	-	-	-	-	388,421,389.75	(178,284,744.12)
<b>合营企业投资</b>											
共青城申宏汇创物流产业股权投 资合伙企业(有限合伙)	15,040,058.72	300,000.00	-	312.21	-	-	-	-	-	15,340,370.93	-
嘉兴麟茂壹号投资合伙企业(有限 合伙)	235,000,000.00	-	(235,000,000.00)	-	-	-	-	-	-	-	-
嘉兴宏创建业投资合伙企业(有限 合伙)	-	241,720,000.00	-	20,398,916.11	-	-	-	-	-	262,118,916.11	-
小计	250,040,058.72	242,020,000.00	(235,000,000.00)	20,399,228.32	-	-	-	-	-	277,459,287.04	-
合计	538,749,790.29	341,020,000.00	(235,000,000.00)	21,110,886.50	-	-	-	-	-	665,880,676.79	(178,284,744.12)

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十七 公司财务报表附注(续)

2 其他资产

		2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
其他应收款	(1)	4,299,554,926.35	6,022,934,701.36
应收股利		3,100,000,000.00	-
抵债资产		2,460,129.00	2,460,129.00
预付款项		2,156,799.52	1,795,737.55
长期待摊费用		733,186.95	1,706,219.22
合计		<u>7,404,905,041.82</u>	<u>6,028,896,787.13</u>

(1) 其他应收款

		2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
其他应收款余额		4,299,554,926.35	6,023,848,687.36
减：坏账准备		-	(913,986.00)
合计		<u>4,299,554,926.35</u>	<u>6,022,934,701.36</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十七 公司财务报表附注(续)

2 其他资产(续)

(1) 其他应收款(续)

(a) 其他应收款账龄分析如下：

	2022 年 6 月 30 日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
1 年以内	2,321,332,990.99	53.99	-	-
1-2 年	1,203,992,876.71	28.00	-	-
2-3 年	473,836,291.53	11.02	-	-
3 年以上	300,392,767.12	6.99	-	-
合计	<u>4,299,554,926.35</u>	<u>100.00</u>	<u>-</u>	<u>-</u>
	2021 年 12 月 31 日			
	账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	计提比例(%)
1 年以内	3,912,456,368.75	64.95	(913,986.00)	0.02
1-2 年	1,298,967,200.84	21.56	-	-
2-3 年	542,520,460.29	9.01	-	-
3 年以上	269,904,657.48	4.48	-	-
合计	<u>6,023,848,687.36</u>	<u>100.00</u>	<u>(913,986.00)</u>	<u>0.02</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十七 公司财务报表附注(续)

2 其他资产(续)

(1) 其他应收款(续)

(b) 于 2022 年 6 月 30 日，按欠款方归集的余额前五名的其他应收款分析如下：

2022 年 6 月 30 日				
	性质	金额	账龄	占其他应收款 余额的比例(%)
宏源汇智投资有限公司	应收往来款	3,244,787,079.38	1 年以内/1-2 年	75.47
宏源恒利(上海)实业有限公 司	应收往来款	700,945,095.93	1-2 年	16.30
宏源期货有限公司	应收往来款	300,424,027.41	1 年以内	6.99
申万宏源产业投资管理 有限责任公司	应收往来款	50,063,233.98	1-2 年	1.16
其他	职工个人借 款	2,918,716.68	1 年以内/2 年以 上	0.07
合计		<u>4,299,138,153.38</u>		<u>99.99</u>
2021 年 12 月 31 日				
	性质	金额	账龄	占其他应收款 余额的比例(%)
宏源汇智投资有限公司	应收往来款	3,245,099,528.71	1 年以内/1 - 2 年	53.87
申万宏源证券有限公司	应收往来款	1,500,719,178.07	1 - 2 年	24.91
宏源恒利(上海)实业有限公 司	应收往来款	901,325,589.06	1 年以内	14.96
宏源期货有限公司	应收往来款	300,192,739.73	1 - 2 年	4.98
申万宏源产业投资管理 有限责任公司	应收往来款	73,100,050.17	1 年以内/2 年以 上	1.21
合计		<u>6,020,437,085.74</u>		<u>99.93</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十七 公司财务报表附注(续)

3 应付债券

债券名称	面值 人民币亿元	起息日期	债券期限	发行金额 人民币亿元	票面 利率 %	2022 年 1 月 1 日 账面余额 人民币元	本期增加 人民币元	本期减少 人民币元	2022 年 6 月 30 日 账面余额 人民币元
18 申宏 01	5.00	2018/07/17	60 个月	5.00	3.20	32,977,864.89	515,757.75	-	33,493,622.64
18 申宏 02	65.00	2018/07/17	60 个月	65.00	4.80	6,642,007,500.44	155,489,678.62	-	6,797,497,179.06
19 申宏 01	10.00	2019/03/08	36 个月	10.00	4.18	1,034,169,269.99	7,630,730.01	(1,041,800,000.00)	-
19 申宏 02	32.00	2019/04/12	36 个月	32.00	4.27	3,298,475,923.39	38,164,076.61	(3,336,640,000.00)	-
19 申宏 04	58.00	2019/10/25	60 个月	58.00	3.94	5,840,714,588.44	114,446,619.13	-	5,955,161,207.57
21 申宏 01	15.00	2021/03/08	60 个月	15.00	3.68	1,543,625,566.31	27,532,630.98	(55,200,000.00)	1,515,958,197.29
21 申宏 02	5.00	2021/03/08	60 个月	5.00	3.95	515,616,844.38	9,830,130.23	(19,750,000.00)	505,696,974.61
21 申宏 04	30.00	2021/07/15	84 个月	30.00	3.65	3,047,201,352.15	54,516,617.51	-	3,101,717,969.66
21 申宏 05	5.00	2021/08/04	36 个月	5.00	2.99	505,610,876.19	7,504,737.12	-	513,115,613.31
21 申宏 06	25.00	2021/08/04	60 个月	25.00	3.38	2,531,877,798.31	42,166,064.48	-	2,574,043,862.79
22 申宏 01	18.00	2022/03/08	36 个月	18.00	3.11	-	1,817,687,468.21	(2,037,735.85)	1,815,649,732.36
22 申宏 02	12.00	2022/03/08	60 个月	12.00	3.50	-	1,213,195,852.97	(1,358,490.57)	1,211,837,362.40
22 申宏 03	30.00	2022/04/26	36 个月	30.00	3.06	-	3,016,540,873.97	(3,396,226.42)	3,013,144,647.55
22 申宏 04	10.00	2022/04/26	60 个月	10.00	3.45	-	1,006,180,876.58	(1,132,075.47)	1,005,048,801.11
合计						24,992,277,584.49	7,511,402,114.17	(4,461,314,528.31)	28,042,365,170.35

债券名称	面值 人民币亿元	起息日期	债券期限	发行金额 人民币亿元	票面 利率 %	2021 年 1 月 1 日 账面余额 人民币元	本年增加 人民币元	本年减少 人民币元	2021 年 12 月 31 日 账面余额 人民币元
16 申宏 01	20.21	2016/04/26	60 个月	50.00	3.70	2,071,631,646.62	23,937,953.38	(2,095,569,600.00)	-
16 申宏 03	55.00	2016/09/09	60 个月	55.00	3.20	5,553,947,966.99	122,052,033.01	(5,676,000,000.00)	-
18 申宏 01	5.00	2018/07/17	60 个月	5.00	3.20	510,079,708.75	12,396,156.14	(489,498,000.00)	32,977,864.89
18 申宏 02	65.00	2018/07/17	60 个月	65.00	4.80	6,640,505,948.94	313,501,551.50	(312,000,000.00)	6,642,007,500.44
19 申宏 01	10.00	2019/03/08	36 个月	10.00	4.18	1,033,778,899.15	42,190,370.84	(41,800,000.00)	1,034,169,269.99
19 申宏 02	32.00	2019/04/12	36 个月	32.00	4.27	3,297,231,002.07	137,884,921.32	(136,640,000.00)	3,298,475,923.39
19 申宏 04	58.00	2019/10/25	60 个月	58.00	3.94	5,838,510,839.34	230,723,749.10	(228,520,000.00)	5,840,714,588.44
21 申宏 01	15.00	2021/03/08	60 个月	15.00	3.68	-	1,545,323,679.51	(1,698,113.20)	1,543,625,566.31
21 申宏 02	5.00	2021/03/08	84 个月	5.00	3.95	-	516,182,882.12	(566,037.74)	515,616,844.38
21 申宏 04	30.00	2021/07/15	84 个月	30.00	3.65	-	3,050,597,578.56	(3,396,226.41)	3,047,201,352.15
21 申宏 05	5.00	2021/08/04	36 个月	5.00	2.99	-	506,176,913.93	(566,037.74)	505,610,876.19
21 申宏 06	25.00	2021/08/04	60 个月	25.00	3.38	-	2,534,707,986.99	(2,830,188.68)	2,531,877,798.31
合计						24,945,686,011.86	9,035,675,776.40	(8,989,084,203.77)	24,992,277,584.49

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十七 公司财务报表附注(续)

4 利息净支出

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
利息收入		
其中：货币资金利息收入	24,304,728.39	12,699,211.87
债权投资利息收入	70,602,881.77	60,767,105.24
其他	107,647,345.99	117,245,155.22
利息收入小计	<u>202,554,956.15</u>	<u>190,711,472.33</u>
利息支出		
其中：应付债券利息支出	<u>(511,402,114.17)</u>	<u>(505,997,641.29)</u>
利息净支出	<u>(308,847,158.02)</u>	<u>(315,286,168.96)</u>

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十七 公司财务报表附注(续)

5 投资收益

(1) 按类别列示

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
成本法核算的长期股权投资收益	3,108,000,000.00	3,195,000,000.00
权益法核算的长期股权投资收益	19,591,856.49	50,179,211.24
金融工具投资收益	172,559,703.87	242,019,242.34
其中：持有期间取得的收益	164,563,593.34	179,526,506.95
其中：交易性金融资产	164,563,593.34	179,526,506.95
处置金融工具的收益	7,996,110.53	62,492,735.39
其中：交易性金融资产	7,996,110.53	62,492,735.39
	<u>3,300,151,560.36</u>	<u>3,487,198,453.58</u>

(2) 按成本法核算的长期股权投资收益

被投资单位	本期发生额	上期发生额	本期比上期增减变动的原因
申万宏源证券有限公司	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00	无变化
宏源汇智投资有限公司	100,000,000.00	150,000,000.00	被投资单位于报告期内分红
宏源汇富创业投资有限公司	-	25,000,000.00	被投资单位未于报告期内分红
宏源期货有限公司	8,000,000.00	20,000,000.00	被投资单位于报告期内分红

(3) 投资收益汇回有无重大限制

以上投资收益汇回均无重大限制。

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十七 公司财务报表附注(续)

6 公允价值变动收益

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
交易性金融资产	109,513,572.56	77,401,820.14

7 业务及管理费

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
职工费用	58,765,469.58	50,669,843.44
固定资产折旧	10,600,039.34	8,957,529.28
办公运营费	1,937,956.00	3,145,090.11
专业服务及咨询费	1,617,746.86	2,701,266.52
长期待摊费用摊销	1,204,960.40	1,185,305.46
租赁费及物业费	1,141,110.57	863,135.41
证券交易所的市场管理费和席位年费	1,110,998.72	165,806.23
无形资产摊销	429,918.22	388,419.60
电子设备运转费	377,701.58	198,152.62
邮电通信费	68,712.41	62,913.60
其他	1,232,842.59	860,284.94
合计	78,487,456.27	69,197,747.21

申万宏源集团股份有限公司

财务报表附注

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

十七 公司财务报表附注(续)

8 现金流量表补充资料

(1) 现金流量表补充资料

将净利润调节为经营活动现金流量

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
净利润	3,028,616,124.57	3,173,287,335.36
加：信用减值损失	139,628.42	1,005.09
固定资产折旧	10,600,039.34	8,957,529.28
投资性房地产折旧	3,646,780.44	3,637,853.40
无形资产摊销	429,918.22	388,419.60
长期待摊费用摊销	1,204,960.40	1,185,305.46
公允价值变动损益	(109,513,572.56)	77,401,820.14
汇兑损益	(1.89)	29,667,680.62
利息净支出	333,151,886.41	327,985,380.83
投资收益	(3,127,591,856.49)	(3,245,179,211.24)
递延所得税资产净减少/(增加)	11,413,883.19	(8,426,428.81)
交易性金融资产的减少/(增加)	139,462,801.55	(1,472,465,473.62)
经营性应收项目的(增加)/减少	(35,976,919.75)	2,780,513.94
经营性应付项目的增加	29,039,369.68	13,090,776.82
经营活动产生的现金流量净额	<u>284,623,041.53</u>	<u>(1,087,687,493.13)</u>

(2) 现金及现金等价物净变动情况

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
现金的期末余额	4,592,775,609.68	1,151,981,202.62
减：现金的期初余额	<u>(344,130,171.90)</u>	<u>(1,883,758,978.74)</u>
现金及现金等价物的变动净额	<u>4,248,645,437.78</u>	<u>(731,777,776.12)</u>

# 申万宏源集团股份有限公司

## 未经审阅补充财务信息

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

### 一 非经常性损益

#### 1 非经常性损益明细表编制基础

根据中国证券监督管理委员会《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[2008]》的规定，非经常性损益是指与公司正常经营业务无直接关系，以及虽与正常经营业务相关，但由于其性质特殊和偶发性，影响报表使用人对公司经营业绩和盈利能力作出正确判断的各项交易和事项产生的损益。

#### 2 非经常性损益明细表

	截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年
非流动资产处置损益	812,939.37	1,993,193.33
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)	245,950,181.61	47,578,932.82
除上述各项之外的其他非经常性损益	<u>(48,350,823.47)</u>	<u>(34,740,990.20)</u>
非经常性损益净额	(1) <u>198,412,297.51</u>	<u>14,831,135.95</u>
以上有关项目对所得税的影响	<u>(49,570,545.25)</u>	<u>(3,701,147.41)</u>
合计	<u>148,841,752.26</u>	<u>11,129,988.54</u>
其中：影响本公司股东净利润的 非经常性损益	148,695,505.41	7,162,388.73
影响少数股东净利润的 非经常性损益	146,246.85	3,967,599.81

- (1) 委托他人投资或管理资产的损益、持有以及处置交易性金融资产、其他债权投资取得的投资收益及受托经营取得的托管费收入等属于本集团正常经营性项目产生的损益，因此不纳入非经常性损益的披露范围。

## 申万宏源集团股份有限公司

### 未经审阅补充财务信息

截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

## 二 净资产收益率及每股收益

	加权平均		每股收益			
	净资产收益率(%)		基本每股收益		稀释每股收益	
	截至 6 月 30 日止 6 个月期间		截至 6 月 30 日止 6 个月期间		截至 6 月 30 日止 6 个月期间	
	2022 年	2021 年	2022 年	2021 年	2022 年	2021 年
归属于公司普通股股东的净利润	3.47%	5.01%	0.13	0.18	0.13	0.18
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	3.32%	5.00%	0.13	0.18	0.13	0.18

于截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间和截至 2021 年 6 月 30 日止 6 个月期间，本集团并无任何会有潜在稀释影响的股份，所以基本每股收益与稀释每股收益并无差异。

（此页无正文，为申万宏源集团股份有限公司 2022 年半年度报告签字页）

董事长：刘健  
申万宏源集团股份有限公司董事会  
二〇二二年八月三十日