

# 合并资产负债表

2023年6月30日

编制单位：申万宏源证券有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
资产：		
货币资金	103,587,647,842.94	103,064,093,806.90
其中：客户资金	74,834,085,478.31	74,640,072,510.77
结算备付金	27,344,960,698.33	30,945,259,872.17
其中：客户备付金	10,168,863,157.84	9,875,831,597.41
融出资金	61,206,393,752.52	61,299,617,386.55
衍生金融资产	7,849,738,253.42	7,824,447,448.73
存出保证金	22,106,613,188.57	21,024,927,028.06
应收款项	6,747,136,865.61	5,209,728,465.30
买入返售金融资产	8,882,835,571.71	17,239,811,017.60
金融投资		
交易性金融资产	241,465,417,842.48	261,386,081,390.03
债权投资	195,444,718.90	520,579,107.94
其他债权投资	61,528,390,381.81	54,510,847,491.05
其他权益工具投资	44,960,698,793.68	2,018,729,506.75
长期股权投资	2,286,407,015.31	2,280,602,726.43
投资性房地产	31,134,482.10	32,974,123.71
固定资产	803,767,923.79	724,795,903.70
在建工程	236,837,144.93	230,149,783.51
使用权资产	1,036,195,720.76	987,495,992.18
无形资产	310,883,181.93	288,454,114.73
递延所得税资产	2,032,573,579.15	2,793,282,441.10
其他资产	1,873,884,657.13	1,088,363,491.26
资产合计	<b>594,486,961,615.07</b>	<b>573,470,241,097.7</b>
负债：		
短期借款	1,530,722,759.14	1,599,222,136.56
应付短期融资款	18,998,627,153.42	23,080,956,660.48
拆入资金	1,038,682,357.89	3,462,411,111.91
交易性金融负债	12,752,355,166.24	5,467,203,058.23
衍生金融负债	5,097,040,045.06	4,709,385,159.54
卖出回购金融资产款	157,848,295,257.50	151,535,531,147.53
代理买卖证券款	92,467,988,777.97	90,362,737,719.75
代理承销证券款	43,120,000.00	41,100,000.00
应付职工薪酬	5,468,818,039.68	5,529,100,056.53
应交税费	842,594,588.14	751,690,386.00
应付款项	42,307,095,176.47	31,712,945,293.55

预计负债	-	121,693.00
应付债券	119,870,096,369.99	126,488,199,952.33
递延所得税负债	16,417,848.29	4,786,704.17
合同负债	19,161,848.96	25,906,231.88
租赁负债	1,054,608,285.53	1,011,720,286.56
其他负债	15,000,474,023.16	12,929,667,816.38
<b>负债合计</b>	<b>474,356,097,697.44</b>	<b>458,712,685,414.40</b>
所有者权益：		
实收资本	53,500,000,000.00	53,500,000,000.00
其他权益工具	21,553,537,735.79	19,776,886,792.42
其中：永续债	21,553,537,735.79	19,776,886,792.42
资本公积	3,273,875,823.46	3,273,875,823.46
其他综合收益	98,646,382.20	(838,290,018.69)
盈余公积	5,098,161,858.15	5,098,161,858.15
一般风险准备	12,142,211,195.74	12,115,867,971.27
未分配利润	23,037,108,513.24	20,437,241,224.03
<b>归属于母公司股东权益合计</b>	<b>118,703,541,508.58</b>	<b>113,363,743,650.64</b>
少数股东权益	1,427,322,409.05	-1,393,812,032.66
<b>所有者权益合计</b>	<b>120,130,863,917.63</b>	<b>114,757,555,683.30</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>594,486,961,615.07</b>	<b>573,470,241,097.70</b>

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：



# 母公司资产负债表

2023年6月30日

编制单位：申万宏源证券有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
资产：		
货币资金	67,224,104,859.97	68,498,982,025.25
其中：客户资金	50,395,186,775.11	49,697,423,779.39
结算备付金	29,361,559,790.93	31,912,969,927.56
其中：客户备付金	9,365,992,830.72	8,267,072,401.39
融出资金	54,892,915,522.68	54,786,331,276.19
衍生金融资产	7,118,372,778.43	7,425,102,156.88
存出保证金	9,868,458,864.30	10,469,364,267.76
应收款项	5,074,556,741.58	2,710,545,941.80
买入返售金融资产	6,513,462,017.73	15,073,429,777.42
金融投资		
交易性金融资产	210,363,410,644.55	232,594,003,599.48
债权投资	-	307,534,014.91
其他债权投资	56,740,190,189.48	50,337,249,982.32
其他权益工具投资	44,922,543,483.41	1,925,763,563.95
长期股权投资	21,224,559,273.26	21,219,302,605.72
投资性房地产	31,134,482.10	32,974,123.71
固定资产	727,251,377.81	654,100,634.02
在建工程	212,567,344.55	203,319,267.17
使用权资产	782,083,523.03	752,153,392.52
无形资产	283,912,404.91	260,616,351.42
递延所得税资产	1,777,786,473.89	2,461,122,127.92
其他资产	1,892,997,237.09	1,461,130,735.98
资产合计	<b>519,011,867,009.70</b>	<b>503,085,995,771.98</b>
负债：		
应付短期融资款	17,986,396,251.67	21,669,008,922.77
拆入资金	1,038,682,357.89	3,462,411,111.91
交易性金融负债	9,656,625,312.60	2,891,214,130.00
衍生金融负债	5,111,828,194.15	4,537,876,426.76
卖出回购金融资产款	149,431,725,454.05	144,842,870,054.02
代理买卖证券款	59,940,034,185.83	58,186,406,675.94
应付职工薪酬	4,443,161,915.45	4,561,201,463.97
应交税费	288,215,699.97	243,278,711.86
应付款项	40,878,475,028.82	32,943,906,124.34
合同负债	6,134,808.84	10,049,940.88
预计负债	-	121,693.00

应付债券	114,059,409,743.96	120,890,600,362.79
租赁负债	792,115,201.23	759,762,825.47
其他负债	2,480,253,647.92	644,873,571.67
<b>负债合计</b>	<b>406,113,057,802.38</b>	<b>395,643,582,015.38</b>
所有者权益：		
实收资本	53,500,000,000.00	53,500,000,000.00
其他权益工具	21,553,537,735.79	19,776,886,792.42
其中：永续债	21,553,537,735.79	19,776,886,792.42
资本公积	3,023,312,985.09	3,023,312,985.09
其他综合收益	(72,873,136.13)	(838,433,391.21)
盈余公积	5,098,161,858.15	5,098,161,858.15
一般风险准备	10,141,497,863.93	10,131,674,292.12
未分配利润	19,655,171,900.49	16,750,811,220.03
<b>所有者权益合计</b>	<b>112,898,809,207.32</b>	<b>107,442,413,756.60</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>519,011,867,009.70</b>	<b>503,085,995,771.98</b>

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：





## 合并利润表

2023年1-6月

编制单位：申万宏源证券有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	2023年1-6月	2022年1-6月
<b>一、营业收入</b>	<b>10,326,441,255.35</b>	<b>9,644,141,550.53</b>
手续费及佣金净收入	3,663,851,568.21	4,172,227,023.38
其中：经纪业务手续费净收入	2,258,202,637.03	2,662,546,391.63
投资银行业务手续费净收入	838,975,347.00	821,336,375.86
资产管理业务及基金管理业务 手续费净收入	495,239,755.88	632,848,137.85
利息净收入	224,500,069.03	284,929,927.19
其中：利息收入	4,611,138,958.09	4,718,554,499.95
利息支出	(4,386,638,889.06)	(4,433,624,572.76)
投资收益	3,518,480,749.29	75,354,466.73
其中：对联营企业和合营企业的投资 收益	296,069,351.24	313,336,533.04
以摊余成本计量的金融资产终 止确认收益	(4,155,667.29)	(19,341,172.21)
其他收益	303,560,346.21	237,525,333.88
公允价值变动收益/(损失)	2,029,140,752.77	4,106,808,088.57
汇兑收益(损失)/收益	(27,605,395.21)	(21,640,768.48)
其他业务收入	614,224,108.36	788,120,469.10
资产处置收益	289,056.69	817,010.16
<b>二、营业支出</b>	<b>5,495,376,864.02</b>	<b>5,562,461,074.69</b>
税金及附加	63,746,715.15	67,039,796.15
业务及管理费	4,828,785,755.49	4,043,225,289.67
信用减值损失	(2,326,492.38)	684,905,511.14
其他减值损失	1,756,142.35	18,744,167.68
其他业务成本	603,414,743.41	748,546,310.05
<b>三、营业利润</b>	<b>4,831,064,391.33</b>	<b>4,081,680,475.84</b>
加：营业外收入	2,239,816.76	3,195,470.16
减：营业外支出	40,755,543.44	51,469,411.48
<b>四、利润总额</b>	<b>4,792,548,664.65</b>	<b>4,033,406,534.52</b>
减：所得税费用	655,540,532.06	413,599,794.73
<b>五、净利润</b>	<b>4,137,008,132.59</b>	<b>3,619,806,739.79</b>
(一) 按经营持续性分类：		
1. 持续经营净利润	4,137,008,132.59	3,619,806,739.79
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	4,138,785,113.86	3,625,533,718.05

2. 少数股东损益	(1,776,981.27)	(5,726,978.26)
<b>六、其他综合收益的税后净额</b>	<b>936,049,158.37</b>	<b>(131,524,019.17)</b>
归属于母公司股东的其他综合收益的税后净额	900,761,800.71	(146,708,228.33)
(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	372,197,123.09	(214,775,589.37)
(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	2,986,155.20	4,365,114.58
2. 其他债权投资公允价值变动	404,003,258.67	(139,652,557.46)
3. 其他债权投资信用减值准备	4,120,447.60	30,385,774.48
4. 外币财务报表折算差额	117,454,816.15	172,969,029.44
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额	35,287,357.66	15,184,209.16
<b>七、综合收益总额</b>	<b>5,073,057,290.96</b>	<b>3,488,282,720.62</b>
归属于母公司股东的综合收益总额	5,039,546,914.57	3,478,825,489.72
归属于少数股东的综合收益总额	33,510,376.39	9,457,230.90

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：



## 母公司利润表

2023年1-6月

编制单位：宏源证券股份有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	2023年1-6月	2022年1-6月
<b>一、营业收入</b>	<b>8,357,004,200.09</b>	<b>6,691,060,096.34</b>
手续费及佣金净收入	2,366,417,494.64	2,907,054,816.71
其中：经纪业务手续费净收入	1,761,288,691.12	2,098,340,595.57
投资银行业务手续费净收入	281,006,882.18	355,512,485.05
资产管理业务及基金管理业务 手续费净收入	291,976,137.63	425,394,726.32
利息净(支出)/收入	(124,650,040.78)	(180,219,928.89)
其中：利息收入	3,808,397,581.32	3,962,738,759.69
利息支出	(3,933,047,622.10)	(4,142,958,688.58)
投资收益	4,460,640,497.64	161,520,902.17
其中：对联营企业和合营企业的投资 收益	291,130,512.34	313,067,613.38
以摊余成本计量的金融资产终 止确认产生的收益(损失)	(4,155,667.29)	
其他收益	190,895,807.86	187,036,212.40
公允价值变动收益	1,435,404,806.29	3,589,309,078.18
汇兑收益/(损失)	8,843,434.18	9,530,056.01
其他业务收入	19,177,156.57	16,294,258.32
资产处置收益	275,043.69	534,701.44
<b>二、营业支出</b>	<b>3,471,711,089.51</b>	<b>3,163,542,850.15</b>
税金及附加	53,028,801.97	53,432,691.17
业务及管理费	3,502,679,610.89	2,945,504,015.94
信用减值损失	(86,034,839.24)	162,609,399.84
其他业务成本	2,037,515.89	1,996,743.20
<b>三、营业利润</b>	<b>4,885,293,110.58</b>	<b>3,527,517,246.19</b>
加：营业外收入	2,055,485.47	2,855,657.34
减：营业外支出	40,110,339.57	50,969,614.48
<b>四、利润总额</b>	<b>4,847,238,256.48</b>	<b>3,479,403,289.05</b>
减：所得税费用	421,784,034.56	245,628,871.70
<b>五、净利润</b>	<b>4,425,454,221.92</b>	<b>3,233,774,417.35</b>
(一)持续经营净利润	4,425,454,221.92	3,233,774,417.35
(二)终止经营净利润		
<b>六、其他综合收益的税后净额</b>	<b>730,690,285.43</b>	<b>(231,812,290.79)</b>
(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	370,709,878.52	(200,488,394.29)

(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	2,986,155.20	4,365,114.58
2. 其他债权投资公允价值变动	357,135,068.90	(48,343,166.47)
3. 其他债权投资信用减值准备	(140,817.19)	12,654,155.39
七、综合收益总额	<b>5,156,144,507.35</b>	<b>3,001,962,126.56</b>

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：



## 合并现金流量表

2023年1-6月

编制单位：申万宏源证券有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	2023年1-6月	2022年1-6月
<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	37,674,427,460.75	12,126,326,860.01
收取利息、手续费及佣金的现金	11,531,353,329.00	11,665,749,846.12
回购业务资金净增加额	6,445,258,185.15	-
代理买卖证券收到的现金净额	2,323,580,748.08	9,341,626,834.96
融出资金净减少额	297,676,692.38	9,157,546,929.35
收到其他与经营活动有关的现金	3,196,381,623.43	1,628,287,608.54
<b>经营活动现金流入小计</b>	<b>61,468,678,038.79</b>	<b>43,919,538,078.98</b>
回购业务资金净减少额	-	7,147,934,387.15
拆入资金净减少额	2,418,786,570.00	1,026,775,020.00
支付利息、手续费及佣金的现金	3,052,105,350.51	2,502,720,414.15
支付给职工以及为职工支付的现金	3,615,940,367.64	2,789,744,803.12
支付的各项税费	1,008,941,009.23	2,044,278,881.23
支付其他与经营活动有关的现金	2,672,679,226.34	3,431,954,186.69
<b>经营活动现金流出小计</b>	<b>12,768,452,523.72</b>	<b>18,943,407,692.34</b>
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>	<b>48,700,225,515.07</b>	<b>24,976,130,386.64</b>
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>		
取得投资收益收到的现金	1,778,254,303.07	580,777,681.47
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收到的现金净额	3,326,682.25	2,100,424.54
<b>投资活动现金流入小计</b>	<b>1,781,580,985.32</b>	<b>582,878,106.01</b>
投资支付的现金	48,131,935,909.02	6,339,043,925.10
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金	314,743,914.47	102,963,864.76
<b>投资活动现金流出小计</b>	<b>48,446,679,823.49</b>	<b>6,442,007,789.86</b>
<b>投资活动使用的现金流量净额</b>	<b>(46,665,098,838.17)</b>	<b>(5,859,129,683.85)</b>
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>		
吸收投资收到的现金	1,800,000,000.00	-
取得借款收到的现金	156,177,757.71	2,345,201,489.52
发行债券收到的现金	39,648,989,806.62	60,173,103,938.46
<b>筹资活动现金流入小计</b>	<b>41,605,167,564.33</b>	<b>62,518,305,427.98</b>
偿还债务支付的现金	50,529,821,273.64	59,202,518,563.57
分配股利、利润或偿付利息支付的现金	2,277,805,759.25	2,765,369,202.58
其中：对其他工具持有者的分配	716,400,000.00	-
支付租赁负债的现金	234,119,953.39	207,135,180.39
支付其他与筹资活动有关的现金	23,349,056.63	-

筹资活动现金流出小计	53,065,096,042.91	62,175,022,946.54
筹资活动（使用）/产生的现金流量净额	(11,459,928,478.58)	343,282,481.44
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	(27,605,395.21)	(21,640,768.48)
五、现金及现金等价物净（减少）/增加额	(9,452,407,196.89)	19,438,642,415.75
加：期初现金及现金等价物余额	141,737,489,867.32	141,498,572,603.76
六、期末现金及现金等价物余额	132,285,082,670.43	160,937,215,019.51

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：



# 母公司现金流量表

2023年1-6月

编制单位：申万宏源证券有限公司

单位：元 币种：人民币

项目	2023年1-6月	2022年1-6月
一、经营活动产生的现金流量：		
为交易目的而持有的金融工具净减少额	39,538,389,030.02	16,954,350,771.59
收取利息、手续费及佣金的现金	9,242,658,501.53	9,279,205,092.59
回购业务资金净增加额	4,770,340,134.91	-
代理买卖证券收到的现金净额	1,714,557,331.40	5,424,983,619.16
融出资金净减少额	93,589,627.08	8,388,589,423.50
收到其他与经营活动有关的现金	2,134,062,284.60	203,388,526.82
<b>经营活动现金流入小计</b>	<b>57,493,596,909.54</b>	<b>40,250,517,433.66</b>
回购业务资金净减少额	-	7,689,295,925.91
拆入资金净减少额	2,418,786,570.00	1,026,775,020.00
支付利息、手续费及佣金的现金	2,543,356,137.36	2,222,906,955.35
支付给职工以及为职工支付的现金	2,567,238,060.23	1,854,878,113.77
支付的各项税费	712,313,124.72	1,573,023,148.97
支付其他与经营活动有关的现金	660,919,613.68	939,081,619.09
<b>经营活动现金流出小计</b>	<b>8,902,613,505.99</b>	<b>15,305,960,783.09</b>
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>	<b>48,590,983,403.55</b>	<b>24,944,556,650.57</b>
二、投资活动产生的现金流量：		
取得投资收益收到的现金	2,690,282,399.40	753,501,147.97
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收到的现金净额	1,788,537.61	1,720,023.42
<b>投资活动现金流入小计</b>	<b>2,692,070,937.01</b>	<b>755,221,171.39</b>
投资支付的现金	47,377,345,005.16	4,006,943,720.00
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金	287,099,618.53	89,551,900.61
取得子公司及其他营业单位支付的现金净额	2,500,000,000.00	
<b>投资活动现金流出小计</b>	<b>50,164,444,623.69</b>	<b>4,096,495,620.61</b>
<b>投资活动使用的现金流量净额</b>	<b>(47,472,373,686.68)</b>	<b>(3,341,274,449.22)</b>
三、筹资活动产生的现金流量：		
吸收投资收到的现金	1,800,000,000.00	-
发行债券收到的现金	39,648,989,806.62	56,634,865,403.75
<b>筹资活动现金流入小计</b>	<b>41,448,989,806.62</b>	<b>56,634,865,403.75</b>
偿还债务支付的现金	49,874,412,302.45	56,693,633,056.20
分配股利、利润或偿付利息支付的现金	2,389,091,297.43	2,730,183,794.52
支付租赁负债的现金	164,542,177.01	150,065,162.29
支付其他与筹资活动有关的现金	23,349,056.63	-

筹资活动现金流出小计	52,451,394,833.52	59,573,882,013.01
筹资活动使用的现金流量净额	(11,002,405,026.90)	(2,939,016,609.26)
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响	8,843,434.18	9,530,056.01
五、现金及现金等价物净增加额	(9,874,951,875.85)	18,673,795,648.10
加：期初现金及现金等价物余额	110,198,519,219.82	110,312,479,510.03
六、期末现金及现金等价物余额	100,323,567,343.97	128,986,275,158.13

法定代表人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：



## 申万宏源证券有限公司 2023 年半年度

## 合并财务报表重要项目的说明

以下注释项目除特别注明外，金额单位为人民币元。

## 1 货币资金

## (1) 按币种列示

	2023 年 6 月 30 日		
	原币金额	折算汇率	人民币金额
现金			
人民币	4,691.96	1.00000	4,691.96
美元	71.45	7.22580	516.28
港币	44,776.20	0.92198	41,282.76
小计			46,491.00
银行存款			
自有资金			
人民币	26,080,723,787.78	1.00000	26,080,723,787.78
美元	129,691,318.39	7.22580	937,123,528.43
港币	1,246,061,201.34	0.92198	1,148,843,506.41
其他币种			369,135,165.09
小计			28,535,825,987.71
客户资金			
人民币	69,204,235,521.52	1.00000	69,204,235,521.52
美元	368,964,085.41	7.22580	2,666,060,688.36
港币	2,912,297,004.07	0.92198	2,685,079,591.81
其他币种			278,709,676.62
小计			74,834,085,478.31
银行存款合计			103,369,911,466.02
其他货币资金			
人民币	221,199,581.18	1.00000	221,199,581.18
港币	1,081,682.62	0.92198	997,289.74
小计			222,196,870.92
小计			103,592,154,827.94
减：减值准备			(4,506,985.00)
合计			103,587,647,842.94

其中，融资融券业务

	2023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	7,812,876,340.30	1.00000	7,812,876,340.30
美元	55,812,761.97	7.22580	403,291,855.47
港币	1,060,067,232.00	0.92198	977,360,786.56
其他币种			295,876,362.68
小计			9,489,405,345.01
合计			9,489,405,345.01

(2) 于2023年6月30日，本集团使用受到限制的货币资金人民币1,192,551,660.85元。

## 2 结算备付金

	2023年6月30日		
	原币金额	折算汇率	人民币金额
公司备付金			
公司自有备付金			
人民币	16,885,495,424.79	1.00000	16,885,495,424.79
美元	16,550,431.79	7.22580	119,590,110.06
港币	25,310,898.58	0.92198	23,336,142.27
其他币种			19,030.82
小计			17,028,440,707.94
公司信用备付金			
人民币	147,656,832.55	1.00000	147,656,832.55
公司备付金合计			17,176,097,540.49
客户备付金			
客户普通备付金			
人民币	8,726,747,322.23	1.00000	8,726,747,322.23
美元	41,038,971.54	7.22580	296,539,400.55
港币	346,791,506.93	0.92198	319,734,833.56
小计			9,343,021,556.34
客户信用备付金			
人民币	825,841,601.50	1.00000	825,841,601.50
客户备付金合计			10,168,863,157.84
合计			27,344,960,698.33

### 3 融出资金

#### (1) 按客户类别列示

		2023年6月30日
境内		
其中：个人		54,253,447,127.52
机构		<u>6,219,395,282.83</u>
小计		<u>60,472,842,410.35</u>
减：减值准备		<u>(368,463,301.72)</u>
账面价值小计		<u>60,104,379,108.63</u>
境外		
其中：个人		646,216,619.30
机构		<u>455,798,024.59</u>
小计		<u>1,102,014,643.89</u>
减：减值准备		<u>-</u>
账面价值小计		<u>1,102,014,643.89</u>
账面价值合计		<u><u>61,206,393,752.52</u></u>

#### (2) 融资融券业务担保物公允价值

		2023年6月30日
股票		188,493,267,572.84
资金		7,901,158,601.88
基金		5,546,823,021.44
债券		<u>241,835,496.03</u>
合计		<u><u>202,183,084,692.19</u></u>

### 4 衍生金融资产和衍生金融负债

		2023年6月30日	
		非套期工具	
名义金额	公允价值		
	资产	负债	

权益衍生工具	196,117,129,339.50	6,136,594,572.84	(3,323,461,697.84)
利率衍生工具	651,660,629,334.19	1,469,994,664.70	(1,584,099,395.63)
商品衍生工具	82,290,637,799.70	212,442,911.15	(154,240,840.88)
信用衍生工具	10,605,331,000.00	30,706,104.73	(33,490,060.71)
货币衍生工具	85,119,950.00	-	(1,748,050.00)
合计	<u>940,758,847,423.39</u>	<u>7,849,738,253.42</u>	<u>(5,097,040,045.06)</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、黄金延期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2023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浮亏人民币39,229,829.00元。

## 5 存出保证金

	2023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	15,517,123,619.63	1.00000	15,517,123,619.63
美元	540,000.00	7.22580	3,901,932.00
港币	37,909,782.71	0.92198	34,952,061.46
小计			<u>15,555,977,613.09</u>
信用保证金			
人民币	44,463,279.41	1.00000	<u>44,463,279.41</u>
履约保证金			
人民币	6,257,855,174.78	1.00000	6,257,855,174.78
美元	6,370,748.01	7.22580	46,033,750.97
港币	53,768,878.00	0.92198	49,573,830.14
小计			<u>6,353,462,755.89</u>
转融通保证金			
人民币	152,709,540.18	1.00000	<u>152,709,540.18</u>
合计			<u>22,106,613,188.57</u>

## 6 应收款项

### (1) 按类别列示

2023年6月30日

应收清算款项	5,413,126,328.18
应收资管业务款	546,466,759.89
应收手续费及佣金	228,918,575.22
其他	1,493,427,962.24
小计	7,681,939,625.53
减：坏账准备	(934,802,759.92)
合计	6,747,136,865.61

(2) 按账龄分析

2023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	6,372,669,204.03	82.96	(44,073,649.46)	0.69
1-2年	668,152,187.43	8.70	(516,928,576.94)	77.37
2-3年	16,302,892.27	0.21	(2,030,689.66)	12.46
3年以上	624,815,341.80	8.13	(371,769,843.86)	59.50
合计	7,681,939,625.53	100.00	(934,802,759.92)	12.17

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2023年6月30日，除部分应收资管业务款和其他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。

7 买入返售金融资产

(1) 按标的物类别列示

2023年6月30日

债券	6,494,775,664.23
股票	4,088,560,296.18
小计	10,583,335,960.41
减：减值准备	(1,700,500,388.70)

合计	<u>8,882,835,571.71</u>
----	-------------------------

(2) 按业务类别列示

**2023年6月30日**

债券质押式回购	6,494,775,664.23
股票质押式回购	<u>4,088,560,296.18</u>

小计	<u>10,583,335,960.41</u>
----	--------------------------

减：减值准备	<u>(1,700,500,388.70)</u>
--------	---------------------------

合计	<u>8,882,835,571.71</u>
----	-------------------------

于2023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2,368,299,888.34元。

(3) 担保物金额

**2023年6月30日**

担保物	7,788,755,648.84
-----	------------------

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	<u>-</u>
--------------------	----------

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2023年6月30日上述交易所国债逆回购的金额为人民币3,081,642,309.19元。

## 8 金融投资：交易性金融资产

### (1) 按类别列示

2023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	122,885,400,362.71	-	122,885,400,362.71	122,506,574,296.19	-	122,506,574,296.19
公募基金	30,445,482,180.82	-	30,445,482,180.82	30,210,943,870.04	-	30,210,943,870.04
股票	42,877,647,134.40	-	42,877,647,134.40	41,467,617,554.79	-	41,467,617,554.79
券商资管产品	2,388,456,933.84	-	2,388,456,933.84	2,557,209,530.46	-	2,557,209,530.46
银行理财产品	1,843,020,666.94	-	1,843,020,666.94	1,845,556,462.97	-	1,845,556,462.97
信托计划	15,917,200.00	-	15,917,200.00	20,957,271.53	-	20,957,271.53
其他	41,709,123,951.25	-	41,709,123,951.25	42,856,558,856.50	-	42,856,558,856.50
合计	242,165,048,429.96	-	242,165,048,429.96	241,465,417,842.48	-	241,465,417,842.48

(2) 交易性金融资产中已融出证券情况

于2023年6月30日，本集团交易性金融资产余额中包含的融出证券余额于12(1)融出证券中披露。本集团融出证券收到的担保物于3(2)中披露。

(3) 存在限售期及承诺条件的交易性金融资产

于2023年6月30日，本集团交易性金融资产中有人民币2,228,722,818.10元的股票投资存在限售期限。

于2023年6月30日，本集团交易性金融资产中有人民币95,985,857,357.10元的金融资产为卖出回购金融资产款设定质押。

于2023年6月30日，本集团交易性金融资产中有人民币8,589,446,547.00元的金融资产为债券借贷业务设定质押。

9 金融投资：债权投资

	2023年6月30日			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值
债券	187,912,431.72	2,327,222.68	(44,864,935.50)	145,374,718.90
信托计划	300,000,000.00	-	(249,930,000.00)	50,070,000.00
合计	487,912,431.72	2,327,222.68	(294,794,935.50)	195,444,718.90

10 金融投资：其他债权投资

(1) 按类别列式

	2023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	11,934,295,285.46	166,191,459.52	(312,478,112.02)	11,788,008,632.96	(254,350,150.29)
公司债	17,715,377,925.48	304,920,203.04	(394,256,005.48)	17,626,042,123.04	(425,650,030.42)
金融债	12,130,387,762.75	124,103,884.38	12,627,357.25	12,267,119,004.38	(8,298,965.55)
中期票据	5,313,361,157.50	74,581,245.06	23,995,354.90	5,411,937,757.46	(5,373,224.11)
地方债	820,086,463.78	6,100,540.00	4,273,572.22	830,460,576.00	(650,214.24)
国债	721,731,674.03	3,228,520.08	2,242,595.97	727,202,790.08	-
其他	12,656,494,560.69	241,850,132.89	(20,725,195.69)	12,877,619,497.89	(65,221,574.93)
合计	61,291,734,829.69	920,975,984.97	(684,320,432.85)	61,528,390,381.81	(759,544,159.54)

(2) 存在承诺条件的其他债权投资

于2023年6月30日，本集团其他债权投资中有人民币20,173,652,302.50元的金融资产为卖出回购金融资产款设定质押。

于 2023 年 6 月 30 日，本集团其他债权投资中人民币 9,431,758,571.50 元的金融资产为债券借贷业务设定质押。

## 11 金融投资：其他权益工具投资

	2023 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	45,239,154,590.21	44,960,698,793.68	502,401,873.83

于 2023 年 6 月 30 日，本集团其他权益工具投资中有人民币 27,832,196,394.70 元的永续债投资为卖出回购金融资产款设定质押。

于 2023 年 6 月 30 日，本集团其他权益工具投资中人民币 8,075,850,857.20 元的永续债投资为债券借贷业务设定质押。

于 2023 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间，本集团终止确认的其他权益工具投资累计损失从其他综合收益转入留存收益为人民币 48,232,800.24 元。

## 12 融出证券

### (1) 按项目分析

	2023 年 6 月 30 日
转融通融入证券	915,893,508.76
交易性金融资产	472,133,561.00
其他权益工具投资	35,737,662.00
融出证券总额	1,423,764,731.76
转融通融入证券总额	1,508,364,228.60

### (2) 融券业务违约情况

于 2023 年 6 月 30 日，本集团融券业务无重大合约逾期。

## 13 长期股权投资

### (1) 按类别列示

2023年6月30日

合营企业	
—不重要的合营企业	64,467,388.07
联营企业	
—重要的联营企业	2,161,268,054.53
—不重要的联营企业	60,671,572.71
	<hr/>
合计	2,286,407,015.31
	<hr/>

于2023年6月30日，本集团的长期股权投资未计提减值准备。

(2) 长期股权投资明细情况

被投资单位名称	本期增减变动									2023年 6月30日	减值准备 期末余额
	2023年 1月1日	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>合营企业</b>											
上海申万宏源嘉实股 权投资合伙企业 (有限合伙)	1,123,804.19	-	-	(101,538.82)	-	-	-	-	-	1,022,265.37	-
珠海申宏格金医疗健 康产业投资基金合 伙企业(有限合伙)	66,418,433.08	-	(4,391,217.56)	1,417,907.18	-	-	-	-	-	63,445,122.70	-
小计	67,542,237.27	-	(4,391,217.56)	1,316,368.36	-	-	-	-	-	64,467,388.07	-
<b>联营企业</b>											
富国基金管理有限公司	2,156,011,386.99	-	-	291,130,512.34	2,986,155.20	-	(288,860,000.00)	-	-	2,161,268,054.53	-
桐乡申万泓鼎成长二 号股权投资基金合 伙企业(有限合伙)	54,994,655.54	-	-	3,529,789.03	-	-	-	-	-	58,524,444.57	-
重庆市富荣股权投资 基金合伙企业(有 限合伙)	2,054,446.63	-	-	92,681.51	-	-	-	-	-	2,147,128.14	-
小计	2,213,060,489.16	-	-	294,752,982.88	2,986,155.20	-	(288,860,000.00)	-	-	2,221,939,627.24	-

合计	2,280,602,726.43	-	(4,391,217.56)	296,069,351.24	2,986,155.20	-	(288,860,000.00)	-	-	2,286,407,015.31	.
----	------------------	---	----------------	----------------	--------------	---	------------------	---	---	------------------	---

### (3) 合营企业基本情况

合营企业	注册地及主要经营地	业务性质	设立时实收资本人民币元	持有权益比例	
				直接	间接
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	1.00 亿元	-	31.00%
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	2.51 亿元	-	20.00%

### (4) 联营企业基本情况

联营企业	注册地及主要经营地	业务性质	设立时实收资本人民币元	持有权益比例	
				直接	间接
富国基金管理有限公司	上海	基金管理	5.20 亿元	-	27.78%
桐乡申万泓鼎成长二号股权投资基金合伙企业(有限合伙)(i)	浙江嘉兴	股权投资	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)(i)	重庆	股权投资	0.50 亿元	-	1.00%

- (i) 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。

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 2023 年 6 月 30 日
资产总额	13,623,840,619.77
负债总额	(5,842,497,489.18)
净资产	7,781,343,130.59
持股比例	27.775%
按持股比例计算的净资产份额	2,161,268,054.53
调整事项	-
对联营企业投资的账面价值	2,161,268,054.53
	<b>1 月 1 日至 6 月 30 日止期间</b>
	2023 年

营业收入	3,648,084,087.97
净利润	1,065,400,275.91
其他综合收益	10,751,233.87
其他调整	-
综合收益总额	1,076,151,509.78
本集团本期间收到的来自联营企业的股利	288,860,000.00

于 2023 年 6 月 30 日，本集团重要联营企业为非上市公司，不存在公开市场报价。

(6) 不重要合营企业和联营企业的汇总财务信息

	2023 年 6 月 30 日
合营企业：	
投资账面价值合计	64,467,388.07
下列各项按持股比例计算的合计数	
-净利润	1,316,368.36
-综合收益总额	1,316,368.36
联营企业：	
投资账面价值合计	60,671,572.71
下列各项按持股比例计算的合计数	
-净利润	3,622,470.54
-综合收益总额	3,622,470.54

14 投资性房地产

	房屋及建筑物
成本	
2022 年 12 月 31 日余额	91,019,200.94
2023 年 6 月 30 日余额	91,019,200.94
减：累计折旧	
2022 年 12 月 31 日余额	(58,045,077.23)
本期增加	(1,839,641.61)
2023 年 6 月 30 日余额	(59,884,718.84)
账面价值	

2023年6月30日余额

31,134,482.10

于2023年6月30日，本集团的投资性房地产未计提减值准备。

于2023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。

## 15 固定资产

### (1) 账面价值

2023年6月30日

固定资产原值	2,446,844,690.57
减：累计折旧	(1,642,792,795.81)
固定资产减值准备	<u>(283,970.97)</u>
合计	<u>803,767,923.79</u>

## (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
原值							
2022年12月31日余额	932,974,064.18	45,154,854.74	16,378,181.04	1,188,879,307.38	75,337,013.28	69,629,879.99	2,328,353,300.61
本期增加							
—本期购置	-	1,238,830.45	-	169,156,016.90	8,924,509.01	60,405.08	179,379,761.44
—在建工程转入	102,751.50	21,407.08	-	3,126,629.10	158,941.58	-	3,409,729.26
本期减少							
—转让和出售	-	(697,972.00)	(108,500.00)	(3,549,244.79)	(970,756.15)	-	(5,326,472.94)
—清理报废	-	(3,587,041.63)	(376,067.06)	(52,469,980.96)	(2,091,813.15)	(446,725.00)	(58,971,627.80)
2023年6月30日余额	<u>933,076,815.68</u>	<u>42,130,078.64</u>	<u>15,893,613.98</u>	<u>1,305,142,727.63</u>	<u>81,357,894.57</u>	<u>69,243,560.07</u>	<u>2,446,844,690.57</u>
减：累计折旧							
2022年12月31日余额	(588,053,175.15)	(37,393,922.78)	(14,336,921.46)	(838,588,455.52)	(61,449,038.46)	(63,451,912.57)	(1,603,273,425.94)
本期计提	(15,301,698.17)	(939,768.39)	(56,911.39)	(79,172,018.54)	(2,958,136.12)	(1,097,960.94)	(99,526,493.55)
本期减少	-	3,928,871.58	459,887.98	52,358,156.83	2,814,197.29	446,010.00	60,007,123.68
2023年6月30日余额	<u>(603,354,873.32)</u>	<u>(34,404,819.59)</u>	<u>(13,933,944.87)</u>	<u>(865,402,317.23)</u>	<u>(61,592,977.29)</u>	<u>(64,103,863.51)</u>	<u>(1,642,792,795.81)</u>
减：减值准备							
2022年12月31日余额	(283,970.97)	-	-	-	-	-	(283,970.97)
2023年6月30日余额	<u>(283,970.97)</u>	-	-	-	-	-	<u>(283,970.97)</u>
账面价值							
2023年6月30日	<u>329,437,971.39</u>	<u>7,725,259.05</u>	<u>1,959,669.11</u>	<u>439,740,410.40</u>	<u>19,764,917.28</u>	<u>5,139,696.56</u>	<u>803,767,923.79</u>

(3) 暂时闲置的固定资产

于 2023 年 6 月 30 日，本集团无闲置的重大固定资产。

(4) 通过融资租赁租入的固定资产情况

于 2023 年 6 月 30 日，本集团无通过融资租赁租入的重大固定资产。

(5) 通过经营租赁租出的固定资产的情况

于 2023 年 6 月 30 日，本集团无通过经营租赁租出的重大固定资产。

(6) 未办妥产权证书的固定资产情况

于 2023 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 1,268,649.17 元。

## 16 在建工程

(1) 在建工程账面价值

	2023 年 6 月 30 日		
	账面余额	减值准备	账面价值
无形资产开发支出	108,548,621.93	-	108,548,621.93
自有房产装修工程	55,132,053.07	-	55,132,053.07
租入房产装修工程	66,126,157.92	-	66,126,157.92
其他	7,030,312.01	-	7,030,312.01
合计	<u>236,837,144.93</u>	<u>-</u>	<u>236,837,144.93</u>

(2) 在建工程项目变动

工程名称	资金来源	2023年1月1日	本期增加	本期减少		2023年6月30日
				本期转入固定资产	其他减少	
自有房产装修工程	自有	47,331,692.42	7,800,360.65	-	-	55,132,053.07
无形资产开发支出	自有	122,932,960.90	94,732,590.76	-	(109,116,929.73)	108,548,621.93
租入房产装修工程	自有	52,888,390.35	29,922,075.67	-	(16,684,308.10)	66,126,157.92
其他	自有	6,996,739.84	3,443,301.43	(3,409,729.26)	-	7,030,312.01
合计		230,149,783.51	135,898,328.51	(3,409,729.26)	(125,801,237.83)	236,837,144.93

## 17 使用权资产

	房屋及建筑物
原值	
2022年12月31日余额	1,821,024,777.12
本期增加	264,150,678.21
本期减少	<u>(143,385,440.85)</u>
2023年6月30日余额	<u>1,941,790,014.48</u>
减：累计折旧	
2022年12月31日余额	(833,528,784.94)
本期计提	(210,525,679.18)
本期减少	<u>138,460,170.40</u>
2023年6月30日余额	<u>(905,594,293.72)</u>
账面价值	
2023年6月30日余额	<u>1,036,195,720.76</u>

于2023年6月30日，本集团的使用权资产未计提减值准备。

## 18 无形资产

	计算机软件	其他	合计
原值			
2022年12月31日余额	977,561,548.38	321,365,961.70	1,298,927,510.08
本期增加	104,293,242.30	1,016,598.06	105,309,840.36
本期减少	<u>(154,230.35)</u>	<u>(2,498,559.48)</u>	<u>(2,652,789.83)</u>
2023年6月30日余额	<u>1,081,700,560.33</u>	<u>319,884,000.28</u>	<u>1,401,584,560.61</u>
减：累计摊销			
2022年12月31日余额	(705,349,767.65)	(304,448,047.78)	(1,009,797,815.43)
本期增加	(80,806,872.23)	(654,804.93)	(81,461,677.16)
本期减少	<u>140,129.12</u>	<u>1,093,564.71</u>	<u>1,233,693.83</u>
2023年6月30日余额	<u>(786,016,510.76)</u>	<u>(304,009,288.00)</u>	<u>(1,090,025,798.76)</u>
减：减值准备			
2023年6月30日余额	<u>-</u>	<u>(675,579.92)</u>	<u>(675,579.92)</u>
账面价值			
2023年6月30日	<u>295,684,049.57</u>	<u>15,199,132.36</u>	<u>310,883,181.93</u>

于 2023 年 6 月 30 日，本集团无用于抵押或担保的重大无形资产。

## 19 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	2023 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	3,891,089,645.50	972,772,411.37
可抵扣亏损	3,631,089,722.77	867,629,110.86
资产减值准备	2,560,743,758.06	639,636,455.87
交易性金融资产	1,095,673,318.87	253,816,355.71
租赁负债	952,896,616.39	238,224,154.11
其他债权投资	342,957,453.34	85,739,363.33
其他权益工具投资	274,303,848.24	68,575,962.07
交易性金融负债	43,456,182.44	10,864,045.61
衍生金融工具	1,387,333.84	346,833.46
其他	139,861,326.62	34,942,938.27
合计	<u>12,933,459,206.07</u>	<u>3,172,547,630.66</u>

### (2) 递延所得税负债

项目	2023 年 6 月 30 日	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
衍生金融工具	(3,177,839,550.00)	(794,459,887.50)
使用权资产	(943,950,483.86)	(235,987,620.98)
交易性金融资产	(333,219,495.57)	(83,304,873.90)
其他权益工具投资	(234,033,474.25)	(38,615,523.25)
交易性金融负债	(4,740,189.16)	(1,185,047.29)
其他	(11,679,787.42)	(2,838,946.88)
合计	<u>(4,705,462,980.26)</u>	<u>(1,156,391,899.80)</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：

	2023 年 6 月 30 日
递延所得税资产	2,032,573,579.15
递延所得税负债	<u>(16,417,848.29)</u>

(4) 未确认递延所得税资产额可抵扣亏损金额

项目	2023年6月30日
可抵扣亏损	1,032,087,049.30

20 其他资产

2023年6月30日

其他应收款	(1)	591,126,976.92
大宗商品存货		361,832,956.95
应收股利		288,930,736.94
预付款项		133,777,467.70
待抵扣税项		101,276,868.42
长期待摊费用	(2)	83,789,224.68
待摊费用		13,435,758.63
应收利息		3,560,764.73
抵债资产		1,000,000.00
其他	(3)	295,153,902.16
合计		1,873,884,657.13

(1) 其他应收款

(a) 按明细列式

2023年6月30日

其他应收款余额	902,076,517.82
减：坏账准备	(310,949,540.90)
合计	591,126,976.92

(b) 按账龄分析

2023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	508,590,534.05	56.38	(17,139,934.91)	3.37
1-2年	72,061,416.78	7.99	(5,355,914.83)	7.43
2-3年	26,396,539.09	2.93	(12,931,657.87)	48.99
3年以上	295,028,027.90	32.70	(275,522,033.29)	93.39
合计	902,076,517.82	100.00	(310,949,540.90)	34.47

(2) 长期待摊费用

	2023年 1月1日	本期购入	在建工程转入	本期摊销	本期转出	2023年 6月30日
经营租						
赁租						
入资						
产改						
良支						
出	71,113,551.02	2,169,800.97	16,684,308.10	(17,228,078.69)	(1,679,840.29)	71,059,741.11
其他	11,472,109.29	2,782,953.21	-	(1,525,578.93)	-	12,729,483.57
合计	<u>82,585,660.31</u>	<u>4,952,754.18</u>	<u>16,684,308.10</u>	<u>(18,753,657.62)</u>	<u>(1,679,840.29)</u>	<u>83,789,224.68</u>

- (3) 截至2023年6月30日，其他包括本公司因收购子公司形成的商誉人民币4,928,346.74元。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。

## 21 资产减值准备

	2023年1月1日	本期计提	本期转回	本期核销	其他变动	2023年6月30日
货币资金	5,200,307.61	-	(807,307.49)	-	113,984.88	4,506,985.00
融出资金(1)	378,024,126.84	32,317,647.31	(41,878,472.43)	-	-	368,463,301.72
应收款项(2)	840,249,196.25	132,684,536.14	(30,516,941.85)	-	(7,614,030.62)	934,802,759.92
买入返售金融资产(3)	1,829,276,430.63	76,846,337.99	(203,013,850.02)	-	(2,608,529.90)	1,700,500,388.70
债权投资(4)	483,512,778.83	23,121,711.40	-	-	(211,839,554.73)	294,794,935.50
其他债权投资(5)	745,479,080.90	61,505,531.08	(55,249,018.03)	-	7,808,565.59	759,544,159.54
其他金融资产(6)	323,681,119.05	15,988,919.15	(13,325,585.63)	-	-	326,344,452.57
金融工具及其他项目						
信用减值准备小计	<u>4,605,423,040.11</u>	<u>342,464,683.07</u>	<u>(344,791,175.45)</u>	<u>-</u>	<u>(214,139,564.78)</u>	<u>4,388,956,982.95</u>
固定资产	283,970.97	-	-	-	-	283,970.97
无形资产	675,579.92	-	-	-	-	675,579.92
其他资产	<u>14,777,708.25</u>	<u>1,756,142.35</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>16,533,850.60</u>
其他资产减值准备小计	<u>15,737,259.14</u>	<u>1,756,142.35</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>17,493,401.49</u>
合计	<u>4,621,160,299.25</u>	<u>344,220,825.42</u>	<u>(344,791,175.45)</u>	<u>-</u>	<u>(214,139,564.78)</u>	<u>4,406,450,384.44</u>

(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)	
2023 年 1 月 1 日	104,071,573.48	23,372,093.12	250,580,460.24	378,024,126.84
本期计提	30,882,625.05	-	1,435,022.26	32,317,647.31
本期转回	(41,509,441.93)	(287,757.64)	(81,272.86)	(41,878,472.43)
阶段转移:	-	-	-	-
第一阶段转移至第三阶段	(1,768.57)	-	1,768.57	-
第二阶段转移至第一阶段	22,845,566.36	(22,845,566.36)	-	-
第二阶段转移至第三阶段	-	(238,769.12)	238,769.12	-
2023 年 6 月 30 日	116,288,554.39	-	252,174,747.33	368,463,301.72

(2) 应收款项

	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)	
2023 年 1 月 1 日	-	40,433,539.16	799,815,657.09	840,249,196.25
本期计提	28,657,000.95	8,154,587.72	95,872,947.47	132,684,536.14
本期转回	-	(13,213,615.01)	(17,303,326.84)	(30,516,941.85)

阶段转移:

第二阶段转移至第三阶段	-	(5,042,435.76)	5,042,435.76	-
外汇及其他变动	-	-	(7,614,030.62)	(7,614,030.62)
2023年6月30日	<u>28,657,000.95</u>	<u>30,332,076.11</u>	<u>875,813,682.86</u>	<u>934,802,759.92</u>

(3) 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	
			整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
	未来12个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失		
2023年1月1日	203,900.49	-	1,829,072,530.14	1,829,276,430.63
本期计提	60,082.50	-	76,786,255.49	76,846,337.99
本期转回	-	-	(203,013,850.02)	(203,013,850.02)
外汇及其他变动	6,553.43	-	(2,615,083.33)	(2,608,529.90)
2023年6月30日	<u>270,536.42</u>	<u>-</u>	<u>1,700,229,852.28</u>	<u>1,700,500,388.70</u>

(4) 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	
			整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
	未来12个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失		
2023年1月1日	761,470.07	-	482,751,308.76	483,512,778.83

本期计提	2,736,207.95	-	20,385,503.45	23,121,711.40
本期转回	-	-	-	-
外汇及其他变动	142,160.93	-	(211,981,715.66)	(211,839,554.73)
2023年6月30日	<u>3,639,838.95</u>	<u>-</u>	<u>291,155,096.55</u>	<u>294,794,935.50</u>

(5) 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)	
2023年1月1日	66,944,881.68	5,572,760.81	672,961,438.41	745,479,080.90
本期计提	34,443,562.06	604,080.68	26,457,888.34	61,505,531.08
本期转回	(35,293,510.69)	(2,754,110.05)	(17,201,397.29)	(55,249,018.03)
阶段转移:				-
第一阶段转移至第二阶段	(306,491.87)	306,491.87	-	-
第二阶段转移至第一阶段	2,400,420.71	(2,400,420.71)	-	-
外汇及其他变动	513,343.42	-	7,295,222.17	7,808,565.59
2023年6月30日	<u>68,702,205.31</u>	<u>1,328,802.60</u>	<u>689,513,151.63</u>	<u>759,544,159.54</u>

(6) 其他金融资产

	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)	
2023 年 1 月 1 日	32,101,023.79	-	291,580,095.26	323,681,119.05
本期计提	15,007,750.00	-	981,169.15	15,988,919.15
本期转回	(11,902,528.32)	-	(1,423,057.31)	(13,325,585.63)
2023 年 6 月 30 日	35,206,245.47	-	291,138,207.10	326,344,452.57

22 短期借款

2023 年 6 月 30 日

银行借款

1,530,722,759.14

于 2023 年 6 月 30 日，短期借款的利率区间为 2.50% - 5.91%

23 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 %	2023 年 1 月 1 日 人民币元	本期增加 人民币元	本期减少 人民币元	2023 年 6 月 30 日 人民币元
22 申万宏源 CP002	20.00	2022/02/17	12 个月	20.00	2.49	2,043,387,397.23	4,229,589.04	(2,047,616,986.27)	-
22 申万宏源 CP003	20.00	2022/03/28	12 个月	20.00	2.66	2,040,665,205.46	8,599,452.05	(2,049,264,657.51)	-

22 申万宏源 CP005	30.00	2022/08/18	10 个月	30.00	1.89	3,021,126,575.34	23,456,712.33	(3,044,583,287.67)	-
22 申万宏源香港美元债(1)						1,411,947,737.71	-	(1,411,947,737.71)	-
收益凭证(2)						14,563,829,744.74	28,103,004,334.64	(24,680,437,827.71)	17,986,396,251.67
融资性票据						-	1,012,230,901.75	-	1,012,230,901.75
合计						<u>23,080,956,660.48</u>	<u>29,151,520,989.81</u>	<u>(33,233,850,496.87)</u>	<u>18,998,627,153.42</u>

于 2023 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。

- (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，已于2023年1月26日到期偿还。
- (2) 截至2023年6月30日止6个月期间，本集团共发行1,193期期限一年以内的收益凭证。于2023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2.15% - 6.80%。

## 24 拆入资金

2023年6月30日

其他拆入资金	633,682,357.89
银行拆入资金	405,000,000.00
	<hr/>
合计	1,038,682,357.89

## 25 交易性金融负债

2023年6月30日

债券	10,065,635,654.44
结构化票据	2,565,249,400.06
股票	121,470,111.74
	<hr/>
合计	12,752,355,166.24

## 26 卖出回购金融资产款

### (1) 按业务类别列示

2023年6月30日

质押式卖出回购	128,977,882,509.78
质押式报价回购	19,295,616,047.63
黄金掉期业务	9,574,796,700.09
买断式卖出回购	-
	<hr/>
合计	157,848,295,257.50

### (2) 按金融资产总类列示

2023年6月30日

债券	128,977,882,509.78
基金	19,295,616,047.63
贵金属	9,574,796,700.09
	<hr/>
合计	157,848,295,257.50

(3) 担保物金额

2023年6月30日

债券	152,778,289,177.36
基金	27,914,532,417.19
贵金属	10,314,810,000.00
	<hr/>
合计	191,007,631,594.55

27 代理买卖证券款

2023年6月30日

普通经纪业务	
—个人	47,878,634,589.42
—机构	34,349,358,933.93
	<hr/>
小计	82,227,993,523.35
	<hr/>
信用业务	
—个人	8,595,395,823.22
—机构	1,644,599,431.40
	<hr/>
小计	10,239,995,254.62
	<hr/>
加：应付利息	-
	<hr/>
合计	92,467,988,777.97

28 应付职工薪酬

		2023年 1月1日	本期增加	本期减少	2023年 6月30日
短期薪酬	(1)	1,476,086,952.67	3,256,624,068.21	(3,281,114,400.87)	1,451,596,620.01
离职后福利					
—设定提存计划	(2)	243,025,052.95	385,332,852.35	(294,869,705.06)	333,488,200.24
辞退福利		8,569,588.07	6,407,803.25	(6,566,726.25)	8,410,665.07
其他长期职工福利					
—递延奖金		3,801,418,462.84	-	(126,095,908.48)	3,675,322,554.36
合计		<u>5,529,100,056.53</u>	<u>3,648,364,723.81</u>	<u>(3,708,646,740.66)</u>	<u>5,468,818,039.68</u>

(1) 短期薪酬

	2023年1月1日	本期增加	本期减少	2023年6月30日
工资、奖金、津贴和补贴	1,300,864,344.58	2,739,558,635.24	(2,756,740,902.73)	1,283,682,077.09
职工福利费	374,448.50	104,227,017.86	(104,428,156.36)	173,310.00
社会保险费	1,480,429.21	147,542,310.86	(147,685,023.68)	1,337,716.39
其中：医疗保险费	1,004,922.40	139,444,348.90	(139,316,576.53)	1,132,694.77
工伤保险费	16,323.55	5,282,133.37	(5,278,313.24)	20,143.68
生育保险费	459,183.26	2,815,828.59	(3,090,133.91)	184,877.94
住房公积金	4,368,180.17	180,837,909.97	(180,365,095.30)	4,840,994.84
工会经费和职工教育经费	166,316,010.82	61,113,234.95	(69,265,424.73)	158,163,821.04

其他	<u>2,683,539.39</u>	<u>23,344,959.33</u>	<u>(22,629,798.07)</u>	<u>3,398,700.65</u>
合计	<u>1,476,086,952.67</u>	<u>3,256,624,068.21</u>	<u>(3,281,114,400.87)</u>	<u>1,451,596,620.01</u>

(2) 离职后福利 - 设定提存计划

	2023年1月1日	本期增加	本期减少	2023年6月30日
企业年金缴费	239,424,707.69	157,939,258.94	(67,985,318.08)	329,378,648.55
基本养老保险	3,360,825.31	220,312,746.60	(219,830,212.18)	3,843,359.73
失业保险费	<u>239,519.95</u>	<u>7,080,846.81</u>	<u>(7,054,174.80)</u>	<u>266,191.96</u>
合计	<u>243,025,052.95</u>	<u>385,332,852.35</u>	<u>(294,869,705.06)</u>	<u>333,488,200.24</u>

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。

(3) 基本养老保险、失业保险及企业年金的缴费情况

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。

## 29 应交税费

2023年6月30日

代扣代缴个人所得税	655,502,469.55
增值税	107,374,576.61
企业所得税	65,514,146.09
城市维护建设税	7,876,729.41
教育费附加及地方教育附加	5,702,503.34
其他	624,163.14
	<hr/>
合计	842,594,588.14

## 30 应付款项

2023年6月30日

应付履约保证金及清算款	42,014,257,850.43
应付货款	167,000,000.00
应付销售服务费	61,975,702.99
应付投资者保护基金	48,109,266.35
应付手续费及佣金	10,317,146.63
应付经纪人佣金	5,435,210.07
	<hr/>
合计	42,307,095,176.47

于2023年6月30日，本集团无账龄超过1年的大额应付款项。

### 31 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 %	2023年1月1日 人民币元	本期增加 人民币元	本期减少 人民币元	2023年6月30日 人民币元
17 申证 02	5.00	2017/02/17	84 个月	5.00	4.50	519,602,739.71	10,171,232.87	(21,513,698.61)	508,260,273.97
18 申证 03	15.00	2018/12/10	60 个月	15.00	4.08	1,503,688,767.12	30,348,493.16	-	1,534,037,260.28
20 申证 02	20.00	2020/01/16	36 个月	20.00	3.55	2,068,069,380.82	-	(2,068,069,380.82)	-
20 申证 04	30.00	2020/02/21	36 个月	30.00	3.20	3,082,586,301.39	8,153,424.66	(3,090,739,726.05)	-
20 申证 06	41.00	2020/07/27	36 个月	41.00	3.49	4,161,940,328.79	70,956,958.92	-	4,232,897,287.71
20 申证 08	32.00	2020/09/10	36 个月	32.00	3.76	3,234,123,364.16	61,911,075.72	-	3,296,034,439.88
20 申证 10	57.00	2020/10/26	36 个月	57.00	3.68	5,731,918,467.88	108,017,843.40	-	5,839,936,311.28
20 申证 C2	60.00	2020/04/23	36 个月	60.00	3.18	6,131,384,709.18	47,744,430.09	(6,179,129,139.27)	-
20 申证 C3	60.00	2020/05/25	36 个月	60.00	3.25	6,117,510,209.39	64,574,825.55	(6,182,085,034.94)	-
21 申证 01	25.00	2021/04/29	36 个月	25.00	3.45	2,555,684,874.87	37,140,830.93	(79,633,561.69)	2,513,192,144.11
21 申证 02	20.00	2021/04/29	120 个月	20.00	4.05	2,050,824,499.97	34,190,324.22	(74,786,301.35)	2,010,228,522.84
21 申证 03	26.00	2021/05/24	60 个月	26.00	3.63	2,653,285,429.43	41,452,452.08	(88,432,767.13)	2,606,305,114.38
21 申证 04	20.00	2021/05/28	36 个月	20.00	3.27	2,036,789,096.24	28,382,801.69	(60,562,191.81)	2,004,609,706.12
21 申证 05	25.00	2021/05/28	120 个月	25.00	4.00	2,554,692,083.69	42,487,905.27	(92,602,739.69)	2,504,577,249.27
21 申证 06	20.00	2021/07/21	36 个月	20.00	3.13	2,025,394,028.64	31,915,209.08	-	2,057,309,237.72
21 申证 07	30.00	2021/07/21	120 个月	30.00	3.77	3,044,040,890.74	56,477,960.00	-	3,100,518,850.74
21 申证 08	28.00	2021/07/28	36 个月	28.00	3.04	2,834,545,552.69	42,844,290.04	-	2,877,389,842.73
21 申证 09	42.00	2021/07/28	60 个月	42.00	3.38	4,251,077,911.29	71,782,465.23	-	4,322,860,376.52
21 申证 10	30.00	2021/08/26	36 个月	30.00	3.02	3,025,647,381.93	46,766,088.82	-	3,072,413,470.75
21 申证 11	30.00	2021/08/26	120 个月	30.00	3.75	3,029,822,748.56	56,339,397.87	-	3,086,162,146.43
21 申证 12	48.00	2021/09/09	36 个月	48.00	3.05	4,838,437,633.79	74,736,120.98	-	4,913,173,754.77
21 申证 13	10.00	2021/09/09	60 个月	10.00	3.40	1,008,629,799.24	17,127,592.13	-	1,025,757,391.37
21 申证 14	23.00	2021/09/22	24 个月	23.00	2.95	2,315,243,786.56	36,067,138.82	-	2,351,310,925.38
21 申证 15	23.00	2021/09/22	36 个月	23.00	3.10	2,314,116,984.03	36,969,496.63	-	2,351,086,480.66
21 申证 C1	30.00	2021/01/21	36 个月	30.00	3.93	3,106,961,824.72	54,110,400.61	(111,439,726.04)	3,049,632,499.29
21 申证 C2	38.00	2021/03/11	36 个月	38.00	3.94	3,915,013,981.76	72,806,942.03	(145,618,082.20)	3,842,202,841.59
21 申证 C3	18.00	2021/12/27	24 个月	18.00	3.08	1,796,991,036.46	29,386,840.02	-	1,826,377,876.48
21 申证 C4	12.00	2021/12/27	36 个月	12.00	3.20	1,197,151,492.18	19,883,501.48	-	1,217,034,993.66
22 申证 01	50.00	2022/01/21	36 个月	50.00	2.80	5,124,117,320.94	63,732,481.60	(132,328,767.15)	5,055,521,035.39

22 申证 02	24.00	2022/01/21	120 个月	24.00	3.60	2,476,456,986.43	38,395,773.19	(81,665,753.41)	2,433,187,006.21
22 申证 03	22.00	2022/02/23	36 个月	22.00	2.95	2,250,761,235.06	29,334,188.58	(60,988,219.17)	2,219,107,204.47
22 申证 05	35.00	2022/03/24	36 个月	35.00	3.18	3,578,795,596.41	49,803,997.18	(104,286,575.34)	3,524,313,018.25
22 申证 06	21.00	2022/03/24	60 个月	21.00	3.53	2,152,343,608.16	32,652,111.62	(69,458,794.49)	2,115,536,925.29
22 申证 07	18.00	2022/05/23	36 个月	18.00	2.78	1,826,394,946.62	22,641,909.83	(47,023,890.38)	1,802,012,966.07
22 申证 08	22.00	2022/05/23	60 个月	22.00	3.20	2,237,377,682.37	31,264,316.05	(66,156,712.32)	2,202,485,286.10
22 申证 C1	30.00	2022/04/27	36 个月	30.00	3.19	3,055,335,153.93	42,704,481.67	(88,883,013.71)	3,009,156,621.89
23 申证 C1	14.00	2023/03/06	24 个月	14.00	3.35	-	1,415,548,465.99	(3,307,169.81)	1,412,241,296.18
23 申证 C2	13.00	2023/03/06	36 个月	13.00	3.55	-	1,315,105,636.69	(3,070,188.68)	1,312,035,448.01
23 申证 C3	23.00	2023/03/27	36 个月	23.00	3.38	-	2,320,954,448.36	(6,075,471.70)	2,314,878,976.66
23 申证 01	8.00	2023/04/14	24 个月	8.00	2.85	-	805,058,806.51	(1,792,075.47)	803,266,731.04
23 申证 02	20.00	2023/04/14	36 个月	20.00	2.99	-	2,013,084,353.89	(4,472,075.47)	2,008,612,278.42
21 申万宏源国际 金融美元债(1)						3,496,834,683.67	164,955,170.37	(31,015,062.54)	3,630,774,791.50
22 申万宏源国际 金融美元债(2)						2,099,434,832.03	107,638,412.43	(27,321,258.89)	2,179,751,985.57
收益凭证(3)						15,085,172,601.48	3,940,455,797.28	(1,321,722,597.75)	17,703,905,801.01
合计						126,488,199,952.33	13,626,076,393.54	(20,244,179,975.88)	119,870,096,369.99

- (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，本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，本公司提供连带责任保证担保。
- (3) 截至 2023 年 6 月 30 日止 6 个月期间，本集团共发行 110 期期限超过一年的收益凭证。于 2023 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 2.90% - 3.15%。

### 32 合同负债

2023年6月30日

保荐及财务顾问合同	9,940,053.84
资产管理合同	9,221,795.12
	<hr/>
合计	19,161,848.96

### 33 租赁负债

2023年6月30日

一年以上的非流动租赁负债	626,896,025.18
一年以内到期的租赁负债	427,712,260.35
	<hr/>
合计	1,054,608,285.53

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并不重大。

### 34 其他负债

2023年6月30日

合并结构化主体形成的其他金融		
负债	(1)	11,952,273,813.85
应付股利	(2)	1,528,787,715.75
其他应付款	(3)	1,093,463,813.18
期货风险准备	(4)	197,677,971.25
预提费用		159,294,217.87
递延收益		68,976,491.26
		<hr/>
合计		15,000,474,023.16

#### (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。

#### (2) 应付股利

2023年6月30日

一年以上应付股利 134,387,715.75

本集团应付股利系原申银万国与原宏源证券吸收合并前应付普通股股利。其中，超过一年尚未支付部分主要是由于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

2023年6月30日

应付保证金及押金	318,003,784.37
资管产品增值税合并纳税结余	178,697,558.97
长期应付款	153,005,916.06
代理兑付债券款	6,538,591.87
应付供应商款项	5,828,279.37
其他	431,389,682.54
	<u>1,093,463,813.18</u>
合计	<u>1,093,463,813.18</u>

于2023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。

(4) 期货风险准备

本集团子公司申银万国期货有限公司根据《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。

35 实收资本

	2023年6月30日余额	
	人民币	%
申万宏源集团	<u>53,500,000,000.00</u>	<u>100.00</u>

### 36 其他权益工具

	2023年1月1日		本期增加		2023年6月30日	
	数量	账面价值	数量	账面价值	数量	账面价值
永续债	198,000,000.00	19,776,886,792.42	18,000,000.00	1,776,650,943.37	216,000,000.00	21,553,537,735.79

经证监会证券基金机构监管部机构部函[2020]3544号文核准，本集团于2021年6月24日、2021年8月19日、2021年11月15日、2022年7月27日、2022年8月25日及2023年6月8日分别发行了五期永续次级债券(以下统称“永续债”)，即“21中证Y1”、“21中证Y2”、“21中证Y3”、“22中证Y1”、“22中证Y2”及“23中证Y1”，债券面值均为人民币100元，票面利率分别为4.10%、3.70%、3.88%、3.45%、3.28%及3.44%。面值总额为人民币21,600,000,000.00元；永续债的其他主要条款如下：

一利率在债券存续的前五个计息年度内分别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。

一除非发生强制付息事件，每个付息日，本公司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本公司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。于2023年6月30日，本公司已在应付股利中确认应付永续债利息人民币716,400,000.00元。

一当存在递延支付利息的情形时，本公司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。

一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本公司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。

37 资本公积

	2023年1月1日	本期增加	本期减少	2023年6月30日
资本溢价	3,273,875,823.46	-	-	3,273,875,823.46

38 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

	2023年1月1日	税后归属于 母公司	其他综合收益 转留存收益	2023年6月30日
其他债权投资公允价值变动	(884,625,609.10)	404,003,258.67	-	(480,622,350.43)
其他债权投资信用减值准备	519,356,140.93	4,120,447.60	-	523,476,588.53
其他权益工具投资公允价值变动	(618,880,203.08)	372,197,123.09	36,174,600.18	(210,508,479.81)
权益法下可转损益的其他综合收益	3,919,351.96	2,986,155.20	-	6,905,507.16
外币财务报表折算差额	141,940,300.60	117,454,816.15	-	259,395,116.75
合计	(838,290,018.69)	900,761,800.71	36,174,600.18	98,646,382.20

(2) 利润表中归属于母公司的其他综合收益情况表

	2023年1月1日至6月30日止期间				
	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	563,119,731.37	(32,420,910.05)	(121,756,644.11)	(4,938,918.54)	404,003,258.67
其他债权投资信用减值准备	7,257,145.52	-	(1,099,778.95)	(2,036,918.97)	4,120,447.60
权益法下可转损益的其他综合收益	2,986,155.20	-	-	-	2,986,155.20
外币财务报表折算差额	145,766,336.30	-	-	(28,311,520.15)	117,454,816.15
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	495,767,082.60	-	(123,569,959.51)	-	372,197,123.09
合计	<u>1,214,896,450.99</u>	<u>(32,420,910.05)</u>	<u>(246,426,382.57)</u>	<u>(35,287,357.66)</u>	<u>900,761,800.71</u>

### 39 盈余公积

	2023年1月1日	本期增加	本期减少	2023年6月30日
法定盈余公积金	4,862,290,410.81	-	-	4,862,290,410.81
任意盈余公积金	235,871,447.34	-	-	235,871,447.34
	<u>5,098,161,858.15</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>5,098,161,858.15</u>

### 40 一般风险准备

	2023年1月1日	本期增加	本期减少	2023年6月30日
一般风险准备	6,457,859,520.33	16,497,198.34	-	6,474,356,718.67
交易风险准备	5,658,008,450.94	9,846,026.13	-	5,667,854,477.07
	<u>12,115,867,971.27</u>	<u>26,343,224.47</u>	<u>-</u>	<u>12,142,211,195.74</u>

### 41 未分配利润

1月1日至6月30日止期间  
2023年

期初未分配利润	20,437,241,224.03
加：本期归属于母公司所有者的净利润	4,138,785,113.86
减：提取法定盈余公积	-
提取任意盈余公积	-
提取一般风险准备(1)	(16,497,198.34)
提取交易风险准备(1)	(9,846,026.13)
对所有者的分配(2)	(760,000,000.00)
其他综合收益结转	(36,174,600.18)
对其他权益工具投资者的分配(3)	(716,400,000.00)
期末未分配利润	<u>23,037,108,513.24</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2023年1月1日至6月30日止期间财务报表的法定盈余公积、任意盈余公积、一般风险准备及交易风险准备。

#### (2) 向所有者分配现金股利

经本公司单一股东申万宏源集团2023年4月12日分配股利的决议，本公

公司向申万宏源集团分配现金股利人民币 760,000,000.00 元。

(3) 向其他权益工具投资者分配现金股利

于 2023 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间，本公司对其他权益工具投资者分配人民币 716,400,000.00 元。

(4) 期/年末未分配利润的说明

于 2023 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 1,052,371,360.72 元。

42 手续费及佣金净收入

(1) 按收入类别列示

	<u>1 月 1 日至 6 月 30 日止期间</u>
	2023 年
证券经纪业务净收入	2,047,343,939.91
证券经纪业务收入	2,509,473,605.00
其中：代理买卖证券业务	1,978,554,274.03
交易单元席位租赁	406,195,556.10
代销金融产品业务	124,723,774.87
证券经纪业务支出	(462,129,665.09)
其中：代理买卖证券业务	(462,129,665.09)
期货经纪业务净收入	210,858,697.12
期货经纪业务收入	271,171,589.22
期货经纪业务支出	(60,312,892.10)
投资咨询业务净收入	71,433,828.30
投资咨询业务收入	71,449,012.31
投资咨询业务支出	(15,184.01)
投资银行业务净收入	838,975,347.00
投资银行业务收入	851,550,316.74
其中：证券承销业务	736,278,602.38
证券保荐业务	29,327,356.27
财务顾问业务	(a) 85,944,358.09
投资银行业务支出	(12,574,969.74)
其中：证券承销业务	(12,446,016.68)
证券保荐业务	(56,144.59)
财务顾问业务	(a) (72,808.47)
资产管理业务净收入	269,079,783.33

资产管理业务收入	270,025,350.77
资产管理业务支出	(945,567.44)
基金管理业务净收入	226,159,972.55
基金管理业务收入	226,159,972.55
合计	3,663,851,568.21
其中：手续费及佣金收入合计	4,199,829,846.59
手续费及佣金支出合计	(535,978,278.38)

(a) 财务顾问业务

	1月1日至6月30日止期间 2023年
并购重组财务顾问业务净收入	3,390,460.40
—境内上市公司	
其他财务顾问业务净收入	82,481,089.22
合计	85,871,549.62

(2) 手续费及佣金收入的分解

	2023年1月1日至6月30日止期间	
	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	2,780,645,194.22	-
投资银行业务收入	823,106,920.47	28,443,396.27
资产管理及基金管理业务收入	-	496,185,323.32
投资咨询业务收入	71,449,012.31	-
合计	3,675,201,127.00	524,628,719.59

43 利息净收入

	1月1日至6月30日止期间 2023年
利息收入	
货币资金及结算备付金利息收入	1,357,347,224.36
融出资金利息收入	2,005,087,562.76
买入返售金融资产利息收入	155,123,936.00
其中：股票质押回购利息收入	51,474,302.04
债权投资利息收入	3,532,559.45

其他债权投资利息收入	1,079,530,557.14
其他	10,517,118.38
利息收入小计	4,611,138,958.09
利息支出	
短期借款利息支出	(50,134,342.30)
应付短期融资款利息支出	(239,899,842.15)
拆入资金利息支出	(79,796,202.68)
其中：转融通利息支出	(25,458,247.20)
卖出回购金融资产款利息支出	(1,765,066,379.55)
其中：报价回购利息支出	(258,967,269.60)
代理买卖证券款利息支出	(188,956,008.75)
长期借款利息支出	
应付债券利息支出	(1,861,492,817.29)
其中：次级债券利息支出	(424,784,976.32)
合并结构化主体形成的其他金融负债利息支出	(78,114,657.07)
租赁负债利息支出	(17,782,544.60)
其他	(105,396,094.67)
利息支出小计	(4,386,638,889.06)
利息净收入	224,500,069.03

#### 44 投资收益

	1月1日至6月30日止期间 2023年
权益法核算的长期股权投资收益	296,069,351.24
金融工具投资收益	3,222,411,398.05
其中：持有期间取得的收益	3,015,085,368.81
—交易性金融工具(1)	2,512,683,494.98
—其他权益工具投资	502,401,873.83
处置金融工具取得的损益	207,326,029.24
—交易性金融工具(1)	1,623,030,417.13
—衍生金融工具	(1,734,153,233.71)
—债券投资	(4,155,667.29)
—其他债权投资	93,925,745.25
—其他	228,678,767.86
合计	3,518,480,749.29

(1) 交易性金融工具投资收益明细如下:

	<u>1月1日至6月30日止期间</u>
	2023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	
其中: 持有期间损益	2,645,643,050.63
处置取得损益	<u>1,775,074,186.61</u>
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	
其中: 持有期间损益	(132,959,555.65)
处置取得损益	<u>(152,043,769.48)</u>

(2) 对联营企业和合营企业的投资收益

参见 13(2)。

(3) 投资收益汇回有无重大限制

于 2023 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间, 本集团投资收益汇回均无重大限制。

45 其他收益

	<u>1月1日至6月30日止期间</u>
	2023年
政府补助	<u>303,560,346.21</u>

46 公允价值变动损益

	<u>1月1日至6月30日止期间</u>
	2023年
衍生金融工具	(230,269,509.76)
交易性金融资产	2,850,935,920.54
交易性金融负债	<u>(591,525,658.01)</u>
合计	<u>2,029,140,752.77</u>

47 其他业务收入

	<u>1月1日至6月30日止期间</u>
	2023年
大宗商品销售收入	592,463,654.84
资产出租和保管收入	4,955,308.16
其他	16,805,145.36
合计	<u>614,224,108.36</u>

#### 48 税金及附加

	<u>1月1日至6月30日止期间</u>
	2023年
城市维护建设税	33,035,076.32
教育费附加及地方教育附加	23,614,092.03
其他	7,097,546.80
合计	<u>63,746,715.15</u>

#### 49 业务及管理费

	<u>1月1日至6月30日止期间</u>
	2023年
职工费用	3,648,364,723.81
使用权资产折旧费	210,525,679.18
电子设备运转费	142,679,744.52
固定资产折旧	99,526,493.55
证券交易所的市场管理费和席位年费	87,665,142.02
无形资产摊销	81,461,677.16
办公运营费	79,639,503.90
租赁费及物业费	76,670,479.68
基金销售服务费	67,236,899.28
差旅费	68,999,426.64
其他	266,015,985.75
合计	<u>4,828,785,755.49</u>

#### 50 信用减值损失

<u>1月1日至6月30日止期间</u>
2023年

应收款项	102,167,594.29
债权投资	23,121,711.40
其他债权投资	6,256,513.05
其他资产	2,663,333.52
货币资金	(807,307.49)
融出资金	(9,560,825.12)
买入返售金融资产	(126,167,512.03)
合计	(2,326,492.38)

## 51 其他业务成本

	1月1日至6月30日止期
	2023年
大宗商品销售成本	601,437,155.52
资产出租和保管支出	1,839,641.61
其他	137,946.28
合计	603,414,743.41

## 52 营业外支出

	1月1日至6月30日止期
	2023年
对外捐赠及赞助支出	30,800,052.00
违约金及赔偿毁损	6,980,589.86
报废非流动资产损失	2,820,609.06
其他	154,292.52
合计	40,755,543.44

## 53 所得税费用

### (1) 本期所得税费用组成

	1月1日至6月30日止期
	2023年
当期所得税费用	155,287,915.40
递延所得税费用	535,171,081.15
汇算清缴差异	(34,918,464.49)

合计	655,540,532.06
<hr/>	
(2) 所得税费用与会计利润的关系	
	1月1日至6月30日止期间
	2023年
税前利润	4,792,548,664.65
	<hr/>
按中国法定税率 25%计算的所得税费用	1,198,137,166.16
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	3,485,421.51
非应纳税收入的影响	(539,084,066.46)
子公司适用不同税率的影响	3,124,483.38
使用前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	(16,263,956.00)
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	30,893,752.89
汇算清缴差异调整	(34,918,464.49)
其他	10,166,195.07
	<hr/>
所得税费用	655,540,532.06
	<hr/>

## 54 现金流量表附注

### (1) 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

	1月1日至6月30日止期间
	2023年
净利润	4,137,008,132.59
加： 信用/其他资产减值损失	(570,350.03)
使用权资产折旧	210,525,679.18
固定资产折旧	99,526,493.55
无形资产摊销	81,461,677.16
长期待摊费用摊销	18,753,657.62
投资性房地产折旧	1,839,641.61
处置或报废固定资产、无形资产和其他长期资产的损益	2,383,390.81
公允价值变动损益	(2,029,140,752.77)

利息净支出	1,086,246,429.75
汇兑损益	27,605,395.21
投资收益	(888,241,303.03)
递延所得税资产增加	760,708,861.95
递延所得税负债减少	11,631,144.12
交易性金融工具的减少	28,804,617,123.00
经营性应收项目的(增加)/减少	(689,010,613.25)
经营性应付项目的增加	17,064,880,907.60
经营活动产生的现金流量净额	<u>48,700,225,515.07</u>

(b) 不涉及现金收支的重大经营、投资和筹资活动

于2023年1月1日至6月30日止期间，本集团无不涉及现金收支的重大投资和筹资活动。

(2) 收到的其他与经营活动有关的现金

	<u>1月1日至6月30日止期间</u>
	2023年
往来款项收到的现金	2,329,614,158.84
大宗商品贸易收到的现金	497,146,965.86
收到的政府补助	303,560,346.21
合并结构化主体净增加的现金	35,666,472.19
房屋租赁收入	5,227,850.11
其他	25,165,830.22
合计	<u>3,196,381,623.43</u>

(3) 支付的其他与经营活动有关的现金

	<u>1月1日至6月30日止期间</u>
	2023年
存出保证金增加	1,081,823,112.78
大宗商品贸易支付的现金	673,511,041.50
支付运营和管理费用	584,092,311.79
往来款项支付的现金	100,263,673.91
支付租赁费及物业费用	76,670,479.68
支付专业服务及咨询费	62,552,511.07
支付证券投资者保护基金	23,713,179.19
其他	70,052,916.42

合计	2,672,679,226.34
----	------------------

(4) 现金及现金等价物净变动情况

	1月1日至6月30日止期间
	2023年
现金的期末余额	125,874,459,785.87
减：现金的期初余额	(128,420,420,769.30)
加：现金等价物的期末余额	6,410,622,884.56
减：现金等价物的期初余额	(13,317,069,098.02)
	(9,452,407,196.89)
现金及现金等价物净增加额	(9,452,407,196.89)

(5) 现金及现金等价物的构成

	2023年6月30日
货币资金	103,326,090,988.39
其中：库存现金	46,491.00
可随时用于支付的银行存款	98,528,455,725.62
可随时用于支付的其他货币资金	996,870.92
三个月以上定期存款	3,604,040,240.00
受限制的货币资金	1,192,551,660.85
结算备付金	27,344,960,698.33
现金等价物	6,410,622,884.56
期末货币资金、结算备付金及现金等价物	137,081,674,571.28
减：三个月以上定期存款	(3,604,040,240.00)
受限制的货币资金	(1,192,551,660.85)
	132,285,082,670.43
期末现金及现金等价物余额	132,285,082,670.43

55 货币性项目

(1) 外币货币性项目

	2023年6月30日		
	外币余额	折算汇率	人民币余额
货币资金			
美元	498,655,475.25	7.22580	3,603,184,733.07
港币	4,159,484,664.23	0.92198	3,834,961,670.72
其他币种			647,844,841.71
			8,085,991,245.50

合计			<u>8,085,991,245.50</u>
结算备付金			
美元	57,589,403.33	7.22580	416,129,510.61
港币	372,102,405.51	0.92198	343,070,975.83
其他币种			<u>19,030.82</u>
合计			<u>759,219,517.26</u>
融出资金			
港币	1,195,269,576.23	0.92198	<u>1,102,014,643.89</u>
应收款项			
港币	2,427,288,789.50	0.92198	<u>2,237,911,718.14</u>
存出保证金			
美元	6,910,748.01	7.22580	49,935,682.97
港币	91,678,660.71	0.92198	<u>84,525,891.60</u>
合计			<u>134,461,574.57</u>
其他资产			
港币	105,118,286.34	0.92198	<u>96,916,957.64</u>
短期借款			
美元	211,841,285.27	7.22580	<u>1,530,722,759.10</u>
代理买卖证券款			
美元	314,328,181.75	7.22580	2,271,272,575.69
港币	6,307,358,237.23	0.92198	<u>5,815,258,147.56</u>
合计			<u>8,086,530,723.25</u>
应付短期融资款			
美元	140,085,651.66	7.22580	<u>1,012,230,901.75</u>
应付债券			
美元	804,136,120.16	7.22580	<u>5,810,526,777.07</u>
应付款项			
港币	702,814,163.09	0.92198	647,980,602.09
美元	332,484.22	7.22580	<u>2,402,464.47</u>

合计			650,383,066.56
其他负债			
港币	303,521,304.83	0.92198	279,840,572.63
美元	190,392.26	7.22580	<u>1,375,736.39</u>
合计			<u>281,216,309.02</u>

(2) 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(国际)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。