



海通证券
HAITONG

A股股票代码
600837

2023

海通证券
半年度报告



2023

半年度报告
海通证券股份有限公司



重要提示

一、本公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证半年度报告内容的真实性、准确性、完整性，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并承担个别和连带的法律责任。

二、未出席董事情况

未出席董事职务	未出席董事姓名	未出席董事的原因说明	被委托人姓名
董事	许建国	因公出差	周杰

三、本半年度报告未经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和罗兵咸永道会计师事务所分别根据中国和国际审阅准则出具了审阅意见。

四、公司负责人周杰、主管会计工作负责人张信军及会计机构负责人（会计主管人员）马中声明：保证半年度报告中财务报告的真实、准确、完整。除特别说明外，本报告所列数据以人民币为单位。

五、董事会决议通过的本报告期利润分配预案或公积金转增股本预案

本公司 2023 年上半年度未拟定利润分配预案和公积金转增股本预案。

六、前瞻性陈述的风险声明

本报告中所涉及的未来计划、发展战略等前瞻性描述不构成公司对投资者的承诺，敬请投资者注意投资风险。

七、是否存在被控股股东及其他关联方非经营性占用资金情况

否

八、是否存在违反规定决策程序对外提供担保的情况？

否

九、是否存在半数以上董事无法保证公司所披露半年度报告的真实性和准确性

否

十、重大风险提示

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

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

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

十一、其他

适用 不适用

目录

第一节 释义	1
第二节 公司简介和主要财务指标	4
第三节 管理层讨论与分析	13
第四节 公司治理	37
第五节 环境与社会责任	46
第六节 重要事项	51
第七节 股份变动及股东情况	62
第八节 债券相关情况	68
第九节 财务报告	76
第十节 证券公司信息披露	185

备查文件目录

载有本公司法定代表人签名的半年度报告文本

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

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

其他有关资料

第一节 释义



在本报告书中，除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

常用词语释义

本公司、公司或海通证券	指	海通证券股份有限公司
集团或本集团	指	本公司及其子公司
董事会	指	海通证券董事会
监事会	指	海通证券监事会
董事	指	海通证券董事
监事	指	海通证券监事
中国证监会	指	中国证券监督管理委员会
上海证监局	指	中国证券监督管理委员会上海监管局
上交所	指	上海证券交易所
深交所	指	深圳证券交易所
北交所	指	北京证券交易所
香港联交所	指	香港联合交易所有限公司
全国社保基金	指	中国社会保障基金理事会
《上交所上市规则》	指	《上海证券交易所股票上市规则》
香港上市规则	指	香港联交所证券上市规则
标准守则	指	香港上市规则附录十所载之《上市发行人董事进行证券交易的标准守则》
守则	指	香港上市规则附录十四《企业管治守则》及《企业管治报告》
证券及期货条例	指	香港法例第 571 章证券及期货条例（经不时修订、补充或以其他方式修改）
公司章程或章程	指	海通证券的公司章程
公司法	指	中华人民共和国公司法
人民币	指	中国法定货币
港元或港币	指	香港法定货币
欧元	指	欧元区法定货币
美元	指	美利坚合众国法定货币
A 股	指	本公司每股面值人民币 1.00 元的内资股，于上海证券交易所上市并进行交易
H 股	指	本公司每股面值人民币 1.00 元的普通股，于香港联交所上市及以港元买卖
ETF	指	交易型开放式指数基金
WIND	指	万得信息技术股份有限公司
QFII	指	合格境外机构投资者
IPO	指	首次公开发售
FICC	指	固定收益、外汇及大宗商品
新三板	指	全国中小企业股份转让系统
报告期	指	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
富国基金	指	富国基金管理有限公司
海通银行	指	海通银行（Haitong Bank, S.A.）
海通开元	指	海通开元投资有限公司

常用词语释义

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

第二节 公司简介和主要财务指标

一、公司信息

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

注册资本和净资本

	本报告期末	上年度末
注册资本	13,064,200,000.00	13,064,200,000.00
净资本	90,601,656,274.77	93,818,677,554.29

公司经营范围

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

公司的各单项业务资格情况

1. 网上证券委托业务资格（证监信息字〔2001〕3号）
2. 全国银行间同业拆借市场和债券市场从事拆借、购买债券、债券现券交易和债券回购业务资格（银办函〔2001〕819号）
3. 全国银行间同业拆借中心组织的拆借交易和债券交易资格（中汇交发〔2001〕306号）
4. 收购证券营业部资格（沪证机便〔2002〕090号）
5. 开放式证券投资基金代销业务资格（证监基金〔2002〕076号）
6. 从事相关创新活动试点证券公司（中证协函〔2005〕079号）
7. 从事短期融资券承销业务资格（银发〔2005〕173号）
8. 上证基金通业务（2005.07）
9. 报价转让业务资格（中证协函〔2006〕3号）
10. 上海证券交易所固定收益证券综合电子平台交易商资格（上证会函〔2007〕86号）
11. 中国银行间市场交易商协会资格（2007.08）
12. 作为合格境内机构投资者从事境外证券投资管理业务资格（证监许可〔2008〕146号）
13. 中国证券登记结算有限责任公司甲类结算参与者资格（中国结算函字〔2008〕22号）

- 14.为期货公司提供中间介绍业务资格（沪证监机构字〔2010〕122号）
- 15.开展直接投资业务试点资格（机构部部函〔2008〕421号）
- 16.实施经纪人制度资格（沪证监机构字〔2009〕302号）
- 17.向保险机构投资者提供交易单元的资格（保监资金审证〔2009〕1号）
- 18.融资融券业务资格（证监许可〔2010〕315号）
- 19.公司自营业务参与股指期货套期保值交易业务资格（沪证监机构字〔2010〕372号）
- 20.基金评价业务资格（中证协发〔2010〕070号）
- 21.全国社保基金理事会签约券商资格（2011.08）
- 22.资产管理业务参与股指期货交易资格（沪证监机构字〔2011〕237号）
- 23.约定购回式证券交易业务试点（机构部部函〔2011〕512号）（上证交字〔2011〕37号）
- 24.发行境外上市外资股资格（证监许可〔2011〕1821号）（H股）
- 25.债券质押式报价回购业务试点（机构部部函〔2011〕585号）
- 26.合伙企业独立托管业务试点（机构部部函〔2012〕686号）
- 27.柜台市场交易业务（中证协函〔2012〕825号）
- 28.转融通业务试点资格（中证金函〔2012〕113号）
- 29.中小企业私募债券承销业务试点资格（中证协函〔2012〕561号）
- 30.证券业务外汇经营（SC201307）
- 31.新三板推荐业务和经纪业务（股转系统函〔2013〕61号）
- 32.代销金融产品业务资格（沪证监机构字〔2013〕180号）
- 33.权益类收益互换业务和场外期权交易业务（中证协函〔2013〕996号）
- 34.开展客户证券资金消费支付服务试点资格（机构部部函〔2013〕741号）
- 35.2013年第十一批保险兼业代理人资格（沪保监许可〔2013〕204号）
- 36.开展黄金等贵金属现货合约代理和黄金现货合约自营业务资格（机构部部函〔2013〕959号）
- 37.证券投资基金托管资格（证监许可〔2013〕1643号）
- 38.代理证券质押登记业务资格（2014.02）
- 39.互联网证券业务试点（中证协函〔2014〕358号）
- 40.黄金交易所会员资格（证书编号:T004）
- 41.上市公司股权激励行权融资业务试点（深圳函〔2014〕321号）
- 42.股票期权做市业务资格（证监许可〔2015〕153号）
- 43.上证50ETF期权合约品种的主做市商（上证函〔2015〕214号）

44. 期权结算业务资格（中国结算函字〔2015〕20号）
45. 期货会员证书（证书编号：NO.G02008）
46. 中国证券投资基金业协会会员证书（证书编号：00000147）
47. 境外自营业务资格（机构部函〔2015〕1204号）
48. 单向视频开户创新方案的无异议函（中国结算办字〔2015〕461号）
49. 银行间黄金询价业务资格（上金交发〔2015〕120号）
50. 非金融企业债务融资工具主承销业务资质（2016.08）
51. 票据交易资质（2016年11月）
52. 信用风险缓释工具相关业务资格（2017.01）
53. 场外期权业务二级交易商资格（中证协发〔2018〕386号）
54. 信用衍生品业务资质（机构部函〔2019〕469号）
55. 军工涉密业务咨询服务安全保密条件备案证书（2019.10）
56. 股指期货做市业务（机构部函〔2019〕3073号）
57. 利率互换实时承接业务资格（中国外汇交易中心公告）
58. 受信用保护债券质押式回购业务合格创设机构资格（中国结算函字〔2021〕201号）
59. 商品互换业务一级交易商（2022.07）
60. 个人养老金基金销售资格（2022.11）
61. 上交所基金通做市业务资格（2022.12）
62. 北交所融资融券业务资格（2023.2）
63. 深交所基金通做市业务资格（2023.3）

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

二、联系人和联系方式

	董事会秘书	证券事务代表
姓名	姜诚君	孙涛
联系地址	上海市黄浦区中山南路888号海通外滩金融广场 (邮政编码: 200011)	上海市黄浦区中山南路888号海通外滩金融广场 (邮政编码: 200011)
电话	8621-23180000	8621-23180000
传真	8621-63410627	8621-63410627
电子信箱	dshbgs@haitong.com	dshbgs@haitong.com

三、基本情况变更简介

公司注册地址	中国上海市广东路 689 号
公司注册地址的历史变更情况	中国上海市江西中路 200 号（1988 年）、中国上海市四川中路 480 号（1990 年）、中国上海市北海宁路 30 号（1994 年）、中国上海市唐山路 218 号（1998 年）、中国上海市淮海中路 98 号（2001 年）、中国上海市广东路 689 号海通证券大厦（2012 年）
公司办公地址	中国上海市黄浦区中山南路 888 号海通外滩金融广场
公司办公地址的邮政编码	200011
公司网址	http://www.htsec.com
电子信箱	haitong@haitong.com
报告期内变更情况查询索引	http://www.sse.com.cn
香港主要营业地址	香港黄竹坑香叶道 2 号 One Island South 15 楼
营业执照统一社会信用代码	9131000013220921X6

四、信息披露及备置地点变更情况简介

公司选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载半年度报告的网站地址	http://www.sse.com.cn
登载半年度报告的香港联交所指定的网址	http://www.hkexnews.hk
公司半年度报告备置地点	中国上海市黄浦区中山南路 888 号海通外滩金融广场
报告期内变更情况查询索引	http://www.sse.com.cn

五、公司股票简况

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

六、其他有关资料

适用 不适用

七、公司主要会计数据和财务指标

(一) 主要会计数据

单位：元 币种：人民币

主要会计数据	本报告期（1-6月）	上年同期	本报告期比上年同期增减（%）
营业收入	16,968,366,973.04	12,104,350,296.48	40.18
归属于母公司股东的净利润	3,829,634,781.60	4,757,725,335.07	-19.51
归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润	3,212,220,025.91	4,234,681,202.48	-24.14
经营活动产生的现金流量净额	-10,742,192,791.84	17,313,673,713.22	-162.04
其他综合收益的税后净额	795,560,056.64	58,198,289.07	1,266.98
	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减（%）
资产总额	762,391,665,182.85	753,609,304,959.17	1.17
负债总额	582,523,133,380.57	575,987,247,342.03	1.13
归属于母公司股东的权益	167,019,634,517.09	164,591,956,430.25	1.47
所有者权益总额	179,868,531,802.28	177,622,057,617.14	1.26

(二) 主要财务指标

主要财务指标	本报告期（1-6月）	上年同期	本报告期比上年同期增减（%）
基本每股收益（元/股）	0.29	0.36	-19.44
稀释每股收益（元/股）	0.29	0.36	-19.44
扣除非经常性损益后的基本每股收益（元/股）	0.25	0.32	-21.88
加权平均净资产收益率（%）	2.29	2.88	减少 0.59 个百分点
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率（%）	1.92	2.57	减少 0.65 个百分点

公司主要会计数据和财务指标的说明

适用 不适用

(三) 母公司的净资本及风险控制指标

单位：元 币种：人民币

项目	本报告期末	上年度末
净资本	90,601,656,274.77	93,818,677,554.29
净资产	149,870,774,715.70	149,045,782,898.20
风险覆盖率 (%)	235.37	241.25
资本杠杆率 (%)	21.60	21.12
流动性覆盖率 (%)	352.58	293.75
净稳定资金率 (%)	161.68	162.85
净资本 / 净资产 (%)	60.45	62.95
净资本 / 负债 (%)	36.59	36.97
净资产 / 负债 (%)	60.53	58.74
自营权益类证券及其衍生品 / 净资本 (%)	14.53	16.59
自营非权益类证券及其衍生品 / 净资本 (%)	164.01	193.66

八、境内外会计准则下会计数据差异

适用 不适用

九、非经常性损益项目和金额

单位：元 币种：人民币

非经常性损益项目	金额	附注（如适用）
非流动资产处置损益	-7,677,343.56	
计入当期损益的政府补助，但与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外	798,374,572.90	主要是政府补助
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	87,642,940.38	
减：所得税影响额	213,351,030.43	
少数股东权益影响额（税后）	47,574,383.60	
合计	617,414,755.69	

对公司根据《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》定义界定的非经常性损益项目，以及把《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第 1 号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目，应说明原因。

适用 不适用

十、财务报表主要项目

1. 合并财务报表主要项目会计数据

单位：元 币种：人民币

项目	2023年6月30日	2022年12月31日	增减幅度
货币资金	167,650,291,602.79	158,580,169,366.67	5.72%
拆出资金	65,128,171.04	274,444,523.06	-76.27%
融出资金	66,419,987,586.89	67,843,870,816.38	-2.10%
衍生金融资产	1,932,424,586.80	1,477,167,315.05	30.82%
买入返售金融资产	41,104,588,898.59	32,645,149,033.49	25.91%
交易性金融资产	208,937,410,147.68	209,598,729,439.75	-0.32%
债权投资	7,570,911,751.00	5,806,156,944.34	30.39%
其他债权投资	46,052,751,650.68	52,851,898,948.27	-12.86%
长期应收款	87,170,113,517.24	84,549,952,480.38	3.10%
在建工程	218,943,499.40	465,704,960.23	-52.99%
短期借款	35,051,068,398.84	34,858,042,732.67	0.55%
拆入资金	9,022,891,869.78	6,276,101,144.00	43.77%
衍生金融负债	1,305,590,839.36	898,418,550.84	45.32%
卖出回购金融资产款	83,066,644,832.97	101,694,356,537.25	-18.32%
代理买卖证券款	119,909,488,360.94	115,513,463,366.21	3.81%
代理承销证券款	18,232,500.00	13,500,000.00	35.06%
应交税费	1,179,744,363.42	2,197,807,712.24	-46.32%
合同负债	107,695,570.93	25,968,623.86	314.71%
长期借款	51,820,794,725.46	55,958,202,723.56	-7.39%
应付债券	205,204,445,765.41	181,830,917,563.00	12.85%
资本公积	75,809,658,507.08	75,007,558,592.52	1.07%
其他综合收益	-1,031,099,996.71	-1,617,313,221.53	-
未分配利润	47,685,543,677.78	46,699,136,993.48	2.11%

项目	2023年1-6月	2022年1-6月	增减幅度
手续费及佣金净收入	4,940,568,989.46	6,140,680,386.57	-19.54%
利息净收入	2,184,402,807.96	3,088,087,983.84	-29.26%
投资收益（损失以“-”号填列）	3,718,096,492.65	-362,282,684.28	-
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	48,516,768.26	1,358,310,150.74	-96.43%
其他业务收入	5,489,305,835.61	1,494,134,804.58	267.39%
业务及管理费	5,695,858,828.97	5,256,123,649.22	8.37%
信用减值损失	1,203,824,441.24	178,662,978.58	573.80%
其他资产减值损失	9,877,840.94	25,910,800.78	-61.88%
其他业务成本	4,763,462,030.79	642,206,662.65	641.73%
营业外收入	99,287,759.09	54,133,555.55	83.41%
所得税费用	1,326,992,645.72	1,420,703,701.27	-6.60%
净利润（净亏损以“-”号填列）	3,924,731,802.09	4,465,360,883.37	-12.11%
其他综合收益的税后净额	795,560,056.64	58,198,289.07	1266.98%
综合收益总额	4,720,291,858.73	4,523,559,172.44	4.35%

2. 母公司财务报表主要项目会计数据

单位：元 币种：人民币

项目	2023年6月30日	2022年12月31日	增减幅度
货币资金	97,541,316,692.66	94,195,714,055.50	3.55%
结算备付金	26,515,365,044.32	31,643,792,015.11	-16.21%
融出资金	57,321,937,475.82	56,840,361,604.00	0.85%
衍生金融资产	1,338,508,372.05	869,903,399.60	53.87%
买入返售金融资产	35,026,908,528.35	26,639,893,553.23	31.48%
交易性金融资产	138,917,910,616.90	139,953,515,347.47	-0.74%
其他债权投资	43,954,266,842.86	50,658,485,366.14	-13.23%
长期股权投资	39,809,950,266.51	39,799,909,184.68	0.03%
在建工程	91,578,567.43	347,796,396.75	-73.67%
应付短期融资款	4,582,225,745.79	7,211,239,604.08	-36.46%
拆入资金	6,757,246,111.12	3,031,458,333.33	122.90%
衍生金融负债	1,439,579,494.27	738,107,811.95	95.04%
卖出回购金融资产款	71,342,525,885.81	93,412,806,373.46	-23.63%
代理买卖证券款	72,754,140,055.78	69,201,352,190.36	5.13%
代理承销证券款	18,232,500.00	13,500,000.00	35.06%
应交税费	278,459,833.24	205,281,487.65	35.65%
应付款项	7,993,105,652.64	5,895,153,043.63	35.59%
应付债券	132,321,927,871.29	121,049,533,559.49	9.31%
其他负债	3,290,964,291.69	528,304,450.41	522.93%
资本公积	74,709,020,563.14	74,709,020,563.14	0.00%
其他综合收益	-110,561,454.13	-393,603,061.50	-71.91%
未分配利润	33,239,811,866.98	32,697,861,656.85	1.66%

项目	2023年1-6月	2022年1-6月	增减幅度
手续费及佣金净收入	3,543,881,582.10	4,335,306,867.71	-18.26%
利息净收入	1,211,799,389.53	1,265,789,633.60	-4.27%
投资收益（损失以“-”号填列）	1,926,025,118.37	-778,809,826.56	-
其他收益	403,723,855.91	463,248,025.00	-12.85%
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	381,397,252.22	2,724,051,391.96	-86.00%
汇兑收益（损失以“-”号填列）	-186,113,715.01	-49,466,656.40	-
业务及管理费	3,248,664,360.21	3,028,928,171.11	7.25%
信用减值损失	34,303,152.25	-678,701,091.05	-
营业外收入	14,311,030.13	24,538,322.36	-41.68%
所得税费用	598,272,292.61	1,027,303,243.47	-41.76%
净利润（净亏损以“-”号填列）	3,325,599,016.78	4,509,685,814.32	-26.26%
其他综合收益的税后净额	242,874,800.72	-551,507,125.92	-
综合收益总额	3,568,473,817.50	3,958,178,688.40	-9.85%

第三节 管理层讨论与分析

一、报告期内公司所属行业及主营业务情况说明

报告期内，本集团所属行业情况请参见本节“三、经营情况讨论与分析”。

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

报告期内，集团实现营业收入 169.68 亿元、归属于母公司股东的净利润 38.30 亿元、总资产 7,623.92 亿元、归属于母公司股东的净资产 1,670.20 亿元，主要财务指标多年来一直保持行业前列。

二、报告期内核心竞争力分析

在长期经营过程中，公司逐步形成了具有自身特色的六大核心竞争力。

1. 雄厚的资本实力

公司通过 A+H 股上市、增发等多次战略性股权融资和债券融资，迅速增强并持续保持了雄厚的资本实力。2023 年上半年，公司抓住市场机遇，完成多次债务融资，通过发行公司债、收益凭证等方式完成境内融资超过 300 亿元，增强了公司流动性管理能力与风险控制能力。另外，公司还积极拓展境外融资渠道，确保了境外业务的健康有序发展。充足的资本为公司业务转型升级、满足境内外客户的多元化金融服务需求、持续提升实体经济服务能力夯实了基础。

2. 卓越的综合金融服务平台

以母公司业务出发，通过设立、收购专业子公司，集团不断扩充金融产品服务范围，延伸金融服务边界，已基本建成涵盖证券期货经纪、投行、自营、资产管理、私募股权投资、另类投资、融资租赁、境外银行等多个业务领域的金融服务集团。集团财富管理业务客户基础雄厚；投资银行业务以服务国家发展战略、助力实体经济发展为核心指导思想，在科创板业务领域积极布局、重点开拓，紧抓“硬科技”的市场定位，坚持创新驱动，在集成电路及生物医药等重点领域成功打造了“海通品牌”，完成了多个具有较大市场影响力的项目，业务排名行业前列；资产管理业务主动管理规模持续提升；私募股权投资业务规模及品牌影响力行业领先；海外业务通过境内外业务联动，持续发挥集团海外市场桥头堡的功能；融资租赁业务已确立并持续保持行业领先地位；研究服务市场影响力强。集团深入践行“一个海通”理念，深化“投、融、保、研”及财富管理业务线的协同联动，加强整体协同，有效推进业务落地。集团综合化的金融平台具有强大的规模效应和交叉销售潜力，为业务发展提供了有力支撑，为客户综合金融服务创造条件。

3. 广泛的营业网点以及扎实的客户基础

集团营业网点覆盖“纽、伦、新、港、沪、东”六大国际金融中心。截至报告期末，集团在中国境内拥有 340 家证券及期货营业部（其中证券营业部 306 家，期货营业部 34 家），遍布 30 个省、直辖市和自治区；境外方面，在亚洲、欧洲、北美洲、南美洲、大洋洲等全球 5 大洲 15 个国家和地区设有分行、子公司或代表处。凭借遍布全国的营业网点和极具战略性的国际化布局，集团得以建立庞大且稳定的客户群，截至报告期末，集团在境内外拥有超 2,300 万名客户。

4. 业内领先的国际跨境服务平台

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

海通国际与海通银行是集团践行国家“一带一路”战略及粤港澳大湾区战略的重要承载平台。在港股 IPO 市场，海通国际按保荐项目数量位居前列，并不断加强项目执行能力及品牌影响力；同时，海通国际积极参与绿色及可持续发展债券发行，践行 ESG 理念，并进一步开拓债务管理业务，在中资境外债务管理市场名列前茅。海通银行拥有在欧盟及南美市场上的专业知识以及长达 20 多年的经验，具有全银行牌照，围绕企业银行、投资银行以及资产管理三大重点业务领域，在深耕本土业务的基础上，致力于开拓中国与欧洲、中国与拉丁美洲间的跨境业务合作。2023 年上半年，海通银行完成退欧后伦敦分行的牌照升级，是海通银行在伦敦这一欧洲最大的金融中心保留并拓展其银行业务的重要一步。

自贸区跨境业务方面，上海自贸区分公司是首批加入自贸区 FTU（自贸区分账核算单元）体系的证券机构，成功实施了国内券商首单 FT（自由贸易账户）项下跨境融资项目。2023 年上半年，自贸区分公司围绕自贸区离岸债券等重点领域，持续推动 FTU 业务拓展和集团内跨境业务联动。

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

5. 稳健的经营理念、有效的合规与风险管理和内部控制体系

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

6. 领先的金融科技创新能力

公司始终秉承“科技引领”发展战略。以建设“敏捷化、平台化、智能化、生态化”为核心特征的“数字海通 2.0”为目标，坚持关键技术自主可控，深入推进金融科技创新应用，已成为行业数字化转型的探索者、先行者。一是全面赋能财富管理转型。一站式互联网金融平台“e 海通财”全面焕新升级，打造集团生态、行业生态、用户生态于一体的综合服务入口，APP 月度活跃数超 550 万，继续保持行业第一梯队；“e 海通财”PC 端与 APP 互联互通，强化对客品牌联动，构建产品差异化服务优势。二是机构综合交易服务全面提升。一体化智能交易平台“e 海方舟”整合极速交易和极速行情，算法交易不断完善，单日规模突破 10 亿元；场外衍生品业务平台“e 海通行”打通南北向交易通道，为境内外投资者提供多样化、专业化的跨境投资交易及对冲工具。融券服务业务系统“e 海通券”日均撮合成交超亿元，通过智能撮合算法，充分满足券源供需双方融券意向，打造融券开放式服务新生态。三是日趋完善的风险预警体系。借助舆情异动监测、财务舞弊识别、违约预警等五大量化预警模型，实现多维风险预警信号在集团内的全流程闭环管理，为前瞻性风险管理提供新动能。四是科技创新不断深化。累计获得 17 项国家专利和 82 项软件著作权，公司科技品牌影响力进一步提升。报告期内，参加各类创新课题 21 项，先后荣获人民银行金融科技发展奖二等奖、证券期货业金融科技研究发展中心（深圳）优秀课题一、二等奖等多项金融科技奖项。

三、经营情况的讨论与分析

(一) 总体经营情况

2023年上半年,公司紧抓服务国家战略和实体经济主线,充分发挥金融服务实体经济作用,在“一个海通”理念下,通过“投、融、保、研”和财富管理协同联动,保持良好经营态势,尤其在融入区域发展、优化网点布局、深化机构改革、加强集团化管理等方面取得积极成效。

(二) 主营业务分析

1. 财富管理业务

市场环境:

2023年上半年,市场交投小幅回暖,根据沪深交易所数据,两市股票、基金交易量达249.40万亿元,同比增加0.11%;截至2023年6月末,市场融资融券余额达1.59万亿元,较上年末增加3.12%。伴随全面注册制的落地,更灵活的转融通政策和更丰富的两融标的为投资策略提供了更多交易空间,股票质押式回购业务持续回归服务实体经济本源。金融产品销售市场持续承压,根据WIND数据,2023年上半年新成立基金发行份额5,286.30亿份,同比减少21.84%。自个人养老金制度实施以来,参与人数不断增加,个人养老金产品持续扩容,截至2023年6月末,全国36个先行城市(地区)开立个人养老金账户人数4,030万人,个人养老金基金数量151只。

经营举措及业绩:

公司坚持“以客户为中心”,围绕客户财富管理和投融资需求,强化财富管理的“交易服务、投资顾问及基于资产配置的产品销售”等三大核心能力。报告期内,围绕“做增量、有特色、强协同、建机制”,积极推动综合创新网点建设,从服务社区的传统经纪业务网点向扎根园区服务企业发展的综合金融平台转型;构建金融产品全生命周期平台系统,金融产品销量及保有规模稳步增长;强化数字金融平台建设,提升服务质量、拓宽服务边界。截至2023年6月末,公司财富管理客户数量1,777万户,较上年末增长4.3%,托管客户资产规模3.16万亿元,较上年末增长5.8%。2023年上半年,公司新开客户数量同比增长29.3%,新开客户资产同比增长193.4%。

2023年上半年公司代理交易额变化

	本报告期	上年同期
股票交易量(亿元)	66,514	70,940
基金交易量(亿元)	15,971	10,227
合计(亿元)	82,485	81,167

(1) 零售业务

公司深耕客户需求,构建以客户为中心,以财富管理转型为方向,以资讯、产品、投研、投顾及工具为抓手的多层次客户服务体系,以“e海通财”和“e海方舟”两大平台为基础,面向财富、机构客群提供综合金融解决方案。

2023年上半年，公司持续推进财富管理机构化转型，零售业务实现高质量发展。公司加快推动分支机构改革，加强国家重大发展战略区域网点覆盖，努力打造具有特色业务属性的综合金融平台，上海临港分公司等6家综合网点已正式开业。公司搭建区域合作平台生态，初步建立战略客户服务体系，充分整合公司资源，为战略客户提供多元化、一揽子综合金融服务，试点“1+N”战略客户服务模式，与60余家政府、园区、高校、股权投资等机构签署战略合作协议。公司着力塑造私行服务品牌，聚焦高净值客户，围绕家族信托、股权管理、综合证券、企业家活动，逐步构建私行客户生态圈。截至2023年6月末，公司日均净资产在600万以上的私行客户数量超1.5万户，较上年末增长6.01%；资产规模近7,900亿元，较上年末增长3.59%。公司深化数字金融平台建设，以“e海通财”APP为线上综合服务阵地，新增服务功能和场景，打造超级服务入口，推动五大服务专区建设，构建多元化数字生态。截至2023年6月末，“e海通财”APP月度活跃数超550万人，位列行业第四；以机构、高净值及量化投资者为主要服务对象的“e海方舟”股基交易量同比增长11%，活跃客户数同比增长40%，用户资产同比增长92%；构建综合机构交易服务体系，算法交易单日规模突破10亿元，融券服务业务系统“e海通券”日均撮合成交超亿元。公司积极推动投顾业务布局和转型，全面优化“盈投顾”服务，覆盖策略、专题、简讯、直播、ETF直击、陪伴服务等六大系列内容，面向高净值客户推出“匠心100”专户定制服务，面向普通投资者持续开展ETF和可转债策略服务；提升投顾团队专业化服务能力，做好客户投资全流程的陪伴服务，帮助客户实现资产的保值增值。

海通国际私人财富管理团队推出“逐浪资本-航海家俱乐部”系列活动，为高净值客户提供定制化的宏观分析和投资策略建议。积极拓展新客户资源，丰富产品选择，协同专业机构，举办更多专业性强的主题活动。同时，通过市场化的定价和快速高效的抵押、托管服务为客户提供有竞争力的开展融资服务，增强客户粘性并达成更多交易。2023年上半年，海通国际私人财富管理新加坡团队根据最新市场环境和客户需求，灵活调整业务方向，积极推进外部资产管理（EAM）业务，以此为契机，开拓客户资源，推动业务长远发展。

（2）金融产品销售

公司以优化客户体验为抓手提升产品保有量，通过强化销售组织、理顺沟通机制、优化系统平台、完善销售制度，不断加强和外部优质基金公司深度合作，并建立以产品细分为基础的专业化评估跟踪机制，覆盖公募、私募、资管等各类产品以及产品售前、售中和售后全生命周期。在复杂的市场环境下，金融产品销售规模仍保持增长势头。截至2023年6月末，公司产品日均保有规模1,259.18亿元，较上年末增长3.72%，其中，公募非货产品日均保有量434亿元；私募产品日均保有量481亿元；ETF产品日均保有量219亿元。同时，公司以券结公募产品及量化私募产品为主要销售抓手，持续提升客户对公司推荐的金融产品的认可度，不断扩大公司金融产品服务品牌的影响力。

2023年以来，公司致力于为机构投资者提供场外基金全方位创新型综合解决方案，精准定位机构投资者对于场外基金的投资需求，针对银行、保险、公募等金融机构以及大型企业客户，打造推出了场外基金综合服务系统——“e海通合”，支持客户端和直连两种模式，为客户提供高效的交易运营支持。同时，“e海通合”依托公司强大的金融产品全生命周期管理系统和深厚的研究实力，为客户提供金融产品长期跟踪陪伴和精准投研支持。

(3) 融资类业务

2023年上半年，公司融资类业务紧跟全面注册制落地市场机遇，业务发展稳中有进。公司融资业务加强重点业务模式推进和核心客户群体覆盖，推进优质客户拓展及规模落地。公司融券业务多途径拓宽券源筹集渠道，强化自营券源管理，满足客户多元化用券需求，截至2023年6月末，公司融券市场份额由年初4.1%提升至6.1%。公司股票质押业务持续发掘优质项目，支持实体企业发展，同时强化项目审核和标的券评估能力，资产质量有效提升。截至2023年6月末，公司融资类业务规模906亿元，其中融资融券业务规模636亿元，股票质押业务规模267亿元。

2023年上半年末公司融资类业务规模变化

	本报告期末	上年度末
融资融券余额（亿元）	636.07	611.64
股票质押余额（亿元） ¹	267.27	273.68
约定购回余额（亿元）	2.45	2.44
合计（亿元）	905.79	887.76

¹ 上表不含表外资管股票质押式回购业务，本报告期末表外资管股票质押式回购业务规模33.52亿元

(4) 期货业务

2023年上半年，海通期货各项业务稳步推进，市场地位持续巩固。实现代理交易额15.6万亿元（单边计算），市场占比6%。期货资管业务规模154亿元，较年初增长52%；基金销售新增销量突破10亿元，同比实现翻倍。

2. 投资银行业务

市场环境：

2023年上半年，我国资本市场各项改革稳步推进，全面实行股票发行注册制成功落地，企业债券职责划转平稳过渡，资本市场功能有效发挥，A股市场407单股权融资项目实现募集资金总额6,627亿元，同比减少10.17%。IPO继续保持常态化，2023年上半年新增挂牌173家，融资金额2,097亿元，同比减少32.78%。其中，以科技、创新为特色的“双创”板块已成为A股IPO的主要阵地，2023年上半年新增挂牌93家，合计融资金额1,525亿元，占我国IPO市场融资总额的72.74%；北交所新股发行提速，2023年上半年新增挂牌42家，募集资金总额81亿元，同比增加183.72%。再融资规模稳中有升，2023年上半年222家上市公司通过增发、可转债、配股等再融资方式募集资金总额4,320亿元，同比增加8.52%。

2023年上半年，我国内地债券发行稳步增长，各类债券发行合计34.58万亿元，同比增加9.74%。利率债发行达12.43万亿元，同比增长7.61%，其中国债同比增长30.59%，地方政府债同比下降16.80%，政策性银行债同比增长24.83%。信用债发行达9.36万亿元，同比增长2.88%。同业存单累计发行12.77万亿元，同比增长17.79%。

经营举措及业绩：

(1) 股权融资

境内股权融资方面，公司着力推动大投行组织架构优化，以服务国家战略为纲，以全面注册制为契机，深入贯彻“行业化”“区域化”战略部署，继续巩固科创板、创业板等领域业务优势，业绩排名位居前列。2023年上半年，公司共完成股权融资项目18单，融资金额330亿元。完成IPO项目

11 单，融资金额 263 亿元，挂牌数量和融资规模均位列市场第三；其中，完成科创板 IPO 项目 6 单，市场排名第二，融资金额 230 亿元，市场排名第一。完成再融资项目 7 单，包括 5 单向特定对象发行股票及 2 单可转债，共融资 66 亿元。随着大投行组织架构优化和“专业化”战略深入，公司在集成电路、生物医药等重点领域巩固优势、取得新突破。上半年完成中芯集成、裕太微等 4 家集成电路领域 IPO，其中中芯集成募资总额 110 亿元，为全市场规模最大的项目；在新能源领域积极突破，润阳股份顺利提交注册，并储备覆盖全产业链的多家市场知名企业。公司大力推进申报工作，股权项目储备丰富。截至 2023 年 6 月末，公司保荐的 IPO 在审及待发项目数量 67 家，市场排名第三。

境内股权融资项目发行及项目储备情况

		本报告期	上年同期
首次公开发行	承销金额 (亿元)	263.37	246.60
	承销家数	11	14
再融资发行	承销金额 (亿元)	66.31	71.93
	承销家数	7	5
在审及待发项目数量	首次公开发行	67	68
	再融资发行	23	13

数据来源：WIND、中国证监会、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所

境外股权融资方面，海通国际投行团队致力于提供全方位的投资银行服务，在拓展费类收入来源的同时，进一步发挥“一个海通”的业务协同效应。报告期内，海通国际投行团队完成了 7 单股权融资项目（包含 IPO、二级市场配售及供股）。信贷资本市场团队和并购团队合作，探索上市前融资的业务机会，为客户提供更广泛的金融服务，实现了投资银行业务的内部协同和交叉销售，进一步提升海通国际的财务咨询收入。投行团队亦与母公司紧密配合，开拓全球存托凭证（GDR）项目储备，挖掘“互联互通”业务机会。

(2) 债券融资

境内债券融资方面，公司持续夯实执业质量，各项指标有所回升。2023 年上半年，公司承销各类债券 533 只，承销金额 2,097 亿元。公司聚焦国家战略，坚持创新驱动，主承销各品种绿色债券 23 期，融资规模合计 1,032 亿元，成功发行多个“市场首单”产品，包括粤港澳大湾区首单绿色车贷资产支持证券、全国首单“绿色+低碳转型挂钩”资产证券化产品、地方国企首单“粤港澳大湾区+科技创新”公司债券等。

境内主承销债券项目承销规模变化

		本报告期	上年同期
企业债	承销金额 (亿元)	47.75	159.40
	承销只数	13	28
公司债	承销金额 (亿元)	543.43	619.89
	承销只数	145	161
其他	承销金额 (亿元)	1,505.57	1,138.40
	承销只数	375	384

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

数据来源：WIND

境外债券融资方面，截至 2023 年 6 月末，根据彭博中国风险（G3+ 人民币）债券排行榜，海通国际共完成 48 笔债券发行项目，包括华发集团深合债、中航租赁自贸区绿色人民币债等。债券资本市场团队深入践行 ESG 和可持续金融理念，报告期内完成 3 笔绿色及可持续债券的承销，融资规模达 5.7 亿美元，蝉联中资美元债年度机构评选“年度 ESG 奖”。根据市场需求，团队进一步拓展债务管理及重组业务，报告期内共完成 6 笔债务管理项目，在彭博亚太负债管理债券排行榜中排名第一。海通银行澳门分行抓住自贸债的战略机遇和发行窗口，累计参与 21 笔境外债券发行；完成 3 个信贷业务项目，合计放款 7,400 万美元，另有 3 个储备项目，规模合计 1.6 亿美元。

3. 资产管理业务

市场环境：

在中国经济和居民财富持续增长的背景下，随着资管新规的全面实施以及养老金体系的逐步完善，以公募基金为代表的标准化、净值型资产管理行业成为金融市场中极具活力和增长潜力的板块，回归资管行业本源、提升主动管理能力成为券商资管业务发展的关键。在“一参一控一牌”的政策东风之下，券商积极筹设资管子公司，加速布局公募赛道。截至 2023 年 6 月末，证券行业资管子公司数量已增至 26 家。中国证监会于 2023 年 1 月 13 日发布《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其配套规范性文件《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》，进一步提升私募资管产品投资运作灵活性，促进私募资管业务充分发挥服务实体经济功能。2023 年以来，券商资管业务整体仍处于降通道、转集合的转型期，据中国基金业协会统计，截至 2023 年 6 月末，公募基金管理机构管理资产规模 27.69 万亿元，较上年末增加 6.37%；证券公司及其子公司私募资产管理业务规模 5.66 万亿元，较上年末减少 9.98%。

经营举措及业绩：

公司贯彻落实证监会《关于加快推进公募基金行业高质量发展的意见》要求，积极谋划资管业务转型并布局公募市场，持续提升主动管理能力，着力打造客户类型、投资市场以及投资策略全覆盖的私募资管产品体系，推进资产管理业务高质量发展。截至 2023 年 6 月末，全集团资产管理业务总规模近 2.0 万亿元。

(1) 基金管理公司

富国基金业务发展保持良好势头，截至 2023 年 6 月末，资产管理规模超 1.4 万亿元，较上年末增长 600 亿元。公募基金规模超 9,000 亿元，位列市场前八；其中非货类规模超 6,000 亿元，位列市场前五；公募固收类规模实现大幅提升，累计增长超 500 亿元；非货类 ETF 期末总规模已突破 500 亿元，创历史新高。各类养老金业务保持良好发展态势，组合总数及管理规模均位于市场领先地位。

截至 2023 年 6 月末，海富通基金资产管理规模 4,403 亿元，其中公募基金规模 1,650 亿元，较年初增长 17%；养老金业务规模 2,336 亿元，较年初增长 4.3%。海富通中证短融 ETF 规模持续增长至 194 亿元；主动权益、“固收+”等特色基金投资业绩均位于市场前列。

(2) 海通资管公司

海通资管公司以公募、私募双轮产品战略驱动公司发展，致力于打造全能资产管理机构。一方面积极谋划资管业务转型并布局公募市场，以参公改造的十余只公募产品为抓手，在维持产品流动性和安全性的前提下，为投资者提供较好的收益，树立公司的公募业务品牌。2023 年上半年，海通资管通过参公改造完成的 17 只参公大集合产品初步形成了产品风险等级由低到高、持有期限差异化的公

募产品矩阵线，投资业绩位列市场同类产品前列。另一方面持续提升主动管理能力，致力于打造客户类型全覆盖、投资市场全覆盖以及投资策略全覆盖的私募资管产品体系。2023年上半年，海通资管新发行私募资管产品 26 只，发行规模合计 23.75 亿元；海通资管集合产品投资业绩在市场同策略产品中排名位于 37.05%。

海通资管公司业务规模及净收入变化

	本报告期		上年同期	
	资产管理规模 (亿元)	净收入 (万元)	资产管理规模 (亿元)	净收入 (万元)
集合资产管理	233	7,840	353	15,162
定向资产管理	187	2,084	261	2,573
专项资产管理	405	473	349	544
合计	825	10,397	963	18,279

(3) 私募投资基金

公司私募股权投资基金围绕国家战略和发展趋势，深耕国家重点领域，深挖细分行业龙头，截至 2023 年 6 月末，基金总规模 308 亿元，完成上海海通引领区产业引导母基金合伙企业（有限合伙）和安徽海螺海通工业互联网母基金合伙企业（有限合伙）二支母基金及上海海通伊泰一期私募基金合伙企业（有限合伙）等综合类基金募集、合伙协议签署工作。2023 年上半年，公司私募股权投资业务在投、退两端发力，业务发展正向循环，新增投资项目 29 个，实现上市项目 10 个，过会待发项目 4 个，实现净利润 0.51 亿元。

2023 年上半年，海通开元荣获“2022 年度最佳私募股权投资机构第 18 名”、“2022 年度中国最佳券商私募基金子公司 TOP10”、“2022-2023 年度中国集成电路与半导体领域最佳投资机构”等奖项。

私募投资基金业务规模变化

	本报告期末	上年度末
管理基金数量	57	55
管理规模余额 (亿元)	308	300
累计投资项目数量	29	42
累计投资项目金额 (亿元)	15	35
项目退出 (含部分退出) 数量	34	65

(4) 境外资产管理

海通国际资产管理强调客户导向，明确自身定位，优化资产结构，聚焦重点产品，深度挖掘和服务客户在境内外市场的投资及配置需求，帮助海外机构客户投资中国市场。面对宏观经济分化、证券市场波动、投资情绪低迷等压力，海通国际进一步深化投研体系能力建设，加强海外业务拓展，投资表现和基金排名逐渐提升，海外客户资产管理规模稳步增长。在高息环境中，资产管理团队有针对性地优化和推广灵活收益基金、ESG ETF 等配置型产品，努力为客户创造收益。2023 年上半年，海通国际资产管理旗下的基金产品荣获“理柏基金香港年奖”、“投资洞见与委托—专业投资大奖”等多项基金中长期表现大奖。

2023 年上半年，海通银行下属资管子公司挂牌后的第一支基金——中国债券基金获葡萄牙证监会批准。

4. 交易与机构服务业务

市场环境：

2023年以来，A股市场窄幅震荡、涨跌分化，上半年上证指数、深证成指分别收涨3.65%、0.10%，创业板指收跌5.61%。2023年上半年，国际大宗商品价格普遍下跌，美国居民消费价格指数继续上涨，受国际环境以及国内经济发展需要影响，我国央行货币政策相对宽松，债券市场表现相对平稳。2023年上半年，中债国债总净价指数、中债企业债总净价指数、中债总财富指数分别收涨1.22%、1.57%、2.55%。

经营举措及业绩：

(1) 交易业务

2023年上半年，公司境内权益及衍生品与交易业务面对市场不利行情，积极优化持仓结构，多措并举控制风险。权益投资业务立足自身资源禀赋，设立价值投资组合，通过专业化、精细化研究，发掘一批可以经受短期市场波动且兼备长期投资价值的品种，实现长期稳健投资收益。基金做市业务主做市品种超400只，实现头部基金公司全覆盖，期权做市业务获得中金所2022年度“股指期权优秀做市商金奖”和“股指期权做市商新品种上市突出贡献奖”。公司提供多资产、跨品种、全球化的机构衍生品交易服务，通过场外衍生品工具提供丰富的表内非标准化衍生产品。2023年上半年，公司联合中证指数公司正式发布“中证海通证券ESG股债联动策略指数”，为践行绿色金融理念提供良好投资工具；为财富管理业务提供丰富的衍生产品工具箱，为高质量服务持牌金融机构、企业及高净值个人三类客户提供有力抓手；一站式场外衍生品业务平台“e海通行”系统持续建设迭代，多空互换交易功能不断优化，对接客户数逐步提升，为客户提供了多样化的算法交易策略。截至2023年6月末，公司场外衍生品存续规模合计1,649亿元。

2023年上半年，固定收益业务强化费类业务开展，稳住自营债券投资基本盘的同时，推动报价回购业务、衍生品业务及客需业务发展，进一步优化负债结构，促进融资成本平稳下降。公司践行金融服务实体经济战略，聚焦国家政策支持项目和战略目标，积极参与公募REITs，服务实体经济，盘活基础设施资产，新增社会责任投资253亿元。落地公司首单银行间信用联结票据；落地公司首单交易所固收平台线上信用保护合约。

2023年上半年，海通创新证券贯彻落实国家创新发展战略，精选直接股权投资项目，重点聚焦国家大力支持的新一代信息技术、新能源、新材料、高端装备制造、生物医药等行业的优质企业，股权投资新增投资项目4个，新增科创板跟投项目6个。

2023年上半年，宏观经济、地缘政治和市场环境持续多变，香港证券市场日均成交额同比下降16%。在客户全球分散投资的需求日益增加的基础上，海通国际坚持以客户为导向，固定收益销售及交易团队根据市场情况，持续巩固一、二级市场销售及交易固收类产品的业务地位。在严控风险的前提下，积极提高在投资级债券市场的参与度，佣金收入保持稳步提升，同时依托与母公司在跨境总收益互换（TRS）业务方面的合作，进一步拓展机构客户以固收类产品为目标的跨境业务。同时，持续关注人民币进一步国际化带来的市场机遇，在债券、利率互联互通方面探索新的业务机会。

(2) 机构业务

公司致力于打造一支强大的专业化机构销售服务团队，持续夯实组织架构调整，加快提升面向机构客户的综合服务能力。机构销售团队协同公司其他产品条线，向公募基金、社保、银行、银行理财子公司、保险及保险资产管理公司、私募基金、QFII、WFOE 等境内外金融机构提供专业化综合服务，包括研究销售、产品销售、投行项目、证券金融、衍生品、跨境业务、证券交易等一揽子综合金融解决方案，为境内外头部机构提供“一站式”服务，为成长期客户提供“陪伴式”服务。

2023 年上半年，公司保持在外资机构客户服务的市场领先地位，继续与境内外资产管理公司加强合作的广度和深度，挖掘产品线，在服务品牌、系列产品打造、公募券结基金合作、ETF 产品生态圈建设、综合金融服务提升等方面持续发力。公司持续强化持牌机构服务能力，巩固机构客户各项业务的市场占有率，构建综合销售服务体系，提高在机构客户中的影响力和渗透率。

公司坚持打造业内一流的研究品牌，以研究驱动机构业务发展及投行业务拓展；强化集团内部协同，加强对分支机构、营业部客户服务支持力度；通过网络直播、电话会议、线下论坛等多种形式精准服务机构客户，品牌优势得到进一步巩固和发挥。公司积极发挥产业研究专业优势，在长沙、上海、合肥等地与地方政府和产业园区共同举办行业论坛，通过研究产业发展趋势和政策动态跟踪，为政府、园区、战略客户等提供产业信息支持、专业智囊服务，提升公司影响力。海通国际股票研究团队不断巩固在中国及跨国研究领域的的能力，截至 2023 年 6 月末，团队已覆盖全球 1,748 只股票。

5. 融资租赁业务

市场环境：

2023 年上半年，融资租赁行业监管政策持续健全，整体展业环境得到进一步优化。目前，中国融资租赁行业正处于统一监管、统一登记、加速出清、转型优化的关键时期，挑战与机遇并存。截至 2023 年 6 月末，全国融资租赁企业总数为 9,540 家，较 2022 年末减少 300 家；全国融资租赁合同余额约 57,660 亿元，较 2022 年末下降 1.44%，融资租赁行业整体依然处于收缩态势，但降幅较去年有所减少。同时，多地地方监管部门相继制定或更新融资租赁行业监管规定、细则，强化融资租赁公司风险防范，监管架构愈发清晰、监管机制愈发完善，融资租赁行业的监管环境持续向好。另外，多个地方政府也陆续出台措施，将融资租赁业务纳入金融市场主体高质量发展实施方案中，鼓励融资租赁企业加大与地方企业的合作，促进实体经济健康有序发展，为融资租赁行业蓬勃发展提供了有利的政策条件及良好的外部环境。

经营举措及业绩：

2023 年上半年，海通恒信以“一个海通”理念为指引，秉持“务实、开拓、稳健、卓越”的经营理念，紧跟国家产业政策导向，把握大势，顺势而为，推动经营业绩稳健提升。2023 年上半年，海通恒信实现期间溢利 8.08 亿元，同比增长 5.6%；实现收入总额 42.86 亿元，同比增长 4.7%；生息资产平均收益率为 6.71%，加权平均净资产回报率为 8.85%。截至 2023 年 6 月 30 日，海通恒信资产总额达到 1,287.99 亿元，较 2022 年末增长 3.4%；权益总额达到 194.63 亿元，较 2022 年末增长 3.4%；不良资产率 1.09%，不良资产拨备覆盖率 253.37%。

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

适用 不适用

四、报告期内主要经营情况

截至 2023 年 6 月 30 日，集团总资产 7,623.92 亿元，归属于母公司净资产 1,670.20 亿元。2023 年上半年，集团实现营业收入 169.68 亿元，归属于母公司净利润 38.30 亿元；加权平均净资产收益率 2.29%。其中，子公司实现收入 99.09 亿元，占比 58%；境外业务实现收入 29.79 亿元，占比 18%。

(一) 主营业务分析

1、财务报表相关科目变动分析表

单位：元 币种：人民币

科目	本期数	上年同期数	变动比例 (%)
营业收入	16,968,366,973.04	12,104,350,296.48	40.18
营业成本	11,802,086,981.64	6,259,598,598.71	88.54
经营活动产生的现金流量净额	-10,742,192,791.84	17,313,673,713.22	-162.04
投资活动产生的现金流量净额	5,398,924,089.57	-2,445,574,232.88	-
筹资活动产生的现金流量净额	10,924,437,556.33	7,702,384,711.14	41.83

(1) 营业收入

单位：元 币种：人民币

项目	本期金额	上年同期	本期金额较上年同期变动比例 (%)	主要原因
手续费及佣金净收入	4,940,568,989.46	6,140,680,386.57	-19.54	主要是经纪业务、投资银行业务手续费净收入减少
其中：经纪业务手续费净收入	1,971,925,520.74	2,474,007,654.92	-20.29	主要是证券经纪业务净收入减少
投资银行业务手续费净收入	1,949,290,370.16	2,434,751,965.24	-19.94	主要是证券承销业务净收入减少
资产管理业务手续费净收入	932,465,708.29	1,086,471,873.13	-14.17	/
利息净收入	2,184,402,807.96	3,088,087,983.84	-29.26	主要是借款利息支出增加
投资收益和公允价值变动收益	3,766,613,260.91	996,027,466.46	278.16	主要是金融工具投资收益增加
其他业务收入	5,489,305,835.61	1,494,134,804.58	267.39	主要是子公司销售收入增加
其他	587,476,079.10	385,419,655.03	52.43	/
合计	16,968,366,973.04	12,104,350,296.48	40.18	/

(2) 主营业务分行业、分产品、分地区情况

单位：元 币种：人民币

主营业务分行业情况						
分行业	营业收入	营业支出	毛利率 (%)	营业收入比上年增减 (%)	营业支出比上年增减 (%)	毛利率比上年增减 (%)
财富管理	4,143,603,125.88	2,407,940,166.20	41.89	-14.59	70.65	减少 29.03 个百分点
投资银行	2,145,474,447.90	1,302,178,291.65	39.31	-13.18	-12.16	减少 0.70 个百分点
资产管理	1,297,312,947.97	674,050,697.44	48.04	-20.88	3.19	减少 12.12 个百分点
交易及机构	2,255,538,889.63	1,178,458,158.36	47.75	574.55	73.48	增加 150.91 个百分点
融资租赁	2,539,015,616.30	1,611,660,105.70	36.52	9.91	7.88	增加 1.20 个百分点
其他	4,587,421,945.36	4,627,799,562.29	-0.88	822.56	757.68	增加 7.63 个百分点

主营业务分地区情况						
分地区	营业收入	营业支出	毛利率 (%)	营业收入比上年增减 (%)	营业支出比上年增减 (%)	毛利率比上年增减 (%)
上海	353,767,743.85	171,543,338.96	51.51	-1.25	9.11	减少 4.60 个百分点
浙江	196,314,235.61	68,230,634.33	65.24	-2.12	-1.50	减少 0.22 个百分点
黑龙江	162,342,982.35	88,045,834.27	45.77	-8.75	7.96	减少 8.39 个百分点
江苏	147,747,167.54	80,119,067.48	45.77	-5.57	3.51	减少 4.76 个百分点
山东	105,349,228.70	53,615,665.33	49.11	-9.43	5.85	减少 7.35 个百分点
其他地区 分支机构	792,062,478.22	456,993,280.47	42.30	-9.09	6.50	减少 8.45 个百分点
公司总部及 境内子公司	12,231,577,168.37	7,995,651,988.79	34.63	48.06	194.40	减少 32.49 个百分点
境内小计	13,989,161,004.64	8,914,199,809.63	36.28	37.94	148.92	减少 28.41 个百分点
境外业务	2,979,205,968.40	2,887,887,172.01	3.07	51.79	7.82	增加 39.54 个百分点
合计	16,968,366,973.04	11,802,086,981.64	30.45	40.18	88.54	减少 17.84 个百分点

2023 年上半年，集团财富管理业务营业收入 41.44 亿元，同比（48.52 亿元）减少 7.08 亿元，减幅 14.59%，主要是证券经纪业务收入同比减少；公司持续推进财富管理机构化转型，加快打造全能型分公司，搭建区域合作平台生态，构建产融结合新高地。投资银行业务营业收入 21.45 亿元，同比（24.71 亿元）减少 3.26 亿元，减幅 13.18%，主要是上半年全市场 IPO 承销规模同比下降，公司股权承销收入减少；公司着力推动大投行组织架构优化，以服务国家战略为纲，深入贯彻“行业化”、“区域化”战略部署，继续巩固科创板、创业板等领域业务优势，业绩排名位居前列。资产管理业务营业收入 12.97 亿元，同比（16.40 亿元）减少 3.43 亿元，减幅 20.88%，主要是资管子公司管理规模下降，管理费收入同比减少。交易及机构业务营业收入 22.56 亿元，同比（3.34 亿元）增加 19.22 亿元，增幅 574.55%，主要是公司把握市场结构性机会，积极优化持仓结构，多措并举控制风险，实现长期稳健投资收益。融资租赁业务营业收入 25.39 亿元，同比（23.10 亿元）增加 2.29 亿元，增幅 9.91%，主要是公司立足租赁本源，聚焦服务国家战略，大力拓展高端装备制造、数字经济、能源环保等国家产业政策鼓励领域业务，加大绿色租赁投放力度，不断提升服务实体经济能力。

(3) 营业支出

单位：元 币种：人民币

成本构成项目	本期金额	上年同期	本期金额较上年同期变动比例 (%)	主要原因
税金及附加	129,063,839.70	156,694,507.48	-17.63	/
业务及管理费	5,695,858,828.97	5,256,123,649.22	8.37	/
信用减值损失	1,203,824,441.24	178,662,978.58	573.80	主要是买入返售金融资产减值损失增加
其他资产减值损失	9,877,840.94	25,910,800.78	-61.88	/
其他业务成本	4,763,462,030.79	642,206,662.65	641.73	主要是子公司销售成本增加
合计	11,802,086,981.64	6,259,598,598.71	88.54	/

(4) 现金流

经营活动产生的现金流量净额为 -107.42 亿元，其中：现金流入 382.82 亿元，占现金流入总量的 22.50%，主要是收取利息、手续费及佣金的现金 125.48 亿元，为交易目的而持有的金融资产净减少额 59.31 亿元，收到其他与经营活动有关的现金 116.18 亿元；现金流出 490.24 亿元，占现金流出总量的 29.78%，主要是回购业务资金净减少额 270.55 亿元，支付其他与经营活动有关的现金 113.99 亿元。

投资活动产生的现金流量净额为 53.99 亿元，其中：现金流入 204.24 亿元，占现金流入总量的 12.00%，主要是收回投资收到的现金 193.61 亿元；现金流出 150.25 亿元，占现金流出总量的 9.13%，主要是投资支付的现金 146.80 亿元。

筹资活动产生的现金流量净额为 109.24 亿元，其中：现金流入 1,114.69 亿元，占现金流入总量的 65.50%，主要是发行债券收到的现金 688.78 亿元，取得借款收到的现金 425.27 亿元；现金流出 1,005.45 亿元，占现金流出总量的 61.09%，主要是偿还债务支付的现金 948.11 亿元。

2、本期公司业务类型、利润构成或利润来源发生重大变动的详细说明

适用 不适用

(二) 非主营业务导致利润重大变化的说明

适用 不适用

(三) 资产、负债情况分析

1、资产及负债状况

单位：元

项目名称	本期期末数	本期期末数 占总资产的 比例 (%)	上期期末数	上期期末数 占总资产的 比例 (%)	本期期末金额 较上期期末变 动比例 (%)	情况说明
拆出资金	65,128,171.04	0.01	274,444,523.06	0.04	-76.27	主要是拆出资金规模减少
衍生金融资产	1,932,424,586.80	0.25	1,477,167,315.05	0.20	30.82	主要是权益衍生工具投资规模增加
债权投资	7,570,911,751.00	0.99	5,806,156,944.34	0.77	30.39	主要是公司债投资规模增加
在建工程	218,943,499.40	0.03	465,704,960.23	0.06	-52.99	主要是办公楼装修结转至固定资产
拆入资金	9,022,891,869.78	1.18	6,276,101,144.00	0.83	43.77	主要是转融通业务融入资金规模增加
衍生金融负债	1,305,590,839.36	0.17	898,418,550.84	0.12	45.32	主要是权益衍生工具投资规模增加
应交税费	1,179,744,363.42	0.15	2,197,807,712.24	0.29	-46.32	主要是企业所得税减少

其他说明

(1) 资产状况

2023 年 6 月末，集团总资产 7,623.92 亿元，较上年末 (7,536.09 亿元) 增加 87.83 亿元，增幅 1.17%。主要变动情况是：买入返售金融资产增加 84.59 亿元，货币资金、结算备付金及存出保证金增加 50.59 亿元，交易性金融资产、其他债权投资、其他权益工具投资等金融资产减少 43.23 亿元。

集团交易性金融资产、其他债权投资、其他权益工具投资等金融资产占集团总资产的 35%，货币资金、结算备付金及存出保证金占总资产的 27%，长期应收款及应收融资租赁款占总资产的 14%，

融出资金占总资产的 9%，买入返售金融资产占总资产的 5%，固定资产、使用权资产、在建工程及投资性房地产占集团总资产的 3%，大部分资产变现能力较强，集团资产流动性较强，资产结构优良。

(2) 负债状况

2023 年 6 月末，集团负债总额 5,825.23 亿元，较上年末（5,759.87 亿元）增加 65.36 亿元，增幅 1.13%。主要变动情况是：应付短期融资款及应付债券增加 202.00 亿元，代理买卖证券款增加 43.96 亿元，卖出回购金融资产款减少 186.28 亿元，短期借款及长期借款减少 39.44 亿元。

2、境外资产情况

(1) 资产规模

其中：境外资产 2,695.22 亿港币，折合人民币为 2,484.94 亿元，占总资产的比例为 32.59%。

(2) 境外资产占比较高的相关说明

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

3、截至报告期末主要资产受限情况

所有权或使用权受到限制的资产，具体参见本报告“第九节 财务报告 五、合并财务报表项目附注 1 货币资金，7 买入返售金融资产，8 交易性金融资产，9 债权投资，10 其他债权投资，11 其他权益工具投资，12 应收融资租赁款及长期应收款，以及 15 固定资产。”

4、其他说明

适用 不适用

(四) 投资状况分析

1、对外股权投资总体分析

报告期末，集团长期股权投资 72.99 亿元，较上年末（70.14 亿元）增加 2.85 亿元，增幅 4.07%。子公司投资参见本报告“第九节 财务报告”中“五、合并财务报表项目附注 13、长期股权投资”。

(1) 重大的股权投资

适用 不适用

(2) 重大的非股权投资

适用 不适用

(3) 以公允价值计量的金融资产

以公允价值计量的金融资产参见本报告“第九节 财务报告”中“十四、其他重要事项 2、金融工具计量基础分类表”。

证券投资、私募基金投资、衍生品投资为公司主营业务，交易频繁、交易品种类别较多，且公司已在本报告“第九节 财务报告”中披露了投资类别、公允价值变动、投资收益等情况，因此不再按照证券明细披露相关情况。

(五) 重大资产和股权出售

适用 不适用

(六) 主要控股参股公司分析

1. 海通创新证券, 注册资本 115 亿元人民币, 海通证券持有 100% 的股权。截至 2023 年 6 月 30 日, 海通创新证券总资产为 210.43 亿元, 净资产 203.25 亿元; 2023 年上半年, 实现营业收入 8.29 亿元, 净利润 6.44 亿元。

2. 海通国际控股, 注册资本 111.80 亿港元, 海通证券持有 100% 的股权。截至 2023 年 6 月 30 日, 海通国际控股总资产为 2,695.22 亿港元, 净资产 310.83 亿港元; 2023 年上半年, 实现收入 33.53 亿港元, 净利润 -2.72 亿港元。

3. 海通开元, 注册资本 75 亿元人民币, 海通证券持有 100% 的股权。截至 2023 年 6 月 30 日, 海通开元总资产为 127.44 亿元, 净资产 111.67 亿元; 2023 年上半年, 实现营业收入 0.97 亿元, 净利润 -0.14 亿元。

4. 海通资管公司, 注册资本 22 亿元人民币, 海通证券持有 100% 的股权。截至 2023 年 6 月 30 日, 海通资管公司的总资产为 69.92 亿元, 净资产 55.30 亿元; 2023 年上半年, 实现营业收入 2.09 亿元, 净利润 0.63 亿元。

5. 上海泽春, 注册资本 1 亿元人民币, 海通证券持有 100% 的股权。截至 2023 年 6 月 30 日, 上海泽春的总资产为 4.96 亿元, 净资产 2.41 亿元; 2023 年上半年, 实现营业收入 0.32 亿元, 净利润 0.17 亿元。

6. 上海惟泰置业, 注册资本 1,000 万元人民币, 海通证券持有 100% 的股权。截至 2023 年 6 月 30 日, 上海惟泰置业的总资产为 2.45 亿元, 净资产 0.15 亿元; 2023 年上半年, 实现营业收入 0.20 亿元, 净利润 13.14 万元。

7. 海通期货, 注册资本 13.015 亿元人民币, 海通证券持有 83.22% 的股权。截至 2023 年 6 月 30 日, 海通期货总资产为 583.07 亿元, 净资产 36.18 亿元; 2023 年上半年, 实现营业收入 50.85 亿元, 净利润 1.52 亿元。

8. 海富通基金, 注册资本 3 亿元人民币, 海通证券持有 51% 的股权。截至 2023 年 6 月 30 日, 海富通基金总资产为 37.47 亿元, 净资产 24.45 亿元; 2023 年上半年, 实现营业收入 6.32 亿元, 净利润 1.92 亿元。

9. 富国基金, 注册资本 5.2 亿元人民币, 海通证券持有 27.775% 的股权。截至 2023 年 6 月 30 日, 富国基金总资产为 136.24 亿元, 净资产 77.81 亿元; 2023 年上半年, 实现营业收入 36.48 亿元, 净利润 10.65 亿元。

(七) 公司控制的结构化主体情况

公司对由子公司作为管理人的结构化主体, 综合考虑合并报表范围内的公司合计享有这些结构化主体的可变回报, 或承担的风险敞口等因素, 认定将 60 个结构化主体纳入合并报表范围。

五、其他披露事项

(一) 可能面对的风险及风险应对措施

1、风险管理概述

本集团一直以来注重对风险的防范与控制,确立了“务实、开拓、稳健、卓越”的经营理念,树立了“稳健乃至保守”的风险控制理念,经营管理实行合规优先、风险管理优先的原则。

本集团根据《证券公司全面风险管理规范》等监管要求及内部制度,从全覆盖、可监测、能计量、有分析、能应对等方面持续完善全面风险管理体系建设,强化风控指标并表管理,健全集团 T+1 风险数据集市,赋能子公司风险管理,推进集团风险管理向纵深发展;搭建了层级分明的风险管理组织架构,覆盖各风险类别、各业务条线、各单位(即总部部门、分支机构及子公司),不断完善风险识别、评估、计量、监控、报告和应对等风险管理流程,规范各类业务开展,加强风险的事前防范、事中监控和事后检查处置;建立了监管指标、风险容忍度及限额指标、业务风控指标的三层风控指标体系,通过系统实现动态监控和自动预警,主动开展压力测试来审慎评估极端风险影响,加强同一客户、同一业务风险集中统一管理,建立、完善集团风险限额体系并向部门、子公司进行拆解,并建成集团智能预警平台,提升风险预判预警能力;开展市场风险、信用风险、流动性风险计量,建立模型管理机制和流程,并持续对模型开展评估和验证;将子公司风险纳入报告范围,定期编制集团风险日报、月报、季报、半年报、年报,针对重大风险事件编制专项报告;根据风险评估和预警的结果,选择合适的应对策略,建立了有效的应对机制以及具有可操作性的应急预案。此外,本集团从文化建设、制度建设、数据和系统建设、人才队伍建设、加强风控投入等方面为全面风险管理提供保障和支持。

2、风险管理架构

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

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

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

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

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

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

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

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

各子公司规范运作，依法经营。公司将子公司风险管理纳入全面风险管理体系，对其风险管理工作实行垂直管理，每日开展风控指标并表管理，建立了集团 T+1 风险数据集市，并从子公司风险管理负责人提名、风险限额与报告、重大事项审批、风险数据对接、风控指标并表、风险督导检查、风险考核评价等方面落实对子公司的垂直风险管理。

3、各类风险的应对措施及其报告期内表现

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

(1) 合规风险

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

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

报告期内,为有效防范公司合规风险,推动公司合规管理有效运行,促进公司持续、健康、合规发展,公司进一步夯实合规审查、合规检查、合规监测等合规管理基础职能,进一步优化集团合规管理机制,提升集团合规管理科技化水平。公司确定2023年为“合规内控文化巩固年”,在集团范围内全面巩固合规内控文化建设工作,聚焦“提升合规文化宣传培育的融合性”“提升合规内控队伍的专业履职能力”“加大对重点领域的执行保障力度”“落实反洗钱检查整改,推动一道防线履职”等四大重点工作,推动公司建立健全合规内控长效机制,合规内控管理效能持续提升。

(2) 洗钱及恐怖融资风险

公司根据《法人金融机构洗钱和恐怖融资风险管理指引(试行)》(银反洗发[2018]19号)制定了《海通证券股份有限公司洗钱和恐怖融资风险管理办法》,建立健全董事会负责下的反洗钱组织架构,形成公司反洗钱领导小组统筹协调、合规部门牵头组织实施、相关业务部门和分支机构落实执行的反洗钱管理体系。公司建立了包括集团洗钱风险管理制度、公司反洗钱基本制度及其他配套制度和操作规程等在内的反洗钱管理制度体系,制定以“风险为本”的洗钱和恐怖融资风险管理策略,针对公司各业务条线面临的不同风险状况采取相应的风险管控措施,并通过培训和宣传促进洗钱风险管理文化传导,营造良好的洗钱风险管理文化氛围,积极防范洗钱和恐怖融资风险。

报告期内,公司将“落实反洗钱检查整改,推动一道防线履职”工作纳入公司“合规内控文化巩固年”重点建设工作,全面推动洗钱和恐怖融资风险管理文化宣导,提升公司洗钱和恐怖融资风险管理水平。一是推动一道防线反洗钱履职,督导业务部门和分支机构加强反洗钱履职。二是完善反洗钱系统建设,探索和尝试利用大数据基础、通过人工智能随机森林等算法,构建可疑交易监测的人工智能模型,提高监测模型有效性。三是加强洗钱风险管理文化建设,继续做好洗钱风险管理系列培训,分享反洗钱学习与工作经验。四是积极履行反洗钱宣导义务,编写发布《合规内控文化动态-反洗钱专刊》,开展反洗钱优秀宣传作品评比,倡导积极的洗钱风险管理文化氛围,提高投资者洗钱和恐怖融资风险防范意识。

(3) 信用风险

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

A、存放在其他金融机构的自有货币资金、经纪业务相关风险

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

B、交易性融资业务相关风险

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

C、信用债券交易与投资业务相关风险

本集团注重通过分散投资控制集中度风险,投资标的主要倾向于高信用评级资产,在信用风险管理中密切跟踪投资标的的经营情况和信用评级变化,落实内部评级和统一授信管理机制,建立健全债务发行人、行业和地域集中度等信用风险监控指标,在投后跟踪中及时根据财务指标变动、重大风险

事件和负面舆情等信息更新债务发行人内部评级和授信限额指标，动态调整交易策略。

D、融资租赁业务相关风险

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

E、债券回购等同业短期拆借、场外衍生品业务相关风险

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

本集团根据行业监管政策、资本市场环境和集团业务发展战略，持续完善信用风险管理体系。报告期内，本集团以信用风险管理办法等制度为依据，全面落实以同一客户、同一业务为核心的信用风险识别、评估、计量、监控、报告及应对工作。一是推动集团智能预警中心的推广应用，建立针对各类风险信号的监测、预警及排查工作机制，赋能业务条线增强风险预警预判能力；二是以集团 T+1 风险数据集市为依托，对信用风险管理信息系统进行持续升级，提升风险识别、计量与压力测试能力，持续完善资产质量、风险抵补和集中度风险等维度的信用风险限额体系；三是持续强化统一评级与集中授信管理机制，发布项目融资类客户信用风险评级与授信管理实施细则，并对信用评级和授信限额进行动态优化；四是继续推进高风险客户名单管理工作落实，修订高风险客户名单管理办法并持续开展相关信息系统的集团化部署；五是积极落实客户 ESG 尽职调查和 ESG 风险评估等工作，开展了集团 ESG 风险管理专题培训。报告期内，本集团核心信用风险监控指标运行平稳，整体信用风险可控。

针对融资类三项业务，公司主动优化业务结构，审慎评估新做项目，强化存续项目的跟踪、监控和管理，加大存量风险项目追偿力度并审慎、前瞻地计提信用减值准备，确保风险拨备计提充分。截至报告期末，公司融资融券存量负债客户的平均维持担保比例为 270.67%，约定购回式证券交易客户的平均履约保障比例为 258.06%，股票质押式回购业务客户的平均履约保障比例为 256.20%，融资人提供的担保品较为充足，信用风险整体可控。

(4) 市场风险

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

A、股票价格风险。股票价格风险主要指集团所投资的权益类证券市场价格发生变化致使本集团承受损失的风险。承担此类风险的业务主要包括权益类证券自营业务、做市业务和场外衍生品业务等。股票价格风险具有较大的不确定性，是本集团主要面对的市场风险类型之一。集团密切关注相关资产

价格波动，并采取相应措施予以防范，通过每日跟踪证券持仓的投资规模和风险价值（VaR）变化情况进行监测和管控。集团通过实施多元化投资策略，对各类证券品种的投资规模进行适当控制和适时调整，并结合各类套期保值工具，较为有效地控制了市场风险。

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

C、汇率风险。汇率风险是指因外汇汇率变动而导致的风险。本集团国际化布局不断完善，面对复杂多变的境外市场，持续跟踪研究外汇市场，不断完善制度建设和内部管理，通过套保等一系列措施对冲、缓释汇率风险。集团注重外币资产和负债的匹配，以控制外汇风险的敞口。截至报告期末，本集团的汇率风险对财务报表无重大影响。

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

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

本集团通过以风险价值为主的市场风险量化指标体系对各项投资交易类业务承担的市场风险情况进行计量和管控。风险价值指在一定的置信水平下，投资组合在未来特定前瞻期内因市场波动而产生的最大可能损失，是衡量市场风险的主要指标。本集团风险价值模型的具体计量参数为 95% 置信水平、1 日前瞻期，模型计量的覆盖范围包括集团层面持有的权益、利率、外汇等各类金融资产和衍生品。本集团通过返回检验等手段，持续监控和评估风险价值模型的有效性，并随着业务发展和风险管理的需要持续完善风险价值模型。此外，本集团建立压力测试管理机制作为风险价值模型的重要补充，通过构建各类历史情景和模拟情景以及相应的压力测试传导机制，衡量投资交易业务可能面临的极端损失情况，并评估损失是否在可承受范围内。报告期内，本公司各月月末风险价值占本公司净资产的比例、以及本集团风险价值占本集团净资产的比例均保持在 0.2% 以内，市场风险可控可承受。

（5）操作风险

操作风险指由内部流程缺陷、人员失误或不当行为、信息系统缺陷或故障，以及外部因素等原因给公司造成损失的风险。操作风险贯穿于公司业务开展与日常运营过程中的各个环节，并可能导致法律风险、合规风险、声誉风险等其他风险。本集团以操作风险管理办法等制度为依据，利用风险与控制自我评估、关键风险指标、损失数据收集等风险管理工具开展操作风险识别、评估、监测、报告等工作。本集团每年开展年度风险与控制自我评估，并根据监管要求及新业务、新产品开展情况进行专项风险与控制自我评估。建立了覆盖集团主要部门及子公司的关键风险指标体系，对关键风险指标开展监测工作。在集团范围内开展操作风险事件收集工作，监控风险事件发生情况及进展，并针对风险事件揭示的问题及时排查分析并制定相应的整改措施。此外，集团通过完善规章制度、规范操作流

程、加强风险检查、强化考核及问责等方式持续完善内部控制管理机制，降低操作风险发生的可能性，积极应对并妥善处理其不利影响。报告期内，本集团面临的操作风险性质和程度未发生重大变化，已建立的各项操作风险管理工具持续有效运行，未发生重大操作风险事件。

信息技术风险指在借助信息技术手段从事证券基金业务活动中，由于自然因素、人为因素、技术漏洞和管理缺陷产生的风险。集团持续加强信息技术管理的制度建设，不断完善网络与信息安全事件应急预案，定期进行应急演练，并采用定期或不定期的监测、专项检查等多种手段对系统运行、系统建设、信息安全、科技管理等方面的信息技术相关情况进行监控和管理，防范信息技术风险。集团持续加强信息技术系统的建设和运维，严格按照操作程序进行定期和不定期的检查和维护，以保证系统的可靠、稳定和安全运转，报告期内未发生重大信息技术风险事件。

(6) 流动性风险

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

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

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

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

报告期内，面对市场环境的变化和公司内部资金需求的转化，公司积极筹划，从多个方面着手，通过事前风险识别、事中风险缓释、事后改进等措施，不断强化对流动性风险的管控。公司通过市场研判，抓住利率低位时点及时通过发债增加资金储备并续作各项到期负债，降低了流动性风险发生的可能，并保证了公司在复杂市场环境下的平稳运营能力。公司核心流动性监管指标流动性覆盖率日均 267.71%，净稳定资金率日均 157.84%，均高于监管要求及预警标准。

(7) 声誉风险

声誉风险是指由于公司行为或外部事件，以及工作人员违反廉洁规定、职业道德、业务规范、行规行约等相关行为，导致投资者、发行人、监管机构、自律组织、社会公众、媒体等对公司形成负面评价，从而损害公司品牌价值，不利于公司正常经营，甚至影响到市场稳定和社会稳定的风险。公司高度重视声誉风险管理的前瞻性和主动性，持续满足监管部门关于声誉风险系统化管理的要求，加强境内外声誉风险监测，在中国内地和中国香港建立传播渠道，围绕经营亮点强化主动宣传，为公司发展营造良好的舆论环境。针对少数负面舆情，公司科学研判、快速反应、主动应对，及时把握舆情走势，与主流媒体保持良好沟通，做好舆论引导，维护公司品牌形象。公司围绕《海通证券股份有限公司声誉风险管理办法》，通过上线专题课程、组织集中学习、解析典型案例、开展应急演练等手段，进行全员宣传和贯彻，不断提升全体员工声誉风险管理意识、防范水平和应对能力。报告期内，公司总体舆论环境良好。

(二) 其他披露事项

经营计划进展说明

2023年上半年，经济社会全面恢复常态化运行。在总体战略的指引下，公司深入践行“一个海通”理念，坚持围绕中心、服务大局，促进“科技—产业—金融”良性循环，助力现代产业体系建设，持续深化区域服务，推动分支机构转型升级，深化机构改革，强化集团管理，各项财务指标保持稳健，为实现全年经营目标打下良好基础。

在投资银行业务线，公司主动适应全面注册制，着力推动大投行组织架构优化；公司股权融资业务积极布局，大力开拓科创板、创业板、北交所项目，市场排名保持行业前列；债券融资业务各项指标排名回升，聚焦国家战略，坚持创新驱动，成功发行多个“市场首单”产品。在财富管理业务线，公司经纪业务加快打造全能型分公司，推进财富管理机构化转型，提升投顾服务能力，加强投资者权益保护，初步建立战略客户服务体系，搭建区域合作平台生态；金融产品业务稳步提升产品保有规模；融资融券业务稳中求进，股票质押业务稳步开展，融券业务市占率提升，纾困基金稳健运行；私人银行业务聚焦高净值客户，逐步构建私行客户生态圈；期货业务代理交易额市场份额稳步增长。在交易及机构业务线，公司衍生品业务规模不断扩大；权益投资交易业务面对市场不利行情，积极求变；固定收益投资重启投顾业务，新增多项社会责任投资；自贸区分公司持续推进以自贸区离岸债券为标的的自营投资和客需服务；研究服务创新工作方法，加强“业务赋能”，强化持牌机构服务能力，构建综合销售服务体系。在资产管理业务线，海通资管参公大集合量化产品、中短债产品投资业绩在市场同类产品中的排名前列；富国基金公募基金管理规模排名行业前列，各类养老金业务保持良好发展态势；海富通基金公募基金规模、养老金业务规模、海富通中证短融ETF规模实现增长。在私募股权投资及直投业务线，私募股权投资基金坚持服务实体经济，高效支持科技创新；创新证券稳健发展股权投资，积极开展战略基金投资。在海外业务与融资租赁业务线，海通国际勇于逆势寻突破，不断强化境内外业务联动；海通银行妥善应对地缘政治紧张局势及全球加息浪潮，在多项工作中取得重要进展；海通恒信加速推进产业化转型，深入布局绿色租赁细分领域，持续优化资产结构。报告期内，公司各个业务条线均取得稳健业绩的同时，在管理工作方面，持续强化合规风控能力，优化财资管理能力，深化数字化转型，整合资源，推进业务协同，实现驻京机构集中办公，通过管理赋能持续强化精耕细作助力公司在“一个海通”理念下的健康发展。

2023年下半年，公司将进一步整合公司资源，发挥公司综合金融服务优势，全方位、多层次推动企业对接资本市场，咬定目标不动摇，打好打赢“四场大仗”，具体的业务重点包括：投资银行业务线，将强化高端产业引领功能，发挥高质量发展的示范作用，进一步深化改革，优化内外部协同机制，并探索研究境内外联动机制；财富管理业务线，将多渠道强化销售体系，加快优化传统网点布局，持续建立战略客户生态圈，加大分支机构转型力度；交易及机构业务线，将加快提升投资管理能力，打造PB业务综合平台，优化持牌金融机构服务；资产管理业务线，将持续完善合规风控体系，着力打造行业良好发展生态，全面强化专业能力建设；私募股权投资及直投业务线，将紧抓服务国家战略和实体经济的主线，加强基础研究与各类基金间的协同联动，并继续巩固股权投资业务优势；海外业务线，将统筹资源、优化流程、完善考核，坚决打好境外业务品牌保卫战，更好发挥“一个海通”协同实效；融资租赁业务线，将加快产业化转型发展，培育战略新兴资产，持续优化资产结构；与此同时，公司下半年还将围绕高质量的合规内控、科技运营、财资管理、集团化管理等体系建设，提升管理工作效能，护航公司高质量发展。

第四节 公司治理

一、股东大会情况简介

会议届次	召开日期	决议刊登的指定网站的查询索引	决议刊登的披露日期	会议决议
2022 年度股东大会	2023 年 6 月 16 日	http://www.sse.com.cn	2023 年 6 月 17 日	详见下文“股东大会情况说明”

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

表决权恢复的优先股股东请求召开临时股东大会

适用 不适用

股东大会情况说明

本报告期内，公司于 2023 年 6 月 16 日在海通外滩金融广场召开了 2022 年度股东大会，审议并通过 11 项议案：1. 公司 2022 年度董事会工作报告，2. 公司 2022 年度监事会工作报告，3. 公司 2022 年度独立董事述职报告，4. 公司 2022 年年度报告，5. 公司 2022 年度财务决算报告，6. 公司 2022 年度利润分配预案，7. 公司关于续聘会计师事务所的议案，8. 关于预计公司 2023 年度自营投资业务配置规模的议案，9. 关于预计公司 2023 年度日常关联 / 连交易的议案，10. 关于提请股东大会给予董事会认可、分配或发行 A 股及 / 或 H 股股份的一般性授权的议案，11. 关于提名肖荷花女士为公司董事的议案。其中议案 1 至议案 9 和议案 11 为普通决议案，议案 10 为特别决议案。相关决议公告于会议当日刊登在香港联交所披露易网站（<http://www.hkexnews.hk>），于会议次日刊登于上交所网站（<http://www.sse.com.cn>）、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》和《证券日报》。

二、公司董事、监事、高级管理人员变动情况

姓名	担任的职务	变动情形
任澎	董事、副总经理	离任
余莉萍	董事	离任
侍旭	职工代表监事	离任
李建国	总经理助理	离任
林涌	总经理助理	离任
杜洪波	首席风险官	离任
李海超	合规总监	离任
肖荷花	董事	选举
曹志刚	职工代表监事	选举
赵慧文	合规总监	聘任
侍旭	首席风险官	聘任

注：除上述表格所列事宜，公司部分高级管理人员任职情况发生了调整，具体如下：李海超先生不再担任公司合规总监，仍担任公司副总经理；姜诚君先生不再担任公司总经理助理，担任公司副总经理；张信军先生担任公司副总经理，原财务总监职务仍保持不变；潘光韬先生不再担任公司总经理助理，担任公司副总经理；裴长江先生不再担任公司副总经理，拟任公司董事会秘书，在取得上海证券交易所颁发的董事会秘书任前培训证明后正式履职，在此之前由姜诚君先生继续履行公司董事会秘书职责。

公司董事、监事、高级管理人员变动的情况说明

1. 董事变更情况

2023年1月30日，公司董事会收到任澎先生提交的书面辞职报告，任澎先生因年龄原因提出辞去公司董事、董事会发展战略与ESG管理委员会委员和副总经理的职务，根据《公司法》《公司章程》的相关规定，任澎先生的辞职申请自辞职报告送达公司董事会之日起生效。详见公司2023年1月31日于上交所网站披露的《关于任澎先生辞职的公告》（公告编号：临2023-001）。

2023年5月31日，公司董事会收到余莉萍女士提交的书面辞职报告，余莉萍女士因个人原因（退休）申请辞去公司第七届董事会董事职务，同时一并辞去公司第七届董事会提名与薪酬考核委员会委员、审计委员会委员职务。余莉萍女士的辞职申请自辞职报告送达公司董事会时生效。详见公司2023年6月1日于上交所网站披露的《关于董事辞职的公告》（公告编号：临2023-018）。

2023年6月16日，公司召开的2022年度股东大会审议通过了《关于提名肖荷花女士为公司董事的议案》，同意肖荷花女士任公司第七届董事会董事。肖荷花女士自本次股东大会决议生效之日起履行董事职责。详见公司于2023年6月17日于上交所网站披露的《公司2022年度股东大会决议公告》（公告编号：临2023-020）。

2. 监事变更情况

2023年6月20日，公司监事会收到侍旭先生提交的书面辞职报告，侍旭先生因公司相关工作安排申请辞去公司第七届监事会职工代表监事职务。根据《公司法》和《公司章程》的相关规定，侍旭先生在新的公司职工代表监事选举产生履职前仍继续履行公司职工代表监事的职责。详见公司2023年6月21日于上交所网站披露的《关于公司职工代表监事辞职的公告》（公告编号：临2023-021）。

2023年6月28日，公司以通讯方式召开了第四届职工代表大会第十七次会议，选举曹志刚先生为公司第七届监事会职工代表监事。曹志刚先生的监事任职自2023年6月28日生效，任期与第七届监事会任期一致。同日，侍旭先生不再履行公司职工代表监事的职责。详见公司于2023年6月29日于上交所网站披露的《公司关于选举第七届监事会职工代表监事的公告》（公告编号：临2023-024）。

3. 高级管理人员变更情况

2023年3月16日，公司董事会收到公司总经理助理林涌先生提交的书面辞职报告。林涌先生因相关工作安排辞去公司总经理助理的职务。林涌先生的辞任自辞职报告送达公司董事会之日起生效。详见公司2023年3月18日于上交所网站披露的《关于公司高级管理人员变动的公告》（公告编号：临2023-003）。

2023年4月12日，公司董事会收到公司总经理助理李建国先生提交的书面辞职报告。李建国先生因年龄原因辞去公司总经理助理的职务。李建国先生的辞任自辞职报告送达公司董事会之日起生效。详见公司2023年4月13日于上交所网站披露的《关于公司高级管理人员变动的公告》（公告编号：临2023-012）。

2023年6月30日，公司董事会收到公司首席风险官杜洪波先生的辞职报告。杜洪波先生因年龄原因，不再担任公司首席风险官职务。杜洪波先生的辞任自辞职报告送达公司董事会之日起生效。详见公司2023年7月1日于上交所网站披露的《公司第七届董事会第三十九次会议（临时会议）决议公告》（公告编号：临2023-025）。

2023年6月30日，公司召开了第七届董事会第三十九次会议（临时会议），该次董事会审议通过了如下事宜：

(1) 审议通过了《关于聘任副总经理的议案》。董事会聘任姜诚君先生、潘光韬先生和张信军先生为公司副总经理。姜诚君先生不再担任公司总经理助理职务；并于同日向董事会提交了辞呈，申请辞去公司董事会秘书、公司联席公司秘书、联席授权代表的职务，待公司新任董事会秘书、公司联席公司秘书、联席授权代表正式履职后卸任。潘光韬先生不再担任公司总经理助理职务。张信军先生仍担任公司财务总监职务。姜诚君先生、潘光韬先生和张信军先生作为公司副总经理的任期自董事会决议通过之日起。

(2) 审议通过了《关于聘任首席风险官的议案》，董事会同意聘任侍旭先生为公司首席风险官，其任期董事会决议通过之日起。

(3) 审议通过了《关于聘任合规总监的议案》，聘任赵慧文女士为公司合规总监，并在取得中国证监会相关派出机构认可后正式履职。

2023年7月31日，赵慧文女士担任公司合规总监事宜已获中国证监会相关派出机构认可，即日起正式任职公司合规总监。李海超先生不再担任公司合规总监。详见公司于2023年8月1日披露的《公司关于合规总监任职的公告》（公告编号：临2023-029）。

(4) 审议通过了《关于聘任董事会秘书和联席公司秘书的议案》，公司董事会秘书姜诚君先生由于工作变动原因于该次董事会召开日向董事会提交了辞呈，辞去公司董事会秘书、公司联席公司秘书、公司联席授权代表（就《香港联合交易所有限公司证券上市规则》第3.05条而言）及公司接收香港联交所电子呈交系统密码及处理其后的登记事宜之授权人士的职务。董事会聘任裴长江先生为董事会秘书、公司联席公司秘书、公司联席授权代表及公司接收香港联交所电子呈交系统密码及处理其后的登记事宜之授权人士。

裴长江先生在取得上海证券交易所颁发的董事会秘书任前培训证明后正式履职。在此之前，由姜诚君先生继续履行公司董事会秘书职责。因委任裴长江先生为联席公司秘书尚需待香港联交所批准授予豁免严格遵守《香港联交所证券上市规则》第3.28条及第8.17条规定，裴长江先生将自取得香港联交所对该豁免的批准之日正式担任联席公司秘书及公司联席授权代表（就《香港联交所证券上市规则》第3.05条而言）职责。在此之前，由姜诚君先生继续履行联席公司秘书及公司联席授权代表（就《香港联交所证券上市规则》第3.05条而言）职责。（详见公司于2023年7月1日披露的《海通证券股份有限公司第七届董事会第三十九次会议（临时会议）决议公告》）

香港联交所已于2023年7月6日批准裴长江先生自该批准日起三年期间，担任公司秘书及授权代表。（详见公司于2023年7月7日披露的《委任联席公司秘书及授权代表之进展公告》）

三、公司董事、监事、高级管理人员及员工其他情况说明

(一) 董事、监事及有关雇员之证券交易

本公司已采纳《标准守则》所订标准作为本公司董事、监事及相关雇员进行证券交易的行为准则。本公司经查询全体董事及监事后，已确认他们于本公司 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日期间一直遵守上述《标准守则》的要求。本公司没有发现有关雇员违反指引。

(二) 董事、监事相关信息的重大变更

董事周东辉先生自 2023 年 1 月起，不再担任上海烟草机械有限公司副董事长、董事，不再担任上海高扬国际烟草有限公司、上海海烟投资管理有限公司、中国烟草上海进出口有限责任公司、上海烟草集团黄浦烟草糖酒有限公司、上海烟草集团徐汇烟草糖酒有限公司、上海烟草集团虹口烟草糖酒有限公司、上海烟草集团杨浦烟草糖酒有限公司、上海烟草集团闵行烟草糖酒有限公司、上海烟草集团宝山烟草糖酒有限公司、上海烟草集团浦东烟草糖酒有限公司、上海烟草集团松江烟草糖酒有限公司、上海烟草集团青浦烟草糖酒有限公司、上海烟草集团崇明烟草糖酒有限公司、上海白玉兰烟草材料有限公司、上海王宝和大酒店有限公司、上海烟草集团房地产开发经营有限公司、上海海烟烟草糖酒有限公司、上海烟草集团苏州中华园大饭店有限责任公司、深圳新型烟草制品有限公司董事，不再担任中维资本控股股份有限公司监事。

董事许建国先生自 2023 年 2 月起不再担任上海海立（集团）股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为 600619）监事长、天津钢管集团股份有限公司董事、上海电气集团恒联企业发展有限公司董事。

独立董事张鸣先生自 2023 年 6 月起担任上工申贝（集团）股份有限公司（该公司于上交所上市，股票代码为 600843）独立董事。

独立董事林家礼先生自 2023 年 4 月起不再担任新加坡交易所上市 Beverly JCG Investment Holdings Limited（股份代号：VFP）独立非执行董事，自 2023 年 5 月起不再担任马来西亚交易所（Bursa Malaysia）上市 TMC 生命科学（股份代号：0101）独立非执行董事；自 2023 年 4 月起担任新火科技控股有限公司（股份代号：1611）独立非执行董事。

独立董事朱洪超先生自 2023 年 5 月起不再担任财通基金管理有限公司独立董事。

监事戴丽自 2023 年 5 月起担任上海东方网股份有限公司董事，2023 年 7 月起担任上海东方报业股份有限公司董事。

监事董小春自 2023 年 6 月起不再担任上海百联集团股份有限公司财务总监、董秘。

监事曹志刚自 2023 年 6 月起由公司稽核部副总经理改任总经理。

监事侍旭（已离任）自 2023 年 6 月起不再担任公司稽核部总经理，并自 2023 年 6 月起担任公司首席风险官。

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

（三）董事、监事服务合约的说明

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

（四）员工及薪酬政策

截至报告期末，本集团雇员人数 12,262 人。其中本公司雇员人数 6,865 人，子公司雇员人数 5,397 人。

本公司重视人才的吸引、激励、培养和保留，不断检视和优化公司薪酬体系，坚持市场化分配、绩效导向、兼顾公平的激励原则，持续完善薪酬递延支付、追索扣回等机制。本公司雇员薪酬由固定薪酬、绩效薪酬和福利三部分构成。依据适用的中国法律法规，本公司为雇员建立各项社会保险（养老保险、医疗保险、失业保险、工伤保险及生育保险）、住房公积金，并依据法规足额缴纳上述各项社会保险费和住房公积金。本公司建立企业年金计划，为雇员提供补充养老保障，并为雇员投保补充医疗保险和人身意外保险。

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

（五）员工培训

2023 年上半年，培训工作坚持统筹规划、分类开展，坚持资源整合、赋能发展，坚持共建共享、智慧运营，依托公司党委党校和海通财富研修院，聚焦内容创新、项目精细、功能完善，助力公司人才发展及梯队建设。丰富党校办学形式，上线“海通党校”专栏，加强新形势下广大干部职工思想政治工作，提高广大党员教育培训工作质量；持续推进内容创新，以“五大分院一个中心”为基础，整合集团资源，完善课程体系，满足员工定制学习、个性学习、按需随学的需求；持续升级重点项目，分类分层搭建公司人才发展体系，“海豚计划”着眼应届生资源储备，“海星计划”突出新员工文化融合，“海燕计划”聚焦国际化人才储备，“蒲公英计划”强调业务交流和协同；持续完善平台功能，有效支持线上业务培训的开展，定制推出创新项目案例、分公司专栏等知识专栏，助力员工专业素质能力的持续提升。

四、利润分配或资本公积金转增预案

（一）报告期实施的利润分配方案的执行或调整情况

公司于 2023 年 6 月 16 日召开 2022 年度股东大会，审议通过了公司 2022 年度利润分配预案：以截至 2022 年 12 月 31 日本公司 A 股和 H 股总股本共计 13,064,200,000 股为基数，向全体股东每股派发现金红利人民币 0.21 元（含税），共计派发现金红利人民币 2,743,482,000.00 元（含税）；其中 A 股股本为 9,654,631,180 股，本次共计派发 A 股现金红利人民币 2,027,472,547.80 元；H 股

股本为 3,409,568,820 股，本次共计派发 H 股现金红利港币 785,837,421.63 元。

公司在《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》、上交所网站、香港联交所披露易网站及公司网站刊登了 2022 年度利润分配实施的有关公告，并于 2023 年 7 月 28 日实施完毕。

(二) 半年度拟定的利润分配预案、公积金转增股本预案

是否分配或转增

否

五、公司股权激励计划、员工持股计划或其他员工激励措施的情况及其影响

(一) 相关股权激励事项已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的

适用 不适用

(二) 临时公告未披露或有后续进展的激励情况

股权激励情况

适用 不适用

其他说明

适用 不适用

员工持股计划情况

适用 不适用

其他激励措施

适用 不适用

六、公司治理的其他情况

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

报告期内，本公司召开股东大会 1 次，董事会 5 次，监事会 2 次，审计委员会 4 次，独立董事年报工作会议 2 次，提名与薪酬考核委员会 1 次，发展战略与 ESG 管理委员会 1 次，合规与风险管理委员会 1 次，共计 17 次会议。

（一）关于股东和股东大会

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

（二）关于董事和董事会

本公司严格按照《公司章程》的规定聘任和变更董事，董事人数构成和任职资格符合法律、法规的要求。截至 2023 年 6 月 30 日，公司董事会由 10 名董事组成，其中执行董事 2 名，分别为周杰先生和李军先生；非执行董事 4 名，分别为屠旋旋先生，周东辉先生，肖荷花女士及许建国先生；独立非执行董事 4 名，分别为张鸣先生，林家礼先生，朱洪超先生及周宇先生。各位董事能够勤勉尽责地履行职责，维护本公司和全体股东的利益。董事会下设发展战略与 ESG 管理委员会、审计委员会、合规与风险管理委员会、提名与薪酬考核委员会，各委员会分工明确，权责分明，有效运作，四个委员会中，发展战略与 ESG 管理委员会主任委员由董事长周杰担任，合规与风险管理委员会主任委员由执行董事李军担任，另两个委员会的主任委员均由独立非执行董事担任。

公司董事会设有审计委员会，符合中国证监会、上交所的有关规定及香港上市规则第三章的规定，成员有 5 名，包括张鸣先生（主任委员）、肖荷花女士、许建国先生、林家礼先生和周宇先生。审计委员会主要负责本公司内、外部审计的沟通、监督及核查等工作，并向董事会提供专业意见。审计委员会已审阅并确认本集团截至 2023 年 6 月 30 日六个月的中期业绩及半年度财务报告，未对本集团所采用的会计政策及常规提出异议。

（三）关于监事和监事会

截至 2023 年 6 月 30 日，公司监事会由 9 名监事组成，其中监事会主席 1 名，职工代表监事 3 名，非职工代表监事 5 名，人员任职资格和构成符合法律、法规的要求。本公司监事能够勤勉尽责地履行职责，本着对股东负责的精神，对本公司财务、董事会成员以及高级管理人员履行职责的合法合规性进行监督，并就有关事项向董事会和高级管理层提出建议和改进意见。

（四）关于高级管理层

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

（五）关于相关利益者

本公司充分尊重和维护相关利益者的合法权益，共同推进本公司持续健康发展。

（六）关于信息披露和投资者关系管理

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

公司注重维护投资者关系,通过开展各类投资者关系活动,持续加强与投资者的信息沟通,切实保护投资者的合法权益,有效增进投资者对公司的了解和认同。为保障投资者关系管理工作规范化、制度化、流程化开展,公司已制定《投资者关系管理办法》等相关制度,通过公司官网、投资者热线、电子邮箱、投资者说明会、路演、分析师会议、接待来访及上证 e 互动平台等多种载体与投资者进行沟通交流,并建立健全投资者关系管理档案。

2023 年上半年,公司顺利召开 2022 年度业绩发布会,管理层全面推介公司发展战略和经营亮点,并就市场热点问题与投资者及分析师交换意见,在回应市场关注的同时,正确引导市场预期。公司定期维护公司官网投资者关系栏目和上证 e 互动平台内容,帮助投资者快速、全面地了解公司信息。及时处理投资者问询和建议,接听投资者热线 133 起,回答上证 e 互动问题 69 个。公司注重在市场交流中加强主动性和战略性沟通,多次以现场或电话方式接待境内外机构投资者及分析师调研,并多次受邀参加境内外卖方机构投资策略会。同时,针对投资者及分析师的关注重点,公司积极组织相关部门参与调研,并将市场声音传达至管理层,反哺公司业务发展及治理提升,充分发挥投资者关系管理的双向传导作用。

（七）合规体系建设

报告期内,本公司严格按照中国证监会的要求,结合自身实际情况,不断完善本公司合规管理。本公司合规总监严格依法履行合规管理职责。本公司股东、董事和高级管理人员未发生违反规定的职责和程序直接向合规总监下达指令或者干涉其工作的情形。本公司为合规总监全面履职和合规管理提供了人力、物力、财力和技术支持,为合规管理提供了保障。报告期内,本公司加强合规审查、合规检查、合规监测等基础职能履行,稳步有序开展合规管理基础工作。同时,公司确定 2023 年为“合规内控文化巩固年”,在集团范围内全面推进合规内控文化建设,贯彻“全员合规、合规从管理层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础”的合规理念,聚焦“提升合规文化宣传培育的融合性”“提升合规内控队伍的专业履职能力”“加大对重点领域的执行保障力度”“落实反洗钱检查整改,推动一道防线履职”等四大重点工作,推动公司建立健全合规内控长效机制,合规内控管理效能持续提升。

第五节 环境与社会



一、环境信息情况

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

适用 不适用

(二) 重点排污单位之外的公司的环保情况说明

1、因环境问题受到行政处罚的情况

适用 不适用

经核查，本公司及子公司不属于环境保护部门公布的重点排污单位。

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

2、参照重点排污单位披露其他环境信息

适用 不适用

3、未披露其他环境信息的原因

适用 不适用

(三) 报告期内披露环境信息内容的后续进展或变化情况的说明

适用 不适用

(四) 有利于保护生态、防治污染、履行环境责任的相关信息

围绕国家“双碳”和高质量发展目标，通过 ESG 风险管理、负责任投资等将 ESG 理念全面融入发展战略和日常经营。为推进 ESG 管理系统化建设，公司搭建发展战略与 ESG 管理委员会、ESG 建设领导小组及 ESG 工作小组三层管理架构，实现公司 ESG 管理工作的规范、有效推进。报告期内，公司不断完善 ESG 管理工作机制，根据实际工作需要，对 ESG 工作小组的责任部门及分工进行动态调整，提升 ESG 管理架构与实际工作开展的匹配性。

公司坚持绿色低碳循环发展，从自身运营及绿色金融两方面自觉履行企业环境责任。自身运营层面，公司大力倡导环保办公理念，通过倡导无纸化办公、空调限温、绿色出行、绿色会议等方式减少办公过程中的资源浪费。绿色金融层面，持续为节能环保、清洁能源、清洁交通等绿色产业提供多渠道、多品种的绿色投融资工具，引导和激励更多社会资本投入绿色产业，并积极开展绿色研究咨询、绿色金融行业交流，以实际行动践行 ESG 理念。

1. 自身运营

绿色运营方面，公司积极落实节约能源和提高能源利用率的责任，鼓励员工合理限定冬夏两季空调温度，自觉做到人走灯灭；公司提倡“绿色出行，低碳生活”的理念，加强公务用车管理，倡导员工选择公共交通办理业务；公司优先采购节水器具，对用水设备定期检修，避免水资源浪费，并采用智能水表开展节水管理。

2022年12月，海通外滩金融广场通过美国绿色建筑委员会 LEED 金级认证，2023年3月，又获 WELL 健康建筑标准（源自美国的健康建筑标准）铂金级认证，充分彰显公司新总部大楼环境友好、绿色节能、舒适健康的建设理念。海通外滩金融广场全部使用小于 WELL 标准 VOC/ 甲醛值要求的建筑材料，设计完全封闭的集中打印室，采购优于 LEED 标准 40% 的节水型器具，使用符合要求的节能型设备和 LED 节能灯具，配备自动化楼宇控制及电梯系统，有效减少能源损耗。园区还设置符合 WELL V2 水质要求的直饮水机、显色指数超过 90 且符合照明要求的办公灯光、声学性能达到 STC-30 的隔声门等，打造舒适、健康、环保的办公环境。

绿色宣传方面，公司在官网、官微等线上阵地开展专题宣传，围绕“双碳”理论研究、绿色投融资、碳金融市场、绿色金融创新等方面的有益实践选题策划，积极展示公司在 ESG 领域的工作成果。公司融合珍惜纸张、节约粮食、节能减排、用房管理等主题，在新总部园区、张江科技园开展“以俭修身”主题宣传活动，倡导绿色办公、绿色生活新风尚；开发设计海通家园环保文创产品，弘扬绿色理念，发扬环保之光。

绿色办公方面，公司借助协同办公系统、RPA 智能流程自动化机器人、智能审核系统等搭建信息化、无纸化办公模式，大量减少废纸张和其他废弃物的产生。

2. 绿色金融

绿色融资方面，报告期内，公司承销发行绿色债券 23 支，融资规模合计 1,032 亿元；通过绿色股权融资服务锦浪能源、晶科科技、新日股份、能辉科技等绿色企业，募集资金 73 亿元。

绿色投资方面，报告期内，公司正式发布“中证海通证券 ESG 股债联动策略指数”，为践行绿色金融理念提供良好投资工具，该指数作为行业首条 ESG 策略指数，是场外衍生品市场和 ESG 理念有机结合的代表性成果，更是资本市场服务“双碳”目标、推动可持续投资实践的重要工具和载体；公司通过二级市场认购中国华电、华夏银行、武汉地铁、中广核风电等企业的绿色中期票据、绿色债券，用于支持绿色产业项目。截至报告期末，海富通碳中和主题基金总规模达 8.3 亿元，富国中证上海环交所碳中和 ETF 规模达 12 亿元。

绿色研究咨询方面，报告期内，公司向中国人民银行上海总部申报的《发展碳金融，完善碳交易市场风险管理功能》课题荣获“2022 年度上海经济金融调研机制优秀调研成果综合奖”三等奖。该课题针对国内碳市场定价机制、产品体系、金融属性、市场功能等进行分析，提出多项发展建议；公司参与上海财经大学国际金融中心研究院关于“构建基于 ESG 的中小企业低碳转型投融资多方协同平台的对策研究”课题征集活动，目前已完成开题计划。

绿色金融行业交流方面，2023 年 3 月，为深化海通绿色“双碳”与新经济产融生态圈，子公司海通恒信在西安举办绿色“双碳”暨新经济合作伙伴发展研讨会；2023 年 6 月，公司参加首届上海国际碳中和博览会，分享公司在绿色金融创新及“双碳”方面做出的探索与实践。公司《服务“双碳”战略 创新绿色发展路径》案例入选上海市国资委系统社会责任工作“十佳案例”。

(五) 在报告期内为减少其碳排放所采取的措施及效果

作为金融服务企业，公司碳排放的主要来源为日常运营过程中耗电、天然气以及公务用车耗油产生的碳排放。报告期内，公司通过绿色办公、低碳数据中心运营、低碳出行等方式持续开展节能工作，以减少运营过程中的碳排放。

公司秉承绿色发展理念，推进绿色数据中心建设，成为业内首家使用光伏能源并顺利投产的证券公司。海通证券张江科技园光伏项目（一期）于2022年12月投产，公司自有资金投资41.5万元，实施64.3kW装机容量的光伏系统安装，应用于张江科技园DTE机房精密空调及机房走道照明、空调系统，建成至今，根据电表测试，已发电2.79万千瓦时，年节能实物量2.79万度电，折合年节能量11.16吨标准煤。

二、巩固拓展脱贫攻坚成果、乡村振兴等工作具体情况

2023年上半年，在中国证监会、上海市委、市政府的正确领导下，海通证券持续开展“一司一县”“百企帮百村”结对帮扶工作，助力安徽利辛、安徽舒城、江西宁都、云南西畴、新疆叶城等五个脱贫县巩固脱贫攻坚成果，积极开展援疆援藏援青工作，努力解决帮扶地区群众实际问题，助力帮扶地区发展振兴。

(一) 坚持项目导向，深入开展结对帮扶支援工作

公司以项目建设为导向，依托分支机构，持续加强与安徽利辛、安徽舒城、江西宁都、云南西畴、新疆叶城等结对县的沟通交流，投入专项资金助力结对帮扶县经济发展。2023年上半年，公司与云南西畴县人民政府开展结对帮扶座谈交流会，深入了解帮扶项目开展情况，精准对接需求，进一步细化帮扶举措；面向新疆叶城开展“爱在海通·助力成长”推普及学前教师赋能提升公益项目，覆盖全县600余名幼儿园园长、幼师，助力当地提升教学水平。安徽分公司召开结对帮扶工作交流座谈会，立足金融帮扶、智力帮扶、产业帮扶、公益帮扶等方面，与利辛县进一步深化合作；举办“强化精准服务 助推企业发展”资本市场公益投教活动，组织海通专家为舒城县相关领导、全县规模以上工业企业负责人及高新技术企业人员共计150余人详细介绍多层次资本市场体系，深刻解读资本市场的新形势、新政策以及全面实行股票发行注册制下创业板股票的上市规则等，为当地经济发展提供智力支持。

(二) 发挥专业优势，赋能帮扶地区经济发展

2023年3月，公司在去年助力江西省宁都县城市发展投资有限公司发行第一期公司债的基础上，成功发行第二期宁都县城市发展投资有限公司公司债券，募集资金4亿元，用于现代农业重点项目建设，持续助力宁都县三农产业结构升级。此外，公司还投入30万元，依托子公司海通期货业务优势，在贵州印江开展“爱在海通 共期美好”生猪“保险+期货”项目，帮助农户规避生猪价格波动风险、保障收益。

（三）消费助力，将帮扶工作融入企业文化建设

公司通过上海市消费帮扶渠道采购云南省特色滇红茶、咖啡以及手工艺品云南斑铜祥瑞牛等作为公司礼品，传递“爱在海通”公益品牌理念。子公司海通期货充分发挥工会优势，采购结对帮扶地区黑龙江桦川县、新疆叶城县等地农副产品，助力当地农户增收。

（四）构建公益体系，传递“爱在海通”公益力量

公司坚持以“爱在海通”党建公益品牌为引领，广泛凝聚爱心力量，以慈善公益助力乡村振兴。一是加强帮扶公益体系建设。持续推进设立“上海爱在海通公益基金会”（以下简称“基金会”），召开基金会第一届理事会、监事会第一次会议，进一步健全基金会办事机构。二是认真落实“爱在海通”公益清单。持续推进“爱在海通·美丽新疆”“爱在海通·美丽西藏”助学公益项目；结合习近平总书记给《共产党宣言》展示馆党员志愿者回信三周年，支持开展《望道》电影全国公益展映项目，激励广大党员干部在学思践悟中坚定理想信念、在奋发有为中践行初心使命；携手嘉定区委区政府面向青海省果洛藏族自治州久治县开展文化帮扶，打造“海通久音三交活动服务中心”项目，进一步彰显公司主动服务国家乡村振兴战略、参与上海对口支援帮扶工作的使命担当；参与开展“同圆中国梦平安校园行”安全防护包捐赠项目，助力培养青少年公共安全意识和自护自救应变能力。公司还应邀参加第二届中国资本市场公益论坛，分享展示公司帮扶公益工作成果，参加上海市合作交流办、上海人民广播电台长三角之声《情义东方》栏目合作推出的《公益半月谈》专题节目，分享“海通·爱阅读”第四季——“童声无界”活动组织情况，号召更多社会力量投身公益工作，助力乡村振兴。此外，各子公司、分支机构结合“学习二十大 志愿新征程”主题活动，围绕公益投教、低碳环保、社区服务等方面开展志愿公益和捐赠帮扶行动，展现了“爱在海通”公益合力。

下一步，公司将继续深入贯彻党中央关于巩固脱贫攻坚成果和全面推进乡村振兴的重要指示精神，认真履行金融国企职责使命，为助力乡村振兴战略贡献更大力量。一是进一步深化结对帮扶工作机制，不断完善“五位一体”帮扶模式，立足新发展阶段，以更精准的帮扶措施，继续助力帮扶地区实现可持续发展。二是持续发挥专业优势，精准对接帮扶地区企业融资需求，为帮扶地区提供多渠道、多品种的金融服务。三是设立“上海爱在海通公益基金会”为契机，进一步加强志愿者队伍建设，丰富拓展“海通·爱”系列公益项目，重点关注结对帮扶地区、革命老区和云南、新疆、西藏等边疆民族地区，持续在慈善公益领域发力，传递海通温度，擦亮“爱在海通”公益品牌。

第六节 重要事项

一、承诺事项履行情况

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

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

二、报告期内控股股东及其他关联方非经营性占用资金情况

适用 不适用

三、违规担保情况

适用 不适用

四、半年报审计情况

适用 不适用

五、上年年度报告非标准审计意见涉及事项的变化及处理情况

适用 不适用

六、破产重整相关事项

适用 不适用

七、重大诉讼、仲裁事项

本报告期公司有重大诉讼、仲裁事项 本报告期公司无重大诉讼、仲裁事项

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

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

公司与南一农公司、红太阳集团、南京世界村质押式证券回购纠纷案

因南京第一农药集团有限公司（简称南一农公司）拒绝依约履行股票质押购回义务，公司向上海金融法院起诉，要求融资人南一农公司支付本金人民币 30,000 万元以及相应的利息、违约金、债权实现费用等，要求担保人红太阳集团有限公司（简称红太阳集团）、南京世界村汽车动力有限公司（简称南京世界村）承担保证责任。2020 年 5 月，上海金融法院受理本案，于 2020 年 11 月 12 日开庭审理。2021 年 4 月，上海金融法院作出一审判决，支持公司诉讼请求。2021 年 6 月，南一农公司被南京市高淳区人民法院裁定破产重整，公司向南一农破产重整项目管理人申报债权。2022 年 6 月 1 日，南京市高淳区人民法院出具《民事裁定书》，裁定对南一农公司、江苏国星投资有限公司、南京苏皖现代农业有限公司、江苏苏农农资连锁集团股份有限公司（以下称南一农公司等四家公司）进行实质合并重整。2022 年 11 月 7 日，南京市中级人民法院决定对 ST 红太阳启动预重整程序。2023 年 6 月 30 日，南一农公司等四家公司实质合并重整管理人向南京市高淳区人民法院提交重整计划草案，并计划安排召开债权人大会表决。2023 年 7 月 28 日，南京市高淳区人民法院裁定同意延期表决。

海通资管与南一农公司质押式证券回购纠纷案

因南一农公司质押其持有的红太阳（证券代码：000525）股票并向海通资管管理的资管计划融入资金，质押交易违约，海通资管向上海金融法院起诉，要求债务人南一农公司支付本金人民币 32,000 万元以及相应的利息、违约金、债权实现费用等。2020 年 1 月，上海金融法院受理本案，于 2020 年 8 月 7 日开庭审理。2020 年 12 月 31 日，上海金融法院作出一审判决，支持海通资管的诉讼请求。南一农公司后上诉至上海市高级人民法院，上海市高级人民法院于 2021 年 6 月 23 日作出终审判决，维持原判。2021 年 6 月，南一农公司被南京市高淳区人民法院裁定破产重整，海通资管已代表资管计划向南一农破产重整项目管理人申报债权。2022 年 6 月 1 日，南京市高淳区人民法院出具《民事裁定书》，裁定对南一农公司等四家公司进行实质合并重整。2022 年 11 月 7 日，南京市中级人民法院决定对 ST 红太阳启动预重整程序。2023 年 6 月 30 日，南一农公司等四家公司实质合并重整管理人向南京市高淳区人民法院提交重整计划草案，并计划安排召开债权人大会表决。2023 年 7 月 28 日，南京市高淳区人民法院裁定同意延期表决。

四川信托与海通资管、公司等金融委托理财合同纠纷案

因金融委托理财合同纠纷，四川信托有限公司（简称四川信托）向四川省成都市中级人民法院起诉，要求海通资管、公司等被告返还或赔偿原告四川信托委托财产 51,455 万元及相应利息。2021 年 9 月，四川省成都市中级人民法院受理本案，于 2022 年 11 月 10 日、2023 年 7 月 10 日开庭审理。目前法院尚未作出一审判决。

邮储银行与富诚海富通等证券虚假陈述责任纠纷案

因“华泰美吉特灯都资产支持专项计划”发生实质性违约，专项计划持有人之一中国邮政储蓄银行股份有限公司（简称邮储银行）向上海金融法院起诉，要求原始权益人昆山美吉特灯都管理有限公司及包括上海富诚海富通资产管理有限公司（简称富诚海富通）在内的相关中介机构对其全部损失承担连带赔偿责任，其诉请金额为本金人民币 52,657.98 万元以及相应的利息等。2020 年 11 月，上海金融法院受理本案。2023 年 4 月 14 日，上海金融法院作出一审判决。目前，原告邮储银行及富诚海富通等被告已向上海市高级人民法院提起上诉。

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

因 ChinaEdu Corporation 及北京弘成立业科技股份有限公司（简称北京弘成）拒绝依约履行股权回购义务，海通开元、西安航天新能源产业基金投资有限公司（简称西安航天新能源）及上海文化产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）（简称上海文化）共同向中国国际贸易仲裁委员会提交仲裁申请，要求 ChinaEdu Corporation 及北京弘成履行回购义务并支付股权回购价款，涉及本金金额合计 2.5 亿元。2022 年 6 月，中国国际贸易仲裁委员会受理本案，于 2023 年 8 月 3 日开庭审理。

上述案件中涉及的潜在损失已根据相关规定进行了充分计提。

公司境外上市子公司、海通银行的重大诉讼、仲裁事宜由其按照所在地的监管规则和相关上市规则（如涉及）自行履行信息披露义务。

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

1. 截至报告期末，本公司无控股股东且无实际控制人。

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

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

2023 年 5 月，公司收到上海证监局出具的《关于对海通证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（沪证监决〔2023〕95 号），被采取出具警示函的行政监管措施。该监管函件认定公司未严格规范有关从业人员的执业行为等。公司收到该监管函件后，高度重视，及时进行整改，完善制度

建设，健全内控机制，加强合规培训及合规检查力度，提升员工合规意识及执业水平。

2023年6月，公司收到上海证券交易所出具的《关于对海通证券股份有限公司予以监管警示的决定》（〔2023〕26号），被予以监管警示。该书面函件认定公司在保荐工作中，核查工作履职尽责不到位、内部质量控制存在薄弱环节。公司收到该监管函件后，高度重视，及时进行整改，加强项目内控审核及跟踪管理，定期组织开展专项培训，督导员工勤勉尽责，夯实工作底稿，切实提高执业水平。

九、报告期内公司及其控股股东、实际控制人诚信状况的说明

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

十、重大关联交易

（一）与日常经营相关的关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

4、日常关联 / 连交易

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

报告期内，公司严格按照2022年度股东大会审议通过的《关于预计公司2023年度日常关联 / 连交易的议案》，开展日常关联 / 连交易。

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

相关执行情况如下：

● 香港上市规则项下的持续性关联交易

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

公司于 2022 年 12 月 31 日与上海国盛集团签署上海国盛（集团）有限公司与海通证券股份有限公司之关联交易 / 关连交易框架协议》（以下简称新框架协议）。框架协议明确关连交易及相关服务的范围、定价基准、管控流程等内容，并对 2023 至 2025 年持续关连交易的年度上限进行预计。

上述框架协议经公司第七届董事会第三十四次会议（临时会议）审议通过。关联董事屠旋旋先生已根据有关法律法规及公司内部规定回避表决，公司独立董事已针对框架协议的签署发表事前认可意见和独立意见。相关董事会审议结果及框架协议签署公告均按照上海证券交易所及香港联合交易所的相关要求进行披露。

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

单位：万元 币种：人民币

交易内容	2023 年度预计交易上限	2023 年 1-6 月实际发生金额
证券及金融产品交易		
流入 ⁽¹⁾	250,000.00	4,363.60
流出 ⁽²⁾	210,000.00	-
证券及金融服务		
本集团向国盛集团及其联系人提供证券和金融服务收取的收入总额	10,000.00	366.16
本集团接受国盛集团及其联系人提供证券和金融服务产生的支出总额	3,000.00	147.22

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

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

● 上交所上市规则项下的日常关联交易

(1) 与上海国盛（集团）有限公司及上海国盛集团资产管理有限公司的关联交易

单位：万元 币种：人民币

交易内容	2023 年 1-6 月发生金额	占同类交易金额的比例	备注
手续费及佣金净收入	83.14	0.02%	向关联方收取的资产管理业务收入
手续费及佣金净收入	30.62	0.01%	向关联人收取的证券交易手续费及佣金收入
利息净收入	34.49	0.02%	关联人保证金产生的利息净收入
衍生金融工具交易净损益（注）	-265.94	-0.22%	报告期内，名义本金发生金额 0.57 亿元，期末名义本金余额 0.45 亿元。

注：关联人作为交易对手方与公司进行衍生品交易产生的已实现及未实现投资收益，亏损以负值列示。

单位：万元 币种：人民币

往来项目	2023 年 6 月 30 日余额	占同类交易金额的比例	备注
应收款项	66.01	0.01%	应向关联人收取的各项服务手续费余额
代理买卖证券款	0.02	0.00%	关联人存放公司的客户保证金余额
应付款项	5,824.03	0.43%	公司应付关联人衍生金融工具保证金余额
衍生金融资产	83.96	0.04%	与关联人开展衍生品交易产生的衍生金融资产余额

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

单位：万元 币种：人民币

交易内容	2023年1-6月发生金额	占同类交易金额的比例	备注
手续费及佣金净收入	9,041.77	1.83%	向关联人收取的资产管理业务收入、销售服务费收入、投资咨询服务费收入等
手续费及佣金净收入	895.62	0.18%	向关联人收取的证券交易手续费及佣金收入
利息净收入	24.09	0.01%	关联人保证金产生的利息净收入
衍生金融工具交易净损益（注）	316.34	0.27%	报告期内，名义本金发生金额 526.61 亿元，期末名义本金余额 177.72 亿元。

注：关联人作为交易对手方与公司进行衍生品交易产生的已实现及未实现投资收益，亏损以负值列示。

单位：万元 币种：人民币

往来项目	2023年6月30日余额	占同类交易金额的比例	备注
应收款项	964.13	0.10%	应收关联人业务报酬及预付业务保证金余额等
应付款项	0.45	0.00%	应付关联人业务服务费及待付业务保证金余额
代理买卖证券款	5,482.42	0.05%	关联人存放公司的客户保证金余额
衍生金融资产	981.65	0.51%	与关联人开展衍生品交易产生的衍生金融资产余额
衍生金融负债	585.67	0.45%	与关联人开展衍生品交易产生的衍生金融负债余额
交易性金融负债	8.70	0.00%	与关联人开展衍生品交易产生的交易性金融负债余额

另外，部分证券公司等关联法人作为合格交易对手方与公司开展现券买卖交易，报告期内累计成交金额 142.37 亿元。

(二) 资产收购或股权收购、出售发生的关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

4、涉及业绩约定的，应当披露报告期内的业绩实现情况

适用 不适用

(三) 共同对外投资的重大关联交易

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

(四) 关联债权债务往来

1、已在临时公告披露且后续实施无进展或变化的事项

适用 不适用

2、已在临时公告披露，但有后续实施的进展或变化的事项

适用 不适用

3、临时公告未披露的事项

适用 不适用

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

适用 不适用

(六) 其他重大关联交易

适用 不适用

(七) 其他

共同参与投资设立上海海通引领区产业引导母基金合伙企业（有限合伙）

公司全资子公司海通开元作为基金管理人，与公司的关联人国盛集团、中国太平洋保险（集团）股份有限公司共同参与设立上海海通引领区产业引导母基金合伙企业（有限合伙）。海通引领区产业基金的形式为有限合伙企业，认缴出资总额为人民币 40 亿元，公司及有关关联法人 / 关连人士的认缴出资情况列示如下：

单位：人民币万元

公司及关联 / 连方	关联 / 连关系说明	认缴出资金额	备注
海通开元投资有限公司	公司全资子公司	130,000	普通合伙人
上海国盛集团	公司关联法人、关连人士	80,000	有限合伙人
中国太平洋保险（集团）股份有限公司	公司关联法人	30,000	有限合伙人

根据《香港联交所上市规则》和《上交所上市规则》的规定，上述交易构成本公司之关联 / 连交易，需提交公司董事会审议并披露关联 / 连交易的相关情况。

此次关联 / 连交易的具体情况参见公司 2023 年 6 月 22 日于上海证券交易所披露的公告《关于公司全资子公司参与设立基金暨关联交易的公告》以及香港联交所披露的公告《关连交易 成立合伙企业》。

十一、重大合同及其履行情况

(一) 托管、承包、租赁事项

适用 不适用

(二) 报告期内履行的及尚未履行完毕的重大担保情况

单位：元 币种：人民币

公司对外担保情况（不包括对子公司的担保）	
报告期内担保发生额合计（不包括对子公司的担保）	-
报告期末担保余额合计（A）（不包括对子公司的担保）	-
公司对子公司的担保情况	
报告期内对子公司担保发生额合计	6,800,000,000
报告期末对子公司担保余额合计（B）	21,587,773,400
公司担保总额情况（包括对子公司的担保）	
担保总额（A+B）	21,587,773,400
担保总额占公司净资产的比例（%）	12.00
其中：	
为股东、实际控制人及其关联方提供担保的金额（C）	-
直接或间接为资产负债率超过 70% 的被担保对象提供的债务担保金额（D）	18,587,773,400
担保总额超过净资产 50% 部分的金额（E）	-
上述三项担保金额合计（C+D+E）	18,587,773,400
未到期担保可能承担连带清偿责任说明	

担保情况说明

1. 2022年10月28日,公司召开第七届董事会第三十三次会议,审议通过了《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》,同意公司为在境外的全资子公司海通国际控股有限公司及其全资附属公司境外债务融资(包括但不限于发行境外债券、中长期商业借款及其他符合监管要求的融资方式)提供连带责任保证担保,担保金额不超过10亿美元债务融资本金(含10亿美元或等值其他币种)、利息、借款人应当承担的其他费用等,担保期限不超过7年(含7年)。

公司于2023年4月20日签署《担保协议》,为公司境外全资附属公司Haitong International Finance Holdings Limited发行金额为40亿元人民币、于2026年到期的债券提供连带责任保证担保。

公司于2023年5月18日签署《担保协议》,为公司境外全资附属公司Haitong International Finance Holdings Limited发行金额为28亿元人民币、于2026年到期的债券提供连带责任保证担保。

2. 2021年3月30日,公司召开第七届董事会第十五次会议,审议通过了《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》,同意公司为在境外的全资子公司海通银行Haitong Bank,S.A.或其附属公司境外债券融资提供连带责任保证担保,担保金额不超过7.5亿欧元债务融资本金(含7.5亿欧元或等值其他币种)、利息、借款人应当承担的其他费用等,担保期限不超过9年(含9年)。

公司于2022年2月8日签署《担保函》,为公司境外全资附属公司海通银行发行金额为2.3亿欧元、于2025年到期的欧元债券提供连带责任保证担保。

公司于2022年5月31日签署《担保协议》,为境外全资附属公司海通银行发行金额为1.5亿美元、于2027年到期的债券提供连带责任保证担保,担保期限66个月。

3. 2020年8月28日,公司召开第七届董事会第十一次会议,审议通过了《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》。同意公司为在境外的全资附属公司海通银行或其附属公司境外债务融资(包括但不限于发行境外债券、中长期商业借款及其他符合监管要求的融资方式)提供连带责任保证担保,担保金额不超过3.75亿欧元债务融资本金(含3.75亿欧元或等值其他币种)、利息、借款人应当承担的其他费用等,担保期限不超过6年(含6年)。

公司于2021年5月17日作为担保人签署《贷款协议》,为境外全资附属公司海通银行3.75亿欧元(含3.75亿欧元或等值其他货币)银团贷款提供连带责任保证担保。截止2023年6月30日,公司的该项担保责任余额为2.25亿欧元。

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

公司于2020年3月12日签署《担保协议》,为公司境外全资附属公司Haitong International Finance Holdings 2015 Limited发行金额为6.7亿美元、于2025年到期、票面利率为2.107%的美元债券,提供连带责任保证担保。

5. 公司第五届董事会第十二次会议审议通过了《关于对上海海通证券资产管理有限公司提供净资本担保承诺的议案》,董事会同意本公司随时对海通资管公司提供不超过十五亿元的净资本担保承诺,以保证其净资本保持充足。2013年6月9日,上海证监局下发《关于海通证券股份有限公司向上海海通证券资产管理有限公司出具净资本担保承诺书的无异议函》(沪证监机构字[2013]145号),同意本公司向海通资管公司提供8亿元的担保承诺。本公司扣减了8亿元净资本,并相应增加海通资管公司8亿元净资本。

2016年8月29日,公司第六届董事会第十八次会议审议通过了《关于公司为海通资管追加净资本担保承诺及对其增加注册资本的议案》,同意公司对海通资管公司追加不超过人民币40亿元的净资本担保承诺。公司为海通资管公司提供最高额度为人民币40亿元的净资本担保承诺,并承诺当海通资管公司开展业务需要现金支持时,公司将无条件在上述额度内提供现金。净资本担保承诺期限自公司董事会审议通过之日起生效。就本次净资本担保事宜,海通资管公司已获得中国证监会上海监管局出具的《关于对海通证券股份有限公司向上海海通证券资产管理有限公司出具净资本担保承诺书的无异议函》(沪证监机构字[2016]325号)。

2021年12月,公司对海通资管公司减少提供净资本担保承诺金额18亿元。就本次净资本担保减少事宜,海通资管公司已收到中国证监会上海监管局《关于对海通证券股份有限公司向上海海通证券资产管理有限公司减少提供部分净资本担保承诺事项的无异议函》(沪证监机构字[2021]532号)。截止2023年6月30日,公司对海通资管公司提供净资本担保承诺金额为人民币30亿元。

注:报告期内子公司海通银行对外担保发生额合计(不包括对子公司的担保)为52,001,841欧元,按2023年6月30日银行间外汇市场人民币汇率中间价1欧元对人民币7.8771元换算,合计为409,623,702元人民币。报告期末对外担保余额合计(不包括对子公司的担保)为171,629,284欧元,按2023年6月30日银行间外汇市场人民币汇率中间价1欧元对人民币7.8771元换算,合计为1,351,941,035元人民币。

报告期内子公司海通国际对内提供债务融资担保,担保期限按2023年6月30日中国外汇交易中心公布的人民币汇率中间价公告1港元对人民币0.92198元、1美元对人民币7.2258元、1新加坡元对人民币5.3442元换算,合计为9,087,969,120元人民币,截至报告期末,实际提贷的担保余额合计为503,516,000元人民币。

(三) 其他重大合同

适用 不适用

十二、其他重大事项的说明

1. 海通国际控股参与海通国际供股计划

2023年3月28日，公司第七届董事会第三十五次会议（临时会议）审议通过了《关于海通国际控股有限公司参与海通国际证券集团有限公司供股的议案》，同意海通国际控股参与海通国际供股计划，供股比例为每10股供3股。海通国际此次供股新发股份数量为1,796,460,483股，供股价为0.65港元/股，已发行股份总数由供股前的6,641,563,594股增加至8,438,024,077股，供股所得款项总额约为11.68亿港元，供股所得款项净额（经扣除供股的所有相关开支后）预期约为11.60亿港元。海通国际控股在此次供股中的认购股份数目为1,683,199,833股，参与供股金额约为10.94亿港元，持有股份数目由供股前的4,510,666,113股增加至6,193,865,946股，持股比例由供股前的67.92%增加至73.40%。

2. 为境外子公司境外债务融资提供维好支持额度

2023年3月30日，公司第七届董事会第三十六次会议审议通过了《关于为境外子公司境外债务融资提供维好支持额度的议案》，同意公司为境外全资子公司海通国际控股、境外控股子公司海通国际及上述两个主体的全资附属公司境外债务融资提供不超过160亿（含）港币（或等值币种）的维好支持额度，维好期限不超过5年（含）。

3. 向海通期货及其全资子公司提供借款

2023年4月28日，公司第七届董事会第三十七次会议审议通过了《关于向子公司提供借款的议案》，同意公司向海通期货及其全资子公司提供借款。

4. 完成恒信金融集团股权架构调整

2021年11月30日，公司第七届董事会第二十一次会议审议通过了《关于调整海通恒信金融集团有限公司股权架构的议案》，拟将恒信金融集团由全资二级子公司变更为全资一级子公司。2023年8月17日，股权转让事项经香港税务局审核后正式生效，恒信金融集团于当日同步完成股东名册变更，恒信金融集团已由公司直接全资持有。

第七节 股份变动及股东情况

一、股本变动情况

(一) 股份变动情况表

1、股份变动情况表

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

2、股份变动情况说明

适用 不适用

报告期内，公司无股份变动情况。

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

适用 不适用

4、公司认为必要或证券监管机构要求披露的其他内容

适用 不适用

(二) 限售股份变动情况

单位：股

股东名称	期初限售股数	报告期解除限售股数	报告期增加限售股数	报告期末限售股数	限售原因	解除限售日期
上海国盛（集团）有限公司	781,250,000	0	0	781,250,000	非公开发行股份限售	2024 年 8 月 5 日
合计	781,250,000	0	0	781,250,000	/	/

二、股东情况

(一) 股东总数：

截至报告期末普通股股东总数（户）	263,998
	（其中 A 股 263,851；H 股 147）

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

单位：股

前十名股东持股情况							
股东名称（全称）	报告期内增减	期末持股数量	比例（%）	持有有限售条件股份数量	质押、标记或冻结情况		股东性质
					股份状态	数量	
香港中央结算（代理人）有限公司	-16,000	3,408,714,695	26.09	0	未知	-	境外法人
上海国盛（集团）有限公司	-	862,489,059	6.60	781,250,000	无	0	国有法人
上海海烟投资管理有限公司	-	635,084,623	4.86	0	无	0	国有法人
光明食品（集团）有限公司	5,560,000	480,275,000	3.68	0	无	0	国有法人
上海电气控股集团有限公司	-260,000	344,236,418	2.63	0	无	0	国家
申能（集团）有限公司	-	322,162,086	2.47	0	无	0	国有法人
中国证券金融股份有限公司	-	258,104,024	1.98	0	无	0	其他
上海国盛集团资产有限公司	-	238,382,008	1.82	0	无	0	国有法人
上海久事（集团）有限公司	-	235,247,280	1.80	0	无	0	国有法人
中国建设银行股份有限公司 - 国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	15,852,069	216,632,400	1.66	0	无	0	其他

前十名无限售条件股东持股情况			
股东名称	持有无限售条件流通股的数量	股份种类及数量	
		种类	数量
香港中央结算（代理人）有限公司	3,408,714,695	境外上市外资股	3,408,714,695
上海海烟投资管理有限公司	635,084,623	人民币普通股	635,084,623
光明食品（集团）有限公司	480,275,000	人民币普通股	480,275,000
上海电气控股集团有限公司	344,236,418	人民币普通股	344,236,418
申能（集团）有限公司	322,162,086	人民币普通股	322,162,086
中国证券金融股份有限公司	258,104,024	人民币普通股	258,104,024
上海国盛集团资产有限公司	238,382,008	人民币普通股	238,382,008
上海久事（集团）有限公司	235,247,280	人民币普通股	235,247,280
中国建设银行股份有限公司 - 国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	216,632,400	人民币普通股	216,632,400
上海百联集团股份有限公司	214,471,652	人民币普通股	214,471,652
前十名股东中回购专户情况说明	-		
上述股东委托表决权、受托表决权、放弃表决权的说明	-		
上述股东关联关系或一致行动的说明		上海国盛集团资产有限公司为上海国盛（集团）有限公司的全资子公司，此外，未知其他股东之间是否存在关联关系，也未知是否属于《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人。	
表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明	-		

注：

1. 人民币普通股（A股）股东性质为股东在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记的账户性质。
2. 上表中，境外上市外资股为H股。本公司H股股东中，非登记股东的股份由香港中央结算（代理人）有限公司代为持有。
3. 上海国盛集团及其全资子公司上海国盛集团资产有限公司持有本公司A股和H股共计135,632.75万股，占公司总股本的10.38%；上海电气控股集团有限公司持有本公司A股和H股共计64,689.88万股，占公司总股本的4.95%。
4. 因公司股票为融资融券标的证券，股东持股数量按照其通过普通证券账户、信用证券账户持有的股票及权益数量合并计算。

前十名有限售条件股东持股数量及限售条件

单位：股

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

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

（三）主要股东及其他人士于股份及相关股份拥有的权益及淡仓

于2023年6月30日，据本公司董事合理查询所知，以下人士（并非本公司董事、监事或最高行政人员）于股份及相关股份中，拥有根据《证券及期货条例》第XV部第2及第3分部须向本公司披露并根据《证券及期货条例》第336条已记录于本公司须存置的登记册内的权益或淡仓：

序号	主要股东名称	股份类别	权益性质	持有的股份数目（股）	占本公司已发行股份总数的比例（%）	占本公司已发行A股/H股总数的比例（%）	好仓（注3）/淡仓（注4）/可供借出的股份
1.	Maunakai Capital Partners (Hong Kong) Limited	H股	投资经理	272,590,000	2.09	7.99	好仓
2.	BSA Strategic Fund I	H股	实益拥有人	272,590,000	2.09	7.99	好仓
3.	史静	H股	酌情信托的成立人	228,000,000	1.75	6.69	好仓
4.	Wickhams Cay Trust Company Limited	H股	受托人（注1）	228,000,000	1.75	6.69	好仓
5.	Abhaya Limited	H股	受控制的法团的权益（注1）	228,000,000	1.75	6.69	好仓
6.	Heyday Trend Limited	H股	实益拥有人（注1）	228,000,000	1.75	6.69	好仓
7.	上海国盛（集团）有限公司（注5）	H股	实益拥有人	241,206,000	1.85	7.07	好仓
		A股	实益拥有人	1,100,871,067	8.43	11.40	好仓
8.	上海电气控股集团有限公司	H股	实益拥有人及受控制的法团的权益（注2）	307,409,200	2.35	9.02	好仓
9.	中国烟草总公司	A股	实益拥有人	635,084,623	4.86	6.58	好仓

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

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

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

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

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

除上述披露外，于 2023 年 6 月 30 日，本公司并不知悉任何其他人士（本公司董事、监事及最高行政人员除外）于本公司股份或相关股份中拥有根据《证券及期货条例》第 336 条规定须记录于登记册内之权益或淡仓。

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

于 2023 年 6 月 30 日，就本公司所获得的资料及据董事所知，概无本公司董事、监事或最高行政人员在本公司或其相关法团（定义见《证券及期货条例》第 XV 部）的股份、相关股份或债权证中拥有根据《证券及期货条例》第 XV 部第 7 及 8 分部须通知本公司及香港联交所的权益及淡仓（包括根据《证券及期货条例》的该等条文被当作或视为拥有的权益或淡仓），或根据《证券及期货条例》第 352 条规定须在存置之权益登记册中记录，或根据《标准守则》的规定需要通知本公司和香港联交所之权益或淡仓。

（四）战略投资者或一般法人因配售新股成为前 10 名股东

适用 不适用

三、董事、监事和高级管理人员情况

（一）现任及报告期内离任董事、监事和高级管理人员持股变动情况

适用 不适用

（二）董事、监事、高级管理人员报告期内被授予的股权激励情况

适用 不适用

（三）其他说明

适用 不适用

四、控股股东或实际控制人变更情况

适用 不适用

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

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

五、购回、出售或赎回上市证券

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

第八节 债券相关情况

一、企业债券、公司债券和非金融企业债务融资工具

(一) 企业债券

适用 不适用

(二) 公司债券

1、公司债券基本情况

以下为公司在半年度报告批准报出日存续的公司债券情况。

单位：亿元 币种：人民币

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券 余额	利率 (%)	还本付 息方式	交易 场所	投资者 适当性安排 (如有)	交易机制	是否存 在终止 上市交 易的 风险
2013年公司 债券(第一期) (10年期)	13海 通03	122282	2013/11/25	2013/11/25	2023/11/25	23.9	6.18	单利按 年计息	上交所	社会公众投 资者、机构 投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
2013年公司 债券(第二期) (10年期)	13海 通06	122313	2014/7/14	2014/7/14	2024/7/14	8	5.85	单利按 年计息	上交所	社会公众投 资者、机构 投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向合格投资 者公开发行 2017年公司 债券(第二期)	17海 通03	143301	2017/9/20	2017/9/22	2027/9/22	55	4.99	单利按 年计息	上交所	合格投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向专业投资 者公开发行 2020年公司 债券(第一期) (品种二)	20海 通05	163508	2020/4/29	2020/4/30	2025/4/30	7	2.88	单利按 年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向专业投资 者公开发行 2020年公司 债券(第三期)	20海 通08	163903	2020/8/10	2020/8/11	2023/8/11	-	3.53	单利按 年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向专业投资 者公开发行 2021年公司 债券(第一期)	21海 通01	175630	2021/1/12	2021/1/13	2024/1/13	60	3.58	单利按 年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向专业投资 者公开发行 2021年公司 债券(第二期)	21海 通02	175741	2021/2/5	2021/2/8	2024/2/8	54	3.79	单利按 年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向专业投资 者公开发行 2021年公司 债券(第三期)	21海 通03	175975	2021/4/22	2021/4/23	2024/4/23	50	3.45	单利按 年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向专业投资 者公开发行 2021年公司 债券(第四期)	21海 通04	188150	2021/5/26	2021/5/27	2024/5/27	28	3.35	单利按 年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向专业投资 者公开发行 2021年公司 债券(第五期)	21海 通05	188202	2021/6/9	2021/6/10	2024/6/10	21	3.40	单利按 年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券 余额	利率 (%)	还本付 息方式	交易 场所	投资者 适当性安排 (如有)	交易机制	是否存 在终止 上市交 易的 风险
面向专业投资者公开发行 2021年公司 债券(第六期) (品种二)	21海 通06	188458	2021/7/28	2021/7/29	2024/7/29	20	3.14	单利按 年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向专业投资者公开发行 2021年公司 债券(第七期)	21海 通07	188571	2021/8/19	2021/8/20	2024/8/20	30	3.04	单利按 年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向专业投资者公开发行 2021年公司 债券(第八期) (品种一)	21海 通08	188663	2021/8/27	2021/8/30	2024/8/30	20	3.10	单利按 年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向专业投资者公开发行 2021年公司 债券(第八期) (品种二)	21海 通09	188664	2021/8/27	2021/8/30	2026/8/30	20	3.43	单利按 年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向专业投资者公开发行 2021年公司 债券(第九期)	21海 通10	188962	2021/11/9	2021/11/10	2024/11/10	50	3.10	单利按 年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
面向专业投资者公开发行 2021年公司 债券(第十期)	21海 通11	185010	2021/11/19	2021/11/22	2024/11/22	50	3.09	单利按 年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
2022年面向 专业投资者公 开发行次级债 券(第一期)	22海 通C1	185219	2022/1/11	2022/1/12	2025/1/12	50	3.18	单利按 年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
2022年面向 专业投资者公 开发行公司债 券(第一期)	22海 通01	185285	2022/1/19	2022/1/20	2024/12/25	50	2.84	单利按 年计息, 到期一 次还本 付息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
2022年面向 专业投资者公 开发行公司债 券(第二期)	22海 通02	185359	2022/2/17	2022/2/21	2025/2/21	29	2.90	单利按 年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
2022年面向 专业投资者公 开发行次级债 券(第二期)	22海 通C2	185400	2022/2/24	2022/2/25	2025/2/25	20	3.15	单利按 年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
2022年面向 专业投资者公 开发行公司债 券(第三期)	22海 通03	185448	2022/3/4	2022/3/7	2025/3/7	5	3.03	单利按 年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
2022年面向 专业投资者公 开发行次级债 券(第三期)	22海 通C3	185472	2022/3/8	2022/3/9	2025/3/9	24.8	3.29	单利按 年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否
2022年面向 专业投资者公 开发行公司债 券(第四期)	22海 通04	137555	2022/7/25	2022/7/26	2025/7/26	50	2.75	单利按 年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、 询价和协议 交易	否

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券 余额	利率 (%)	还本付 息方式	交易 场所	投资者 适当性安排 (如有)	交易机制	是否存 在终止 上市交 易的 风险
2022年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第五期)	22海通05	137799	2022/9/8	2022/9/9	2025/9/9	50	2.53	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2022年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第六期)	22海通06	137904	2022/10/13	2022/10/14	2025/10/14	47	2.60	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2022年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第七期)	22海通07	138571	2022/11/9	2022/11/10	2025/11/10	30	2.61	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2022年面向专业机构投资者公开发行绿色公司债券(专项用于碳中和)(第一期)	GC海通01	138623	2022/12/12	2022/12/13	2023/12/20	27	2.90	到期一次还本付息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第一期)(品种一)	23海通01	138869	2023/2/7	2023/2/8	2025/2/8	25	2.95	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第一期)(品种二)	23海通02	138870	2023/2/7	2023/2/8	2026/2/8	30	3.23	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第二期)(品种一)	23海通03	115003	2023/3/3	2023/3/6	2025/3/6	25	3.11	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第二期)(品种二)	23海通04	115004	2023/3/3	2023/3/6	2026/3/6	17	3.26	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第三期)(品种一)	23海通05	115104	2023/3/21	2023/3/22	2025/3/22	33	2.97	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第三期)(品种二)	23海通06	115105	2023/3/21	2023/3/22	2026/3/22	27	3.10	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第四期)(品种一)	23海通07	115272	2023/4/21	2023/4/24	2025/4/24	20	2.89	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否

债券名称	简称	代码	发行日	起息日	到期日	债券余额	利率 (%)	还本付息方式	交易场所	投资者适当性安排 (如有)	交易机制	是否存在终止上市交易的风险
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第四期)(品种二)	23海通08	115273	2023/4/21	2023/4/24	2026/4/24	40	3.05	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第五期)(品种一)	23海通09	115362	2023/5/17	2023/5/18	2026/5/18	36	2.94	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第五期)(品种二)	23海通10	115363	2023/5/17	2023/5/18	2028/5/18	14	3.10	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第六期)(品种一)	23海通11	115487	2023/6/14	2023/6/15	2026/6/15	30	2.73	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第六期)(品种二)	23海通12	115488	2023/6/14	2023/6/15	2028/6/15	20	3.07	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第七期)(品种一)	23海通13	115618	2023/7/24	2023/7/25	2026/7/25	20	2.72	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第七期)(品种二)	23海通14	115619	2023/7/24	2023/7/25	2028/7/25	27	3.05	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否
2023年面向专业机构投资者公开发行公司债券(第八期)	23海通15	155828	2023/8/17	2023/8/18	2026/8/18	32	2.67	单利按年计息	上交所	专业投资者	竞价、报价、询价和协议交易	否

报出日前，20海通08已兑付。

公司对债券终止上市交易风险的应对措施

适用 不适用

逾期未偿还债券

适用 不适用

关于逾期债项的说明

适用 不适用

2、发行人或投资者选择权条款、投资者保护条款的触发和执行情况

适用 不适用

3、信用评级结果调整情况

适用 不适用

其他说明

无。

4、担保情况、偿债计划及其他偿债保障措施在报告期内的执行和变化情况及影响

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

其他说明

未发生变更。

5、公司债券其他情况的说明

(1) 为公司债券发行及存续期业务提供服务的中介机构

中介机构名称	办公地址	签字会计师姓名	联系人	联系电话
中信证券股份有限公司	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 22、23 层	-	聂磊、祁继华	010-60838888
中信建投证券股份有限公司	北京市东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 2 层	-	耿华	010-65608396
国信证券股份有限公司	北京市西城区金融大街兴盛街 6 号国信证券大厦四层	-	郭睿、何俊贤	010-88005384
申万宏源证券有限公司	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层	-	段亚平	021-33389706
普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼	许康玮、刘伟	许康玮	021-23238888
德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市延安东路 222 号外滩中心 21 楼	胡小骏、宫明亮	胡小骏	021-61412068
上海市锦天城律师事务所	上海市浦东新区银城中路 501 号上海中心大厦 11、12 层	-	肖文艳	021-20511000
中诚信国际信用评级有限责任公司	北京市东城区南竹杆胡同 2 号 1 幢 60101	-	乔爽	010-66428877

上述中介机构发生变更的情况:

因债券到期兑付,中介机构比上年末减少两家,系“主承销商”兴业证券股份有限公司和民生证券股份有限公司。

(2) 公司债券报告期内募集资金使用情况

单位：亿元 币种：人民币

债券名称	募集资金总金额	已使用金额	未使用金额	募集资金专项账户 运作情况 (如有)	募集资金违规使用 的整改情况 (如有)	是否与募集说明书 承诺的用途、 使用计划及其他 约定一致
2023年面向专业机构投资者 公开发行公司债券 (第一期) (品种一)	25	25	0	无	无	是
2023年面向专业机构投资者 公开发行公司债券 (第一期) (品种二)	30	30	0	无	无	是
2023年面向专业机构投资者 公开发行公司债券 (第二期) (品种一)	25	25	0	无	无	是
2023年面向专业机构投资者 公开发行公司债券 (第二期) (品种二)	17	17	0	无	无	是
2023年面向专业机构投资者 公开发行公司债券 (第三期) (品种一)	33	33	0	无	无	是
2023年面向专业机构投资者 公开发行公司债券 (第三期) (品种二)	27	27	0	无	无	是
2023年面向专业机构投资者 公开发行公司债券 (第四期) (品种一)	20	20	0	无	无	是
2023年面向专业机构投资者 公开发行公司债券 (第四期) (品种二)	40	40	0	无	无	是
2023年面向专业机构投资者 公开发行公司债券 (第五期) (品种一)	36	36	0	无	无	是
2023年面向专业机构投资者 公开发行公司债券 (第五期) (品种二)	14	14	0	无	无	是
2023年面向专业机构投资者 公开发行公司债券 (第六期) (品种一)	30	30	0	无	无	是
2023年面向专业机构投资者 公开发行公司债券 (第六期) (品种二)	20	20	0	无	无	是

(三) 其他债券

单位：亿元 币种：见明细表

债券名称	简称	代码	债券余额	利率 (%)	发行日期	兑付日期	还本付息方式	交易场所
金融债 (境外)	海通证券 4.5% B2023	5482	3 亿美元	4.50	2018/12/13	2023/12/13	单利按半年计息	香港联交所
金融债 (境外)	海通证券 FRN B2023	5483	2.3 亿欧元	3M EURIBOR +1.65	2018/12/13	2023/12/13	单利按季计息	香港联交所

(四) 银行间债券市场非金融企业债务融资工具

适用 不适用

(五) 公司报告期内合并报表范围亏损超过上年末净资产 10%

适用 不适用

(六) 主要会计数据和财务指标

单位：亿元 币种：人民币

主要指标	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减(%)	变动原因
流动比率	2.17	1.94	11.86	-
速动比率	2.17	1.94	11.86	-
资产负债率(%)	72.00	72.16	-0.22	-
	本报告期(1-6月)	上年同期	本报告期比上年同期增减(%)	变动原因
扣除非经常性损益后净利润	32.12	42.35	-24.14	-
EBITDA 全部债务比	0.03	0.03	-	-
利息保障倍数	1.69	1.97	-14.21	-
现金利息保障倍数	-0.10	4.44	-102.25	经营活动产生的现金流量净额减少
EBITDA 利息保障倍数	1.80	2.09	-13.87	-
贷款偿还率(%)	100	100	-	-
利息偿付率(%)	100	100	-	-

注：扣除非经常性损益的净利润即归属于母公司股东的扣除非经常性损益的净利润。

二、可转换公司债券情况

适用 不适用

第九节 财务报告

审阅报告

普华永道中天阅字 (2023) 第 0055 号

海通证券股份有限公司全体股东：

我们审阅了后附的海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）的中期财务报表，包括 2023 年 6 月 30 日的合并及公司资产负债表，截至 2023 年 6 月 30 日止六个月期间的中期合并及公司利润表、合并及公司股东权益变动表和合并及公司现金流量表以及中期财务报表附注。按照《企业会计准则第 32 号—中期财务报告》的规定编制中期财务报表是海通证券管理层的责任，我们的责任是在实施审阅工作的基础上对中期财务报表出具审阅报告。

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

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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册会计师

许康玮

注册会计师

王以彬

中国·上海市

2023 年 8 月 30 日

合并及公司资产负债表

2023年6月30日

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

资产	附注五	合并		附注十五	母公司	
		2023年6月30日 (未经审计)	2022年12月31日 (经审计)		2023年6月30日 (未经审计)	2022年12月31日 (经审计)
资产：						
货币资金	1	167,650,291,602.79	158,580,169,366.67		97,541,316,692.66	94,195,714,055.50
其中：客户存款		99,893,842,379.50	98,970,479,371.57		59,603,982,655.42	57,609,295,872.92
结算备付金	2	18,566,286,644.34	21,380,695,420.73		26,515,365,044.32	31,643,792,015.11
其中：客户备付金		12,146,852,465.30	10,476,841,294.70		10,350,001,391.42	9,265,947,457.08
拆出资金		65,128,171.04	274,444,523.06		-	-
融出资金	3	66,419,987,586.89	67,843,870,816.38		57,321,937,475.82	56,840,361,604.00
衍生金融资产	4	1,932,424,586.80	1,477,167,315.05		1,338,508,372.05	869,903,399.60
存出保证金	5	21,667,484,375.17	22,864,574,405.46		4,782,448,609.25	6,187,577,011.98
应收款项	6	9,988,638,026.50	10,394,514,867.70		4,164,502,012.41	4,490,816,958.87
买入返售金融资产	7	41,104,588,898.59	32,645,149,033.49		35,026,908,528.35	26,639,893,553.23
金融投资：						
交易性金融资产	8	208,937,410,147.68	209,598,729,439.75		138,917,910,616.90	139,953,515,347.47
债权投资	9	7,570,911,751.00	5,806,156,944.34		-	-
其他债权投资	10	46,052,751,650.68	52,851,898,948.27		43,954,266,842.86	50,658,485,366.14
其他权益工具投资	11	7,468,695,645.78	6,096,318,840.12		6,789,988,561.13	5,361,534,796.02
应收融资租赁款	12	17,997,213,319.94	19,458,452,903.05		-	-
长期应收款	12	87,170,113,517.24	84,549,952,480.38		-	-
长期股权投资	13	7,298,898,164.79	7,013,713,624.88	1	39,809,950,266.51	39,799,909,184.68
投资性房地产	14	2,718,465,832.64	2,641,589,533.64		12,544,040.83	13,081,299.31
固定资产	15	16,275,343,440.44	16,098,669,846.45		7,658,866,661.09	7,512,856,147.29
在建工程	16	218,943,499.40	465,704,960.23		91,578,567.43	347,796,396.75
无形资产	17	1,275,196,011.91	1,270,854,646.95		394,878,264.05	363,429,650.20
使用权资产	18	1,016,712,813.72	984,539,724.88		508,233,603.32	492,977,773.78
商誉	19	3,794,196,893.00	3,676,231,096.22		-	-
递延所得税资产	20	4,553,890,906.15	4,711,680,014.57		1,378,889,038.15	1,640,204,084.93
其他资产	21	22,648,091,696.36	22,924,226,206.90		4,024,983,841.50	4,993,842,280.00
资产总计		762,391,665,182.85	753,609,304,959.17		470,233,077,038.63	472,005,690,924.86

合并及公司资产负债表 (续)

2023年6月30日

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

负债和股东权益	附注五	合并		附注十五	母公司	
		2023年6月30日 (未经审计)	2022年12月31日 (经审计)		2023年6月30日 (未经审计)	2022年12月31日 (经审计)
负债：						
短期借款	25	35,051,068,398.84	34,858,042,732.67		-	-
应付短期融资款	26	12,985,279,819.13	16,159,094,370.29		4,582,225,745.79	7,211,239,604.08
拆入资金	27	9,022,891,869.78	6,276,101,144.00		6,757,246,111.12	3,031,458,333.33
交易性金融负债	28	22,521,256,625.55	22,888,479,844.59		16,890,889,459.36	18,834,648,459.91
衍生金融负债	4	1,305,590,839.36	898,418,550.84		1,439,579,494.27	738,107,811.95
卖出回购金融资产款	29	83,066,644,832.97	101,694,356,537.25		71,342,525,885.81	93,412,806,373.46
代理买卖证券款	30	119,909,488,360.94	115,513,463,366.21		72,754,140,055.78	69,201,352,190.36
代理承销证券款		18,232,500.00	13,500,000.00		18,232,500.00	13,500,000.00
应付职工薪酬	31	4,179,650,625.72	4,485,010,758.39		2,193,554,397.62	2,351,788,209.09
应交税费	32	1,179,744,363.42	2,197,807,712.24		278,459,833.24	205,281,487.65
应付款项	33	13,444,503,709.75	11,490,826,596.82		7,993,105,652.64	5,895,153,043.63
合同负债		107,695,570.93	25,968,623.86		-	-
预计负债	34	209,497,934.14	201,705,446.68		-	-
长期借款	35	51,820,794,725.46	55,958,202,723.56		-	-
应付债券	36	205,204,445,765.41	181,830,917,563.00		132,321,927,871.29	121,049,533,559.49
租赁负债	18	1,049,508,104.08	1,015,700,455.81		499,451,024.32	486,734,503.30
递延所得税负债	20	1,016,600,891.30	909,458,907.22		-	-
其他负债	37	20,430,238,443.79	19,570,192,008.60		3,290,964,291.69	528,304,450.41
负债合计		582,523,133,380.57	575,987,247,342.03		320,362,302,322.93	322,959,908,026.66
股东权益：						
股本	38	13,064,200,000.00	13,064,200,000.00		13,064,200,000.00	13,064,200,000.00
资本公积	39	75,809,658,507.08	75,007,558,592.52		74,709,020,563.14	74,709,020,563.14
其他综合收益	40	(1,031,099,996.71)	(1,617,313,221.53)		(110,561,454.13)	(393,603,061.50)
盈余公积	41	9,656,101,246.57	9,656,101,246.57		9,656,101,246.57	9,656,101,246.57
一般风险准备	42	21,835,231,082.37	21,782,272,819.21		19,312,202,493.14	19,312,202,493.14
未分配利润	43	47,685,543,677.78	46,699,136,993.48		33,239,811,866.98	32,697,861,656.85
归属于母公司股东权益合计		167,019,634,517.09	164,591,956,430.25		149,870,774,715.70	149,045,782,898.20
少数股东权益		12,848,897,285.19	13,030,101,186.89		-	-
股东权益合计		179,868,531,802.28	177,622,057,617.14		149,870,774,715.70	149,045,782,898.20
负债和股东权益总计		762,391,665,182.85	753,609,304,959.17		470,233,077,038.63	472,005,690,924.86

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

第 78 页至第 183 页的财务报表由下列负责人签署：

周杰	张信军	马中
_____ 法定代表人	_____ 主管会计工作负责人	_____ 会计机构负责人

合并及公司利润表

2023年1-6月

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	合并			母公司		
	附注五	本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)	附注十五	本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)
一、营业总收入		16,968,366,973.04	12,104,350,296.48		7,285,907,605.02	7,964,467,555.84
手续费及佣金净收入	44	4,940,568,989.46	6,140,680,386.57	2	3,543,881,582.10	4,335,306,867.71
其中：经纪业务手续费净收入		1,971,925,520.74	2,474,007,654.92		1,721,378,711.90	2,064,117,835.34
投资银行业务手续费净收入		1,949,290,370.16	2,434,751,965.24		1,753,920,625.71	2,143,973,926.93
资产管理业务手续费净收入		932,465,708.29	1,086,471,873.13		-	-
利息净收入	45	2,184,402,807.96	3,088,087,983.84	3	1,211,799,389.53	1,265,789,633.60
其中：金融资产利息收入		9,320,529,028.84	8,258,455,027.52		4,741,396,853.52	4,808,806,134.02
融资租赁收入		781,924,708.86	1,280,942,435.03		-	-
利息支出		(7,918,050,929.74)	(6,451,309,478.71)		(3,529,597,463.99)	(3,543,016,500.42)
投资收益	46	3,718,096,492.65	(362,282,684.28)	4	1,926,025,118.37	(778,809,826.56)
其中：对联营企业和合营企业的投资收益		479,771,270.73	303,592,418.25		295,914,926.63	311,694,737.85
其他收益	47	792,742,726.68	721,755,618.98		403,723,855.91	463,248,025.00
公允价值变动收益	48	48,516,768.26	1,358,310,150.74	5	381,397,252.22	2,724,051,391.96
汇兑损失		(205,419,634.21)	(297,909,682.71)		(186,113,715.01)	(49,466,656.40)
其他业务收入	49	5,489,305,835.61	1,494,134,804.58		4,967,542.46	4,345,764.28
资产处置收益/(损失)		152,986.63	(38,426,281.24)		226,579.44	2,356.25
二、营业总支出		11,802,086,981.64	6,259,598,598.71		3,365,095,490.43	2,441,371,321.80
税金及附加	50	129,063,839.70	156,694,507.48		81,590,719.49	90,606,983.26
业务及管理费	51	5,695,858,828.97	5,256,123,649.22	6	3,248,664,360.21	3,028,928,171.11
信用减值损失	52	1,203,824,441.24	178,662,978.58		34,303,152.25	(678,701,091.05)
其他资产减值损失		9,877,840.94	25,910,800.78		-	-
其他业务成本	53	4,763,462,030.79	642,206,662.65		537,258.48	537,258.48
三、营业利润		5,166,279,991.40	5,844,751,697.77		3,920,812,114.59	5,523,096,234.04
加：营业外收入	54	99,287,759.09	54,133,555.55		14,311,030.13	24,538,322.36
减：营业外支出	55	13,843,302.68	12,820,668.68		11,251,835.33	10,645,498.61
四、利润总额		5,251,724,447.81	5,886,064,584.64		3,923,871,309.39	5,536,989,057.79
减：所得税费用	56	1,326,992,645.72	1,420,703,701.27		598,272,292.61	1,027,303,243.47
五、净利润		3,924,731,802.09	4,465,360,883.37		3,325,599,016.78	4,509,685,814.32
(一) 按经营持续性分类：						
1. 持续经营净利润		3,924,731,802.09	4,465,360,883.37		3,325,599,016.78	4,509,685,814.32
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		3,829,634,781.60	4,757,725,335.07		3,325,599,016.78	4,509,685,814.32
2. 少数股东损益		95,097,020.49	(292,364,451.70)		-	-

合并及公司利润表 (续)

2023年1-6月

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	合并			母公司		
	附注五	本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)	附注十五	本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)
六、其他综合收益的税后净额		795,560,056.64	58,198,289.07		242,874,800.72	(551,507,125.92)
归属于母公司股东的其他综合收益的税后净额		551,978,256.34	(882,374,185.94)		242,874,800.72	(551,507,125.92)
(一) 不能重分类进损益的其他综合收益		58,291,960.75	(673,928,088.48)		41,850,695.17	(601,179,617.70)
1. 重新计量设定受益计划变动额		(2,265,927.31)	55,465,679.89		-	-
2. 其他权益工具投资公允价值变动		60,557,888.06	(729,393,768.37)		41,850,695.17	(601,179,617.70)
(二) 将重分类进损益的其他综合收益		493,686,295.59	(208,446,097.46)		201,024,105.55	49,672,491.78
1. 权益法下可转损益的其他综合收益		2,986,155.20	4,365,114.58		2,986,155.20	4,365,114.58
2. 其他债权投资公允价值变动		245,048,485.52	38,171,582.84		234,729,644.60	80,236,564.75
3. 其他债权投资信用损失准备		(28,194,730.21)	(42,617,744.92)		(36,691,694.25)	(34,929,187.55)
4. 现金流量套期储备		46,582,152.62	33,598,149.21		-	-
5. 外币财务报表折算差额		227,264,232.46	(241,963,199.17)		-	-
归属于少数股东的其他综合收益的税后净额		243,581,800.30	940,572,475.01		-	-
七、综合收益总额		4,720,291,858.73	4,523,559,172.44		3,568,473,817.50	3,958,178,688.40
归属于母公司股东的综合收益总额		4,381,613,037.94	3,875,351,149.13		3,568,473,817.50	3,958,178,688.40
归属于少数股东的综合收益总额		338,678,820.79	648,208,023.31		-	-
八、每股收益：						
(一) 基本每股收益 (元/股)		0.29	0.36		-	-
(二) 稀释每股收益 (元/股)		0.29	0.36		-	-

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

周杰

法定代表人

张信军

主管会计工作负责人

马中

会计机构负责人

合并及公司现金流量表

2023年1-6月

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	合并			母公司		
	附注五	本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)	附注十五	本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)
一、经营活动(使用)/产生的现金流量:						
收取利息、手续费及佣金的现金		12,548,486,872.67	14,194,729,654.65		8,717,408,703.13	9,885,958,143.78
为交易目的而持有的金融资产净减少额		5,931,017,211.27	20,276,363,076.85		3,652,340,665.08	23,729,654,873.43
拆入资金净增加额		2,931,754,889.53	-		3,700,000,000.00	-
融出资金净减少额		894,483,092.29	5,097,014,619.57		-	7,035,108,335.08
代理买卖证券收到的现金净额		4,358,453,331.21	6,389,401,344.80		3,553,667,013.30	5,715,547,533.75
收到其他与经营活动有关的现金	57	11,618,107,910.63	10,000,836,650.20		3,805,553,012.20	557,562,889.49
经营活动现金流入小计		38,282,303,307.60	55,958,345,346.07		23,428,969,393.71	46,923,831,775.53
拆入资金净减少额		-	4,737,045,008.10		-	2,256,000,000.00
回购业务资金净减少额		27,055,244,203.71	13,012,414,188.56		30,387,425,386.95	15,960,630,671.02
融出资金净增加额		-	-		705,326,518.53	-
支付利息、手续费及佣金的现金		3,733,270,070.74	3,688,423,492.11		2,084,343,933.70	2,206,639,464.35
支付给职工以及为职工支付的现金		3,940,097,697.87	4,234,418,963.66		2,307,010,499.08	2,257,680,894.11
支付的各项税费		2,897,082,585.26	4,559,539,517.43		727,425,229.32	2,002,117,359.79
支付其他与经营活动有关的现金	57	11,398,801,541.86	8,412,830,462.99		1,572,419,677.44	5,277,567,704.82
经营活动现金流出小计		49,024,496,099.44	38,644,671,632.85		37,783,951,245.02	29,960,636,094.09
经营活动(使用)/产生的现金流量净额	58	(10,742,192,791.84)	17,313,673,713.22	7	(14,354,981,851.31)	16,963,195,681.44
二、投资活动产生/(使用)的现金流量:						
收回投资收到的现金		19,361,060,634.66	16,535,604,240.11		17,129,888,267.08	13,396,855,302.10
取得投资收益收到的现金		1,059,824,674.06	1,035,876,360.93		735,049,796.43	491,627,814.75
处置子公司及其他营业单位收到的现金净额		-	132,053,369.74		-	-
处置固定资产、无形资产和其他长期资产收回的现金净额		2,850,209.12	1,204,388.53		5,169,323.60	1,049,046.05
投资活动现金流入小计		20,423,735,517.84	17,704,738,359.31		17,870,107,387.11	13,889,532,162.90
投资支付的现金		14,680,185,809.59	18,297,444,190.19		11,184,346,738.66	15,065,333,416.15
购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		344,625,618.68	1,852,868,402.00		267,702,350.89	256,658,247.71
投资活动现金流出小计		15,024,811,428.27	20,150,312,592.19		11,452,049,089.55	15,321,991,663.86
投资活动产生/(使用)的现金流量净额		5,398,924,089.57	(2,445,574,232.88)		6,418,058,297.56	(1,432,459,500.96)

合并及公司现金流量表 (续)

2023年1-6月

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	合并			母公司		
	附注五	本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)	附注十五	本期发生额 (未经审计)	上期发生额 (未经审计)
三、筹资活动产生的现金流量：						
吸收投资收到的现金		64,301,720.50	-		-	-
其中：子公司吸收少数股东投资收到的现金		64,301,720.50	-		-	-
取得借款收到的现金		42,526,736,614.21	43,467,338,922.84		-	-
发行债券收到的现金		68,877,961,409.37	56,850,896,997.57		38,728,039,700.00	31,874,507,000.00
筹资活动现金流入小计		111,468,999,744.08	100,318,235,920.41		38,728,039,700.00	31,874,507,000.00
偿还债务支付的现金		94,810,967,367.70	87,529,796,495.23		30,049,692,700.00	27,670,133,000.00
分配股利、利润或偿付利息支付的现金		5,460,455,381.98	4,360,877,437.41		2,236,249,611.58	2,129,829,475.43
其中：子公司支付给少数股东的股利、利润		278,192,179.57	189,226,709.76		-	-
支付其他与筹资活动有关的现金	57	273,139,438.07	725,177,276.63		104,539,715.63	86,216,086.61
筹资活动现金流出小计		100,544,562,187.75	92,615,851,209.27		32,390,482,027.21	29,886,178,562.04
筹资活动产生的现金流量净额		10,924,437,556.33	7,702,384,711.14		6,337,557,672.79	1,988,328,437.96
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		772,761,713.21	769,430,121.90		48,107,836.94	61,764,044.15
五、现金及现金等价物净增加/(减少)额	58	6,353,930,567.27	23,339,914,313.38	7	(1,551,258,044.02)	17,580,828,662.59
加：期初现金及现金等价物余额		176,699,519,071.53	175,257,907,676.68		125,324,821,911.95	117,262,317,533.08
六、期末现金及现金等价物余额	58	183,053,449,638.80	198,597,821,990.06	7	123,773,563,867.93	134,843,146,195.67

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

周杰

法定代表人

张信军

主管会计工作负责人

马中

会计机构负责人

合并股东权益变动表

2023年1-6月

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	2023年1-6月						少数股东权益	股东权益合计
	归属于母公司股东权益							
	股本	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润		
一、2022年12月31日余额	13,064,200,000.00	75,007,558,592.52	(1,617,313,221.53)	9,656,101,246.57	21,782,272,819.21	46,699,136,993.48	13,030,101,186.89	177,622,057,617.14
二、本期增减变动金额	-	802,099,914.56	586,213,224.82	-	52,958,263.16	986,406,684.30	(181,203,901.70)	2,246,474,185.14
(一) 综合收益总额	-	-	551,978,256.34	-	-	3,829,634,781.60	338,678,820.79	4,720,291,858.73
(二) 股东投入和减少资本	-	802,099,914.56	-	-	-	(12,545,349.52)	(241,690,542.92)	547,864,022.12
1. 股东投入的普通股	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 其他权益工具持有者投入资本	-	-	-	-	-	-	-	480,000,000.00
3. 股份支付计入股东权益的金额	-	542,948.13	-	-	-	-	-	4,755,202.55
4. 其他	-	801,556,966.43	-	-	-	(12,545,349.52)	(726,445,745.47)	62,565,871.44
(三) 利润分配	-	-	-	-	52,958,263.16	(2,796,447,779.30)	(278,192,179.57)	(3,021,681,695.71)
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	52,958,263.16	(52,958,263.16)	-	-
3. 对股东的分配	-	-	-	-	-	(2,743,482,000.00)	(278,199,695.71)	(3,021,681,695.71)
4. 其他	-	-	-	-	-	(7,516.14)	7,516.14	-
(四) 股东权益内部结转	-	-	34,234,968.48	-	-	(34,234,968.48)	-	-
1. 资本公积转增股本	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 盈余公积转增股本	-	-	-	-	-	-	-	-
3. 盈余公积弥补亏损	-	-	-	-	-	-	-	-
4. 设定受益计划变动额结转留存收益	-	-	-	-	-	-	-	-
5. 其他综合收益结转留存收益	-	-	34,234,968.48	-	-	(34,234,968.48)	-	-
6. 其他	-	-	-	-	-	-	-	-
三、2023年6月30日余额	13,064,200,000.00	75,809,658,507.08	(1,031,099,996.71)	9,656,101,246.57	21,835,231,082.37	47,685,543,677.78	12,848,897,285.19	179,868,531,802.28

合并股东权益变动表 (续)

2022年1-6月

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

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

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

周杰

法定代表人

张信军

主管会计工作负责人

马中

会计机构负责人

公司股东权益变动表

2023年1-6月

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

项目	2023年1-6月						
	股本	资本公积	其他综合收益	盈余公积	一般风险准备	未分配利润	股东权益合计
一、2022年12月31日余额	13,064,200,000.00	74,709,020,563.14	(393,603,061.50)	9,656,101,246.57	19,312,202,493.14	32,697,861,656.85	149,045,782,898.20
二、本期增减变动金额	-	-	283,041,607.37	-	-	541,950,210.13	824,991,817.50
(一) 综合收益总额	-	-	242,874,800.72	-	-	3,325,599,016.78	3,568,473,817.50
(二) 股东投入和减少资本	-	-	-	-	-	-	-
1. 股东投入的普通股	-	-	-	-	-	-	-
2. 其他权益工具持有者投入资本	-	-	-	-	-	-	-
3. 股份支付计入股东权益的金额	-	-	-	-	-	-	-
4. 其他	-	-	-	-	-	-	-
(三) 利润分配	-	-	-	-	-	(2,743,482,000.00)	(2,743,482,000.00)
1. 提取盈余公积	-	-	-	-	-	-	-
2. 提取一般风险准备	-	-	-	-	-	-	-
3. 对股东的分配	-	-	-	-	-	(2,743,482,000.00)	(2,743,482,000.00)
4. 其他	-	-	-	-	-	-	-
(四) 股东权益内部结转	-	-	40,166,806.65	-	-	(40,166,806.65)	-
1. 资本公积转增股本	-	-	-	-	-	-	-
2. 盈余公积转增股本	-	-	-	-	-	-	-
3. 盈余公积弥补亏损	-	-	-	-	-	-	-
4. 设定受益计划变动额结转留存收益	-	-	-	-	-	-	-
5. 其他综合收益结转留存收益	-	-	40,166,806.65	-	-	(40,166,806.65)	-
6. 其他	-	-	-	-	-	-	-
三、2023年6月30日余额	13,064,200,000.00	74,709,020,563.14	(110,561,454.13)	9,656,101,246.57	19,312,202,493.14	33,239,811,866.98	149,870,774,715.70

公司股东权益变动表 (续)

2022年1-6月

编制单位：海通证券股份有限公司

单位：人民币元

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

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

周杰

法定代表人

张信军

主管会计工作负责人

马中

会计机构负责人

一、公司基本情况

1、公司概况

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

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

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

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

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

截至2023年6月30日,本公司股本总数为13,064,200,000股,其中无限售条件股份为12,282,950,000股,有限售条件股份为781,250,000股。

本公司注册地:上海市广东路689号,总部地址:上海市黄浦区中山南路888号海通外滩金融广场。

截至2023年6月30日,本公司经批准设立分公司29家,340家证券及期货营业部(其中证券营业部306家,期货营业部34家)。

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

一、公司基本情况 (续)

2、合并财务报表范围

合并财务报表范围包括直接或间接控制的子公司和结构化主体。

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

本年合并财务报表范围及其变动情况、在相关被投资单位权益的信息详见附注“六、合并范围的变更”和“七、在其他主体中的权益”。

二、中期财务报表的编制基础

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

本中期财务报表根据财政部颁布的《企业会计准则第 32 号——中期财务报告》和中国证监会颁布的《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第 3 号——半年度报告的内容与格式》(2021 年修订) 的要求列示和披露有关财务信息。本中期财务报表应与本集团经审计的 2022 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、会计政策变更

财政部于 2022 年颁布了《关于印发〈企业会计准则解释第 16 号〉的通知》(以下简称“解释 16 号”)。在编制 2023 年中期财务报表时, 本集团及本公司已选择自 2023 年 1 月 1 日起采用解释 16 号中有关单项交易产生的资产和负债相关递延所得税不适用初始确认豁免的会计处理规定, 并采用追溯调整法处理, 相应调整比较期间相关的财务报表项目和财务报表附注, 上述修订对本集团及本公司财务报表无重大影响。

四、遵循企业会计准则的声明

本中期财务报表符合《企业会计准则第 32 号——中期财务报告》的要求, 真实、完整地反映了本集团及本公司于 2023 年 6 月 30 日的合并及公司财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间的合并及公司经营成果和现金流量。

五、合并财务报表项目附注

1、货币资金

(1) 按类别列示

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
库存现金	100,999.47	335,542.05
银行存款	164,686,247,647.35	154,164,090,581.12
其中：客户存款	99,893,842,379.50	98,970,479,371.57
公司存款	64,792,405,267.85	55,193,611,209.55
其他货币资金	914,008,103.81	1,170,646,922.87
存放中央银行款项	2,049,934,852.16	3,245,096,320.63
其中：存放中央银行法定准备金	14,454,482.32	13,497,066.30
存放中央银行超额存款准备金	2,035,480,369.84	3,231,599,254.33
合计	167,650,291,602.79	158,580,169,366.67

于2023年6月30日，本集团货币资金的预期信用损失减值准备为人民币13,726,585.53元（2022年12月31日：人民币14,585,172.22元）。

(2) 按币种列示

项目	2023年6月30日			2022年12月31日		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
库存现金						
人民币			42,253.00			97,611.74
美元	84.19	7.2258	608.34	3,525.64	6.9646	24,554.67
港币	3,960.19	0.92198	3,651.22	9,299.69	0.89327	8,307.13
欧元	2,401.18	7.8771	18,914.33	6,513.55	7.4229	48,349.43
其他			35,572.58			156,719.08
小计			100,999.47			335,542.05
银行存款						
其中：客户资金						
人民币			84,179,891,439.52			83,653,107,338.22
美元	414,646,345.46	7.2258	2,996,151,563.02	481,389,393.90	6.9646	3,352,684,572.75
港币	6,117,940,131.03	0.92198	5,640,618,442.01	6,061,979,080.97	0.89327	5,414,984,053.66
欧元	2,984,863.02	7.8771	23,512,064.49	3,151,031.80	7.4229	23,389,793.95
其他			85,203,482.70			65,795,908.40
小计			92,925,376,991.74			92,509,961,666.98
客户信用资金						
人民币			6,968,465,387.76			6,460,517,704.59
小计			6,968,465,387.76			6,460,517,704.59
客户存款合计			99,893,842,379.50			98,970,479,371.57

五、合并财务报表项目附注 (续)

1、货币资金 (续)

(2) 按币种列示 (续)

项目	2023年6月30日			2022年12月31日		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
公司自有资金						
人民币			53,848,085,687.46			47,682,939,524.24
美元	995,826,181.00	7.2258	7,195,640,818.67	522,920,328.76	6.9646	3,641,930,921.68
港币	3,542,623,497.85	0.92198	3,266,228,012.55	3,816,170,880.64	0.89327	3,408,870,962.55
欧元	4,646,936.66	7.8771	36,604,384.76	4,761,953.83	7.4229	35,347,507.08
其他			445,846,364.41			424,522,294.00
小计			64,792,405,267.85			55,193,611,209.55
公司存款合计			64,792,405,267.85			55,193,611,209.55
其他货币资金						
人民币			588,289,819.19			920,805,664.03
美元	45,077,124.28	7.2258	325,718,284.62	35,873,023.41	6.9646	249,841,258.84
小计			914,008,103.81			1,170,646,922.87
存放中央银行款项						
欧元	257,899,055.89	7.8771	2,031,496,653.15	437,134,866.69	7.4229	3,244,808,401.95
其他			18,438,199.01			287,918.68
小计			2,049,934,852.16			3,245,096,320.63
合计			167,650,291,602.79			158,580,169,366.67

(3) 2023年6月30日, 受限制的货币资金为2,758,866,194.63元(2022年12月31日: 人民币2,900,551,701.46元), 主要为风险准备专户存款、银票保证金存款及飞机维修基金等。

2、结算备付金

(1) 按类别列示

单位: 人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
客户备付金	12,146,852,465.30	10,476,841,294.70
公司备付金	6,419,434,179.04	10,903,854,126.03
合计	18,566,286,644.34	21,380,695,420.73

五、合并财务报表项目附注 (续)

2、结算备付金 (续)

(2) 按币种列示

类别	2023年6月30日			2022年12月31日		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
客户普通备付金						
人民币			10,633,035,180.45			8,928,186,191.60
美元	25,262,463.01	7.2258	182,541,505.22	30,119,573.85	6.9646	209,770,784.04
港币	81,855,991.33	0.92198	75,469,586.89	89,480,329.18	0.89327	79,930,093.65
小计			10,891,046,272.56			9,217,887,069.29
客户信用备付金						
人民币			1,255,806,192.74			1,258,954,225.41
小计			1,255,806,192.74			1,258,954,225.41
客户备付金合计			12,146,852,465.30			10,476,841,294.70
公司自有备付金						
人民币			6,419,434,179.04			10,903,854,126.03
小计			6,419,434,179.04			10,903,854,126.03
公司备付金合计			6,419,434,179.04			10,903,854,126.03
合计			18,566,286,644.34			21,380,695,420.73

3、融出资金

(1) 按类别列示

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
境内		
其中：个人	48,610,385,322.32	47,507,724,109.46
机构	9,914,793,861.78	10,491,562,102.28
减：减值准备	1,206,420,141.96	1,158,924,607.74
小计	57,318,759,042.14	56,840,361,604.00
境外		
其中：个人	1,453,520,632.48	1,564,458,217.71
机构	8,953,487,590.40	10,462,867,386.91
减：减值准备	1,305,779,678.13	1,023,816,392.24
小计	9,101,228,544.75	11,003,509,212.38
合计	66,419,987,586.89	67,843,870,816.38

五、合并财务报表项目附注 (续)

3、融出资金 (续)

(2) 减值准备调节表

单位：人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2022 年 12 月 31 日	52,120,819.21	31,983,648.30	2,098,636,532.47	2,182,740,999.98
本期 (转回)/ 计提	(36,809,814.99)	(23,062,710.31)	347,364,778.31	287,492,253.01
阶段转移	25,318,375.83	(2,806,812.73)	(22,511,563.10)	-
外汇变动及其他	266,319.40	123,113.58	41,577,134.12	41,966,567.10
于 2023 年 6 月 30 日	40,895,699.45	6,237,238.84	2,465,066,881.80	2,512,199,820.09

(3) 信用风险敞口

单位：人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2023 年 6 月 30 日	62,073,347,292.13	1,899,327,699.65	4,959,512,415.20	68,932,187,406.98
于 2022 年 12 月 31 日	60,787,569,250.17	2,212,706,573.09	7,026,335,993.10	70,026,611,816.36

(4) 客户因融资融券业务向公司提供的担保物公允价值情况

单位：人民币元

担保物类别	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
资金	8,122,962,421.40	7,634,836,044.39
债券	1,698,178,569.40	1,651,218,310.65
基金	10,261,917,356.61	8,470,087,232.95
股票	210,740,500,894.22	198,166,141,592.28
合计	230,823,559,241.63	215,922,283,180.27

4、衍生金融工具

单位：人民币元

类别	2023 年 6 月 30 日					
	非套期工具 (注 1)			套期工具 (注 2)		
	名义金额	公允价值		名义金额	公允价值	
	资产	负债		资产	负债	
利率衍生工具	161,684,055,368.86	331,975,461.57	302,811,207.33	1,735,436,307.40	86,983,657.33	-
货币衍生工具	18,403,876,399.83	85,328,330.89	54,677,829.49	1,452,610,505.49	90,062,563.01	6,188,851.61
权益衍生工具	136,521,531,393.54	1,294,198,290.38	790,127,310.80	-	-	-
信用衍生工具	526,000,000.00	1,290,276.02	263,860.00	-	-	-
其他衍生工具	59,158,576,028.70	42,586,007.60	151,521,780.13	-	-	-
合计		1,755,378,366.46	1,299,401,987.75		177,046,220.34	6,188,851.61

五、合并财务报表项目附注 (续)

4、衍生金融工具 (续)

单位: 人民币元

类别	2022年12月31日					
	非套期工具 (注1)			套期工具 (注2)		
	名义金额	公允价值		名义金额	公允价值	
		资产	负债		资产	负债
利率衍生工具	166,702,700,076.38	322,448,645.03	301,825,398.34	2,437,841,403.15	87,005,133.02	18,744,547.43
货币衍生工具	39,846,015,441.55	66,442,683.23	93,739,575.36	2,699,551,882.23	26,350,723.94	57,426,732.01
权益衍生工具	111,268,234,349.29	964,375,786.33	366,992,116.72	-	-	-
信用衍生工具	152,000,000.00	-	364,240.00	-	-	-
其他衍生工具	25,831,796,107.10	10,544,343.50	59,325,940.98	-	-	-
合计		1,363,811,458.09	822,247,271.40		113,355,856.96	76,171,279.44

注1: 在每日无负债结算制度下, 非套期衍生金融工具项下的期货合约和在上海清算所集中清算的利率互换合约按抵销后的净额列示, 为人民币零元。于2023年6月30日, 本集团未到期的期货合约的公允价值为人民币-34,393,495.00元(2022年12月31日: -624,668,220.00元), 本集团未到期的在上海清算所集中清算的利率互换的公允价值为49,546,439.05元(2022年12月31日: 46,712,342.00元)。

注2: 本集团利用套期衍生工具对利率风险及汇率风险导致的现金流量波动进行套期保值。被套期项目为借款及借款利息。截至2023年6月30日止六个月期间, 本集团现金流量套期产生的计入其他综合收益的税前净影响为人民币72,403,261.13元(截至2022年6月30日止六个月期间: 净影响人民币22,417,503.54元), 考虑所得税影响后的计入其他综合收益的净影响为人民币54,802,571.64元(截至2022年6月30日止六个月期间: 净影响人民币39,527,262.61元); 其中本集团因汇率和利率波动从其他综合收益转入损益金额为人民币63,942,196.31元(截至2022年6月30日止六个月期间: 人民币126,878,373.04元)。现金流量套期中确认的套期无效部分产生的损益不重大, 且不存在由于很可能发生的预期现金流不再预计会发生而导致的终止使用套期会计的情况。

5、存出保证金

(1) 项目列示

单位: 人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
交易保证金	411,318,852.31	574,186,133.00
信用保证金	597,835,478.85	1,460,668,527.31
期货保证金	18,720,128,854.87	19,317,813,518.49
履约保证金	1,938,201,189.14	1,511,906,226.66
合计	21,667,484,375.17	22,864,574,405.46

五、合并财务报表项目附注 (续)

5、存出保证金 (续)

(2) 按币种列示

类别	2023年6月30日			2022年12月31日		
	外币金额	折算率	人民币金额	外币金额	折算率	人民币金额
交易保证金						
人民币			305,412,131.66			476,452,811.93
美元	1,818,860.18	7.2258	13,142,719.89	1,820,010.58	6.9646	12,675,645.69
港币	91,928,954.77	0.92198	84,756,657.72	88,785,888.21	0.89327	79,309,770.36
欧元	1,016,534.39	7.8771	8,007,343.04	774,347.63	7.4229	5,747,905.02
小计			411,318,852.31			574,186,133.00
信用保证金						
人民币			597,835,478.85			1,460,668,527.31
小计			597,835,478.85			1,460,668,527.31
期货保证金						
人民币			18,680,989,602.34			19,292,115,589.00
港币	11,772,355.99	0.92198	10,853,876.78	2,519,195.00	0.89327	2,250,321.32
欧元	3,590,836.19	7.8771	28,285,375.75	3,158,820.43	7.4229	23,447,608.17
小计			18,720,128,854.87			19,317,813,518.49
履约保证金						
人民币			1,784,347,900.27			1,295,937,095.95
欧元	17,914,557.89	7.8771	141,114,763.96	-	7.4229	-
其他			12,738,524.91			215,969,130.71
小计			1,938,201,189.14			1,511,906,226.66
合计			21,667,484,375.17			22,864,574,405.46

6、应收款项

(1) 按明细列示

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
应收清算款	5,094,444,852.78	7,243,640,205.30
应收手续费及管理费	1,703,571,215.58	1,621,706,974.41
场外业务预付金	2,583,030,005.03	1,085,227,881.80
其他	971,195,625.94	765,971,087.31
应收款项余额	10,352,241,699.33	10,716,546,148.82
减：减值准备	363,603,672.83	322,031,281.12
应收款项账面价值	9,988,638,026.50	10,394,514,867.70

五、合并财务报表项目附注 (续)

6、应收款项 (续)

(2) 按账龄分析

单位：人民币元

账龄	2023年6月30日				2022年12月31日			
	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)	金额	比例 (%)
1年以内 (含1年)	9,636,045,173.54	93.08	96,171,088.41	26.45	10,071,217,541.78	93.98	124,738,487.22	38.73
1-2年 (含2年)	266,940,501.56	2.58	47,791,195.51	13.14	238,521,486.53	2.23	17,136,050.62	5.32
2-3年 (含3年)	161,960,786.69	1.56	33,672,540.93	9.26	230,169,664.38	2.15	49,049,934.99	15.23
3年以上	287,295,237.54	2.78	185,968,847.98	51.15	176,637,456.13	1.64	131,106,808.29	40.72
合计	10,352,241,699.33	100.00	363,603,672.83	100.00	10,716,546,148.82	100.00	322,031,281.12	100.00

7、买入返售金融资产

(1) 按标的物类别列示

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
股票	27,152,363,605.88	27,795,961,280.65
债券	14,571,174,952.11	5,413,745,382.79
小计	41,723,538,557.99	33,209,706,663.44
减：减值准备	618,949,659.40	564,557,629.95
合计	41,104,588,898.59	32,645,149,033.49

(2) 按业务类别列示

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
约定购回式证券	254,061,098.34	247,329,444.45
股票质押式回购 (6)	26,898,302,507.54	27,548,631,836.20
债券质押式回购	13,286,726,154.56	4,219,866,724.38
债券买断式回购	1,284,448,797.55	1,193,878,658.41
小计	41,723,538,557.99	33,209,706,663.44
减：减值准备	618,949,659.40	564,557,629.95
合计	41,104,588,898.59	32,645,149,033.49

五、合并财务报表项目附注 (续)

7、买入返售金融资产 (续)

(3) 减值准备调节表

单位：人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2022 年 12 月 31 日	13,571,221.53	1,692,570.14	549,293,838.28	564,557,629.95
本期 (转回)/ 计提	(1,022,393.77)	1,757,862.08	53,656,786.05	54,392,254.36
阶段转移	1,663,012.14	(1,663,012.14)	-	-
外汇变动及其他	(224.91)	-	-	(224.91)
于 2023 年 6 月 30 日	14,211,614.99	1,787,420.08	602,950,624.33	618,949,659.40

(4) 信用风险敞口

单位：人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2023 年 6 月 30 日	39,781,582,851.34	457,607,037.88	1,484,348,668.77	41,723,538,557.99
于 2022 年 12 月 31 日	31,146,702,710.11	330,638,000.01	1,732,365,953.32	33,209,706,663.44

(5) 买入返售金融资产的担保物信息

单位：人民币元

担保物类别	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
担保物	96,095,047,953.45	89,186,203,953.56
其中：可出售或可再次向外抵押的担保物	1,683,392,215.27	1,847,542,236.66
其中：已出售或已再次向外抵押的担保物	668,669,047.03	470,972,505.43

(6) 股票质押式回购业务

(i) 股票质押式回购剩余期限

单位：人民币元

剩余期限	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
1 个月以内	4,855,014,087.82	5,240,569,199.53
1 个月以上到 3 个月内	3,547,356,686.31	3,299,990,976.63
3 个月以上到 1 年以内	17,484,448,261.19	18,957,963,326.71
1 年以上	1,011,483,472.22	50,108,333.33
合计	26,898,302,507.54	27,548,631,836.20

五、合并财务报表项目附注 (续)

7、买入返售金融资产 (续)

(6) 股票质押式回购业务 (续)

(ii) 股票质押式回购信用风险敞口

单位：人民币元

2023年6月30日	阶段 1	阶段 2	阶段 3	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
账面余额	24,956,346,800.89	457,607,037.88	1,484,348,668.77	26,898,302,507.54
减值准备	14,081,676.02	1,787,420.08	602,950,624.33	618,819,720.43
担保物价值	77,828,606,567.75	854,187,800.00	1,285,562,002.46	79,968,356,370.21

单位：人民币元

2022年12月31日	阶段 1	阶段 2	阶段 3	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
账面余额	25,485,627,882.87	330,638,000.01	1,732,365,953.32	27,548,631,836.20
减值准备	13,411,540.14	1,692,570.14	549,293,838.28	564,397,948.56
担保物价值	79,627,830,709.98	648,740,956.37	2,258,697,486.56	82,535,269,152.91

8、交易性金融资产

(1) 按项目列示

单位：人民币元

项目	分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产			
	2023年6月30日		2022年12月31日	
	公允价值	初始投资成本	公允价值	初始投资成本
债券	93,203,937,527.04	93,426,732,188.31	101,634,305,301.69	104,472,795,021.17
公募基金	46,742,783,736.16	47,174,032,367.74	39,755,368,582.18	40,110,488,457.07
股票 / 股权	30,670,781,456.96	28,032,844,135.56	30,343,977,037.72	27,199,948,960.66
银行理财产品	4,776,009,654.53	4,703,614,912.96	4,428,914,400.73	4,352,973,230.49
券商资管产品	287,993,045.55	273,311,255.76	1,693,981,493.99	1,785,201,672.76
信托计划	1,972,800,988.19	2,291,772,561.34	2,563,556,421.69	2,755,772,561.33
其他	31,283,103,739.25	31,501,354,238.02	29,178,626,201.75	31,441,923,818.25
合计	208,937,410,147.68	207,403,661,659.69	209,598,729,439.75	212,119,103,721.73

(2) 2023年6月30日，交易性金融资产中有承诺条件的金融资产，系用于卖出回购业务、债券借贷业务、转融通业务和衍生业务等，其公允价值为人民币 48,824,145,672.62 元 (2022年12月31日：人民币 63,261,137,421.63 元)，其中包括存在限售期限的交易性金融资产，其公允价值为人民币 481,507,942.02 元 (2022年12月31日：人民币 487,228,918.90 元)。

(3) 2023年6月30日，存在限售期限的交易性金融资产账面价值合计人民币 5,399,788,909.50 元 (2022年12月31日：人民币 4,256,861,577.26 元)。

五、合并财务报表项目附注 (续)

9、债权投资

(1) 按项目列示

单位：人民币元

项目名称	2023年6月30日			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值
公司债	2,966,265,663.83	60,466,920.92	17,131,413.80	3,009,601,170.95
境外国债	3,621,759,357.13	31,289,356.32	4,472,438.02	3,648,576,275.43
金融债	387,897,736.81	2,661,322.27	622,230.32	389,936,828.76
其他	481,414,870.24	47,052,886.75	5,670,281.13	522,797,475.86
合计	7,457,337,628.01	141,470,486.26	27,896,363.27	7,570,911,751.00

单位：人民币元

项目名称	2022年12月31日			
	初始成本	利息	减值准备	账面价值
公司债	1,646,462,258.35	29,606,622.58	8,419,961.78	1,667,648,919.15
境外国债	3,252,871,428.35	47,178,729.57	3,146,718.16	3,296,903,439.76
金融债	277,235,993.54	3,211,510.98	412,607.54	280,034,896.98
其他	514,694,746.69	53,885,936.65	7,010,994.89	561,569,688.45
合计	5,691,264,426.93	133,882,799.78	18,990,282.37	5,806,156,944.34

(2) 减值准备调节表

单位：人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2022 年 12 月 31 日	18,990,282.37	-	-	18,990,282.37
本期计提	3,978,287.75	3,304,562.40	-	7,282,850.15
阶段转移	(1,106,601.65)	1,106,601.65	-	-
外汇变动及其他	1,314,220.50	309,010.25	-	1,623,230.75
于 2023 年 6 月 30 日	23,176,188.97	4,720,174.30	-	27,896,363.27

(3) 信用风险敞口

单位：人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2023 年 6 月 30 日	7,511,382,875.26	87,425,239.01	-	7,598,808,114.27
于 2022 年 12 月 31 日	5,825,147,226.71	-	-	5,825,147,226.71

五、合并财务报表项目附注 (续)

9、债权投资 (续)

(4) 存在有承诺条件的债权投资

2023年6月30日, 债权投资中有承诺条件的金融资产, 系用于卖出回购、向葡萄牙央行融资等, 其账面价值为人民币 5,620,138,952.62 元 (2022年12月31日: 4,003,583,327.57 元)。

10、其他债权投资

(1) 按项目列示

单位: 人民币元

项目名称	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
境外及境内国债	15,535,655,048.34	297,790,280.63	75,444,128.79	15,908,889,457.76	1,472,852.83
金融债	337,026,844.70	3,933,962.19	4,142,445.30	345,103,252.19	501,938.34
企业债	2,631,820,878.65	77,751,829.72	32,839,576.35	2,742,412,284.72	66,732,589.78
公司债	4,926,894,426.33	117,717,209.01	(76,603,622.93)	4,968,008,012.41	47,136,211.50
地方政府债	14,880,245,703.96	247,427,517.28	117,745,420.34	15,245,418,641.58	8,202,949.32
其他	6,673,573,271.02	113,230,636.02	56,116,094.98	6,842,920,002.02	41,962,048.95
合计	44,985,216,173.00	857,851,434.85	209,684,042.83	46,052,751,650.68	166,008,590.72

单位: 人民币元

项目名称	2022年12月31日				
	初始成本	利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
境外及境内国债	10,914,522,661.86	288,309,009.41	(39,642,708.35)	11,163,188,962.92	3,413,892.19
金融债	1,204,352,834.99	13,437,352.53	(46,432,803.49)	1,171,357,384.03	2,947,602.77
企业债	3,357,532,488.87	89,726,286.30	(33,220,903.87)	3,414,037,871.30	64,787,805.30
公司债	4,832,412,924.17	115,595,843.34	(70,381,713.12)	4,877,627,054.39	53,777,385.24
地方政府债	21,533,093,073.79	323,541,282.13	62,261,126.91	21,918,895,482.83	15,061,717.71
其他	10,105,801,596.25	183,880,777.40	17,109,819.15	10,306,792,192.80	64,420,107.01
合计	51,947,715,579.93	1,014,490,551.11	(110,307,182.77)	52,851,898,948.27	204,408,510.22

(2) 减值准备调节表

单位: 人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2022 年 12 月 31 日	86,988,582.58	117,419,927.64	-	204,408,510.22
本期 (转回) / 计提	(55,559,352.65)	5,628,960.05	9,460,930.48	(40,469,462.12)
阶段转移	14,036,071.90	(14,178,840.01)	142,768.11	-
外汇变动及其他	754,311.11	96,484.15	1,218,747.36	2,069,542.62
于 2023 年 6 月 30 日	46,219,612.94	108,966,531.83	10,822,445.95	166,008,590.72

五、合并财务报表项目附注 (续)

10、其他债权投资 (续)

(3) 信用风险敞口

单位：人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2023 年 6 月 30 日	41,665,405,385.96	4,137,234,706.23	40,427,515.66	45,843,067,607.85
于 2022 年 12 月 31 日	48,696,363,985.69	4,265,842,145.35	-	52,962,206,131.04

(4) 存在有承诺条件的其他债权投资

2023 年 6 月 30 日，其他债权投资中有承诺条件的金融资产，系用于卖出回购业务、债券借贷业务质押、转融通业务、衍生业务和向葡萄牙央行融资等，其公允价值为人民币 36,026,593,990.08 元 (2022 年 12 月 31 日：35,446,837,513.02 元)。

11、其他权益工具投资

单位：人民币元

项目	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
非交易性权益工具	7,468,695,645.78	6,096,318,840.12

于 2023 年 6 月 30 日，其他权益工具投资包括本公司持有的非交易性股权及股票。

由于上述权益工具并非为交易目的而持有，本集团将其指定为其他权益工具投资。由于战略调整，本集团对部分其他权益工具进行处置，相应的税后亏损人民币 34,234,968.48 元从其他综合收益重分类为留存收益。

2023 年 6 月 30 日，其他权益工具中有承诺条件的金融资产，系用于融出证券业务，其公允价值为人民币 788,388,276.55 元 (2022 年 12 月 31 日：1,866,595,325.98 元)。

12、应收融资租赁款及长期应收款

单位：人民币元

项目	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
应收融资租赁款 (1)	17,997,213,319.94	19,458,452,903.05
长期应收款 (2)	87,170,113,517.24	84,549,952,480.38
合计	105,167,326,837.18	104,008,405,383.43

五、合并财务报表项目附注 (续)

12、应收融资租赁款及长期应收款 (续)

(1) 应收融资租赁款

(i) 应收融资租赁款列示如下:

单位: 人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
资产负债表日后第一年	11,504,984,178.61	14,822,053,077.58
资产负债表日后第二年	4,436,747,408.04	4,761,042,317.37
资产负债表日后第三年	2,255,528,070.26	1,324,033,487.33
资产负债表日后第四年	1,083,677,959.80	565,994,885.44
资产负债表日后第五年	693,747,365.57	446,252,239.00
以后年度	1,852,559,797.48	1,586,041,921.40
最低租赁收款额合计	21,827,244,779.76	23,505,417,928.12
减: 未实现融资收益	2,708,870,567.57	2,457,072,695.23
应收融资租赁款余额	19,118,374,212.19	21,048,345,232.89
减: 减值准备	1,121,160,892.25	1,589,892,329.84
应收融资租赁款净额	17,997,213,319.94	19,458,452,903.05
其中: 一年内到期的应收融资租赁款净额	9,518,249,240.82	12,355,869,609.15
一年后到期的应收融资租赁款净额	8,478,964,079.12	7,102,583,293.90

期末用于抵押或担保的资产情况见附注十一、1、(1)。

(ii) 应收融资租赁款减值准备调节表如下:

单位: 人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2022 年 12 月 31 日	439,313,584.68	531,299,164.62	619,279,580.54	1,589,892,329.84
本期 (转回) / 计提	(115,630,630.14)	140,337,909.90	120,960,866.09	145,668,145.85
本期核销	-	-	(314,668,204.67)	(314,668,204.67)
阶段转移	18,936,215.33	(256,155,579.63)	237,219,364.30	-
收回以前年度核销	-	-	51,928,924.74	51,928,924.74
本期其他终止确认	-	-	(351,660,303.51)	(351,660,303.51)
于 2023 年 6 月 30 日	342,619,169.87	415,481,494.89	363,060,227.49	1,121,160,892.25

(iii) 应收融资租赁款现值分析如下:

单位: 人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
2023 年 6 月 30 日	17,001,426,651.77	1,547,687,396.78	569,260,163.64	19,118,374,212.19
2022 年 12 月 31 日	18,404,093,453.24	1,623,102,172.83	1,021,149,606.82	21,048,345,232.89

五、合并财务报表项目附注 (续)

12、应收融资租赁款及长期应收款 (续)

(2) 长期应收款

(i) 长期应收款列示如下:

单位: 人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
资产负债表日后第一年	44,657,552,529.98	41,038,253,854.34
资产负债表日后第二年	28,845,938,679.22	27,141,406,828.44
资产负债表日后第三年	14,494,913,889.89	15,714,478,543.37
资产负债表日后第四年	6,291,064,798.92	6,709,395,456.30
资产负债表日后第五年	2,059,066,457.56	3,069,130,682.24
以后年度	1,138,654,262.25	837,855,255.04
长期应收款总额	97,487,190,617.82	94,510,520,619.73
减: 利息调整	8,684,839,769.92	8,775,538,959.86
长期应收款余额	88,802,350,847.90	85,734,981,659.87
减: 减值准备	1,632,237,330.66	1,185,029,179.49
长期应收款净额	87,170,113,517.24	84,549,952,480.38
其中: 一年内到期的长期应收款净额	40,012,578,731.64	36,702,132,264.98
一年后到期的长期应收款净额	47,157,534,785.60	47,847,820,215.40

期末用于抵押或担保的资产情况见附注十一、1、(1)。

(ii) 长期应收款减值准备调节表如下:

单位: 人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2022 年 12 月 31 日	952,361,272.37	159,714,874.60	72,953,032.52	1,185,029,179.49
本期计提	41,107,388.07	257,992,849.03	160,452,083.06	459,552,320.16
本期核销	-	-	(8,035,300.32)	(8,035,300.32)
阶段转移	(56,098,546.55)	(19,467,109.49)	75,565,656.04	-
收回以前年度核销	-	-	186,917.20	186,917.20
本期其他终止确认	-	-	(4,538,806.28)	(4,538,806.28)
外汇变动及其他	43,020.41	-	-	43,020.41
于 2023 年 6 月 30 日	937,413,134.30	398,240,614.14	296,583,582.22	1,632,237,330.66

(iii) 长期应收款现值分析如下:

单位: 人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
2023 年 6 月 30 日	86,411,252,920.16	1,775,817,265.76	615,280,661.98	88,802,350,847.90
2022 年 12 月 31 日	84,955,976,352.38	634,234,675.11	144,770,632.38	85,734,981,659.87

五、合并财务报表项目附注 (续)

13、长期股权投资

被投资单位	2022年12月31日				2023年6月30日				减值准备 期末余额
	追加投资	减少投资	权益法下确认的 投资收益	其他综合收益 调整	公司享有的宣告发 放现金股利或利润	其他	2023年6月30日	减值准备 期末余额	
联营企业									
富国基金管理有限公司	2,151,251,582.61	-	295,914,926.63	2,986,155.20	(288,860,000.00)	-	2,161,292,664.44	-	
吉林省现代农业和新兴产业投资基金有限公司	65,761,834.54	-	(12,842,098.54)	-	-	-	52,919,736.00	-	
西安航天新能源产业基金投资有限公司	292,847,405.82	-	5,769,780.60	-	-	-	298,617,186.42	-	
上海文化产业股权投资合伙企业(有限合伙)	100,497,033.42	-	6,700,323.77	-	-	-	107,197,357.19	-	
上海并购股权投资合伙企业(有限合伙)	63,297,670.29	-	(5,082,068.79)	-	-	-	20,231,752.95	-	
海通(吉林)现代服务业创业投资基金合伙企业(有限合伙)	29,261,603.75	-	(58,004.91)	-	-	-	29,203,598.84	-	
海通兴泰(安徽)新兴产业投资基金(有限合伙)	172,327,335.48	-	27,291,769.45	-	-	-	199,619,104.93	-	
海通齐东(威海)股权投资合伙企业(有限合伙)	158,818,784.16	-	(4,267,335.05)	-	(1,461,702.42)	-	170,115,768.62	-	
广东南方媒体融合发展投资基金(有限合伙)	177,443,404.71	-	15,498,117.30	-	-	-	192,941,522.01	-	
海通(吉林)股权投资合伙企业(有限合伙)	47,128,868.54	-	(2,632,657.08)	-	-	-	44,496,211.46	-	
西安军民电子卫星基金投资有限公司	88,525,500.16	-	10,595,049.10	-	-	-	99,120,549.26	-	
盐城中韩产业园二期投资基金(有限合伙)	120,020,240.13	-	-	-	-	-	120,020,240.13	-	
上海海通焕新私募基金合伙企业(有限合伙)	229,011,867.80	-	(378,120.84)	-	-	-	228,633,746.96	-	
上海海通伊泰一期私募基金合伙企业(有限合伙)	-	75,000,000.00	-	-	-	-	75,000,000.00	-	
嘉兴海通旭初股权投资合伙企业(有限合伙)	73,279,350.29	-	18,084,432.46	-	-	-	91,363,782.75	-	
上海并购股权投资基金二期合伙企业(有限合伙)	159,051,463.72	-	11,369,286.15	-	-	-	170,420,749.87	-	
辽宁海通新动能股权投资合伙企业(有限合伙)	310,740,240.97	-	25,544,294.92	-	-	-	336,284,535.89	-	
许昌海通创新股权投资合伙企业(有限合伙)	16,598,117.41	-	(326,167.73)	-	-	-	16,271,949.68	-	
吉林海通创新卫星投资中心(有限合伙)	29,450,673.26	-	(14,877.18)	-	-	-	29,435,796.08	-	
合肥市海通徽银股权投资合伙企业(有限合伙)	114,983,054.56	-	(31,348.98)	-	-	-	114,951,705.58	-	
辽宁中德产业股权投资基金合伙企业(有限合伙)	663,313,551.41	-	27,011,065.02	-	-	-	690,324,616.43	-	
西安航天海通创新新材料股权投资合伙企业(有限合伙)	1,390,138.91	-	1,167.74	-	-	-	1,391,306.65	-	
中小企业发展基金海通(合肥)合伙企业(有限合伙)	430,620,950.27	-	18,674,755.62	-	-	-	449,295,705.89	-	
央视融媒体中心(有限合伙)	675,811,838.60	-	(1,311,995.53)	-	-	-	674,499,843.07	-	
过宁海通新能源低碳产业股权投资基金有限公司	660,118,050.60	-	23,419,823.70	-	-	-	683,537,874.30	-	
海通临沂股权投资基金合伙企业(有限合伙)	12,026,250.20	-	15,565.96	-	-	-	12,041,816.16	-	
安徽省皖能海通双碳产业并购投资基金合伙企业(有限合伙)	89,767,615.38	60,000,000.00	(647,065.25)	-	-	-	149,120,550.13	-	
吉林海创长新投资中心(有限合伙)	60,311,977.84	-	255,616.34	-	-	-	60,567,594.18	-	
金华市海通重点产业发展招商并购投资基金合伙企业(有限合伙)	15,986,777.42	-	(79,976.13)	-	-	-	15,906,801.29	-	
上海海通智达私募基金合伙企业(有限合伙)	4,070,442.63	-	3,655.00	-	-	-	4,074,097.63	-	
合计	7,013,713,624.88	135,000,000.00	479,771,270.73	2,986,155.20	(290,321,702.42)	-	7,298,898,164.79	-	

注：在联营企业中的权益相关信息详见附注七、2。

五、合并财务报表项目附注 (续)

14、投资性房地产

单位：人民币元

项目	房屋、建筑物
一、账面原值	
1、2022年12月31日	2,710,765,131.36
2、本期转入	-
3、本期增加金额	11,563,635.19
4、本期减少金额	-
5、外币报表折算差额	99,123,711.79
6、2023年6月30日	2,821,452,478.34
二、累计折旧	
1、2022年12月31日	69,175,597.72
2、本期转入	-
3、本期增加金额	29,790,938.49
4、本期减少金额	-
5、外币报表折算差额	2,196,152.11
6、2023年6月30日	101,162,688.32
三、减值准备	
1、2022年12月31日	-
2、本期增加金额	1,823,957.38
3、本期减少金额	-
4、外币报表折算差额	-
5、2023年06月30日	1,823,957.38
四、账面价值	
1、2023年6月30日	2,718,465,832.64
2、2022年12月31日	2,641,589,533.64

于2023年6月30日，本集团投资性房地产的公允价值为人民币3,515,028,426.09元(2022年12月31日：3,385,022,665.72元)，系参考相同或相似地点及状况的类似物业的近期市价厘定公允价值。

于2023年6月30日，本集团无用于抵押或担保的投资性房地产(2022年12月31日：同)。

15、固定资产

(1) 账面价值

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
固定资产原值	20,450,110,124.31	19,962,797,922.26
减：累计折旧	4,086,666,734.51	3,778,088,041.83
减：固定资产减值准备	88,099,949.36	86,040,033.98
固定资产账面价值合计	16,275,343,440.44	16,098,669,846.45

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

单位：人民币元

项目	房屋及建筑物	电子通讯设备	交通运输工具	机器设备及其他	经营租赁固定资产	合计
一、账面原值：						
2022年12月31日	11,313,385,375.39	1,976,527,346.24	155,420,012.98	343,872,874.62	6,173,592,313.03	19,962,797,922.26
本期增加	260,888,028.15	104,222,214.03	3,936,070.24	12,185,919.41	-	381,232,231.83
(1) 本期购置	-	102,612,640.25	3,936,070.24	9,314,094.52	-	115,862,805.01
(2) 在建工程转入	260,888,028.15	1,609,573.78	-	2,871,824.89	-	265,369,426.82
(3) 其他转入	-	-	-	-	-	-
本期减少	-	146,933,032.75	7,493,337.60	10,187,239.68	-	164,613,610.03
(1) 转让和出售	-	-	-	-	-	-
(2) 清理报废	-	146,933,032.75	7,493,337.60	10,187,239.68	-	164,613,610.03
(3) 其他减少	-	-	-	-	-	-
外币报表折算差额	19,509,772.48	13,596,968.63	20,068.29	6,032,682.44	231,534,088.41	270,693,580.25
2023年6月30日	11,593,783,176.02	1,947,413,496.15	151,882,813.91	351,904,236.79	6,405,126,401.44	20,450,110,124.31
二、累计折旧：						
2022年12月31日	1,234,106,214.85	1,365,632,224.64	132,961,910.20	215,799,754.76	829,587,937.38	3,778,088,041.83
本期转入	-	-	-	-	-	-
本期计提	152,158,846.90	126,664,801.88	3,329,920.28	15,625,301.65	111,522,409.86	409,301,280.57
本期减少	-	139,556,656.27	6,506,427.81	9,425,098.65	-	155,488,182.73
外币报表折算差额	2,259,987.97	12,258,303.76	9,681.59	5,020,573.84	35,217,047.68	54,765,594.84
2023年6月30日	1,388,525,049.72	1,364,998,674.01	129,795,084.26	227,020,531.60	976,327,394.92	4,086,666,734.51
三、减值准备：						
2022年12月31日	30,381,872.93	4,426,005.02	-	698,422.08	50,533,733.95	86,040,033.98
本期计提	-	-	-	-	-	-
本期减少	-	-	-	-	-	-
外币报表折算差额	-	142,253.30	-	22,447.52	1,895,214.56	2,059,915.38
2023年6月30日	30,381,872.93	4,568,258.32	-	720,869.60	52,428,948.51	88,099,949.36
四、账面价值：						
2023年6月30日	10,174,876,253.37	577,846,563.82	22,087,729.65	124,162,835.59	5,376,370,058.01	16,275,343,440.44
2022年12月31日	10,048,897,287.61	606,469,116.58	22,458,102.78	127,374,697.78	5,293,470,641.70	16,098,669,846.45

(3) 期末用于抵押或担保的固定资产情况见附注十一、1、(1)。

(4) 于2023年6月30日，尚未办妥产权证书的固定资产账面价值为人民币27,659,141.15元(2022年12月31日：28,259,454.35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

项目	2023年6月30日			2022年12月31日		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
办公楼装修及设备改造	194,144,097.44	-	194,144,097.44	440,564,212.49	-	440,564,212.49
软件系统	24,799,401.96	-	24,799,401.96	25,140,747.74	-	25,140,747.74
合计	218,943,499.40	-	218,943,499.40	465,704,960.23	-	465,704,960.23

(2) 在建工程项目变动情况

工程名称	资金来源	2022年 12月31日	本期增加	本期减少				外币报表 折算差额	2023年 6月30日
				本期转入 固定资产	本期转入 无形资产	本期转入 长期待摊费用	其他减少		
办公楼装修及设备改造	自有资金	440,564,212.49	40,554,283.33	265,369,426.82	-	21,604,971.56	-	-	194,144,097.44
软件系统	自有资金	25,140,747.74	3,562,018.92	-	4,136,766.15	-	66,238.56	299,640.01	24,799,401.96
合计		465,704,960.23	44,116,302.25	265,369,426.82	4,136,766.15	21,604,971.56	66,238.56	299,640.01	218,943,499.40

17、无形资产

(1) 无形资产增减变动表

单位：人民币元

项目	土地使用权	计算机软件	交易席位费	其他	合计
一、账面原值					
2022年12月31日	832,440,829.50	2,007,924,472.99	224,618,239.58	136,001,953.90	3,200,985,495.97
本期增加	-	125,366,103.51	-	-	125,366,103.51
本期减少	-	25,868,657.08	1,400,000.00	50,000.00	27,318,657.08
外币报表折算差额	-	32,073,151.89	218,504.49	1,817,227.43	34,108,883.81
2023年6月30日	832,440,829.50	2,139,495,071.31	223,436,744.07	137,769,181.33	3,333,141,826.21
二、累计摊销					
2022年12月31日	118,437,200.83	1,592,710,573.76	116,600,323.50	102,382,750.93	1,930,130,849.02
本期增加	10,151,966.04	107,821,353.23	-	3,516,251.21	121,489,570.48
本期减少	-	25,866,531.70	-	50,000.00	25,916,531.70
外币报表折算差额	-	30,499,425.15	-	1,742,501.35	32,241,926.50
2023年6月30日	128,589,166.87	1,705,164,820.44	116,600,323.50	107,591,503.49	2,057,945,814.30
三、减值准备					
2022年12月31日	-	-	-	-	-
本期增加	-	-	-	-	-
本期减少	-	-	-	-	-
外币报表折算差额	-	-	-	-	-
2023年6月30日	-	-	-	-	-
四、账面价值					
2023年6月30日	703,851,662.63	434,330,250.87	106,836,420.57	30,177,677.84	1,275,196,011.91
2022年12月31日	714,003,628.67	415,213,899.23	108,017,916.08	33,619,202.97	1,270,854,646.95

五、合并财务报表项目附注 (续)

17、无形资产 (续)

(2) 期末无用于抵押或担保的无形资产。

18、使用权资产与租赁负债

(1) 使用权资产

单位：人民币元

项目	房屋及建筑物	电子通讯设备	交通运输工具	其他	合计
一、账面原值					
2022年12月31日	1,837,910,710.16	625,616.67	2,617,366.57	2,357,175.95	1,843,510,869.35
本期增加	220,974,953.68	-	-	305,193.82	221,280,147.50
本期减少	154,819,703.38	-	484,768.05	485,307.61	155,789,779.04
外币报表折算差额	27,066,834.35	64,982.02	194,366.12	-	27,326,182.49
2023年6月30日	1,931,132,794.81	690,598.69	2,326,964.64	2,177,062.16	1,936,327,420.30
二、累计折旧					
2022年12月31日	855,489,852.48	294,874.94	1,472,881.26	1,713,535.79	858,971,144.47
本期增加	197,754,406.13	89,205.35	273,829.38	334,004.55	198,451,445.41
本期减少	150,473,916.90	-	466,871.32	482,864.71	151,423,652.93
外币报表折算差额	13,504,560.86	22,732.10	88,376.67	-	13,615,669.63
2023年6月30日	916,274,902.57	406,812.39	1,368,215.99	1,564,675.63	919,614,606.58
三、减值准备					
2022年12月31日	-	-	-	-	-
本期增加	-	-	-	-	-
本期减少	-	-	-	-	-
外币报表折算差额	-	-	-	-	-
2023年6月30日	-	-	-	-	-
四、账面价值					
2023年6月30日	1,014,857,892.24	283,786.30	958,748.65	612,386.53	1,016,712,813.72
2022年12月31日	982,420,857.68	330,741.73	1,144,485.31	643,640.16	984,539,724.88

(2) 租赁负债

租赁负债的到期期限分析如下：

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
1年以内	293,722,820.63	279,881,306.10
1-2年	223,434,831.27	204,320,483.39
2-5年	320,202,666.42	300,300,897.47
5年以上	212,147,785.76	231,197,768.85
合计	1,049,508,104.08	1,015,700,455.81

五、合并财务报表项目附注 (续)

18、使用权资产与租赁负债 (续)

(2) 租赁负债 (续)

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

2023年上半年，租赁资金流出总额达人民币22,730.97万元(2022年上半年：人民币22,734.03万元)。

2023年上半年，租赁负债利息支出人民币2,363.34万元(2022年上半年：人民币2,091.17万元)。

截至2023年6月30日止，除本集团向出租人支付的押金作为租入资产的担保权益外，租赁协议不附加任何其他担保条款。租入资产不可被用于借款担保。

于2023年6月30日，本集团未订立尚未开始的任何重大租赁。

19、商誉

单位：人民币元

被投资单位名称	2022年12月31日	本期增加	本期减少	汇兑调整	2023年6月30日
商誉					
海通期货股份有限公司	5,896,464.26	-	-	-	5,896,464.26
海通国际证券集团有限公司	701,199,852.30	-	-	22,536,800.48	723,736,652.78
海通恒信金融集团有限公司	2,236,907,432.98	-	-	71,894,961.66	2,308,802,394.64
Haitong International Holdings (UK) Limited	132,064,232.92	-	-	4,244,589.12	136,308,822.04
Haitong Bank, S.A.	1,041,863,542.60	-	-	33,485,846.74	1,075,349,389.34
Haitong International Financial Services (Singapore) Pte. Ltd.	4,934,571.16	-	-	158,598.78	5,093,169.94
小计	4,122,866,096.22	-	-	132,320,796.78	4,255,186,893.00
减：减值准备					
Haitong Bank, S.A.	446,635,000.00	-	-	14,355,000.00	460,990,000.00
小计	446,635,000.00	-	-	14,355,000.00	460,990,000.00
合计	3,676,231,096.22	-	-	117,965,796.78	3,794,196,893.00

五、合并财务报表项目附注（续）

20、递延所得税资产和递延所得税负债

(1) 未经抵销的递延所得税资产

单位：人民币元

项目	2023年6月30日		2022年12月31日	
	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产	可抵扣暂时性差异	递延所得税资产
资产减值准备	12,229,304,180.16	3,051,674,719.79	12,222,695,731.51	3,052,492,561.74
应付未付款项可抵扣税款	4,097,268,184.08	1,026,305,683.77	4,239,081,251.81	1,066,444,794.63
可抵扣亏损	2,863,703,676.33	742,292,453.05	2,487,215,078.95	546,944,718.53
租赁负债	1,288,516,006.39	322,129,001.61	1,356,254,700.21	339,063,675.06
其他权益工具投资	641,418,228.39	160,354,557.10	750,774,897.48	187,693,724.37
交易性金融资产	630,561,737.52	152,675,890.89	613,838,338.36	153,459,584.60
交易性金融负债	432,975,990.43	108,243,997.61	-	-
衍生金融工具	95,494,737.60	23,720,563.20	716,079,412.43	212,228,868.52
其他债权投资	95,489,321.91	29,171,007.33	114,717,589.57	33,818,560.59
其他	104,395,212.63	39,051,718.87	173,581,469.32	45,269,339.13
合计	22,479,127,275.44	5,655,619,593.22	22,674,238,469.64	5,637,415,827.17

(2) 未经抵销的递延所得税负债

单位：人民币元

项目	2023年6月30日		2022年12月31日	
	应纳税暂时性差异	递延所得税负债	应纳税暂时性差异	递延所得税负债
交易性金融资产	5,229,248,041.23	1,307,268,007.22	3,811,480,401.13	952,870,100.28
使用权资产	1,287,958,887.34	321,989,721.83	1,330,372,195.44	332,593,048.87
无形资产、固定资产及长期待摊费用	694,787,017.12	90,262,123.09	655,599,972.57	86,646,264.75
其他债权投资	326,953,277.21	81,738,319.30	13,980,417.75	3,495,104.44
衍生金融工具	220,589,933.72	89,076,488.37	5,511,602.91	1,139,679.72
交易性金融负债	-	-	964,140,115.87	241,035,028.97
其他	914,121,593.29	227,994,918.56	870,651,119.86	217,415,492.79
合计	8,673,658,749.91	2,118,329,578.37	7,651,735,825.53	1,835,194,719.82

(3) 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
递延所得税资产	4,553,890,906.15	4,711,680,014.57
递延所得税负债	1,016,600,891.30	909,458,907.22

五、合并财务报表项目附注 (续)

21、其他资产

(1) 项目列示

单位：人民币元

项目	注释	2023年6月30日	2022年12月31日
其他应收款	(2)	1,433,216,566.32	2,493,607,013.13
长期待摊费用	(3)	250,651,919.96	267,804,169.30
发放贷款和垫款	(4)	6,900,125,816.20	5,869,014,532.14
其他贷款和应收款	(5)	6,152,991,095.93	6,728,167,613.07
政府合作项目长期应收款项		1,301,372,427.68	1,174,762,185.21
回收融资租赁设备		78,516,822.68	85,384,553.87
抵债资产		63,390,295.48	86,701,202.81
存货		262,849,563.46	104,378,819.49
其他		6,204,977,188.65	6,114,406,117.88
合计		22,648,091,696.36	22,924,226,206.90

(2) 其他应收款

(i) 其他应收款明细列示

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
预付款项	1,394,153,583.70	1,349,583,244.30
浙江斯文新技术投资有限公司	429,993,924.48	429,993,924.48
应收项目保证金及待结算款	11,356,479.96	1,131,552,944.85
其他	170,469,540.53	139,996,222.32
其他应收款余额	2,005,973,528.67	3,051,126,335.95
减：坏账准备(注)	572,756,962.35	557,519,322.82
其他应收款账面价值	1,433,216,566.32	2,493,607,013.13

(ii) 其他应收款按账龄分析

单位：人民币元

账龄	2023年6月30日				2022年12月31日			
	账面余额		坏账准备		账面余额		坏账准备	
	金额	比例(%)	金额	比例(%)	金额	比例(%)	金额	比例(%)
1年以内	996,810,842.17	49.70	5,730,076.44	1.00	1,065,181,651.19	34.91	61,974,187.39	11.12
1-2年	408,649,738.21	20.37	78,383,184.10	13.69	1,385,744,489.55	45.42	16,563,756.46	2.97
2-3年	58,840,347.57	2.93	10,268,050.04	1.79	45,100,528.50	1.48	7,342,204.34	1.32
3年以上	541,672,600.72	27.00	478,375,651.77	83.52	555,099,666.71	18.19	471,639,174.63	84.59
合计	2,005,973,528.67	100.00	572,756,962.35	100.00	3,051,126,335.95	100.00	557,519,322.82	100.00

注：于2023年6月30日，其他应收款坏账准备主要为本公司通过浙江斯文新技术投资有限公司存放在广东证券的保证金人民币429,993,924.48元，本公司已根据可收回情况计提了100%的坏账准备。

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

五、合并财务报表项目附注 (续)

21、其他资产 (续)

(3) 长期待摊费用

单位：人民币元

项目	2022年12月31日	本期增加额	本期摊销额	其他减少	2023年6月30日
装修及布线改造等	267,804,169.30	65,394,427.60	58,555,366.19	23,991,310.75	250,651,919.96

(4) 发放贷款和垫款

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
企业贷款和垫款	7,012,144,549.57	5,978,798,454.70
个人贷款和垫款	7,299.08	17,148.99
小计	7,012,151,848.65	5,978,815,603.69
减：贷款损失准备	112,026,032.45	109,801,071.55
合计	6,900,125,816.20	5,869,014,532.14

(i) 发放贷款和垫款减值准备调节表如下：

单位：人民币元

	阶段1 未来12个月预期信用损失	阶段2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于2022年12月31日	22,710,512.50	40,253,359.56	46,837,199.49	109,801,071.55
本期计提/(转回)	1,792,602.98	(3,154,576.72)	999,813.89	(362,159.85)
本期核销	-	-	(7,815,327.54)	(7,815,327.54)
外汇变动及其他	1,732,072.92	4,414,322.77	4,256,052.60	10,402,448.29
于2023年6月30日	26,235,188.40	41,513,105.61	44,277,738.44	112,026,032.45

(ii) 发放贷款和垫款风险敞口如下：

单位：人民币元

	阶段1 未来12个月预期信用损失	阶段2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于2023年6月30日	6,135,542,105.75	806,392,061.99	70,217,680.91	7,012,151,848.65
于2022年12月31日	5,153,647,142.10	752,825,347.81	72,343,113.78	5,978,815,603.69

(5) 其他贷款和应收款

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
境外贷款和应收款项	6,758,985,511.85	7,055,246,178.08
境内委托贷款及其他贷款	515,327,347.81	514,158,916.72
小计	7,274,312,859.66	7,569,405,094.80
减：减值准备	1,121,321,763.73	841,237,481.73
合计	6,152,991,095.93	6,728,167,613.07

五、合并财务报表项目附注 (续)

21、其他资产 (续)

(5) 其他贷款和应收款 (续)

(i) 其他贷款和应收款减值准备调节表如下:

单位: 人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2022 年 12 月 31 日	26,938,763.36	160,167,462.13	654,131,256.24	841,237,481.73
本期 (转回)/ 计提	(15,426,107.57)	83,802,104.03	166,959,621.63	235,335,618.09
阶段转移	(6,979,925.32)	403,737.83	6,576,187.49	-
外汇变动及其他	66,701.07	4,975.30	44,676,987.54	44,748,663.91
于 2023 年 6 月 30 日	4,599,431.54	244,378,279.29	872,344,052.90	1,121,321,763.73

(ii) 其他贷款和应收款风险敞口如下:

单位: 人民币元

	阶段 1 未来 12 个月预期信用损失	阶段 2 整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	阶段 3 整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	合计
于 2023 年 6 月 30 日	1,455,664,276.16	596,119,308.22	5,222,529,275.28	7,274,312,859.66
于 2022 年 12 月 31 日	2,460,819,441.04	378,612,074.53	4,729,973,579.23	7,569,405,094.80

22、融券业务情况

单位: 人民币元

项目	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
融出证券	6,151,001,298.33	4,419,334,352.76
交易性金融资产	1,336,863,763.37	954,763,298.34
其中: 股票	723,407,520.45	643,443,406.74
基金	613,456,242.92	311,319,891.60
其他权益工具投资 - 股票	788,388,276.55	1,866,595,325.98
转融通融入证券	4,025,749,258.41	1,597,975,728.44
转融通融入证券总额	6,609,713,616.17	3,093,306,897.00

注: 本期融券业务无违约情况 (2022 年: 同)。

五、合并财务报表项目附注 (续)

23、资产减值准备变动表

单位：人民币元

项目	年初余额	本期增加 (含汇率变动)		本期减少			期末余额
		计提	其他增加	转回	核销	其他减少	
货币资金减值准备	14,585,172.22	140,385.34	293,694.98	1,292,667.01	-	-	13,726,585.53
融出资金减值准备	2,182,740,999.98	287,494,589.61	41,966,567.10	2,336.60	-	-	2,512,199,820.09
应收款项坏账准备	322,031,281.12	39,430,439.97	8,439,012.65	5,700,758.99	186,112.13	410,189.79	363,603,672.83
其他应收款坏账准备	557,519,322.82	18,981,227.21	2,634,398.70	6,377,986.38	-	-	572,756,962.35
买入返售金融资产减值准备	564,557,629.95	66,586,656.62	-	12,194,402.26	-	224.91	618,949,659.40
发放贷款和垫款损失准备	109,801,071.55	7,336,683.57	10,402,448.29	7,698,843.42	7,815,327.54	-	112,026,032.45
应收融资租赁款减值准备	1,589,892,329.84	145,668,145.85	-	-	262,739,279.93	351,660,303.51	1,121,160,892.25
长期应收款减值准备	1,185,029,179.49	459,552,320.16	43,020.41	-	7,848,383.12	4,538,806.28	1,632,237,330.66
其他贷款和应收款项减值准备	841,237,481.73	240,527,665.09	44,748,663.91	5,192,047.00	-	-	1,121,321,763.73
其他债权投资减值准备	204,408,510.22	13,018,060.73	2,069,542.62	53,487,522.85	-	-	166,008,590.72
债权投资减值准备	18,990,282.37	8,532,447.74	1,623,230.75	1,249,597.59	-	-	27,896,363.27
其他金融资产减值准备	84,673,772.47	9,751,981.45	2,932,809.36	-	-	11,939,865.01	85,418,698.27
金融工具及其他项目信用减值准备小计	7,675,467,033.76	1,297,020,603.34	115,153,388.77	93,196,162.10	278,589,102.72	368,549,389.50	8,347,306,371.55
投资性房地产减值准备	-	1,823,957.38	-	-	-	-	1,823,957.38
固定资产减值准备	86,040,033.98	-	2,059,915.38	-	-	-	88,099,949.36
商誉减值准备	446,635,000.00	-	14,355,000.00	-	-	-	460,990,000.00
其他资产减值准备	73,796,593.05	8,053,883.56	48,676.44	-	725,320.28	1,664,424.91	79,509,407.86
其他资产减值准备小计	606,471,627.03	9,877,840.94	16,463,591.82	-	725,320.28	1,664,424.91	630,423,314.60
合计	8,281,938,660.79	1,306,898,444.28	131,616,980.59	93,196,162.10	279,314,423.00	370,213,814.41	8,977,729,686.15

24、金融工具及其他项目预期信用损失准备表

单位：人民币元

金融工具类别	2023年6月30日			合计
	未来12个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失 (已发生信用减值)	
货币资金减值准备	13,726,585.53	-	-	13,726,585.53
融出资金减值准备	40,895,699.45	6,237,238.84	2,465,066,881.80	2,512,199,820.09
应收款项坏账准备	77,217,279.38	114,975,045.71	171,411,347.74	363,603,672.83
其他应收款坏账准备	10,955,223.91	46,960,586.58	514,841,151.86	572,756,962.35
买入返售金融资产减值准备	14,211,614.99	1,787,420.08	602,950,624.33	618,949,659.40
发放贷款和垫款损失准备	26,235,188.40	41,513,105.61	44,277,738.44	112,026,032.45
应收融资租赁款减值准备	342,619,169.87	415,481,494.89	363,060,227.49	1,121,160,892.25
长期应收款减值准备	937,413,134.30	398,240,614.14	296,583,582.22	1,632,237,330.66
其他贷款和应收款项减值准备	4,599,431.54	244,378,279.29	872,344,052.90	1,121,321,763.73
其他债权投资减值准备	46,219,612.94	108,966,531.83	10,822,445.95	166,008,590.72
债权投资减值准备	23,176,188.97	4,720,174.30	-	27,896,363.27
其他金融资产减值准备	33,298,473.69	-	52,120,224.58	85,418,698.27
合计	1,570,567,602.97	1,383,260,491.27	5,393,478,277.31	8,347,306,371.55

五、合并财务报表项目附注 (续)

24、金融工具及其他项目预期信用损失准备表 (续)

单位: 人民币元

金融工具类别	2022年12月31日			合计
	未来12个月 预期信用损失	整个存续期 预期信用损失 (未发生信用减值)	整个存续期 预期信用损失 (已发生信用减值)	
货币资金减值准备	14,585,172.22	-	-	14,585,172.22
融出资金减值准备	52,120,819.21	31,983,648.30	2,098,636,532.47	2,182,740,999.98
应收款项坏账准备	76,476,906.15	88,651,709.13	156,902,665.84	322,031,281.12
其他应收款坏账准备	75,510,108.22	47,988,585.71	434,020,628.89	557,519,322.82
买入返售金融资产减值准备	13,571,221.53	1,692,570.14	549,293,838.28	564,557,629.95
发放贷款和垫款损失准备	22,710,512.50	40,253,359.56	46,837,199.49	109,801,071.55
应收融资租赁款减值准备	439,313,584.68	531,299,164.62	619,279,580.54	1,589,892,329.84
长期应收款减值准备	952,361,272.37	159,714,874.60	72,953,032.52	1,185,029,179.49
其他贷款和应收款减值准备	26,938,763.36	160,167,462.13	654,131,256.24	841,237,481.73
其他债权投资减值准备	86,988,582.58	117,419,927.64	-	204,408,510.22
债权投资减值准备	18,990,282.37	-	-	18,990,282.37
其他金融资产减值准备	28,005,082.41	3,359,250.49	53,309,439.57	84,673,772.47
合计	1,807,572,307.60	1,182,530,552.32	4,685,364,173.84	7,675,467,033.76

25、短期借款

单位: 人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
信用借款	33,859,380,983.50	34,566,945,419.43
抵质押借款	1,191,687,415.34	291,097,313.24
合计	35,051,068,398.84	34,858,042,732.67

注: 短期借款质押物情况详见附注十一、1、(1)。

五、合并财务报表项目附注 (续)

26、应付短期融资款

单位：人民币元

发行主体	类型	起息日期	到期日期	票面利率	2022年12月31日	本期增加	本期减少	2023年6月30日
海通证券股份有限公司	短期公司债券	2022年6月9日	2023年6月9日	2.50%	4,563,493,150.68	49,006,849.32	4,612,500,000.00	-
海通证券股份有限公司	短期收益凭证	2022年7月4日至 2023年6月30日	2023年7月2日至 2024年6月30日	0.00%-2.92%	2,647,746,453.40	6,321,060,753.43	4,386,581,461.04	4,582,225,745.79
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2022年5月25日	2023年2月17日	2.05%	1,012,128,648.56	2,639,726.02	1,014,768,374.58	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2022年6月15日	2023年3月10日	2.06%	505,442,571.79	1,918,904.12	507,361,475.91	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2022年8月9日	2023年4月21日	2.03%	1,007,492,738.09	6,117,808.22	1,013,610,546.31	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2022年8月23日	2023年4月28日	1.86%	1,006,089,682.87	5,962,191.78	1,012,051,874.65	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2022年10月26日	2023年3月10日	1.86%	501,435,186.32	1,732,602.75	503,167,789.07	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	短期融资券	2022年10月25日	2023年10月25日	2.45%	1,003,519,613.40	12,793,408.42	-	1,016,313,021.82
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2022年11月16日	2023年8月11日	2.51%	1,002,700,426.03	12,798,395.69	-	1,015,498,821.72
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	短期融资券	2023年1月10日	2024年1月10日	3.41%	-	1,015,357,101.81	-	1,015,357,101.81
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2023年2月15日	2023年8月25日	2.63%	-	1,009,625,810.83	-	1,009,625,810.83
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2023年3月8日	2023年9月22日	2.73%	-	1,008,399,229.42	-	1,008,399,229.42
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2023年4月19日	2023年11月24日	2.48%	-	1,004,535,255.70	-	1,004,535,255.70
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	超短期融资券	2023年4月26日	2024年1月19日	2.56%	-	1,003,767,157.40	-	1,003,767,157.40
海通国际证劵集团有限公司	中期票据	2022年2月17日	2023年2月16日	1.00%	923,319,450.84	29,675,799.51	952,995,250.35	-
海通国际证劵集团有限公司	中期票据	2022年6月8日	2023年1月9日	2.10%	1,536,732,747.02	49,391,110.38	1,586,123,857.40	-
海通国际证劵集团有限公司	中期票据	2022年6月9日	2023年1月10日	2.00%	90,338,268.81	2,903,502.53	93,241,771.34	-
海通国际证劵集团有限公司	中期票据	2022年8月26日	2023年8月24日	4.10%	358,655,432.48	22,095,937.41	-	380,751,369.89
海通国际证劵集团有限公司	中期票据	2023年1月27日	2023年7月27日	5.00%	-	376,491,332.50	-	376,491,332.50
海通国际证劵集团有限公司	中期票据	2023年2月9日	2024年2月8日	4.70%	-	283,694,279.30	-	283,694,279.30
海通国际证劵集团有限公司	中期票据	2023年2月16日	2023年11月16日	5.15%	-	288,620,692.95	-	288,620,692.95
合计					16,159,094,370.29	12,508,587,849.49	15,682,402,400.65	12,985,279,819.13

注：于2023年6月30日，应付短期融资款包括未到期偿付的短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据以及原始期限为1年以内的收益凭证。于2023年6月30日及2022年12月31日，本集团发行的应付短期融资券没有出项本金、利息或赎回款项的违约情况。

五、合并财务报表项目附注 (续)

27、拆入资金

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
银行拆入	2,965,841,869.78	3,244,642,810.67
转融通业务融入	6,057,050,000.00	3,031,458,333.33
合计	9,022,891,869.78	6,276,101,144.00

本公司转融通融入资金的剩余期限及利率如下表所示：

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	利率	2022年12月31日	利率
1至3个月	6,057,050,000.00	2.10%	3,031,458,333.33	2.50%

28、交易性金融负债

单位：人民币元

2023年6月30日			
项目	为交易目的而持有的金融负债	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 (注)	公允价值合计
债券	1,740,996,550.00	-	1,740,996,550.00
黄金期权	-	890,944,636.46	890,944,636.46
归属结构化主体其他份额持有人的利益	-	1,211,517,193.36	1,211,517,193.36
结构化收益产品	-	11,803,022,337.02	11,803,022,337.02
其他	878,517,843.55	5,996,258,065.16	6,874,775,908.71
合计	2,619,514,393.55	19,901,742,232.00	22,521,256,625.55

单位：人民币元

2022年12月31日			
项目	为交易目的而持有的金融负债	指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债 (注)	公允价值合计
黄金期权	-	279,483,104.82	279,483,104.82
归属结构化主体其他份额持有人的利益	-	702,487,735.93	702,487,735.93
结构化收益产品	-	16,122,779,742.64	16,122,779,742.64
其他	286,697,318.98	5,497,031,942.22	5,783,729,261.20
合计	286,697,318.98	22,601,782,525.61	22,888,479,844.59

注：于2023年6月30日和2022年12月31日，本集团的指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的公允价值与按合同到期日应支付持有人的金额的差异并不重大。由于本集团自身信用风险变化导致上述金融负债公允价值变化的金额并不重大。本集团指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债主要为本集团发行的结构化收益产品、收益凭证以及纳入合并范围内的结构化主体中归属于第三方权益等。

五、合并财务报表项目附注（续）

29、卖出回购金融资产款

(1) 按金融资产种类列示

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
股票	2,393,547,802.15	3,025,125,034.23
债券	70,214,887,476.88	87,906,635,862.92
黄金	10,458,209,553.94	10,762,595,640.10
合计	83,066,644,832.97	101,694,356,537.25

(2) 按业务类别列示

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
债券质押式报价回购	4,953,711,262.76	694,201,360.68
其他质押式回购	56,259,207,143.41	80,408,890,923.81
买断式回购	11,395,516,872.86	9,828,668,612.66
黄金掉期业务	10,458,209,553.94	10,762,595,640.10
合计	83,066,644,832.97	101,694,356,537.25

(3) 债券质押式报价回购的剩余期限和利率区间

单位：人民币元

剩余期限	2023年6月30日	利率区间	2022年12月31日	利率区间
一个月以内	1,365,807,793.83	0.50%-8.18%	173,564,620.51	1.00%-8.18%
一个月至三个月内	325,076,942.90		14,178,215.38	
三个月至一年以内	3,262,826,526.03		506,458,524.79	
合计	4,953,711,262.76		694,201,360.68	

(4) 卖出回购金融资产款的担保物信息

单位：人民币元

担保物类别	2023年6月30日	2022年12月31日
股票	2,737,444,082.94	3,370,775,844.22
债券	76,054,726,779.23	94,490,939,741.30
其他	16,935,731,780.75	11,934,656,831.80
合计	95,727,902,642.92	109,796,372,417.32

五、合并财务报表项目附注 (续)

30、代理买卖证券款

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
普通经纪业务		
- 个人	66,121,865,789.90	65,447,619,529.96
- 机构	45,664,183,573.50	42,430,421,582.24
小计	111,786,049,363.40	107,878,041,112.20
信用业务		
- 个人	6,224,807,286.24	5,923,990,808.60
- 机构	1,898,631,711.30	1,711,431,445.41
小计	8,123,438,997.54	7,635,422,254.01
合计	119,909,488,360.94	115,513,463,366.21

31、应付职工薪酬

(1) 应付职工薪酬列示

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
短期薪酬 (2)	3,783,273,581.22	4,092,974,144.57
离职后福利设定提存计划 (3)	23,609,989.47	18,968,822.90
其他长期职工福利 (2)	372,767,055.03	373,067,790.92
合计	4,179,650,625.72	4,485,010,758.39

(2) 短期薪酬及其他长期职工福利列示

单位：人民币元

项目	2022年12月31日	本期增加额	本期减少额	2023年6月30日
一、工资、奖金、津贴和补贴	4,419,276,113.62	2,681,369,429.58	3,006,775,498.71	4,093,870,044.49
二、职工福利费	10,795,905.40	70,311,730.72	69,849,878.42	11,257,757.70
三、社会保险费	16,747,792.67	203,757,474.41	200,568,446.89	19,936,820.19
其中：医疗保险费	14,040,548.47	129,925,383.90	128,183,710.25	15,782,222.12
工伤保险费	238,015.79	2,688,063.05	2,662,396.11	263,682.73
生育保险费	14,964.60	1,350,428.30	1,352,298.43	13,094.47
四、住房公积金	11,993,908.25	172,218,330.16	170,052,295.53	14,159,942.88
五、工会经费和职工教育经费	7,228,215.55	57,347,577.57	47,759,722.13	16,816,070.99
六、因解除劳动关系给予的补偿	-	10,617,339.49	10,617,339.49	-
七、其他	-	9,298,045.03	9,298,045.03	-
合计	4,466,041,935.49	3,204,919,926.96	3,514,921,226.20	4,156,040,636.25
其中：短期薪酬	4,092,974,144.57			3,783,273,581.22
其他长期职工福利	373,067,790.92			372,767,055.03

五、合并财务报表项目附注 (续)

31、应付职工薪酬 (续)

(3) 设定提存计划

单位：人民币元

项目	2022年12月31日	本期增加	本期减少	2023年6月30日
基本养老保险	17,849,571.07	219,347,500.84	216,630,246.54	20,566,825.37
失业保险费	691,710.13	6,922,540.53	6,963,353.14	650,897.52
企业年金缴费	427,541.70	221,315,392.31	219,350,667.43	2,392,266.58
合计	18,968,822.90	447,585,433.68	442,944,267.11	23,609,989.47

32、应交税费

单位：人民币元

税费项目	2023年6月30日	2022年12月31日
企业所得税	700,304,713.23	1,729,484,850.27
个人所得税	261,535,137.59	207,510,515.12
增值税	84,243,196.09	110,434,781.33
城建税	5,378,985.92	5,819,620.57
教育费附加及地方教育费附加	3,827,813.14	4,717,074.47
其他	124,454,517.45	139,840,870.48
合计	1,179,744,363.42	2,197,807,712.24

33、应付款项

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
应付各类清算款	3,236,544,374.76	2,899,715,192.85
收益互换保证金	5,914,967,697.88	3,849,458,228.60
应付票据	1,589,145,555.67	2,047,520,882.31
其他	2,703,846,081.44	2,694,132,293.06
合计	13,444,503,709.75	11,490,826,596.82

期末余额中无欠持公司 5% 以上 (含 5%) 表决权股份的股东单位款项。

五、合并财务报表项目附注 (续)

34、预计负债

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
对外提供担保	19,874,169.45	12,417,195.81
未决诉讼及其他	189,623,764.69	189,288,250.87
合计	209,497,934.14	201,705,446.68

35、长期借款

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	利率区间	2022年12月31日	利率区间
信用借款	35,082,480,404.34	0.40%-4.70%	33,332,670,346.78	1.75%-6.24%
抵押借款	16,738,314,321.12	3.05%-7.01%	18,399,853,380.86	2.93%-6.44%
保证借款	-	-	4,225,678,995.92	4.93%
合计	51,820,794,725.46		55,958,202,723.56	

注 1：基于贷款合同对息税折旧及摊销前利润与融资成本比率约定了相关要求，海通国际控股已于本财务报表批准报出前就其截至 2023 年 6 月 30 日账面价值为港币 31.80 亿元 (折合人民币 29.32 亿元) 的银行贷款潜在无法满足贷款合同约定比率获得了有关银行的豁免。

注 2：长期借款质押物情况详见附注十一、1、(1)。

五、合并财务报表项目附注 (续)

36、应付债券

发行主体	债券类型	币种	面值 (原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2022年12月31日	本期增加	本期减少	2023年6月30日
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,390,000,000.00	2013年11月25日	2023年11月25日	6.18%	2,402,796,408.99	73,465,331.81	-	2,476,261,740.80
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	800,000,000.00	2014年7月14日	2024年7月14日	5.85%	821,693,735.48	23,280,443.53	-	844,974,179.01
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,500,000,000.00	2017年9月22日	2027年9月22日	4.99%	5,565,490,032.73	136,559,117.45	-	5,702,049,150.18
海通证券股份有限公司	公司债券	美元	300,000,000.00	2018年12月13日	2023年12月13日	4.50%	2,091,000,537.22	222,357,000.13	142,439,215.85	2,170,918,321.50
海通证券股份有限公司	公司债券	欧元	230,000,000.00	2018年12月13日	2023年12月13日	Euribor+165bps	1,704,749,370.17	176,829,055.90	70,545,552.08	1,811,032,873.99
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2020年2月27日	2023年2月27日	3.01%	5,126,498,472.84	24,001,527.16	5,150,500,000.00	-
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,500,000,000.00	2020年3月19日	2023年3月19日	2.99%	3,582,103,174.09	22,546,825.91	3,604,650,000.00	-
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,600,000,000.00	2020年4月30日	2023年4月30日	2.38%	5,688,670,203.04	44,609,796.96	5,733,280,000.00	-
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	700,000,000.00	2020年4月30日	2025年4月30日	2.88%	712,972,092.12	10,115,351.67	20,160,000.00	702,927,443.79
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	6,700,000,000.00	2020年5月25日	2023年5月25日	2.70%	6,807,858,770.41	73,041,229.59	6,880,900,000.00	-
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	6,000,000,000.00	2020年8月11日	2023年8月11日	3.53%	6,080,675,776.34	106,903,812.79	-	6,187,579,589.13
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	6,000,000,000.00	2021年1月13日	2024年1月13日	3.58%	6,203,833,661.31	108,373,471.52	214,800,000.00	6,097,407,132.83
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,400,000,000.00	2021年2月8日	2024年2月8日	3.79%	5,579,597,250.47	103,155,976.27	204,660,000.00	5,478,093,226.74
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2021年4月23日	2024年4月23日	3.45%	5,115,449,196.96	86,991,248.11	172,500,000.00	5,029,940,445.07
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,800,000,000.00	2021年5月27日	2024年5月27日	3.35%	2,853,809,454.26	47,351,104.54	93,800,000.00	2,807,360,558.80
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,100,000,000.00	2021年6月10日	2024年6月10日	3.40%	2,138,197,893.83	36,040,707.78	71,400,000.00	2,102,838,601.61
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,000,000,000.00	2021年7月29日	2024年7月29日	3.14%	2,024,859,157.88	31,755,970.43	-	2,056,615,128.31
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,000,000,000.00	2021年8月20日	2024年8月20日	3.04%	3,030,396,041.60	46,145,795.79	-	3,076,541,837.39
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,000,000,000.00	2021年8月30日	2024年8月30日	3.10%	2,018,971,546.40	31,358,421.74	-	2,050,329,968.14
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,000,000,000.00	2021年8月30日	2026年8月30日	3.43%	2,020,541,627.70	34,372,263.03	-	2,054,913,890.73
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2021年11月10日	2024年11月10日	3.10%	5,016,234,339.15	78,390,704.64	-	5,094,625,043.79
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2021年11月22日	2024年11月22日	3.09%	5,010,980,456.82	78,141,985.92	-	5,089,122,442.74
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2022年1月20日	2024年12月25日	2.84%	5,128,222,016.90	71,925,020.82	142,000,000.00	5,058,147,037.72
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,900,000,000.00	2022年2月21日	2025年2月21日	2.90%	2,968,443,535.52	42,587,580.30	84,100,000.00	2,926,931,115.82
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	500,000,000.00	2022年3月7日	2025年3月7日	3.03%	511,766,652.06	7,851,328.89	15,150,000.00	504,267,980.95
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2022年7月26日	2025年7月26日	2.75%	5,051,830,663.55	69,699,759.41	-	5,121,530,422.96

五、合并财务报表项目附注 (续)

36、应付债券 (续)

(续上表)

发行主体	债券类型	币种	面值 (原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2022年12月31日	本期增加	本期减少	2023年6月30日
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	5,000,000,000.00	2022年9月9日	2025年9月9日	2.53%	5,031,056,002.07	64,245,843.39	-	5,095,301,845.46
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	4,700,000,000.00	2022年10月14日	2025年10月14日	2.60%	4,718,219,462.50	62,019,533.98	-	4,780,238,996.48
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,000,000,000.00	2022年11月10日	2025年11月10日	2.61%	3,005,763,004.37	39,734,635.05	-	3,045,497,639.42
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,700,000,000.00	2022年12月13日	2023年12月20日	2.90%	2,699,241,047.98	41,178,694.19	-	2,740,419,742.17
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,500,000,000.00	2023年2月8日	2025年2月8日	2.95%	-	2,525,073,299.16	-	2,525,073,299.16
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,000,000,000.00	2023年2月8日	2026年2月8日	3.23%	-	3,033,006,712.81	-	3,033,006,712.81
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,500,000,000.00	2023年3月6日	2025年3月6日	3.11%	-	2,520,866,033.80	-	2,520,866,033.80
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	1,700,000,000.00	2023年3月6日	2026年3月6日	3.26%	-	1,714,832,942.62	-	1,714,832,942.62
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,300,000,000.00	2023年3月22日	2025年3月22日	2.97%	-	3,321,649,474.24	-	3,321,649,474.24
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,700,000,000.00	2023年3月22日	2026年3月22日	3.10%	-	2,718,447,831.90	-	2,718,447,831.90
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,000,000,000.00	2023年4月24日	2025年4月24日	2.89%	-	2,007,301,786.97	-	2,007,301,786.97
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	4,000,000,000.00	2023年4月24日	2026年4月24日	3.05%	-	4,015,560,517.34	-	4,015,560,517.34
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,600,000,000.00	2023年5月18日	2026年5月18日	2.94%	-	3,606,186,370.76	-	3,606,186,370.76
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	1,400,000,000.00	2023年5月18日	2028年5月18日	3.10%	-	1,402,633,439.75	-	1,402,633,439.75
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	3,000,000,000.00	2023年6月15日	2026年6月15日	2.73%	-	2,997,994,194.99	-	2,997,994,194.99
海通证券股份有限公司	公司债券	人民币	2,000,000,000.00	2023年6月15日	2028年6月15日	3.07%	-	1,998,939,191.37	-	1,998,939,191.37
海通证券股份有限公司	次级债券	人民币	5,000,000,000.00	2022年1月12日	2025年1月12日	3.18%	5,147,818,580.20	80,368,709.73	159,000,000.00	5,069,187,289.93
海通证券股份有限公司	次级债券	人民币	2,000,000,000.00	2022年2月25日	2025年2月25日	3.15%	2,050,799,637.54	31,848,813.96	63,000,000.00	2,019,648,451.50
海通证券股份有限公司	次级债券	人民币	2,480,000,000.00	2022年3月9日	2025年3月9日	3.29%	2,543,206,709.85	41,141,990.79	81,592,000.00	2,502,756,700.64
海通证券股份有限公司	收益凭证	人民币	753,297,000.00	2021年7月5日至 2023年6月30日	2023年6月30日至 2025年6月25日	0.00%-3.50%	595,787,047.14	447,756,820.31	281,566,589.47	761,977,277.98
上海海通证券资产管理有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2020年11月4日	2025年11月4日	3.85%	1,006,012,328.71	19,091,780.81	-	1,025,104,109.52
上海海通证券资产管理有限公司	次级债券	人民币	1,000,000,000.00	2018年4月4日	2023年4月4日	5.00%	103,726,027.31	1,273,972.69	105,000,000.00	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2020年5月11日	2023年5月11日	3.50%	1,021,766,906.72	12,465,753.40	1,034,232,660.12	-

五、合并财务报表项目附注 (续)

36、应付债券 (续)

(续上表)

发行主体	债券类型	币种	面值 (原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2022年12月31日	本期增加	本期减少	2023年6月30日
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,200,000,000.00	2020年7月28日	2023年7月28日	4.00%	1,219,165,347.70	25,070,131.41	-	1,244,235,479.11
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2020年9月17日	2023年9月17日	4.20%	1,010,666,911.57	21,842,008.91	-	1,032,508,920.48
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	800,000,000.00	2020年10月30日	2023年10月30日	4.15%	804,368,718.61	17,274,646.37	-	821,643,364.98
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2021年4月26日	2025年4月26日	3.65%	1,027,185,640.81	697,473,808.25	1,037,957,115.35	686,702,333.71
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	800,000,000.00	2021年6月18日	2023年6月15日	3.85%	815,697,647.36	14,176,438.36	829,874,085.72	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	600,000,000.00	2021年8月12日	2024年8月12日	3.90%	607,367,482.78	12,112,342.07	-	619,479,824.85
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2021年10月25日	2023年10月25日	3.80%	1,005,094,498.50	20,065,593.36	-	1,025,160,091.86
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2021年12月24日	2024年12月24日	3.70%	997,950,669.33	19,145,556.62	-	1,017,096,225.95
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,500,000,000.00	2022年4月21日	2024年4月21日	3.48%	1,531,627,201.00	25,885,479.46	50,193,321.62	1,507,319,358.84
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	500,000,000.00	2022年5月5日	2025年5月5日	3.57%	509,827,190.90	8,851,643.85	17,346,731.30	501,332,103.45
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2022年6月21日	2024年6月21日	3.16%	1,013,122,785.92	15,670,136.99	30,484,408.27	998,308,514.64
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	600,000,000.00	2022年7月7日	2025年7月7日	3.44%	607,330,112.27	10,904,570.44	-	618,234,682.71
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2022年10月21日	2025年10月21日	3.13%	1,001,299,263.65	16,359,732.05	-	1,017,658,995.70
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2023年4月17日	2026年4月17日	3.90%	-	1,004,362,894.14	-	1,004,362,894.14
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	公司债券	人民币	1,000,000,000.00	2023年6月26日	2028年6月26日	3.80%	-	997,239,842.74	-	997,239,842.74
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	500,000,000.00	2020年8月31日	2023年8月31日	4.20%	506,524,720.64	10,826,185.61	-	517,350,906.25

五、合并财务报表项目附注（续）

36、应付债券（续）

（续上表）

发行主体	债券类型	币种	面值（原币）	起息日期	到期日期	票面利率	2022年12月31日	本期增加	本期减少	2023年6月30日
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	500,000,000.00	2021年1月20日	2023年1月20日	4.00%	518,889,743.97	1,041,095.81	519,930,839.78	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	1,000,000,000.00	2021年12月9日	2024年12月9日	3.70%	999,074,241.41	19,174,681.67	-	1,018,248,923.08
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	800,000,000.00	2022年1月13日	2025年1月13日	3.64%	825,379,339.87	14,440,328.77	28,418,297.80	811,401,370.84
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	1,000,000,000.00	2022年5月27日	2025年5月27日	3.42%	1,016,579,183.79	16,959,452.03	33,380,664.80	1,000,157,971.02
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	1,200,000,000.00	2022年8月10日	2025年8月10日	3.25%	1,210,215,298.24	20,328,776.14	-	1,230,544,074.38
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	1,000,000,000.00	2022年12月14日	2025年12月14日	4.13%	998,270,712.33	21,133,519.89	-	1,019,404,232.22
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	1,000,000,000.00	2023年2月23日	2026年2月23日	4.20%	-	1,011,870,565.43	-	1,011,870,565.43
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	中期票据	人民币	1,000,000,000.00	2023年6月6日	2026年6月6日	3.81%	-	999,291,438.10	-	999,291,438.10
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持票据	人民币	950,000,000.00	2021年11月29日	2023年5月26日	3.95%	186,326,876.34	1,198,354.21	187,525,230.55	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持票据	人民币	950,000,000.00	2022年3月10日	2024年8月26日	3.30%、3.50%	453,065,750.32	5,824,228.61	227,083,639.60	231,806,339.33
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持票据	人民币	855,000,000.00	2022年7月22日	2023年1月18日	2.30%	863,410,890.45	915,904.12	864,326,794.57	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持票据	人民币	950,000,000.00	2022年9月21日	2023年3月20日	2.10%	954,136,749.19	4,263,287.67	958,400,036.86	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持票据	人民币	955,000,000.00	2023年1月18日	2023年7月19日	2.98%	-	967,446,509.28	-	967,446,509.28
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持票据	人民币	950,000,000.00	2023年3月20日	2023年9月15日	2.96%	-	956,867,778.43	-	956,867,778.43
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	190,000,000.00	2020年4月7日	2023年2月13日	5.00%	191,107,208.46	1,119,177.97	192,226,386.43	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2020年10月22日	2023年6月26日	4.30%	7,029,798.64	71,049.29	7,100,847.93	-

五、合并财务报表项目附注 (续)

36、应付债券 (续)

(续上表)

发行主体	债券类型	币种	面值 (原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2022年12月31日	本期增加	本期减少	2023年6月30日
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2020年12月9日	2023年1月30日	4.30%	40,603,764.52	137,940.67	40,741,705.19	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2021年2月2日	2023年2月27日	4.55%	44,799,384.26	317,344.83	45,116,729.09	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2021年3月25日	2023年2月27日	4.50%	49,386,874.46	346,465.19	49,733,339.65	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2021年4月29日	2023年6月26日	4.00%、4.50%	88,165,460.73	1,204,820.52	89,370,281.25	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2021年5月31日	2023年1月26日	4.35%	39,330,666.66	135,522.81	39,466,189.47	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2021年6月17日	2023年5月26日	3.80%、4.40%	84,519,101.04	669,198.31	85,188,299.35	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2021年8月5日	2023年6月26日	3.50%、4.20%	113,787,376.15	1,389,505.64	115,176,881.79	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2021年9月24日	2023年4月26日	3.83%、3.99%	139,084,809.59	487,944.63	139,572,754.22	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2021年11月19日	2023年5月26日	3.80%、3.95%	231,732,821.26	2,418,573.01	234,151,394.27	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2021年12月8日	2023年8月28日	4.00%	179,703,684.39	1,834,905.27	176,310,291.22	5,228,298.44
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2022年1月26日	2023年5月26日	3.30%、3.40%	140,866,270.75	732,936.51	141,599,207.26	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	935,000,000.00	2022年4月28日	2024年12月27日	3.60%、4.40%	463,660,623.62	4,234,374.20	187,904,292.02	279,990,705.80
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2022年6月29日	2025年2月26日	3.19%、3.60%	698,906,333.96	8,901,861.73	288,127,982.36	419,680,213.33
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	943,000,000.00	2022年7月7日	2025年9月15日	3.50%、4.30%	650,114,819.44	10,044,085.21	213,805,464.59	446,353,440.06
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,425,000,000.00	2022年9月16日	2025年12月25日	4.10%	1,395,618,573.97	28,972,397.26	24,304,157.69	1,400,286,813.54

五、合并财务报表项目附注(续)

36、应付债券(续)

(续上表)

发行主体	债券类型	币种	面值(原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2022年12月31日	本期增加	本期减少	2023年6月30日
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2022年9月21日	2025年8月26日	2.25%-3.40%	817,694,421.26	9,842,805.17	258,505,427.58	569,031,798.85
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	984,000,000.00	2022年10月28日	2025年8月15日	3.03%-4.00%	1,007,143,971.46	5,083,324.33	484,608,072.00	527,619,223.79
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,425,000,000.00	2022年12月23日	2025年12月25日	4.48%	1,401,009,935.20	31,657,643.85	28,316,265.60	1,404,351,313.45
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2022年12月23日	2023年11月22日	4.30%	630,296,508.44	335,257,123.28	13,907,004.06	951,646,627.66
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2023年1月13日	2025年8月26日	3.96%-4.70%	-	961,478,734.00	264,331,240.00	697,147,494.00
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	737,000,000.00	2023年3月10日	2025年10月23日	3.58%-4.80%	-	765,248,904.50	-	765,248,904.50
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2023年3月16日	2025年7月28日	3.20%-4.00%	-	953,741,077.57	217,022,850.00	736,718,227.57
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2023年5月24日	2025年12月26日	2.68%-3.62%	-	947,339,350.12	-	947,339,350.12
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2023年6月7日	2026年3月26日	2.70%-3.58%	-	943,868,685.93	-	943,868,685.93
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	非公开定向债务融资工具	人民币	1,000,000,000.00	2021年6月4日	2023年6月4日	3.95%	1,022,001,231.32	16,665,753.44	1,038,666,984.76	-
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	非公开定向债务融资工具	人民币	1,000,000,000.00	2021年11月11日	2024年11月11日	4.19%	1,002,893,155.35	21,559,141.22	-	1,024,452,296.57
海通恒信国际融资租赁股份有限公司/海通恒信小微融资租赁(上海)有限公司	资产支持专项计划	人民币	950,000,000.00	2023年4月10日	2024年5月26日	2.90%、3.29%	-	952,329,155.75	-	952,329,155.75
海通恒信国际融资租赁股份有限公司/海通恒信小微融资租赁(上海)有限公司	资产支持专项计划	人民币	760,000,000.00	2021年12月29日	2023年8月15日	3.95%	235,532,711.79	2,631,878.16	200,527,997.31	37,636,592.64
海通恒信国际融资租赁股份有限公司/海通恒信小微融资租赁(上海)有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,140,000,000.00	2022年4月13日	2023年12月26日	3.24%、3.40%	418,334,265.87	5,436,805.62	301,940,399.01	121,830,672.48

五、合并财务报表项目附注 (续)

36、应付债券 (续)

(续上表)

发行主体	债券类型	币种	面值 (原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2022年12月31日	本期增加	本期减少	2023年6月30日
海通恒信国际融资租赁股份有限公司/海通恒信小微融资租赁(上海)有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,140,000,000.00	2022年5月18日	2024年3月26日	2.95%、3.20%	567,139,621.12	6,994,186.58	328,264,379.30	245,869,428.40
海通恒信国际融资租赁股份有限公司/海通恒信小微融资租赁(上海)有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,140,000,000.00	2022年7月12日	2024年5月27日	3.00%、3.03%	790,671,478.08	8,993,337.01	381,298,857.63	418,365,957.46
海通恒信国际融资租赁股份有限公司/海通恒信小微融资租赁(上海)有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,140,000,000.00	2022年9月8日	2024年8月26日	2.30%-2.80%	958,318,393.81	10,264,963.23	379,529,484.15	589,053,872.89
海通恒信国际融资租赁股份有限公司/海通恒信小微融资租赁(上海)有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,140,000,000.00	2022年11月25日	2024年11月26日	3.18%-3.60%	1,136,239,734.08	16,190,804.41	416,716,274.86	735,714,263.63
海通恒信国际融资租赁股份有限公司/海通恒信小微融资租赁(上海)有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,140,000,000.00	2023年3月8日	2025年1月26日	3.15%-3.70%	-	1,145,800,791.21	279,790,060.00	866,010,731.21
海通恒信国际融资租赁股份有限公司/海通恒信小微融资租赁(上海)有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,140,000,000.00	2023年5月16日	2025年3月26日	2.69%-3.43%	-	1,138,100,266.74	-	1,138,100,266.74
海通恒信国际融资租赁股份有限公司/海通恒信小微融资租赁(上海)有限公司	资产支持专项计划	人民币	1,140,000,000.00	2023年6月27日	2025年6月26日	2.69%-3.41%	-	1,133,741,683.70	-	1,133,741,683.70
Haitong UT Brilliant Limited	中期票据	美元	100,000,000.00	2021年6月3日	2024年6月3日	3.00%	672,836,423.29	36,453,591.47	3,001,535.60	706,288,479.16
Haitong UT Brilliant Limited	中期票据	美元	200,000,000.00	2022年4月27日	2025年4月27日	4.20%	1,398,585,034.97	82,299,672.43	28,777,154.53	1,452,107,552.87
海通国际证券集团有限公司	公司债券	美元	700,000,000.00	2019年7月19日	2024年7月19日	3.38%	4,940,162,126.81	184,466,308.89	-	5,124,628,435.70
海通国际证券集团有限公司	公司债券	美元	400,000,000.00	2019年11月18日	2025年5月18日	3.13%	2,784,762,499.25	104,668,027.35	-	2,889,430,526.60
海通国际证券集团有限公司	公司债券	美元	400,000,000.00	2020年7月2日	2023年7月2日	2.13%	2,812,755,247.44	105,758,167.96	-	2,918,513,415.40
海通国际证券集团有限公司	公司债券	美元	300,000,000.00	2021年5月20日	2026年5月20日	2.13%	2,088,114,053.97	77,624,918.87	-	2,165,738,972.84
Haitong International Finance Holdings 2015 Limited	公司债券	美元	670,000,000.00	2020年3月12日	2025年3月11日	2.11%	4,690,174,497.83	185,797,877.54	8,539,029.24	4,867,433,346.13

五、合并财务报表项目附注 (续)

36、应付债券 (续)

(续上表)

发行主体	债券类型	币种	面值 (原币)	起息日期	到期日期	票面利率	2022年12月31日	本期增加	本期减少	2023年6月30日
Haitong International Finance Holdings Limited	公司债券	人民币	4,000,000,000.00	2023年4月20日	2026年4月20日	3.40%	-	4,026,738,981.61	-	4,026,738,981.61
Haitong International Finance Holdings Limited	公司债券	人民币	2,800,000,000.00	2023年5月18日	2026年5月18日	3.20%	-	2,810,739,380.09	-	2,810,739,380.09
Haitong Investment Ireland PLC	中期票据	美元	350,000.00	2018年2月15日	2026年1月23日	1.71%	1,663,600.71	459,494.44	-	2,123,095.15
Haitong Investment Ireland PLC	中期票据	欧元	1,300,000.00	2018年7月23日	2023年7月24日	1.15%	8,842,457.65	759,949.64	-	9,602,407.29
Haitong Banco de Investimento do Brasil S.A.	金融债券	巴西雷亚尔	1,088,052,334.07	2018年5月21日至2023年6月30日	2023年1月30日至2026年3月30日	5.00%-15.668%	1,270,917,967.16	594,861,257.91	102,231,493.63	1,763,547,731.44
Haitong Bank, S.A.	金融债券	欧元	230,000,000.00	2022年2月8日	2025年2月8日	4.73%	1,707,876,852.36	110,591,104.66	-	1,818,467,957.02
Haitong Bank, S.A.	金融债券	美元	150,000,000.00	2022年5月23日	2027年5月29日	4.00%	1,044,918,002.70	43,846,740.57	-	1,088,764,743.27
合计							181,830,917,563.00	59,289,596,099.19	35,916,067,896.78	205,204,445,765.41

五、合并财务报表项目附注 (续)

37、其他负债

(1) 按类别列示

单位：人民币元

项目	注释	2023年6月30日	2022年12月31日
其他应付款	(2)	2,985,753,480.22	2,882,683,992.60
代理兑付债券款		17,563,483.02	17,563,483.02
长期应付款	(3)	7,382,654,309.66	8,215,134,260.29
中央银行款项及国家外汇存款		671,190,063.06	2,215,129,510.41
吸收存款	(4)	5,462,362,591.11	5,318,475,028.79
应付股利		2,962,133,656.45	7,535,561.12
其他		948,580,860.27	913,670,172.37
合计		20,430,238,443.79	19,570,192,008.60

(2) 其他应付款

(i) 明细列示

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
应付投资者保护基金及风险准备金等	760,046,175.31	743,176,426.85
应付服务费	38,857,821.67	37,041,954.62
其他	2,186,849,483.24	2,102,465,611.13
合计	2,985,753,480.22	2,882,683,992.60

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

(3) 长期应付款

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
承租人保证金	6,669,144,576.39	7,429,345,391.03
其他	713,509,733.27	785,788,869.26
合计	7,382,654,309.66	8,215,134,260.29

(4) 吸收存款

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
活期存款	278,353,630.24	350,258,215.07
公司	268,188,896.50	341,188,165.14
个人	10,164,733.74	9,070,049.93
定期存款 (含通知存款)	5,184,008,960.87	4,968,216,813.72
公司	2,560,442,484.57	3,074,504,851.06
个人	2,623,566,476.30	1,893,711,962.66
合计	5,462,362,591.11	5,318,475,028.79

五、合并财务报表项目附注 (续)

38、股本

单位：人民币元

流通股	2022年12月31日	本期变动	2023年6月30日
无限售条件流通股份-A股	8,873,381,180.00	-	8,873,381,180.00
有限售条件流通股份-A股	781,250,000.00	-	781,250,000.00
无限售条件流通股份-H股	3,409,568,820.00	-	3,409,568,820.00
合计	13,064,200,000.00	-	13,064,200,000.00

截止 2023 年 6 月 30 日，公司无限售条件流通股为 12,282,950,000 股，有限售条件流通股为 781,250,000 股。

39、资本公积

单位：人民币元

	2022年12月31日	本期增加	本期减少	2023年6月30日
资本溢价(股本溢价)				
(1) 投资者投入的资本	74,932,781,994.07	-	-	74,932,781,994.07
(2) 其他	74,776,598.45	802,099,914.56	-	876,876,513.01
合计	75,007,558,592.52	802,099,914.56	-	75,809,658,507.08

五、合并财务报表项目附注 (续)

40、其他综合收益

单位：人民币元

项目	2022年12月31日	本期发生金额				2023年6月30日
	归属于母公司股东的其他综合收益	本期所得税前发生额	减：所得税费用	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益	归属于母公司股东的其他综合收益
1. 不能重分类进损益的其他综合收益	(806,515,450.24)	82,087,461.42	13,950,231.72	-	(34,234,968.48)	(713,988,521.01)
其中：重新计量设定受益计划变动额	(5,593,338.21)	(2,265,927.31)	-	-	-	(7,859,265.52)
其他权益工具投资公允价值变动	(800,922,112.03)	84,353,388.73	13,950,231.72	-	(34,234,968.48)	(706,129,255.49)
2. 以后将重分类进损益的其他综合收益	(810,797,771.29)	968,315,985.63	90,039,097.89	150,854,060.80	-	(317,111,475.70)
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	1,973,978.03	2,986,155.20	-	-	-	4,960,133.23
其他债权投资公允价值变动和信用减值准备	133,366,754.87	376,211,618.75	72,438,408.39	86,911,864.49	-	350,220,510.18
现金流量套期	57,259,212.51	136,345,457.45	17,600,689.50	63,942,196.31	-	103,841,365.13
外币财务报表折算差额	(993,170,237.75)	452,772,754.23	-	-	-	(765,906,005.29)
其他	(10,227,478.95)	-	-	-	-	(10,227,478.95)
其他综合收益合计	(1,617,313,221.53)	1,050,403,447.05	103,989,329.61	150,854,060.80	(34,234,968.48)	(1,031,099,996.71)

五、合并财务报表项目附注(续)

40、其他综合收益(续)

单位：人民币元

项目	本年发生金额					2022年12月31日 归属于母公司股东 的其他综合收益	
	2021年12月31日 归属于母公司股东 的其他综合收益	本年所得税前发生额	减：所得税费用	减：前期计入其他综合收益当期转入损益	减：前期计入其他综合收益当期转入留存收益		税后归属于少数股东
1. 不能重分类进损益的其他综合收益	(45,227,996.70)	(1,472,730,882.51)	(320,322,416.09)	-	(300,125,133.92)	(806,515,450.24)	
其中：重新计量设定受益计划变动额	(85,950,035.50)	80,356,697.29	-	-	-	(5,593,338.21)	
其他权益工具投资公允价值变动	40,722,038.80	(1,553,087,579.80)	(320,322,416.09)	-	(300,125,133.92)	(800,922,112.03)	
2. 以后将重分类进损益的其他综合收益	(612,450,323.89)	1,285,602,690.07	(73,692,941.98)	345,848,731.37	-	(810,797,771.29)	
其中：权益法下可转损益的其他综合收益	(6,361,998.26)	8,335,976.29	-	-	-	1,973,978.03	
其他债权投资公允价值变动和信用减值准备	348,429,554.74	(174,841,921.59)	(43,912,568.43)	83,882,748.47	-	133,366,754.87	
现金流量套期	18,567,039.28	277,705,845.67	(29,780,373.55)	261,965,982.90	-	57,259,212.51	
外币财务报表折算差额	(962,857,440.70)	1,174,402,789.70	-	-	-	(993,170,237.75)	
其他	(10,227,478.95)	-	-	-	-	(10,227,478.95)	
其他综合收益合计	(657,678,320.59)	(187,128,192.44)	(394,015,358.07)	345,848,731.37	(300,125,133.92)	(1,617,313,221.53)	

五、合并财务报表项目附注 (续)

41、盈余公积

单位：人民币元

项目	2022年12月31日	本期增加	本期减少	2023年6月30日
法定盈余公积	9,656,101,246.57	-	-	9,656,101,246.57
合计	9,656,101,246.57	-	-	9,656,101,246.57

42、一般风险准备

单位：人民币元

项目	2022年12月31日	本期增加	本期减少	2023年6月30日
一般风险准备	11,643,338,480.81	52,958,263.16	-	11,696,296,743.97
交易风险准备	10,138,934,338.40	-	-	10,138,934,338.40
合计	21,782,272,819.21	52,958,263.16	-	21,835,231,082.37

43、未分配利润

单位：人民币元

项目	2023年1-6月	2022年度
期 / 年初未分配利润	46,699,136,993.48	47,504,315,755.70
加：本期归属于母公司股东的净利润	3,829,634,781.60	6,545,346,964.83
其他	(46,787,834.14)	(306,101,760.20)
减：提取法定盈余公积 (注 1)	-	962,495,548.36
提取一般风险准备 (注 1)	52,958,263.16	2,162,668,418.49
应付普通股股利 (注 2)	2,743,482,000.00	3,919,260,000.00
期 / 年末未分配利润	47,685,543,677.78	46,699,136,993.48

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

注 2：根据海通证券 2023 年 6 月 16 日召开的 2022 年股东大会审议批准向全体股东宣派 2022 年度现金股利每 10 股人民币 2.10 元 (含税)，宣派总额为人民币 27.43 亿元 (含税)。于 2023 年 7 月 28 日，该现金股利已发放。

五、合并财务报表项目附注 (续)

44、手续费及佣金净收入

(1) 按类别列示

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
证券经纪业务净收入	1,811,543,716.95	2,250,206,979.99
——证券经纪业务收入	2,579,599,103.73	3,067,020,881.96
其中：代理买卖证券业务	2,039,877,831.87	2,430,237,793.13
交易单元席位租赁	402,104,235.78	455,054,708.28
代销金融产品业务	137,617,036.08	181,728,380.55
——证券经纪业务支出	768,055,386.78	816,813,901.97
其中：代理买卖证券业务	768,055,386.78	816,813,901.97
期货经纪业务净收入	160,381,803.79	223,800,674.93
——期货经纪业务收入	859,279,481.17	917,867,206.23
——期货经纪业务支出	698,897,677.38	694,066,531.30
投资银行业务净收入	1,949,290,370.16	2,434,751,965.24
——投资银行业务收入	1,974,909,744.28	2,459,952,506.95
其中：证券承销业务	1,798,502,295.26	2,314,001,827.53
证券保荐业务	29,298,113.20	33,201,886.79
财务顾问业务	147,109,335.82	112,748,792.63
——投资银行业务支出	25,619,374.12	25,200,541.71
其中：证券承销业务	13,873,486.68	10,977,282.09
财务顾问业务	11,745,887.44	14,223,259.62
资产管理业务净收入	181,176,892.17	220,901,159.11
——资产管理业务收入	181,176,892.17	220,901,159.11
基金管理业务净收入	751,288,816.12	865,570,714.02
——基金管理业务收入	778,463,577.31	887,153,810.12
——基金管理业务支出	27,174,761.19	21,583,096.10
投资咨询业务净收入	41,508,439.37	90,387,916.88
——投资咨询业务收入	41,508,439.37	90,387,916.88
其他手续费及佣金净收入	45,378,950.90	55,060,976.40
——其他手续费及佣金收入	47,125,349.99	56,027,288.07
——其他手续费及佣金支出	1,746,399.09	966,311.67
合计	4,940,568,989.46	6,140,680,386.57
其中：手续费及佣金收入合计	6,462,062,588.02	7,699,310,769.32
手续费及佣金支出合计	1,521,493,598.56	1,558,630,382.75

五、合并财务报表项目附注 (续)

44、手续费及佣金净收入 (续)

(2) 财务顾问业务净收入按类别列示

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
并购重组财务顾问业务净收入 - 境内上市公司	8,088,679.25	3,350,943.40
并购重组财务顾问业务净收入 - 其他	25,232,379.55	7,755,833.32
其他财务顾问业务净收入	102,042,389.58	87,418,756.29
合计	135,363,448.38	98,525,533.01

45、利息净收入

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入		
其中：货币资金及结算备付金利息收入	1,977,916,990.08	1,774,837,922.24
融出资金利息收入	2,116,167,728.91	2,321,896,271.42
买入返售金融资产利息收入	931,069,356.00	1,016,331,185.11
其中：约定购回利息收入	6,996,004.73	6,776,394.14
股权质押回购利息收入	769,143,335.18	922,279,353.40
债权投资利息收入	115,835,004.14	50,015,024.55
其他债权投资利息收入	871,432,429.52	665,731,905.38
长期应收款利息收入	2,831,408,464.21	1,937,065,265.24
贷款和应收款利息收入	469,823,663.70	487,593,240.22
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	6,875,392.28	4,984,213.36
小计	9,320,529,028.84	8,258,455,027.52
融资租赁收入	781,924,708.86	1,280,942,435.03
收入合计	10,102,453,737.70	9,539,397,462.55
利息支出		
其中：借款利息支出	2,088,012,810.29	1,217,833,733.16
应付短期融资款利息支出	208,060,457.23	215,682,586.53
拆入资金利息支出	156,082,941.70	184,162,019.95
其中：转融通利息支出	63,508,333.37	126,416,666.44
卖出回购金融资产款利息支出	1,406,249,962.02	981,576,191.06
其中：报价回购利息支出	36,155,726.94	5,881,903.68
代理买卖证券款利息支出	305,090,416.53	377,405,785.91
应付债券利息支出	3,305,306,402.08	3,004,959,366.45
其中：次级债券利息支出	153,359,514.48	145,213,008.20
租赁负债利息支出	23,633,356.53	20,911,676.90
其他按实际利率法计算的金融负债产生的利息支出	425,614,583.36	448,778,118.75
支出合计	7,918,050,929.74	6,451,309,478.71
利息净收入	2,184,402,807.96	3,088,087,983.84

五、合并财务报表项目附注 (续)

46、投资收益

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
权益法核算的长期股权投资收益	479,771,270.73	303,592,418.25
处置长期股权投资产生的投资收益	-	10,292.93
金融工具投资收益	3,238,325,221.92	(665,885,395.46)
(1) 持有期间取得的收益	2,537,849,221.18	2,479,827,496.37
交易性金融工具	2,470,564,031.87	2,411,790,376.68
其他权益工具投资	67,285,189.31	68,037,119.69
(2) 处置金融工具取得的收益	700,476,000.74	(3,145,712,891.83)
交易性金融工具	35,855,510.26	(1,522,296,576.67)
其他债权投资	135,549,726.60	33,523,153.34
衍生金融工具	525,435,693.60	(1,632,231,821.82)
其他	3,635,070.28	(24,707,646.68)
合计	3,718,096,492.65	(362,282,684.28)

47、其他收益

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
政府补助 / 财政补贴	729,330,191.62	676,499,337.97
其他	63,412,535.06	45,256,281.01
合计	792,742,726.68	721,755,618.98

48、公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产	759,724,079.99	(1,399,212,330.35)
衍生金融工具	662,554,685.85	1,759,124,861.26
交易性金融负债	(1,373,761,997.58)	998,397,619.83
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	(1,224,135,951.28)	983,274,419.83
合计	48,516,768.26	1,358,310,150.74

49、其他业务收入

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
大宗商品销售收入	4,577,360,327.76	479,251,903.46
服务收入	383,248,601.73	488,559,145.68
出租收入	314,703,304.53	267,556,463.23
其他	213,993,601.59	258,767,292.21
合计	5,489,305,835.61	1,494,134,804.58

五、合并财务报表项目附注 (续)

50、税金及附加

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
城建税	35,966,432.87	55,062,336.06
房产税	35,745,754.13	34,141,633.07
教育费附加及地方教育费附加	26,407,265.64	39,614,626.20
印花税	7,270,320.68	8,146,792.25
其他	23,674,066.38	19,729,119.90
合计	129,063,839.70	156,694,507.48

51、业务及管理费

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
职工费用	3,651,013,289.68	3,488,369,344.03
固定资产折旧费	297,778,870.71	257,916,071.96
电子设备运转费	269,621,473.15	127,629,904.60
使用权资产折旧	198,451,445.41	211,186,006.76
咨询费	147,046,819.95	149,542,713.78
差旅费	133,346,880.55	50,124,575.91
无形资产摊销	121,489,570.48	104,151,492.91
聘请中介机构费	108,416,110.12	94,875,828.17
邮电通讯费	103,159,105.49	66,227,848.57
公杂费	77,512,115.29	70,786,500.35
其他	588,023,148.14	635,313,362.18
合计	5,695,858,828.97	5,256,123,649.22

52、信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
货币资金	(1,152,281.67)	553,469.16
融出资金	287,492,253.01	312,634,624.45
应收款项	33,729,680.98	28,353,884.73
其他应收款	12,603,240.83	14,992,734.30
买入返售金融资产	54,392,254.36	(822,810,248.48)
发放贷款和垫款	(362,159.85)	(2,561,733.73)
应收融资租赁款	145,668,145.85	639,862,163.61
长期应收款	459,552,320.16	145,586,531.79
其他贷款和应收款项	235,335,618.09	(82,843,221.96)
其他债权投资	(40,469,462.12)	(54,550,425.13)
债权投资	7,282,850.15	1,238,060.90
其他金融资产	9,751,981.45	(1,792,861.06)
合计	1,203,824,441.24	178,662,978.58

五、合并财务报表项目附注 (续)

53、其他业务成本

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
大宗商品销售成本	4,565,499,760.39	474,761,005.95
出租成本	141,313,348.35	105,619,523.82
其他	56,648,922.05	61,826,132.88
合计	4,763,462,030.79	642,206,662.65

54、营业外收入

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额	计入本期非经常性损益的金额
非流动资产处置利得	559,116.54	356,678.95	559,116.54
其他	98,728,642.55	53,776,876.60	98,728,642.55
合计	99,287,759.09	54,133,555.55	99,287,759.09

55、营业外支出

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额	计入本期非经常性损益的金额
非流动资产处置损失	8,389,446.73	1,008,363.60	8,389,446.73
捐赠支出	408,520.68	9,416,440.03	408,520.68
其他	5,045,335.27	2,395,865.05	5,045,335.27
合计	13,843,302.68	12,820,668.68	13,843,302.68

56、所得税费用

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
当期所得税费用	1,101,737,432.30	883,632,598.67
递延所得税费用	225,255,213.42	537,071,102.60
合计	1,326,992,645.72	1,420,703,701.27

五、合并财务报表项目附注 (续)

57、现金流量表项目注释

(1) 收到的其他与经营活动有关的现金

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
其他业务收入	5,489,305,835.61	1,494,134,804.58
融资租赁收到的款项净额	2,065,948,223.29	-
存出保证金减少	1,197,090,030.29	-
营业外收入及其他收益	891,471,369.23	775,532,495.58
其他贷款和应收款净减少额	296,260,666.23	6,814,354,141.89
吸收存款的增加	143,887,562.32	433,583,111.16
其他	1,534,144,223.66	483,232,096.99
合计	11,618,107,910.63	10,000,836,650.20

(2) 支付的其他与经营活动有关的现金

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
其他业务成本	4,622,148,682.44	536,587,138.82
央行存放款项的净减少额	1,543,939,447.35	71,159,326.68
日常经营费用等	1,363,272,135.82	1,171,875,328.81
发放的客户贷款及垫款净增加额	1,041,151,572.50	635,682,184.06
融资租赁支付的款项净额	-	2,549,137,675.22
存出保证金增加	-	2,387,543,382.89
其他	2,828,289,703.75	1,060,845,426.51
合计	11,398,801,541.86	8,412,830,462.99

(3) 支付其他与筹资活动有关的现金

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
偿还租赁负债款	183,106,373.12	211,223,664.97
发行债券支付的承销费用等	90,033,064.95	92,731,477.73
子公司购买股份用于股份奖励计划	-	14,679,529.20
少数股东收回投资款	-	406,542,604.73
合计	273,139,438.07	725,177,276.63

五、合并财务报表项目附注 (续)

58、现金流量表补充资料

(1) 现金流量表补充资料

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
1、将净利润调节为经营活动现金流量		
净利润	3,924,731,802.09	4,465,360,883.37
加：信用减值损失	1,203,824,441.24	178,662,978.58
其他资产减值损失	9,877,840.94	25,910,800.78
固定资产及投资性房地产折旧	439,092,219.06	363,535,595.79
使用权资产折旧	198,451,445.41	211,186,006.76
无形资产摊销	121,489,570.48	104,151,492.91
长期待摊费用摊销	58,555,366.19	55,528,203.78
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失	7,677,343.56	651,684.65
公允价值变动收益	(48,516,768.26)	(1,358,310,150.74)
利息净支出	4,637,745,592.47	3,743,640,433.11
汇兑损失	205,419,634.21	297,909,682.71
投资收益	(751,887,179.63)	(625,295,662.42)
递延所得税资产减少	105,838,497.42	892,467,651.65
递延所得税负债增加/(减少)	107,141,984.08	(355,396,549.09)
交易性金融资产等的减少	564,367,158.65	21,270,272,619.58
经营性应收项目的(增加)/减少	(8,693,849,399.37)	3,923,452,952.09
经营性应付项目的减少	(12,832,152,340.38)	(15,880,054,910.29)
经营活动(使用)/产生的现金流量净额	(10,742,192,791.84)	17,313,673,713.22
2、不涉及现金收支的重大投资和筹资活动		
债务转为资本	-	-
一年内到期的可转换公司债券	-	-
融资租入固定资产	-	-
3、现金及现金等价物净变动情况		
现金的期末余额	183,053,449,638.80	198,597,821,990.06
减：现金的年初余额	176,699,519,071.53	175,257,907,676.68
加：现金等价物的期末余额	-	-
减：现金等价物的年初余额	-	-
现金及现金等价物净增加额	6,353,930,567.27	23,339,914,313.38

(2) 现金和现金等价物的构成

单位：人民币元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
现金	183,053,449,638.80	176,699,519,071.53
其中：库存现金	100,999.47	335,542.05
可随时用于支付的银行存款	162,436,991,593.29	152,034,147,266.37
可随时用于支付的其他货币资金	14,786,325.78	53,099,634.28
存放中央银行款项	2,035,284,075.92	3,231,241,208.10
结算备付金	18,566,286,644.34	21,380,695,420.73
现金及现金等价物合计	183,053,449,638.80	176,699,519,071.53

五、合并财务报表项目附注（续）

59、所有权或使用权受到限制的资产

所有权或使用权受到限制的资产，具体参见附注五、1 货币资金，7 买入返售金融资产，8 交易性金融资产，9 债权投资，10 其他债权投资，11 其他权益工具投资，12 应收融资租赁款及长期应收款，以及 15 固定资产。

60、金融资产转移

(1) 资产支持证券

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

截至 2023 年 6 月 30 日，本集团未予终止确认的已转移应收融资租赁款和长期应收款的账面价值为人民币 131.54 亿元 (2022 年 12 月 31 日：人民币 101.49 亿元)。

(2) 资产支持票据

本集团于日常业务过程中进行证券化交易，即本集团向结构化主体转让应收融资租赁款及售后回租安排的应收款项，而结构化主体在中国银行间市场向投资者发行资产支持票据。由于本集团持有所有次级资产支持票据，保留已转移资产的绝大部分风险及报酬，因此继续确认全部已转移资产并就已收代价确认应付债券。

截至 2023 年 6 月 30 日，本集团已转移但未予终止确认的应收融资租赁款和长期应收款的账面价值为人民币 22.41 亿元 (2022 年 12 月 31 日：人民币 18.87 亿元)。

(3) 融出证券

本集团与客户订立协议，融出股票及基金予客户，以客户的证券或押金为抵押，由于本集团仍保留有关证券的全部风险，因此并未于资产负债表终止确认该等证券。于 2023 年 6 月 30 日，上述转让资产的账面价值为人民币 21.25 亿元 (2022 年 12 月 31 日：人民币 28.21 亿元)。

六、合并范围的变更

1、非同一控制下企业合并

公司本期无通过非同一控制下企业合并取得的子公司。

六、合并范围的变更（续）

2、同一控制下企业合并

公司本期无通过同一控制下企业合并取得的子公司。

七、在其他主体中的权益

1、在子公司中的权益

(1) 企业集团的重要子公司

子公司全称	注册及 营业地	注册资本	业务性质	持股比例 (%)		取得方式
				直接	间接	
海富通基金管理有限公司	上海	人民币 30,000 万元	基金管理	51.00		设立或投资等方式
上海富诚海富通资产管理有限公司	上海	人民币 20,000 万元	资产管理		51.00	设立或投资等方式
海通开元投资有限公司	上海	人民币 750,000 万元	私募股权投资管理	100.00		设立或投资等方式
海富产业投资基金管理有限公司	上海	人民币 10,000 万元	基金管理		67.00	设立或投资等方式
海通吉禾私募股权投资基金管理 有限责任公司	上海	人民币 5,000 万元	股权投资管理		51.00	设立或投资等方式
海通创新私募基金管理有限公司	上海	人民币 5,000 万元	股权投资管理		51.00	设立或投资等方式
海通创意私募基金管理有限公司	上海	人民币 12,000 万元	股权投资管理		53.25	设立或投资等方式
海通新能源私募股权投资管理有限公司	上海	人民币 5,000 万元	股权投资管理		51.00	设立或投资等方式
海通并购(上海)私募基金管理有限公司	上海	人民币 10,000 万元	股权投资管理		51.00	设立或投资等方式
上海海通旭禹股权投资有限公司	上海	人民币 35,000 万元	股权投资		100.00	设立或投资等方式
上海海通创世投资管理有限公司	上海	人民币 100 万元	股权投资管理		53.25	设立或投资等方式
海通创新证券投资有限公司	上海	人民币 1,150,000 万元	金融产品投资、股权投资、证券投资	100.00		设立或投资等方式
上海海通证券资产管理有限公司	上海	人民币 220,000 万元	证券资产管理	100.00		设立或投资等方式
上海惟泰置业管理有限公司	上海	人民币 1,000 万元	物业管理、房地产开发经营、餐饮企 业管理	100.00		收购
上海泽春投资发展有限公司	上海	人民币 10,000 万元	实业投资, 房地产开发与经营, 投资 管理	100.00		收购
海通国际控股有限公司	香港	港币 1,117,973 万元	投资控股	100.00		设立或投资等方式
Haitong Investment Ireland PLC	爱尔兰	欧元 825,000 元	非银行金融公司		100.00	非同一控制下企业合并
海通期货股份有限公司	上海	人民币 130,150 万元	期货代理	83.22		非同一控制下企业合并
上海海通资源管理有限公司	上海	人民币 100,000 万元	资源管理		83.22	非同一控制下企业合并
海通期货香港有限公司	香港	港币 7,000 万元	期货经纪		83.22	非同一控制下企业合并
海通国际证券集团有限公司*	百慕达	港币 84,380 万元	投资控股		73.40	非同一控制下企业合并
海通国际投资经理有限公司	香港	港币 4,700 万元	资产管理		73.40	非同一控制下企业合并
海通国际资产管理有限公司	香港	港币 1,300 万元	资产管理		73.40	非同一控制下企业合并
海通国际资产管理(香港)有限公司	香港	港币 2,000 万元	资产管理		73.40	非同一控制下企业合并
海通国际证券有限公司	香港	港币 1,150,000 万元	经纪业务		73.40	非同一控制下企业合并
海通国际证券代理人有限公司	香港	港币 2 元	经纪业务		73.40	非同一控制下企业合并
海通国际期货有限公司	香港	港币 40,000 万元	经纪业务		73.40	非同一控制下企业合并
海通国际金融产品有限公司	香港	港币 5,000 万元	FICC 及衍生品		73.40	非同一控制下企业合并
海通国际金融服务有限公司	香港	港币 100 万元	FICC 及衍生品		73.40	非同一控制下企业合并
海通国际融资(香港)有限公司	香港	港币 1,000 万元	企业融资		73.40	非同一控制下企业合并
海通国际资本有限公司	香港	港币 2,000 万元	企业融资		73.40	非同一控制下企业合并
海通国际研究有限公司	香港	港币 100 万元	研究服务		73.40	非同一控制下企业合并
Haitong International (Japan) K.K.	日本	日元 1,000 万元	研究服务		73.40	非同一控制下企业合并

七、在其他主体中的权益 (续)

1、在子公司中的权益 (续)

(1) 企业集团的重要子公司 (续)

子公司全称	注册及 营业地	注册资本	业务性质	持股比例 (%)		取得方式
				直接	间接	
Haitong International (UK) Limited	英国	英镑 8,334,563 元	研究服务		73.40	非同一控制下企业合并
Haitong International Securities (USA) Inc.	美国	美元 12,654,319 元	研究服务		73.40	非同一控制下企业合并
Haitong International Securities Group (Singapore) Pte Ltd.	新加坡	新加坡元 730,550,721 元	投资控股		73.40	非同一控制下企业合并
Haitong Securities India Private Limited	印度	印度卢比 260,732,520 元	证券业务		73.40	非同一控制下企业合并
Haitong International Securities (Australia) Pty Ltd.	澳大利亚	澳元 1,380,435 元	经纪业务		73.40	非同一控制下企业合并
Haitong International Securities (UK) Limited	英国	英镑 560 元	企业融资咨询		73.40	非同一控制下企业合并
演天资讯科技 (深圳) 有限公司	中国	港币 1,000 万元	提供软件开发服务		73.40	非同一控制下企业合并
海通恒信金融集团有限公司	香港	港币 414,616 万元	投资控股		100.00	非同一控制下企业合并
海通恒信国际融资租赁股份有限公司 *	上海	人民币 823,530 万元	租赁		85.00	非同一控制下企业合并
海通恒信国际融资租赁 (天津) 有限公司	天津	人民币 21,000 万元	租赁		85.00	非同一控制下企业合并
上海泛圆投资发展有限公司	上海	人民币 10,000 万元	物业管理、单位后勤管理服务、餐饮管理		85.00	非同一控制下企业合并
海通恒运融资租赁 (上海) 有限公司	上海	人民币 136,000 万元	租赁		85.00	非同一控制下企业合并
海通恒信租赁 (香港) 有限公司	香港	美元 25,315 万元	租赁		85.00	非同一控制下企业合并
海通恒信小微融资租赁 (上海) 有限公司	上海	人民币 150,000 万元	租赁		85.00	非同一控制下企业合并
Haitong Bank, S.A.	葡萄牙	欧元 86,328 万元	银行		100.00	非同一控制下企业合并
Haitong Global Asset Management, SGOLC, S.A.	葡萄牙	欧元 2,500 万元	资产管理		100.00	非同一控制下企业合并
Haitong Banco de Investimento do Brasil S.A.	巴西	雷亚尔 42,000 万元	投资银行		80.00	非同一控制下企业合并
Haitong Negócios, SA	巴西	雷亚尔 11,138 万元	投资控股		80.00	非同一控制下企业合并
Haitong Securities do Brasil Corretora de Câmbio e Valores Mobiliários S.A.	巴西	雷亚尔 10,000 万元	证券经纪		80.00	非同一控制下企业合并
Haitong do Brasil Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A.	巴西	雷亚尔 5,190 万元	资产管理		80.00	非同一控制下企业合并

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

七、在其他主体中的权益 (续)

1、在子公司中的权益 (续)

(2) 重要的非全资子公司

单位：人民币亿元

子公司全称	持股比例 %	少数股东持股比例 %	本期归属于少数股东的损益	本期向少数股东宣告分派的股利	期末少数股东权益余额
海通国际证券集团有限公司	73.40	26.60	(2.14)	-	53.38
海通恒信国际融资租赁股份有限公司	85.00	15.00	1.13	0.72	25.21

(3) 重要非全资子公司的主要财务信息

单位：人民币百万元

项目	海通国际证券集团有限公司		海通恒信国际融资租赁股份有限公司	
	期末余额	年初余额	期末余额	年初余额
流动资产	67,238.26	64,366.74	61,104.75	57,624.83
非流动资产	15,152.29	15,221.11	67,694.36	66,888.91
资产合计	82,390.55	79,587.85	128,799.11	124,513.74
流动负债	51,703.00	51,210.83	58,335.77	57,560.79
非流动负债	10,257.64	9,896.34	51,000.68	48,126.29
负债合计	61,960.64	61,107.17	109,336.45	105,687.08

单位：人民币百万元

项目	海通国际证券集团有限公司		海通恒信国际融资租赁股份有限公司	
	本期发生额	上期发生额	本期发生额	上期发生额
营业收入	1,553.00	74.86	4,527.59	4,228.83
净利润	(757.44)	(1,396.69)	807.63	764.87
综合收益总额	(676.17)	(1,557.58)	906.53	846.42
经营活动现金流量	3,831.77	(2,848.23)	291.96	24.65

2、在联营企业中的权益

(1) 重要的联营企业

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

七、在其他主体中的权益 (续)

2、在合营企业或联营企业中的权益 (续)

(2) 重要联营企业的主要财务信息

单位：人民币百万元

富国基金管理有限公司	期末余额 / 本期发生额	年初余额 / 上期发生额
资产总额	13,623.84	13,070.53
负债总额	5,842.50	5,325.34
归属于母公司股东权益总额	7,781.34	7,745.19
营业收入	3,648.08	3,772.56
净利润	1,065.40	1,122.21
其他综合收益	10.75	15.72
综合收益总额	1,076.15	1,137.93
本期收到的来自联营企业的股利	288.86	388.85

(3) 不重要联营企业的汇总财务信息

单位：人民币百万元

	期末余额 / 本期发生额	年初余额 / 上期发生额
联营企业：		
投资账面价值合计	5,137.61	4,862.46
下列各项按持股比例计算的合计数		
— 净利润	183.86	212.71
— 其他综合收益	-	-
— 综合收益总额	183.86	212.71

3、在结构化主体中的权益

(1) 在纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

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

本集团持有的上述纳入合并财务报表范围的结构化主体对本集团于 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日的财务状况及 2023 上半年及 2022 年度的经营成果和现金流量影响并不重大,因此,本集团未对这些被合并结构化主体的财务信息进行单独披露。

于 2023 年 6 月 30 日,本集团于所有合并结构化主体之直接权益的公允价值为人民币 340.04 亿元(2022 年 12 月 31 日:人民币 314.23 亿元)。该等本集团所有直接权益包括本集团于分级产品中认购的风险级产品,本集团作为风险级产品持有人为优先级产品持有人提供增信支持。于 2023 年 6 月 30 日,本集团未持有上述风险级产品(2022 年 12 月 31 日:人民币 0.10 亿元)。

七、在其他主体中的权益 (续)

3、在结构化主体中的权益 (续)

(2) 在未纳入合并财务报表范围的结构化主体中的权益

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

于 2023 年 6 月 30 日，由本集团担任投资管理人且持有权益之未合并结构化主体的账面价值为人民币 152.58 亿元 (2022 年 12 月 31 日：人民币 154.64 亿元)，本集团所面临风险敞口与账面价值相若。2023 年上半年，本集团作为投资管理人，于未纳入合并范围的结构化主体获取的管理费收入为人民币 8.00 亿元 (2022 年上半年：9.64 亿元)。

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

八、关联方及关联交易

1、持有公司 5% 以上股份的股东情况

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

2、公司的子公司情况

本公司子公司的情况详见附注“七、1、在子公司中的权益”。

3、公司的合营和联营企业情况

本公司合营或联营企业详见附注“五、13、长期股权投资”。

4、其他关联方情况

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

八、关联方及关联交易（续）

5、关联方交易

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

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

(3) 向关联方收取的手续费及佣金收入

单位：人民币元

本期发生额	上期发生额	本期发生额	上期发生额
富国基金管理有限公司	佣金收入等	71,698,846.37	85,352,739.74
央视融媒体产业投资基金（有限合伙）	管理费收入等	40,305,052.99	34,382,075.47
辽宁海通新动能股权投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	12,735,849.06	12,735,849.06
辽宁中德产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	8,525,828.38	8,490,566.04
上海海通焕新私募投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	8,415,611.26	-
上海并购股权投资基金二期合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	7,500,000.94	7,095,169.01
中小企业发展基金海通（合肥）合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	5,867,924.53	-
西安军融电子卫星基金投资有限公司	管理费收入等	3,773,584.90	2,465,419.93
安徽省皖能海通双碳产业并购投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	2,422,667.36	1,940,036.19
广东南方媒体融合发展投资基金（有限合伙）	管理费收入等	1,960,143.61	2,127,155.71
吉林省现代农业和新兴产业投资基金有限公司	管理费收入等	1,924,528.30	4,261,222.34
许昌海通创新股权投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	1,509,433.92	1,415,094.30
光明食品（集团）有限公司	佣金收入等	1,415,094.34	-
吉林海创长新投资中心（有限合伙）	管理费收入等	1,403,463.42	-
上海国盛（集团）有限公司	佣金收入等	1,137,577.01	86,335.61
金华市海通重点产业发展招商并购投资合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	823,902.82	-
吉林海通创新卫星投资中心（有限合伙）	管理费收入等	701,731.72	-
海通（吉林）股权投资基金合伙企业（有限合伙）	管理费收入等	305,641.57	575,420.01
西安航天新能源产业基金投资有限公司	管理费收入等	2,455.75	3,419,766.00
其他	佣金收入等	40,003.98	276,771.51

(4) 向关联方收取的利息净收入

单位：人民币元

关联方名称	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
上海国盛（集团）有限公司	利息净收入	344,882.65	535,341.00
上海电气控股集团有限公司	利息净收入	98,415.96	193,030.49
西安航天新能源产业基金投资有限公司	利息净收入	88,987.64	231,672.40
其他	利息净收入	581,381.88	169,076.30

八、关联方及关联交易（续）

5、关联方交易（续）

(5) 向关联方收取的投资收益

单位：人民币元

关联方名称	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
上海国盛（集团）有限公司	投资收益	(1,188,918.94)	4,905,213.76

(6) 其他关联方交易

单位：人民币元

关联方名称	关联交易内容	本期发生额	上期发生额
上海国盛（集团）有限公司	公允价值变动收益	(1,470,447.62)	(2,503,249.32)

(7) 关键管理人员薪酬

单位：人民币万元

项目	本期发生额	上期发生额
关键管理人员薪酬	1,290.75	1,804.14

注：上述集团主要管理人员在报告期内从公司获得的税前报酬总额未包含在 2023 年度递延发放的、归属于过往年度的薪酬，共计 833.12 万元。

6、关联方应收应付款项

(1) 应收关联方款项

单位：人民币元

项目名称	关联方名称	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
应收款项	西安航天新能源产业基金投资有限公司	33,055,404.87	33,055,404.87
应收款项	辽宁海通新动能股权投资基金合伙企业（有限合伙）	13,540,000.00	20,000.00
应收款项	上海海通焕新私募投资基金合伙企业（有限合伙）	8,920,547.94	-
应收款项	上海并购股权投资基金二期合伙企业（有限合伙）	7,950,000.00	-
应收款项	安徽省皖能海通双碳产业并购投资基金合伙企业（有限合伙）	2,568,027.40	-
应收款项	金华市海通重点产业发展招商并购投资合伙企业（有限合伙）	873,336.99	-
应收款项	上海国盛（集团）有限公司	660,092.78	684,333.85
应收款项	海通兴泰（安徽）新兴产业投资基金（有限合伙）	-	32,881,229.87
应收款项	上海文化产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）	-	31,758,051.09
应收款项	西安航天海通创新新材料股权投资合伙企业（有限合伙）	-	8,368,632.46
应收款项	其他	40,000.00	120,000.00

八、关联方及关联交易 (续)

6、关联方应收应付款项 (续)

(2) 应付关联方款项

单位：人民币元

项目名称	关联方名称	2023年6月30日	2022年12月31日
代理买卖证券款	辽宁中德产业股权投资基金合伙企业(有限合伙)	248,687,316.56	-
代理买卖证券款	嘉兴海通旭初股权投资基金合伙企业(有限合伙)	67,240,776.21	2,414,190.01
代理买卖证券款	上海电气控股集团有限公司	31,216,269.18	15,398,400.84
代理买卖证券款	西安航天新能源产业基金投资有限公司	27,147,221.64	826,464.67
代理买卖证券款	光明食品(集团)有限公司	23,505,742.94	23,476,062.63
代理买卖证券款	上海并购股权投资基金二期合伙企业(有限合伙)	51,820.02	50,064,674.52
代理买卖证券款	上海并购股权投资基金合伙企业(有限合伙)	38,079.07	57,191,665.02
代理买卖证券款	其他	32,213.86	42,607.10
应付款项	上海国盛(集团)有限公司	58,240,254.08	56,980,000.00
应付款项	西安军融电子卫星基金投资有限公司	2,291,684.38	-
应付款项	吉林省现代农业和新兴产业投资基金有限公司	1,710,000.00	-

(3) 其他关联方款项

单位：人民币元

项目名称	关联方名称	2023年6月30日	2022年12月31日
衍生金融资产	上海国盛(集团)有限公司	839,552.38	2,310,000.00

九、风险管理

1、风险管理政策及组织架构

(1) 风险管理政策

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

九、风险管理（续）

1、风险管理政策及组织架构（续）

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

(2) 风险治理组织架构

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

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

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

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

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

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

九、风险管理 (续)

1、风险管理政策及组织架构 (续)

(2) 风险治理组织架构 (续)

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

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

各子公司规范运作，依法经营。公司将子公司风险管理纳入全面风险管理体系，对其风险管理工作实行垂直管理，每日开展风控指标并表管理，建立了集团 T+1 风险数据集市，并从子公司风险管理负责人提名、风险限额与报告、重大事项审批、风险数据对接、风控指标并表、风险督导检查、风险考核评价等方面落实对子公司的垂直风险管理。

2、信用风险管理

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

A、存放在其他金融机构的自有货币资金、经纪业务相关风险

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

B、交易性融资业务相关风险

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

C、信用债券交易与投资业务相关风险

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

九、风险管理（续）

2、信用风险管理（续）

D、融资租赁业务相关风险

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

E、债券回购等同业短期拆借、场外衍生品业务相关风险

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

本集团根据行业监管政策、资本市场环境和集团业务发展战略，持续完善信用风险管理体系。报告期内，本集团以信用风险管理办法等制度为依据，全面落实以同一客户、同一业务为核心的信用风险识别、评估、计量、监控、报告及应对工作。一是推动集团智能预警中心的推广应用，建立针对各类风险信号的监测、预警及排查工作机制，赋能业务条线增强风险预警预判能力；二是以集团 T+1 风险数据集市为依托，对信用风险管理信息系统进行持续升级，提升风险识别、计量与压力测试能力，持续完善资产质量、风险抵补和集中度风险等维度的信用风险限额体系；三是持续强化统一评级与集中授信管理机制，发布项目融资类客户信用风险评级与授信管理实施细则，并对信用评级和授信限额进行动态优化；四是继续推进高风险客户名单管理工作落实，修订高风险客户名单管理办法并持续开展相关信息系统的集团化部署；五是积极落实客户 ESG 尽职调查和 ESG 风险评估等工作，开展了集团 ESG 风险管理专题培训。报告期内，本集团核心信用风险监控指标运行平稳，整体信用风险可控。

预期信用损失计量

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

九、风险管理 (续)

2、信用风险管理 (续)

预期信用损失计量 (续)

①第一阶段:

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

②第二阶段:

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

③第三阶段:

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

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

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

信用风险显著增加判断标准

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

九、风险管理 (续)

2、信用风险管理 (续)

信用风险显著增加的判断标准 (续)

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

九、风险管理 (续)

2、信用风险管理 (续)

信用风险显著增加的判断标准 (续)

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

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

预期信用损失计量的参数和估值技术

公司计量预期信用损失使用的关键输入值如下:

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

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

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

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

九、风险管理 (续)

2、信用风险管理 (续)

信用风险显著增加的判断标准 (续)

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

前瞻性信息

信用风险显著增加的评估及预期信用损失的计算均涉及前瞻性信息。

对于债券投资类金融资产，公司定性选取关键经济指标作为前瞻因子，识别出影响信用风险及预期信用损失的关键经济指标主要包括广义货币供应量 (M2) 同比增速、国内生产总值 (GDP) 增速、工业生产者出厂价格指数 (PPI) 同比增速、社会消费品零售总额增速等。对于融资类金融资产，违约概率前瞻采用回归分析方法，构建违约概率与宏观经济指标的相关性模型，利用该模型与预测的宏观经济指标来推断未来的违约概率变动情形。宏观经济指标包括但不限于国内生产总值 (GDP) 增速、广义货币供应量 (M2) 增速、工业生产者出厂价格指数 (PPI) 同比增速、居民消费价格指数 (CPI) 同比增速等，通过构建这些经济指标与业务风险特征之间的关系，最终实现对融资类金融资产的预期信用损失进行前瞻性调整。

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

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

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

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

九、风险管理 (续)

2、信用风险管理 (续)

信用风险显著增加的判断标准 (续)

敏感性分析

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

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

同时，公司还对信用风险阶段分类进行了敏感性分析。于 2023 年 6 月 30 日，假设信用风险自初始确认后未发生显著变化，导致阶段二的金融工具全部进入阶段一，则对资产负债表中确认的预期信用损失影响不重大。

担保物及其他信用增级措施

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

金融工具减值管理

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

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

九、风险管理 (续)

2、信用风险管理 (续)

金融工具减值管理 (续)

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

在不考虑可利用的担保物或其他信用增级的情况下，代表本集团在资产负债表日最大信用风险敞口的金额如下：

单位：人民币万元

涉及信用风险的项目	2023年6月30日	2022年12月31日
货币资金	16,765,029.16	15,858,016.94
结算备付金	1,856,628.66	2,138,069.54
存出保证金	2,166,748.44	2,286,457.44
拆出资金	6,512.82	27,444.45
融出资金	6,641,998.76	6,784,387.08
交易性金融资产	9,995,274.82	10,862,677.61
衍生金融资产	193,242.46	147,716.73
买入返售金融资产	4,110,458.89	3,264,514.90
应收款项	998,863.80	1,039,451.49
其他债权投资	4,605,275.17	5,285,189.89
债权投资	757,091.18	580,615.69
应收融资租赁款	1,799,721.33	1,945,845.29
长期应收款	8,717,011.35	8,454,995.25
其他资产	2,040,348.60	2,082,077.90
合计	60,654,205.44	60,757,460.20

表外项目信用风险如下：

单位：人民币万元

涉及信用风险的项目	2023年6月30日	2022年12月31日
保函和备用信用证 (注 1)	131,778.43	107,062.50
不可撤销信贷承诺 (注 2)	97,105.87	122,002.69
合计	228,884.30	229,065.19

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

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

九、风险管理 (续)

3、市场风险管理

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

本集团采用风险价值 (VaR) 方法对各类投资金融工具及持仓组合的市场风险进行评估和分析。计量口径包含母公司及集团范围内开展交易类业务的子公司。集团所使用的风险价值模型置信度为 95%，目标期间为下个交易日。具体如下：

项目	2023 年上半年 VaR95%			
	本公司风险价值 (万元)	本集团风险价值 (万元)	本公司风险价值 / 公司净资产	本集团风险价值 / 集团净资产
报告期最高月末值	19,448.88	30,267.94	0.13%	0.17%
报告期最低月末值	11,534.92	22,579.69	0.08%	0.12%
报告期平均月末值	14,893.09	25,486.58	0.10%	0.14%
2023 年 6 月 30 日值	11,534.92	23,207.42	0.08%	0.13%

报告期内，公司各月月末风险价值占公司净资产比例以及集团风险价值占集团净资产比例始终处于 0.2% 以内，市场风险可控可承受。

本集团和本公司按风险类别分类的风险价值 (VaR) 分析概括如下：

单位：万元

项目	本集团		本公司	
	2023 年 6 月 30 日	2022 年 6 月 30 日	2023 年 6 月 30 日	2022 年 6 月 30 日
权益风险价值	20,344.70	34,896.80	8,849.65	31,074.65
利率风险价值	6,906.93	8,686.15	6,315.15	8,476.90
商品风险价值	283.09	1,526.05	288.37	258.94
汇率风险价值	4,080.27	1,631.70	847.33	316.29
整体组合风险价值	23,207.42	37,486.80	11,534.92	32,679.24

单位：万元

项目	本公司					
	2023 年上半年度			2022 年上半年度		
	平均	最高	最低	平均	最高	最低
权益风险价值	13,278.57	18,252.52	8,849.65	24,989.14	31,074.65	20,499.01
利率风险价值	7,820.11	8,984.37	6,315.15	8,496.29	10,219.68	7,340.96
商品风险价值	242.18	456.03	89.33	283.20	958.08	-
汇率风险价值	833.83	895.21	795.00	305.64	332.80	292.11
整体组合风险价值	14,893.09	19,448.88	11,534.92	28,326.89	32,679.24	21,295.32

九、风险管理 (续)

3、市场风险管理 (续)

(1) 股票价格风险

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

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

本集团的股票价格风险源于分类为交易性金融资产和指定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的股权投资。公司董事会密切监控投资组合以管理风险敞口，并通过订立衍生品合约进行风险对冲。

本集团采用证券价格波动对报告期内净利润及其他综合收益的影响管理和分析股票价格风险。在向主要管理人员内部汇报风险时，管理层估计合理的潜在价格变动为 10%。假设其他相关变量不变的前提下，有关权益类资产的市场价格上升或下降 10%，对本集团的净利润及其他综合收益的影响如下：

单位：人民币万元

	2023 年 6 月 30 日		2022 年 12 月 31 日	
	对净利润的影响	对其他综合收益的影响	对净利润的影响	对其他综合收益的影响
上升 10%	159,192.73	48,428.79	136,477.84	38,261.19
下降 10%	(159,192.73)	(48,428.79)	(136,477.84)	(38,261.19)

管理层认为，敏感性分析并不代表着报告期末的固有价格风险会在报告期内发生。

(2) 利率风险

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

本集团采用敏感性分析衡量利率变化对公司利息净收入，公允价值变动损益和权益的可能影响 (税后)。利息净收入的敏感性是基于一定利率变动对期末持有的预计未来一年内进行利率重定的金融资产及负债的影响所产生的利息净收入的影响。公允价值变动损益敏感性和权益敏感性的计算是基于在一定利率变动时对期末持有的固定利率以交易性金融资产和其他债权投资进行重估的影响。

九、风险管理 (续)

3、市场风险管理 (续)

(2) 利率风险 (续)

假设其他相关变量不变，市场利率上升或下降 25 个基点对本集团净利润、其他综合收益的影响如下：

单位：人民币万元

项目	2023 年 6 月 30 日		2022 年 12 月 31 日	
	对净利润的影响	对其他综合收益的影响	对净利润的影响	对其他综合收益的影响
市场利率上升 25 个基点	(14,852.69)	(16,155.05)	(19,845.84)	(19,751.59)
市场利率下降 25 个基点	15,542.08	16,316.17	20,345.97	19,952.00

(3) 汇率风险

汇率风险是指因外汇汇率变动而导致的风险。报告期内，本集团国际化布局不断完善，面对复杂多变的境外市场，持续跟踪研究外汇市场，不断完善制度建设和内部管理，通过套保等一系列措施对冲、缓释汇率风险。集团注重外币资产和负债的匹配，以控制外汇风险的敞口。假设其他变量保持不变的前提下，如果人民币对其他外汇币种升值或贬值 5%，于 2023 年 6 月 30 日，本集团净利润将增加或减少人民币 3.36 亿元 (2022 年 12 月 31 日：人民币 3.03 亿元)。

(4) 商品价格风险

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

4、流动性风险管理

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

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

九、风险管理（续）

4、流动性风险管理（续）

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

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

下表列示了本集团为管理流动性风险而持有的金融负债在合同到期时的应付现金流量，表中披露的金额为合同未折现现金流，且包含本金和利息。

于本集团 2023 年 6 月 30 日持有的金融负债在合同到期时的应付现金流量如下：

单位：人民币万元

项目	即期	3个月以内	3个月至1年	1年至5年	5年以上	合计	账面价值
短期借款	-	2,954,105	574,561	-	-	3,528,666	3,505,107
应付短期融资款	-	554,291	756,908	-	-	1,311,199	1,298,528
拆入资金	-	696,730	11,268	203,679	74,691	986,368	902,289
交易性金融负债	457,791	185,389	511,170	1,097,776	-	2,252,126	2,252,126
卖出回购金融资产款	5,486	6,832,082	1,405,381	68,081	-	8,311,030	8,306,664
代理买卖证券款	11,990,949	-	-	-	-	11,990,949	11,990,949
代理承销证券款	1,823	-	-	-	-	1,823	1,823
应付款项	301,208	153,780	898,934	1,911	1,192	1,357,025	1,344,450
应付债券	-	1,921,715	4,761,553	15,004,861	-	21,688,129	20,520,445
衍生金融负债	5,750	45,886	48,575	11,913	18,435	130,559	130,559
长期借款	-	1,253,169	1,396,594	2,704,746	109,675	5,464,184	5,182,079
租赁负债	-	9,011	23,288	59,936	24,891	117,126	104,951
其他负债	562,130	357,777	442,290	721,548	58,698	2,142,443	2,043,024
合计	13,325,137	14,963,935	10,830,522	19,874,451	287,582	59,281,627	57,582,994

九、风险管理 (续)

4、流动性风险管理 (续)

本集团 2022 年末持有的金融负债在合同到期时的应付现金流量如下:

单位: 人民币万元

项目	即期	3个月以内	3个月至1年	1年至5年	5年以上	合计	账面价值
短期借款	-	2,607,063	893,703	-	-	3,500,766	3,485,804
应付短期融资款	-	616,398	1,011,844	-	-	1,628,242	1,615,909
拆入资金	-	305,404	33,032	356,868	35,076	730,380	627,610
交易性金融负债	334,844	92,613	120,379	1,740,793	219	2,288,848	2,288,848
卖出回购金融资产款	302,513	9,242,602	637,423	-	-	10,182,538	10,169,436
代理买卖证券款	11,551,346	-	-	-	-	11,551,346	11,551,346
代理承销证券款	1,350	-	-	-	-	1,350	1,350
应付款项	319,155	123,220	908,402	2,619	1,192	1,354,588	1,149,083
应付债券	-	1,447,300	5,039,607	12,670,941	37,450	19,195,298	18,183,092
衍生金融负债	13,396	28,793	18,542	13,449	15,662	89,842	89,842
长期借款	-	547,228	1,768,038	3,435,356	98,698	5,849,320	5,595,820
租赁负债	12	8,379	23,004	54,970	27,114	113,479	101,570
其他负债	238,820	499,127	498,599	721,781	64,141	2,022,468	1,957,019
合计	12,761,436	15,518,127	10,952,573	18,996,777	279,552	58,508,465	56,816,729

十、公允价值的披露

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

确定金融资产及金融负债公允价值的方式如下:

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

当无法从公开市场获取报价时, 本集团通过估值技术来确定金融工具的公允价值。

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

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

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

十、公允价值的披露 (续)

1、以公允价值计量的资产和负债的期末公允价值

单位：人民币元

项目	2023年6月30日			
	第一层次公允价值计量	第二层次公允价值计量	第三层次公允价值计量	合计
(一) 交易性金融资产	17,889,192,444.15	140,712,969,469.38	50,335,248,234.15	208,937,410,147.68
(1) 债券	1,259,580,214.89	84,653,890,869.67	7,290,466,442.48	93,203,937,527.04
(2) 公募基金	6,526,251,589.60	40,182,152,485.46	34,379,661.10	46,742,783,736.16
(3) 股票 / 股权	10,103,360,639.66	591,763,723.04	19,975,657,094.26	30,670,781,456.96
(4) 银行理财产品	-	4,776,009,654.53	-	4,776,009,654.53
(5) 券商资管产品	-	287,993,045.55	-	287,993,045.55
(6) 信托计划	-	124,041,458.26	1,848,759,529.93	1,972,800,988.19
(7) 其他	-	10,097,118,232.87	21,185,985,506.38	31,283,103,739.25
(二) 以公允价值计量且变动计入其他综合收益的金融资产	7,569,846,754.36	44,216,127,992.82	1,735,472,549.28	53,521,447,296.46
(1) 其他债权投资	1,112,674,867.13	44,216,127,992.82	723,948,790.73	46,052,751,650.68
(2) 其他权益工具投资	6,457,171,887.23	-	1,011,523,758.55	7,468,695,645.78
(三) 衍生金融资产	117,997,359.43	748,303,116.34	1,066,124,111.03	1,932,424,586.80
(四) 交易性金融负债	1,126,724,184.16	7,243,212,174.57	14,151,320,266.82	22,521,256,625.55
(1) 为交易目的而持有的金融负债	682,857,732.24	1,936,656,661.31	-	2,619,514,393.55
(2) 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	443,866,451.92	5,306,555,513.26	14,151,320,266.82	19,901,742,232.00
(五) 衍生金融负债	658,393.91	422,215,196.51	882,717,248.94	1,305,590,839.36

2、以公允价值计量的资产和负债的上年末公允价值

单位：人民币元

项目	2022年12月31日			
	第一层次公允价值计量	第二层次公允价值计量	第三层次公允价值计量	合计
(一) 交易性金融资产	16,065,889,779.47	147,360,266,513.97	46,172,573,146.31	209,598,729,439.75
(1) 债券	1,357,058,621.44	92,234,055,055.86	8,043,191,624.39	101,634,305,301.69
(2) 公募基金	3,480,910,902.66	36,245,724,717.17	28,732,962.35	39,755,368,582.18
(3) 股票 / 股权	11,227,920,255.37	640,955,559.34	18,475,101,223.01	30,343,977,037.72
(4) 银行理财产品	-	4,428,914,400.73	-	4,428,914,400.73
(5) 券商资管产品	-	1,693,981,493.99	-	1,693,981,493.99
(6) 信托计划	-	86,923,044.40	2,476,633,377.29	2,563,556,421.69
(7) 其他	-	12,029,712,242.48	17,148,913,959.27	29,178,626,201.75
(二) 以公允价值计量且变动计入其他综合收益的金融资产	6,003,447,734.87	51,107,051,375.04	1,837,718,678.48	58,948,217,788.39
(1) 其他债权投资	901,955,770.11	51,107,051,375.04	842,891,803.12	52,851,898,948.27
(2) 其他权益工具投资	5,101,491,964.76	-	994,826,875.36	6,096,318,840.12
(三) 衍生金融资产	44,366,158.70	646,635,989.46	786,165,166.89	1,477,167,315.05
(四) 交易性金融负债	766,277,015.49	3,257,988,379.71	18,864,214,449.39	22,888,479,844.59
(1) 为交易目的而持有的金融负债	164,914,219.16	121,783,099.82	-	286,697,318.98
(2) 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	601,362,796.33	3,136,205,279.89	18,864,214,449.39	22,601,782,525.61
(五) 衍生金融负债	-	535,106,869.36	363,311,681.48	898,418,550.84

十、公允价值的披露 (续)

2、以公允价值计量的资产和负债的上年末公允价值 (续)

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

3、持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

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

4、持续第二层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

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

5、持续第三层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

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

6、持续第三层次公允价值计量项目，期初与期末账面价值之间的调节信息

项目	2022年 12月31日	转入第三层次	转出第三层次	当期利得或损失总额		增加	减少	2023年 6月30日
				计入损益	计入其他 综合收益			
交易性金融资产	46,172,573,146.31	1,777,371,387.55	(2,214,752,732.28)	1,256,219,125.03	-	10,088,749,123.07	(6,744,911,815.53)	50,335,248,234.15
其他债权投资	842,891,803.12	28,299,664.25	-	100,285,755.54	(10,249,942.34)	202,161,315.45	(439,439,805.29)	723,948,790.73
其他权益工具投资	994,826,875.36	1,400,000.00	-	-	15,296,883.19	-	-	1,011,523,758.55
衍生金融工具	422,853,485.41	45,197,900.40	661,268.04	(270,939,491.85)	-	(268,652,736.07)	254,286,436.16	183,406,862.09
交易性金融负债	(18,864,214,449.39)	-	-	(2,191,495,915.81)	-	(4,251,301,327.34)	11,155,691,425.72	(14,151,320,266.82)

十、公允价值的披露 (续)

6、持续第三层次公允价值计量项目，期初与期末账面价值之间的调节信息 (续)

项目	2021年 12月31日	转入第三层次	转出第三层次	当期利得或损失总额		增加	减少	2022年 12月31日
				计入损益	计入其他综合收益			
交易性金融资产	30,655,630,684.97	17,740,117,151.65	(6,394,651,658.11)	(331,643,078.64)	-	8,213,544,761.67	(3,710,424,715.23)	46,172,573,146.31
其他债权投资	1,287,426,748.82	-	(6,199,717.21)	66,490,549.87	17,284,852.82	440,267,784.03	(962,378,415.21)	842,891,803.12
其他权益工具投资	388,791,946.91	-	-	-	(287,996,386.26)	894,031,314.71	-	994,826,875.36
衍生金融工具	(328,735,479.95)	537,869.28	-	1,865,978,944.21	-	348,949,224.93	(1,463,877,073.06)	422,853,485.41
交易性金融负债	(445,701,451.85)	(437,843,635.92)	-	(514,871,867.45)	-	(24,387,020,668.08)	6,921,223,173.91	(18,864,214,449.39)

截至 2023 年 6 月 30 日止 6 个月期间，本集团将部分股权投资从第三层次转移至第一层次，其主要原因为该部分投资已解除上市流通的限制，且其公允价值基于未经流动性折扣调整的活跃市场报价进行确定。此外，本集团亦将部分金融工具转入第三层次，原因为该部分金融工具的估值技术方法转变为基于重大不可观察输入值的估值技术方法。本集团按公允价值计量的金融工具截至 2023 年 6 月 30 日止 6 个月期间未发生其他于第一、第二及第三层次间的重大转移 (截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间：同)。

7、不以公允价值计量的金融资产和金融负债的公允价值情况

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

单位：人民币元

项目	2023年6月30日		2022年12月31日	
	账面价值	公允价值	账面价值	公允价值
金融资产				
债权投资	7,570,911,751.00	7,366,806,744.27	5,806,156,944.34	5,546,901,325.78
金融负债				
应付债券 - 非可转换债券	205,204,445,765.41	205,906,783,418.66	181,830,917,563.00	182,341,774,104.74

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

十一、或有事项、承诺及表外事项 (续)

1、重大承诺事项 (续)

(1) 银行借款质押情况

截至 2023 年 6 月 30 日, 本公司下属子公司海通国际证券的银行质押借款余额合计港币 3.88 亿元 (折合人民币 3.58 亿元)(2022 年 12 月 31 日: 港币 1.85 亿元, 折合人民币 1.65 亿元), 该款项系海通国际在客户同意下, 以其给予客户的融资款而取得的质押品 (持有的上市公司股份) 作为质押借入, 截止 2023 年 6 月 30 日, 该质押品期末市值为港币 20.99 亿元 (折合人民币 19.35 亿元)(2022 年 12 月 31 日: 港币 19.79 亿元, 折合人民币 17.68 亿元)。

截至 2023 年 6 月 30 日, 约有人民币 104.82 亿元的银行贷款 (2022 年 12 月 31 日: 人民币 103.72 亿元) 以本公司下属子公司海通国际证券百分之七十的股权、海通恒信金融集团有限公司和海通银行的股权作为质押。

截至 2023 年 6 月 30 日, 约有人民币 70.91 亿元借款 (2022 年 12 月 31 日: 人民币 81.54 亿元), 以应收融资租赁款项、长期应收款、下属子公司股权作为质押及房屋、飞机租赁固定资产作为抵押。截止 2023 年 6 月 30 日, 质押的应收融资租赁款项账面价值为人民币 3.89 亿元 (2022 年 12 月 31 日: 人民币 4.26 亿元), 质押的长期应收款账面价值为人民币 23.75 亿元 (2022 年 12 月 31 日: 人民币 50.06 亿元), 抵押的房屋、飞机租赁计入固定资产的账面价值为人民币 65.26 亿元 (2022 年 12 月 31 日: 人民币 48.32 亿元)。

(2) 有关公司为境外全资附属公司提供融资担保

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

2020 年 8 月 28 日, 本公司召开第七届董事会第十一次会议, 审议通过了《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》, 同意本公司为在境外的全资附属公司海通银行或其附属公司境外债务融资 (包括但不限于发行境外债券、中长期商业借款及其他符合监管要求的融资方式) 提供连带责任保证担保, 担保金额不超过 3.75 亿欧元债务融资本金 (含 3.75 亿欧元或等值其他币种)、利息、借款人应当承担的其他费用等, 担保期限不超过 6 年 (含 6 年)。本公司于 2021 年 5 月 17 日作为担保人签署《贷款协议》, 为境外全资附属公司海通银行 3.75 亿欧元 (含 3.75 亿欧元或等值其他货币) 银团贷款提供连带责任保证担保。截至 2023 年 6 月 30 日, 公司的该项担保责任余额为 2.25 亿欧元。

十一、或有事项、承诺及表外事项 (续)

1、重大承诺事项 (续)

(2) 有关公司为境外全资附属公司提供融资担保 (续)

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

2022年10月28日, 本公司召开第七届董事会第三十三次会议, 审议通过了《关于为境外全资附属公司境外债务融资提供连带责任保证担保的议案》, 同意本公司为在境外的全资子公司海通国际控股有限公司及其全资附属公司境外债务融资 (包括但不限于发行境外债券、中长期商业借款及其他符合监管要求的融资方式) 提供连带责任保证担保, 担保金额不超过 10 亿美元债务融资本金 (含 10 亿美元或等值其他币种)、利息、借款人应当承担的其他费用等, 担保期限不超过 7 年 (含 7 年)。本公司于 2023 年 4 月 20 日签署《担保协议》, 为本公司境外全资附属公司 Haitong International Finance Holdings Limited (以下简称发行人或被担保人) 发行金额为 40 亿元人民币、于 2026 年到期的债券提供连带责任保证担保。本公司于 2023 年 5 月 18 日签署《担保协议》, 为公司境外全资附属公司 Haitong International Finance Holdings Limited 发行金额为 28 亿元人民币、于 2026 年到期的债券提供连带责任保证担保。

(3) 有关公司为上海海通证券资产管理有限公司提供和追加净资本担保承诺

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

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

十一、或有事项、承诺及表外事项 (续)

1、重大承诺事项 (续)

(3) 有关公司为上海海通证券资产管理有限公司提供和追加净资本担保承诺 (续)

2021年12月, 本公司对海通资管公司减少提供净资本担保承诺金额18亿元。就本次净资本担保减少事宜, 海通资管公司已收到中国证监会上海监管局《关于对海通证券股份有限公司向上海海通证券资产管理有限公司减少提供部分净资本担保承诺事项的无异议函》(沪证监机构字[2021]532号)。截止2023年6月30日, 本公司对海通资管公司提供净资本担保承诺金额为人民币30亿元。

(4) 资本承诺

单位: 人民币万元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
已签约但未拨付的购建长期资产承诺	88,059.16	80,638.46

(5) 经营租赁

根据与承租人已签订的不可撤销的经营性租赁合同, 未来最低应收取租金汇总如下:

单位: 人民币万元

项目	2023年6月30日	2022年12月31日
一年以内	58,674.08	57,468.25
一至二年	55,618.32	55,692.16
二至三年	48,067.51	51,457.05
三至四年	47,186.48	47,432.53
四至五年	28,756.77	34,853.12
五年以上	73,426.28	82,941.71
合计	311,729.44	329,844.82

(6) 其他承诺事项

其他存在限售期及有承诺条件的资产为交易性金融资产、债权投资、其他债权投资和其他权益工具投资, 详见附注五、8, 附注五、9, 附注五、10及附注五、11。

十二、资产负债表日后事项

本公司第七届董事会第二十一次会议审议通过了《关于调整海通恒信金融集团有限公司股权架构的议案》, 拟将海通恒信金融集团有限公司由全资二级子公司变更为全资一级子公司。2023年8月17日, 股权转让事项经香港税务局审核后正式生效, 海通恒信金融集团有限公司于当日同步完成股东名册变更, 海通恒信金融集团有限公司已由本公司直接全资持有。

十二、资产负债表日后事项 (续)

本公司于 2023 年 8 月 25 日发布《海通证券股份有限公司关于筹划回购公司 A 股股份的提示性公告》，拟通过集中竞价交易方式回购 A 股股份，回购资金额预计为 3-6 亿元人民币，预计本次回购 A 股股份价格不超过本公司董事会通过回购股份决议前 30 个交易日公司 A 股股票交易均价的 150%，且不超过人民币 12.8 元 / 股 (含)。本次回购股份实施期限为自董事会审议通过回购方案之日起 3 个月内。拟回购股份将在符合所有适用的法律、法规及公司股票上市地证券监督管理机构的相关规则的前提下进行。

本集团无其他重大的资产负债表日后事项。

十三、分部报告

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

单位：人民币元

本期发生额 / 期末余额	财富管理	投资银行	资产管理	交易及机构	融资租赁	其他	合计
一、营业总收入	4,143,603,125.88	2,145,474,447.90	1,297,312,947.97	2,255,538,889.63	2,539,015,616.30	4,587,421,945.36	16,968,366,973.04
手续费及佣金净收入	1,481,184,470.19	1,963,826,265.90	829,204,276.76	666,353,976.61	-	-	4,940,568,989.46
其他收入	2,662,418,655.69	181,648,182.00	468,108,671.21	1,589,184,913.02	2,539,015,616.30	4,587,421,945.36	12,027,797,983.58
二、营业总支出	2,407,940,166.20	1,302,178,291.65	674,050,697.44	1,178,458,158.36	1,611,660,105.70	4,627,799,562.29	11,802,086,981.64
三、营业利润	1,735,662,959.68	843,296,156.25	623,262,250.53	1,077,080,731.27	927,355,510.60	(40,377,616.93)	5,166,279,991.40
四、利润总额	1,736,550,081.78	908,222,469.93	623,611,506.70	1,096,332,806.57	927,310,734.36	(40,303,151.53)	5,251,724,447.81
五、资产总额							762,391,665,182.85
分部资产	226,521,137,957.71	15,419,157,553.66	21,234,521,134.84	359,959,052,713.21	130,984,330,367.43	3,719,574,549.85	757,837,774,276.70
递延所得税资产							4,553,890,906.15
六、负债总额							582,523,133,380.57
分部负债	183,736,685,866.72	13,368,938,653.09	12,092,813,046.06	254,612,557,533.19	116,809,228,565.35	886,308,824.86	581,506,532,489.27
递延所得税负债							1,016,600,891.30
七、补充信息							
1、折旧与摊销费用	233,042,741.32	123,314,833.73	92,768,452.40	174,505,886.60	170,500,616.40	23,456,070.69	817,588,601.14
2、资本性支出	93,807,167.03	60,801,859.55	27,011,125.48	150,071,499.03	12,926,867.59	7,100.00	344,625,618.68
3、信用减值损失	339,747,880.76	15,772,951.86	39,179,780.94	86,276,926.23	722,838,002.56	8,898.89	1,203,824,441.24
4、其他减值损失	-	-	-	-	8,189,822.02	1,688,018.92	9,877,840.94

十三、分部报告（续）

单位：人民币元

上期发生额 / 上年末余额	财富管理	投资银行	资产管理	交易及机构	融资租赁	其他	合计
一、营业总收入	4,851,698,113.48	2,471,305,202.59	1,639,739,944.55	334,375,483.58	2,309,981,502.96	497,250,049.32	12,104,350,296.48
手续费及佣金净收入	1,699,828,379.90	2,525,822,838.12	1,056,647,727.52	858,381,441.03	-	-	6,140,680,386.57
其他收入	3,151,869,733.58	(54,517,635.53)	583,092,217.03	(524,005,957.45)	2,309,981,502.96	497,250,049.32	5,963,669,909.91
二、营业总支出	1,411,050,067.57	1,482,523,150.87	653,217,052.67	679,321,669.92	1,493,913,399.59	539,573,258.09	6,259,598,598.71
三、营业利润	3,440,648,045.91	988,782,051.72	986,522,891.88	(344,946,186.34)	816,068,103.37	(42,323,208.77)	5,844,751,697.77
四、利润总额	3,458,722,386.82	996,610,737.61	986,930,814.35	(329,623,684.13)	815,744,779.16	(42,320,449.17)	5,886,064,584.64
五、资产总额							753,609,304,959.17
分部资产	240,892,803,571.16	12,623,013,512.92	21,379,980,149.66	343,674,776,102.73	127,115,673,870.71	3,211,377,737.42	748,897,624,944.60
递延所得税资产							4,711,680,014.57
六、负债总额							575,987,247,342.03
分部负债	174,524,635,518.39	11,665,089,800.37	14,673,608,652.79	260,136,584,033.91	113,871,143,958.81	206,726,470.54	575,077,788,434.81
递延所得税负债							909,458,907.22
七、补充信息							
1、折旧与摊销费用	210,791,056.37	128,028,790.80	87,022,100.56	128,450,455.11	156,711,571.78	23,397,324.62	734,401,299.24
2、资本性支出	165,837,378.62	48,890,184.03	11,414,040.85	1,599,868,234.36	12,106,790.20	14,751,773.94	1,852,868,402.00
3、信用减值损失	(497,649,079.08)	13,582,671.07	(10,243,236.10)	5,406,552.96	667,984,441.21	(418,371.48)	178,662,978.58
4、其他减值损失	-	-	-	-	23,438,997.32	2,471,803.46	25,910,800.78

十四、其他重要事项

1、海通国际证券集团购股权计划

(1) 海通国际证券集团有限公司 2015 年购股权计划

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

海通国际证券 2015 购股权计划的详情已于本集团 2022 年度财务报表中披露，该购股权计划应与海通国际证券有关购股权的公告一并阅读。

2022 年 9 月 6 日，根据 2015 年购股权计划，海通国际证券以每股港币 0.935 元的价格授予了 10,635,000 股份给予员工，合计 10,570,000 份购股权被接受。此项计划的有效期限是 2023 年 4 月 3 日至 2027 年 9 月 5 日。所有的购股权的等待期间是授予日起的 6 个月内。海通国际证券的股份的收盘价为每股港币 0.85 元。

十四、其他重要事项（续）

1、海通国际证券集团购股权计划（续）

(1) 海通国际证券集团有限公司 2015 年购股权计划（续）

在 2022 年 9 月 6 日授权日，根据 2015 年购股权计划授予股权的估计公允价格折合港币 1.3 百万元，这个价格是用二项式期权定价模型得出的，关键数据如下：

项目	2022 年
授予日之加权平均股价	港元 0.85
初始行权价格	港元 0.935
预期波动	38.168%
预期授权期限	5 年
无风险折现率	3.05%
预期股息率	10.481%
提前行权乘数 - 海通国际证券董事	1.68
提前行权乘数 - 海通国际证券员工	1.91

预期波动是由海通国际证券股权在授予日之前 5 年内的历史价格决定的。

截至 2023 年 6 月 30 日止 6 个月期间，根据 2015 年购股权计划，海通国际证券于综合损益表中确认权益结算的股份支付港币 649,000 元，折合人民币 598,365.02 元（截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间：港币 892,000 元，折合人民币 762,829.48 元）。

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

	2023 上半年度		2022 年度	
	加权平均行使价 每股港币	配股权数目 千份	加权平均行使价 每股港币	配股权数目 千份
于期 / 年初	1.93	45,162	2.86	40,551
期 / 年内授予及接受的购股权	-	-	0.94	10,570
期 / 年内调整 (注)	1.91	341	2.59	3,998
期 / 年内没收	1.95	(2,301)	3.88	(9,957)
于期 / 年末	1.91	43,202	1.93	45,162

十四、其他重要事项 (续)

1、海通国际证券集团购股权计划 (续)

(1) 海通国际证券集团有限公司 2015 年购股权计划 (续)

截止各报告日期未行使购股权的行使价及行使期如下:

购股权数目 千份	行使价 每股港币 (注)	行权期
2023 年 6 月 30 日		
11,168	2.614	2019 年 5 月 28 日至 2023 年 10 月 31 日
6,190	2.304	2019 年 12 月 27 日至 2024 年 5 月 30 日
7,146	1.558	2020 年 12 月 25 日至 2025 年 5 月 28 日
8,704	2.163	2022 年 2 月 17 日至 2026 年 7 月 20 日
9,994	0.928	2023 年 4 月 3 日至 2027 年 9 月 5 日
43,202		

购股权数目 千份	行使价 每股港币 (注)	行权期
2022 年 12 月 31 日		
11,599	2.635	2019 年 5 月 28 日至 2023 年 10 月 31 日
6,439	2.322	2019 年 12 月 27 日至 2024 年 5 月 30 日
7,419	1.570	2020 年 12 月 25 日至 2025 年 5 月 28 日
9,295	2.180	2022 年 2 月 17 日至 2026 年 7 月 20 日
10,410	0.935	2023 年 4 月 3 日至 2027 年 9 月 5 日
45,162		

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

截止到 2023 年 6 月 30 日, 海通国际证券在 2015 购股权计划中拥有 43,201,613 份 (2022 年 12 月 31 日: 45,161,765 份) 购股权, 大约占到海通国际证券当天发行股票的 0.51% (2022 年 12 月 31 日: 0.68%)。

根据海通国际证券现有的资本结构, 行使所有剩余的股票期权会使海通国际证券发行额外普通股 43,201,613 股 (2022 年: 45,161,765 股), 发行额外股本港币 4,320,000 元, 折合人民币 3,982,953.60 元 (2022 年: 港币 4,516,000 元, 折合人民币 4,034,007.32 元), 股本溢价港币 76,369,000 元, 折合人民币 70,410,690.62 元 (2022 年: 港币 82,642,000 元, 折合人民币 73,821,619.34 元) (不包括发行费用)。

十四、其他重要事项 (续)

1、海通国际证券集团购股权计划 (续)

(2) 海通国际证券集团有限公司股权激励计划

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

在 2023 年 6 月 30 日被授予和失效的股票的信息如下：

授予股份的日期	授予股份的数量	可行权股份的数量	已失效授予股份的数量 (附注 (f))	未及可行权日股份的数量	可行权日期	被授予日的公允价值 (港元)
2020 年 3 月 25 日	14,294,205	11,367,275	2,926,930	-	附注 (a)	28,731,000
2021 年 8 月 31 日	36,788,082	27,307,411	1,247,600	8,233,071	附注 (b)	82,773,000
2022 年 9 月 8 日	9,453,454	9,155,640	119,243	178,571	附注 (c)	8,413,000
2023 年 6 月 7 日	8,650,000	-	-	8,650,000	附注 (d)	5,536,000

授予股权的公允价值以海通国际证券股票的市价衡量。截至 2023 年 6 月 30 日止 6 个月期间，本集团于综合损益表中确认该计划的权益结算股份支付共计港币 5,120,000 元，折合人民币 4,720,537.60 元 (截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间：港币 19,649,000 元，折合人民币 16,803,628.31 元)。

于 2023 年 6 月 30 日，海通国际证券无 2020 年 3 月 25 日被授权但未及可行权日的股份 (2022 年 12 月 31 日：3,293,930 股)。本六个月期间内，于 2020 年 3 月 25 日授权的 18,906 股失效 (截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间：112,105 股)。于 2020 年 3 月 25 日授权的 3,275,024 股可行权 (截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间：3,733,223 股)。

于 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日，海通国际证券未持有 2021 年 3 月 25 日被授予但未及可行权日的股份。

于 2023 年 6 月 30 日，海通国际证券持有 2021 年 8 月 31 日被授权但未及可行权日的股份 8,233,071 股 (2022 年 12 月 31 日：8,315,070 股)。本六个月期间，于 2021 年 8 月 31 日授权的股份并无失效及可行权。

十四、其他重要事项 (续)

1、海通国际证券集团购股权计划 (续)

(2) 海通国际证券集团有限公司股权激励计划 (续)

于 2023 年 6 月 30 日，海通国际证券持有 2022 年 9 月 8 日被授权但未及可行权日的股份 178,571 股 (2022 年 12 月 31 日: 351,439 股)。本六个月期间内，于 2022 年 9 月 8 日授权的 119,243 股失效 (截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间: 无)，于 2022 年 9 月 8 日授权的 53,625 股可行权 (截至 2022 年 6 月 30 日止 6 个月期间: 无)。

于 2023 年 6 月 30 日，海通国际证券持有 2023 年 6 月 7 日被授权但未及可行权日的股份 8,650,000 股。本六个月期间，于 2023 年 6 月 7 日授权的股份并无失效及可行权。

附注:

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

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

(c) 按照商定的条款，于 2022 年 9 月 8 日授予的三分之一激励股权的行使日是 2022 年 9 月 30 日，而于 2022 年 9 月 8 日授予的 282,114 激励股权的行使日是 2022 年 11 月 30 日，而于 2022 年 9 月 8 日授予的 178,572 激励股权的行使日是 2022 年 12 月 31 日，而于 2022 年 9 月 8 日授予的 53,625 激励股权的行使日是 2023 年 3 月 1 日，最后剩余的 178,571 激励股权的行使日是 2023 年 12 月 31 日。

(d) 按照商定的条款，于 2023 年 6 月 7 日授予的 8,650,000 激励股权的行使日是 2023 年 7 月 14 日。

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

下表披露本期在该计划下的股权的变动:

	2023 上半年度		2022 年度	
	港币千元	股份数量	港币千元	股份数量
期 / 年初数	230,864	116,982,123	269,732	117,409,723
本期购买	-	-	17,670	14,662,000
根据红股发行的股份	-	-	-	12,508,264
本期失效并且转出	(6,726)	(3,328,649)	(56,538)	(27,597,864)
期 / 年末数	224,138	113,653,474	230,864	116,982,123

十四、其他重要事项 (续)

2、金融工具计量基础分类表

单位：人民币元

金融资产项目	金融资产计量基础分类表							
	以摊余成本计量的金融资产		以公允价值计量且其变动计入其他综合收益		以公允价值计量且其变动计入当期损益		以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	
	期末数	年初数	期末数	年初数	期末数	年初数	期末数	年初数
货币资金	167,650,291,602.79	158,580,169,366.67						
结算备付金	18,566,286,644.34	21,380,695,420.73						
拆出资金	65,128,171.04	274,444,523.06						
融出资金	66,419,987,586.89	67,843,870,816.38						
衍生金融资产								
存出保证金	21,667,484,375.17	22,864,574,405.46			1,755,378,366.46	1,363,811,458.09	177,046,220.34	113,355,856.96
应收款项	9,988,638,026.50	10,394,514,867.70						
买入返售金融资产	41,104,588,898.59	32,645,149,033.49						
交易性金融资产					208,937,410,147.68	209,598,729,439.75		
债权投资	7,570,911,751.00	5,806,156,944.34						
其他债权投资			46,052,751,650.68	52,851,898,948.27				
其他权益工具投资					7,468,695,645.78	6,096,318,840.12		
长期应收款	87,170,113,517.24	84,549,952,480.38						
其他资产 (金融资产)	15,787,705,906.13	16,265,551,343.55						
合计	435,991,136,479.69	420,605,079,201.76	46,052,751,650.68	52,851,898,948.27	7,468,695,645.78	6,096,318,840.12	210,692,788,514.14	210,962,540,897.84
							177,046,220.34	113,355,856.96

十四、其他重要事项 (续)

2、金融工具计量基础分类表 (续)

单位：人民币元

金融负债项目	金融负债计量基础分类表					
	以摊余成本计量的金融负债		分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债		以公允价值计量且其变动计入当期损益	
	期末数	年初数	期末数	年初数	期末数	年初数
短期借款	35,051,068,398.84	34,858,042,732.67				
应付短期融资款	12,985,279,819.13	16,159,094,370.29				
拆入资金	9,022,891,869.78	6,276,101,144.00				
交易性金融负债		2,619,514,393.55	286,697,318.98	19,901,742,232.00	22,601,782,525.61	
衍生金融负债		1,299,401,987.75	822,247,271.40		6,188,851.61	76,171,279.44
卖出回购金融资产业款	83,066,644,832.97	101,694,356,537.25				
代理买卖证券款	119,909,488,360.94	115,513,463,366.21				
代理承销证券款	18,232,500.00	13,500,000.00				
应付款项	13,444,503,709.75	11,490,826,596.82				
长期借款	51,820,794,725.46	55,958,202,723.56				
应付债券	205,204,445,765.41	181,830,917,563.00				
其他负债 (金融负债)	16,501,960,444.05	18,631,422,792.09				
合计	547,025,310,426.33	542,425,927,825.89	3,918,916,381.30	1,108,944,590.38	19,901,742,232.00	22,601,782,525.61
					6,188,851.61	76,171,279.44

十四、其他重要事项 (续)

3、社会责任

2023年1-6月在环保公益项目、救灾捐款、教育资助、慈善捐赠等公益性方面的投入金额共计68.38万元。

2023年1-6月公益性投入构成明细

单位：人民币万元

项目	本期发生额
慈善捐赠、教育资助、救灾捐款等	68.38
合计	68.38

十五、母公司财务报表项目注释

1、长期股权投资

(1) 长期股权投资分类如下

单位：人民币元

项目	2023年6月30日			2022年12月31日		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
子公司	37,648,657,602.07	-	37,648,657,602.07	37,648,657,602.07	-	37,648,657,602.07
联营企业	2,161,292,664.44	-	2,161,292,664.44	2,151,251,582.61	-	2,151,251,582.61
合计	39,809,950,266.51	-	39,809,950,266.51	39,799,909,184.68	-	39,799,909,184.68

(2) 对子公司投资

单位：人民币元

被投资单位	初始投资成本	2022年12月31日	本期增加	本期减少	2023年6月30日	本期计提减值准备	减值准备期末余额
海富通基金管理有限公司	76,500,000.00	76,500,000.00	-	-	76,500,000.00	-	-
海通期货股份有限公司	2,190,938,863.68	2,190,938,863.68	-	-	2,190,938,863.68	-	-
海通国际控股有限公司	9,406,814,500.00	9,406,814,500.00	-	-	9,406,814,500.00	-	-
海通开元投资有限公司	7,500,000,000.00	7,500,000,000.00	-	-	7,500,000,000.00	-	-
海通创新证券投资咨询有限公司	14,650,000,000.00	14,650,000,000.00	-	-	14,650,000,000.00	-	-
上海海通证券资产管理有限公司	2,200,000,000.00	2,200,000,000.00	-	-	2,200,000,000.00	-	-
上海惟泰置业管理有限公司	756,066,063.75	756,066,063.75	-	-	756,066,063.75	-	-
上海泽春投资发展有限公司	868,338,174.64	868,338,174.64	-	-	868,338,174.64	-	-
合计	37,648,657,602.07	37,648,657,602.07	-	-	37,648,657,602.07	-	-

十五、母公司财务报表项目注释 (续)

1、长期股权投资 (续)

(3) 对联营企业投资

单位：人民币元

被投资单位	2022年12月31日	本期增、减变动							2023年6月30日	减值准备期末余额	
		追加投资	减少投资	权益法下确认的投资收益	其他综合收益调整	公司享有其他权益变动	公司享有的宣告发放现金股利或利润	计提减值准备			其他
联营企业											
富国基金管理有限公司	2,151,251,582.61	-	-	295,914,926.63	2,986,155.20	-	(288,860,000.00)	-	-	2,161,292,664.44	-

(4) 公司无向投资企业转移资金能力受到限制的情况。

2、手续费及佣金净收入

(1) 手续费及佣金净收入按类别列示

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
证券经纪业务净收入	1,721,378,711.90	2,064,117,835.34
— 证券经纪业务收入	2,351,928,120.11	2,772,335,680.54
其中：代理买卖证券业务	1,809,457,730.63	2,131,557,883.21
交易单元席位租赁	402,104,235.78	455,054,708.28
代销金融产品业务	140,366,153.70	185,723,089.05
— 证券经纪业务支出	630,549,408.21	708,217,845.20
其中：代理买卖证券业务	630,549,408.21	708,217,845.20
投资银行业务净收入	1,753,920,625.71	2,143,973,926.93
— 投资银行业务收入	1,768,046,235.03	2,159,069,354.30
其中：证券承销业务	1,707,966,979.19	2,109,050,886.38
证券保荐业务	29,298,113.20	33,201,886.79
财务顾问业务	30,781,142.64	16,816,581.13
— 投资银行业务支出	14,125,609.32	15,095,427.37
其中：证券承销业务	13,873,486.68	10,977,282.09
财务顾问业务	252,122.64	4,118,145.28
投资咨询业务净收入	23,203,293.59	72,154,129.04
— 投资咨询业务收入	23,203,293.59	72,154,129.04
其他手续费及佣金净收入	45,378,950.90	55,060,976.40
— 其他手续费及佣金收入	47,125,349.99	56,027,288.07
— 其他手续费及佣金支出	1,746,399.09	966,311.67
合计	3,543,881,582.10	4,335,306,867.71
其中：手续费及佣金收入合计	4,190,302,998.72	5,059,586,451.95
手续费及佣金支出合计	646,421,416.62	724,279,584.24

十五、母公司财务报表项目注释 (续)

2、手续费及佣金净收入 (续)

(2) 财务顾问业务净收入按类别列示

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
并购重组财务顾问业务净收入 - 境内上市公司	8,088,679.25	3,350,943.40
并购重组财务顾问业务净收入 - 其他	-	283,018.87
其他财务顾问业务净收入	22,440,340.75	9,064,473.58
合计	30,529,020.00	12,698,435.85

3、利息净收入

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
利息收入	4,741,396,853.52	4,808,806,134.02
其中：货币资金及结算备付金利息收入	1,239,313,387.97	1,228,248,811.49
融出资金利息收入	1,824,367,198.41	2,059,179,044.17
买入返售金融资产利息收入	865,575,911.48	873,500,226.85
其中：约定购回利息收入	6,996,004.73	6,776,394.14
股票质押回购利息收入	769,143,335.18	833,271,964.21
其他债权投资利息收入	782,929,735.50	631,208,450.23
其他按实际利率法计算的金融资产产生的利息收入	29,210,620.16	16,669,601.28
利息支出	3,529,597,463.99	3,543,016,500.42
其中：借款利息支出	-	43,429,416.69
应付短期融资款利息支出	84,112,000.95	192,278,813.79
拆入资金利息支出	102,823,866.44	153,000,756.45
其中：转融通利息支出	63,508,333.37	126,416,666.44
卖出回购金融资产利息支出	1,013,891,682.04	946,501,586.54
其中：报价回购利息支出	36,155,726.94	5,881,903.68
代理买卖证券款利息支出	95,098,258.12	131,701,257.18
应付债券利息支出	2,077,004,257.49	1,980,771,488.98
其中：次级债券利息支出	153,359,514.48	142,733,556.17
租赁负债利息支出	9,395,756.45	9,005,125.10
其他按实际利率法计算的金融负债利息支出	147,271,642.50	86,328,055.69
利息净收入	1,211,799,389.53	1,265,789,633.60

十五、母公司财务报表项目注释 (续)

4、投资收益

(1) 投资收益按类别列示

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
权益法核算的长期股权投资收益	295,914,926.63	311,694,737.85
金融工具投资收益	1,630,110,191.74	(1,090,504,564.41)
(1) 持有期间取得的收益	1,920,886,649.37	2,167,939,823.33
交易性金融工具	1,853,601,460.06	2,099,902,703.64
其他权益工具投资	67,285,189.31	68,037,119.69
(2) 处置金融工具取得的收益	(290,776,457.63)	(3,258,444,387.74)
交易性金融工具	(852,040,228.34)	(1,244,389,826.57)
其他债权投资	133,638,624.44	33,633,905.39
衍生金融工具	423,990,076.02	(2,048,589,952.95)
其他	3,635,070.25	901,486.39
合计	1,926,025,118.37	(778,809,826.56)

5、公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
交易性金融资产	1,355,775,101.88	306,853,164.97
衍生金融工具	422,738,256.64	1,535,383,935.58
交易性金融负债	(1,397,116,106.30)	881,814,291.41
其中：指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	(1,362,524,419.48)	866,691,091.41
合计	381,397,252.22	2,724,051,391.96

6、业务及管理费

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
职工费用	2,137,496,475.37	2,147,175,151.70
固定资产折旧费	210,587,796.58	199,840,586.93
电子设备运转费	177,411,172.42	70,322,011.94
使用权资产折旧	92,604,650.66	81,124,644.04
无形资产摊销	74,572,304.93	57,879,051.38
差旅费	71,672,599.14	23,718,125.95
邮电通讯费	67,610,136.85	31,246,124.73
业务招待费	47,670,479.64	43,815,598.46
物业管理费	47,190,860.50	38,876,680.07
租赁费	44,637,797.40	24,430,820.62
其他	277,210,086.72	310,499,375.29
合计	3,248,664,360.21	3,028,928,171.11

十五、母公司财务报表项目注释 (续)

7、现金流量表补充资料

单位：人民币元

项目	本期发生额	上期发生额
1、将净利润调节为经营活动现金流量		
净利润	3,325,599,016.78	4,509,685,814.32
加：信用减值损失	34,303,152.25	(678,701,091.05)
固定资产及投资性房地产折旧	211,125,055.06	200,377,845.41
使用权资产折旧	92,604,650.66	81,124,644.04
无形资产摊销	74,572,304.93	57,879,051.38
长期待摊费用摊销	35,458,558.62	30,839,417.80
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失	7,503,562.20	482,033.90
公允价值变动收益	(381,397,252.22)	(2,724,051,391.96)
利息支出	1,387,582,279.39	1,629,718,460.08
汇兑损失	186,113,715.01	49,466,656.40
投资收益	(496,838,740.38)	(413,365,762.93)
递延所得税资产减少	157,293,482.26	843,244,800.45
交易性金融资产等的 (增加)/减少	(293,890,307.89)	25,298,575,250.58
经营性应收项目的 (增加)/减少	(5,724,060,481.02)	1,086,667,811.36
经营性应付项目的减少	(12,970,950,846.96)	(13,008,747,858.34)
经营活动 (使用)/产生的现金流量净额	(14,354,981,851.31)	16,963,195,681.44
2、不涉及现金收支的重大投资和筹资活动		
债务转为资本	-	-
一年内到期的可转换公司债券	-	-
融资租入固定资产	-	-
3、现金及现金等价物净变动情况		
现金的期末余额	123,773,563,867.93	134,843,146,195.67
减：现金的年初余额	125,324,821,911.95	117,262,317,533.08
加：现金等价物的期末余额	-	-
减：现金等价物的年初余额	-	-
现金及现金等价物净 (减少)/增加额	(1,551,258,044.02)	17,580,828,662.59

十六、财务报表的批准报出

本财务报表业经本公司董事会于 2023 年 8 月 30 日批准报出。

补充资料

1、非经常性损益明细表

项目	本期发生额
非流动资产处置损益	(7,677,343.56)
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)	798,374,572.90
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益	-
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	87,642,940.38
减: 所得税影响额	213,351,030.43
少数股东权益影响额(税后)	47,574,383.60
合计	617,414,755.69

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

2、境内外会计准则下会计数据差异

公司按照中国会计准则编制的合并财务报表及按照国际财务报告准则编制的合并财务报表中列示的 2023 年 1-6 月及 2022 年 1-6 月的净利润和 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日的净资产并无差异。

3、净资产收益率及每股收益

本净资产收益率和每股收益计算表是本公司按照中国证监会颁布的《公开发行证券公司信息披露编报规则第 9 号净资产收益率和每股收益的计算及披露》(2010 年修订) 的有关规定而编制的。

报告期利润	加权平均净资产收益率 (%)	每股收益 (元)	
		基本每股收益	稀释每股收益
归属于公司普通股股东的净利润	2.29	0.29	0.29
扣除非经常性损益后归属于公司普通股股东的净利润	1.92	0.25	0.25

第十节 证券公司信息披露

一、公司重大行政许可事项的相关情况

日期	批复标题	批复单位	批文号
2023年7月14日	关于同意海通证券股份有限公司 向专业投资者公开发行短期公司 债券注册的批复	中国证监会	证监许可〔2023〕1536号

二、监管部门对公司的分类结果

适用 不适用



海通证券
HAITONG

地 址：中国上海市黄浦区中山南路888号海通外滩金融广场

邮 编：200011

邮 箱：haitong@haitong.com

全国统一服务热线：95553