



# 海通証券股份有限公司

## HAITONG SECURITIES CO., LTD.\*

(在中華人民共和國註冊成立之股份有限公司)

股份代號：6837

# 2022

## 中期報告

\*僅供識別

# 目錄

|      |              |     |
|------|--------------|-----|
| 重要提示 |              | 02  |
| 第一節  | 釋義及重大風險提示    | 03  |
| 第二節  | 本公司簡介和主要財務指標 | 07  |
| 第三節  | 董事會報告        | 14  |
| 第四節  | 公司治理         | 62  |
| 第五節  | 環境與社會責任      | 82  |
| 第六節  | 重要事項         | 89  |
| 第七節  | 股份變動及股東情況    | 107 |
| 第八節  | 優先股相關情況      | 114 |
| 第九節  | 債券相關情況       | 115 |
| 第十節  | 財務報告         | 124 |
| 第十一節 | 證券公司信息披露     | 125 |



## 重要提示

本公司董事會、監事會及董事、監事、高級管理人員保證中期報告(「本報告」)內容的真實性、準確性及完整性，不存在虛假記載、誤導性陳述或重大遺漏，並承擔個別和連帶的法律責任。

本報告經本公司第七屆董事會第32次會議、第七屆監事會第18次會議通過。本公司全體董事、監事出席董事會會議。未有董事、監事對本報告提出異議。

本集團按國際財務報告準則編製的2022中期簡明綜合財務資料未經審計。羅兵咸永道會計師事務所已根據國際審閱準則2410號對該中期財務資料進行審閱並出具了審閱報告。

本公司董事長周杰先生、主管會計工作負責人張信軍先生及會計機構負責人(會計主管人員)馬中先生聲明：保證本報告中財務報告的真實、準確及完整。除特別說明外，本報告所列數據以人民幣為單位。

本公司2022年上半年度未擬定利潤分配預案和公積金轉增股本預案。

本報告可能載有未來計劃及發展戰略等前瞻性陳述。本報告所載除過往事實陳述以外的一切陳述均為或視為前瞻性陳述。本公司及其任何附屬公司並無責任因出現新數據而公開更新或修訂任何前瞻性陳述。本報告中所設計的未來計劃、發展戰略等前瞻性描述不構成本公司對投資者的承諾，敬請投資者注意投資風險，不應過分依賴前瞻性陳述。

報告期內，本公司不存在被控股股東或其關聯方非經營性佔用資金的情況。

報告期內，本公司不存在違反規定決策程序對外提供擔保的情況。

## 第一節 釋義及重大風險提示

### 一、釋義

在本報告書中，除非文義另有所指，下列詞語具有如下含義：

|         |   |                                     |
|---------|---|-------------------------------------|
| A股      | 指 | 本公司每股面值人民幣1.00元的內資股，於上海證券交易所上市並進行交易 |
| 公司章程或章程 | 指 | 本公司的公司章程                            |
| 董事會     | 指 | 本公司董事會                              |
| 北交所     | 指 | 北京證券交易所                             |
| 《守則》    | 指 | 香港上市規則附錄十四《企業管治守則》及《企業管治報告》         |
| 本公司     | 指 | 海通證券股份有限公司                          |
| 公司法     | 指 | 中華人民共和國公司法                          |
| 中國證監會   | 指 | 中國證券監督管理委員會                         |
| 董事      | 指 | 本公司董事                               |
| ETF     | 指 | 交易型開放式指數基金                          |
| 歐元      | 指 | 歐元區法定貨幣                             |
| FICC    | 指 | 固定收益、外匯及大宗商品                        |
| 富國基金    | 指 | 富國基金管理有限公司                          |
| 本集團     | 指 | 本公司及其子公司                            |
| H股      | 指 | 本公司每股面值人民幣1.00元的普通股，於香港聯交所上市及以港元買賣  |
| 海通銀行    | 指 | 海通銀行(Haitong Bank, S.A.)            |

## 第一節 釋義及重大風險提示

|          |   |                                     |
|----------|---|-------------------------------------|
| 海通開元     | 指 | 海通開元投資有限公司                          |
| 海通期貨     | 指 | 海通期貨股份有限公司                          |
| 海通創新證券   | 指 | 海通創新證券投資有限公司                        |
| 海通國際     | 指 | 海通國際證券集團有限公司，於香港聯交所上市，股份代號：665      |
| 海通國際控股   | 指 | 海通國際控股有限公司                          |
| 海通恒信     | 指 | 海通恒信國際融資租賃股份有限公司，於香港聯交所上市，股份代號：1905 |
| 海富產業     | 指 | 海富產業投資基金管理有限公司                      |
| 海富通基金    | 指 | 海富通基金管理有限公司                         |
| 港元或港幣    | 指 | 香港法定貨幣                              |
| 香港上市規則   | 指 | 香港聯交所證券上市規則                         |
| 香港聯交所    | 指 | 香港聯合交易所有限公司                         |
| 海通資管公司   | 指 | 上海海通證券資產管理有限公司                      |
| 國際財務報告準則 | 指 | 國際財務報告準則                            |
| IPO      | 指 | 首次公開發售                              |
| 《標準守則》   | 指 | 香港上市規則附錄十所載之《上市發行人董事進行證券交易的標準守則》    |
| 新三板      | 指 | 全國中小企業股份轉讓系統                        |

## 第一節 釋義及重大風險提示

|           |   |                                    |
|-----------|---|------------------------------------|
| 全國社保基金    | 指 | 中國社會保障基金理事會                        |
| QFII      | 指 | 合格境外機構投資者                          |
| 報告期       | 指 | 2022年1月1日至2022年6月30日               |
| 人民幣       | 指 | 中國法定貨幣                             |
| RQFII     | 指 | 人民幣合格境外機構投資者                       |
| 證券及期貨條例   | 指 | 香港法例第571章證券及期貨條例(經不時修訂、補充或以其他方式修改) |
| 上海國盛集團    | 指 | 上海國盛(集團)有限公司                       |
| 上海證監局     | 指 | 中國證券監督管理委員會上海監管局                   |
| 上海澤春      | 指 | 上海澤春投資發展有限公司                       |
| 上海惟泰置業    | 指 | 上海惟泰置業管理有限公司                       |
| 上交所       | 指 | 上海證券交易所                            |
| 《上交所上市規則》 | 指 | 《上海證券交易所股票上市規則》                    |
| 監事        | 指 | 本公司監事                              |
| 監事會       | 指 | 本公司監事會                             |
| 深交所       | 指 | 深圳證券交易所                            |
| 美元        | 指 | 美利堅合眾國法定貨幣                         |
| WIND      | 指 | 萬得信息技術股份有限公司                       |

## 第一節 釋義及重大風險提示

### 二、重大風險提示

本集團的業務高度依賴於中國及其他業務所處國家或地區的整體經濟及市場狀況，宏觀經濟環境、行業周期特徵、市場發展程度、投資者行為以及國際經濟形勢等諸多因素都將對本集團經營業績產生重大影響。

本集團面臨的主要風險包括：因違反法律法規和準則而使證券公司被依法追究法律責任、採取監管措施、給予紀律處分等情形的法律及合規風險；因借款人、交易對手方或債務發行人無法履行其約定的財務義務而可能對經營造成損失的信用風險；因市場價格的不利變動而使自有資金投資業務發生損失的市場風險；由於內部流程不完善、員工操作失誤及不當行為、信息系統故障缺陷以及外部事件導致的操作風險；無法以合理成本及時獲得充足資金，以償付到期債務、履行其他支付義務和滿足正常業務開展所需資金的流動性風險；因經營、管理及其他行為或外部事件導致利益相關方進行負面評價的聲譽風險。以上各類風險將給本集團的經營和收益帶來直接影響，同時由於風險之間存在一定關聯性，這種影響還可能產生疊加效應。

針對上述風險的具體分析及採取的具體措施，請投資者認真閱讀本報告「董事會報告」中關於「可能面對的風險」相關內容，並特別注意上述風險因素。

## 第二節 本公司簡介和主要財務指標

### 一、本公司信息

|            |                              |
|------------|------------------------------|
| 本公司的中文名稱   | 海通證券股份有限公司                   |
| 本公司的中文簡稱   | 海通證券                         |
| 本公司的外文名稱   | Haitong Securities Co., Ltd. |
| 本公司的外文名稱縮寫 | Haitong Securities           |
| 本公司的法定代表人  | 周杰                           |
| 本公司總經理     | 李軍                           |
| 本公司授權代表    | 周杰、姜誠君                       |
| 聯席公司秘書     | 姜誠君、黃慧玲                      |
| 合規總監       | 李海超                          |

### 本公司經營範圍

證券經紀；證券自營；證券承銷與保薦；證券投資諮詢；與證券交易、證券投資活動有關的財務顧問；直接投資業務；證券投資基金代銷；為期貨公司提供中間介紹業務；融資融券業務；代銷金融產品；股票期權做市業務；中國證監會批准的其他業務，本公司可以對外投資設立子公司從事金融產品等投資業務。【依法須經批准的項目，經相關部門批准後方可開展經營活動】

### 註冊資本和淨資本

單位：元 幣種：人民幣

|      | 本報告期末             | 上年度末              |
|------|-------------------|-------------------|
| 註冊資本 | 13,064,200,000.00 | 13,064,200,000.00 |
| 淨資本  | 90,947,668,475.75 | 85,222,467,669.07 |

### 本公司的各單項業務資格情況

1. 網上證券委託業務資格（證監信息字[2001]3號）
2. 全國銀行間同業拆借市場和債券市場從事拆借、購買債券、債券現券交易和債券回購業務資格（銀辦函[2001]819號）
3. 全國銀行間同業拆借中心組織的拆借交易和債券交易資格（中匯交發[2001]306號）
4. 收購證券營業部資格（滬證機便[2002]090號）
5. 開放式證券投資基金代銷業務資格（證監基金[2002]076號）
6. 從事相關創新活動試點證券公司（中證協函[2005]079號）
7. 從事短期融資券承銷業務資格（銀發[2005]173號）
8. 報價轉讓業務資格（中證協函[2006]3號）
9. 上海證券交易所固定收益證券綜合電子平台交易商資格（上證會函[2007]86號）

## 第二節 本公司簡介和主要財務指標

10. 中國銀行間市場交易商協會資格(2007.08)
11. 作為合格境內機構投資者從事境外證券投資管理業務資格(證監許可[2008]146號)
12. 中國證券登記結算有限責任公司甲類結算參與人資格(中國結算函字[2008]22號)
13. 為期貨公司提供中間介紹業務資格(滬證監機構字[2010]122號)
14. 開展直接投資業務試點資格(機構部部函[2008]421號)
15. 實施經紀人制度資格(滬證監機構字[2009]302號)
16. 向保險機構投資者提供交易單元的資格(保監資金審證[2009]1號)
17. 融資融券業務資格(證監許可[2010]315號)
18. 公司自營業務參與股指期貨套期保值交易業務資格(滬證監機構字[2010]372號)
19. 基金評價業務資格(中證協發[2010]070號)
20. 全國社保基金理事會簽約券商資格(2011.08)
21. 資產管理業務參與股指期貨交易資格(滬證監機構字[2011]237號)
22. 約定購回式證券交易業務試點(機構部部函[2011]512號)(上證交字[2011]37號)
23. 發行境外上市外資股資格(證監許可[2011]1821號)(H股)
24. 債券質押式報價回購業務試點(機構部部函[2011]585號)
25. 合夥企業獨立託管業務試點(機構部部函[2012]686號)
26. 櫃台市場交易業務(中證協函[2012]825號)
27. 轉融通業務試點資格(中證金函[2012]113號)
28. 中小企業私募債券承銷業務試點資格(中證協函[2012]561號)
29. 證券業務外匯經營(SC201307)
30. 新三板推薦業務和經紀業務(股轉系統函[2013]61號)
31. 代銷金融產品業務資格(滬證監機構字[2013]180號)
32. 權益類收益互換業務和場外期權交易業務(中證協函[2013]996號)
33. 開展客戶證券資金消費支付服務試點資格(機構部部函[2013]741號)
34. 2013年第十一批保險兼業代理人資格(滬保監許可[2013]204號)
35. 開展黃金等貴金屬現貨合約代理和黃金現貨合約自營業務資格(機構部部函[2013]959號)
36. 證券投資基金託管資格(證監許可[2013]1643號)

## 第二節 本公司簡介和主要財務指標

37. 代理證券質押登記業務資格(2014.02)
38. 互聯網證券業務試點(中證協函[2014]358號)
39. 黃金交易所會員資格(證書編號:T004)
40. 上市公司股權激勵行權融資業務試點(深圳函[2014]321號)
41. 股票期權做市業務資格(證監許可[2015]153號)
42. 上證50ETF期權合約品種的主做市商(上證函[2015]214號)
43. 期權結算業務資格(中國結算函字[2015]20號)
44. 期貨會員證書(證書編號:NO.G02008)
45. 中國證券投資基金業協會會員證書(證書編號:00000147)
46. 境外自營業務資格(機構部函[2015]1204號)
47. 單向視頻開戶創新方案的無異議函(中國結算辦字[2015]461號)
48. 銀行間黃金詢價業務資格(上金交發[2015]120號)
49. 非金融企業債務融資工具主承銷業務資質(2016.08)
50. 票據交易資質(2016年11月)
51. 信用風險緩釋工具相關業務資格(2017.01)
52. 場外期權業務二級交易商資格(中證協發[2018]386號)
53. 信用衍生品業務資質(機構部函[2019]469號)
54. 軍工涉密業務諮詢服務安全保密條件備案證書(2019.10)
55. 股指期權做市業務(機構部函[2019]3073號)
56. 利率互換實時承接業務資格(中國外匯交易中心公告)
57. 受信用保護債券質押式回購業務合格創設機構資格(中國結算函字[2021]201號)
58. 中證1000股指期權主做市商(2022.07)
59. 商品互換業務一級交易商(2022.07)

本公司具備上交所、深交所和北交所的會員資格，中國證券登記結算有限責任公司權證結算業務資格。本公司附屬子公司均依法，或經相關監管部門批准獲得相應的業務資格後開展經營業務活動。

## 第二節 本公司簡介和主要財務指標

### 二、聯繫人和聯繫方式

|      | 董事會秘書                                  | 證券事務代表                                 |
|------|--|--|
| 姓名   | 姜誠君                                    | 孫濤                                     |
| 聯繫地址 | 中國上海市廣東路689號海通證券<br>大廈12層(郵政編碼:200001) | 中國上海市廣東路689號海通證券<br>大廈12層(郵政編碼:200001) |
| 電話   | 8621-23219000                          | 8621-23219000                          |
| 傳真   | 8621-63410627                          | 8621-63410627                          |
| 電子信箱 | jiangcj@htsec.com                      | sunt@htsec.com                         |

### 三、基本情況變更簡介

|                |  |
|----------------|--|
| 本公司註冊地址        | 中國上海市廣東路689號   |
| 本公司註冊地址的歷史變更情況 | 中國上海市江西中路200號(1988年)<br>中國上海市四川中路480號(1990年)<br>中國上海市北海寧路30號(1994年)<br>中國上海市唐山路218號(1998年)<br>中國上海市淮海中路98號(2001年)<br>中國上海市廣東路689號海通證券大廈(2012年) |
| 本公司辦公地址        | 中國上海市廣東路689號   |
| 本公司辦公地址的郵政編碼   | 200001   |
| 本公司網址          | <a href="http://www.htsec.com">http://www.htsec.com</a>  |
| 電子信箱           | haitong@htsec.com  |
| 報告期內變更情況查詢索引   | <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>  |
| 香港主要營業地址       | 香港黃竹坑香葉道2號One Island South 15樓   |
| 營業執照統一社會信用代碼   | 9131000013220921X6   |

### 四、信息披露及備置地地點變更情況簡介

|                |  |
|----------------|--|
| 本公司選定的信息披露報紙名稱 | 中國證券報、上海證券報、證券時報、證券日報  |
| 登載中期報告的網站地址    | <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a><br><a href="http://www.hkexnews.hk">http://www.hkexnews.hk</a> |
| 本公司中期報告備置地地點   | 中國上海市廣東路689號海通證券大廈12層董事會<br>辦公室  |
| 報告期內變更情況查詢索引   | <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a><br><a href="http://www.hkexnews.hk">http://www.hkexnews.hk</a> |

## 第二節 本公司簡介和主要財務指標

### 五、本公司股票簡況

| 股票種類 | 股票上市交易所 | 股票簡稱 | 股票代碼   | 變更前股票簡稱 | 股份登記處                       |
|------|---------|------|--------|---------|-----------------------------|
| A股   | 上交所     | 海通證券 | 600837 | /       | 中國證券登記結算<br>有限責任公司<br>上海分公司 |
| H股   | 香港聯交所   | 海通證券 | 6837   | /       | 香港中央證券登記<br>有限公司            |

### 六、其他有關資料

✓不適用

### 七、本公司主要會計數據和財務指標

若無特別說明，本報告所載會計數據和財務數據指標按照國際財務報告準則編製。

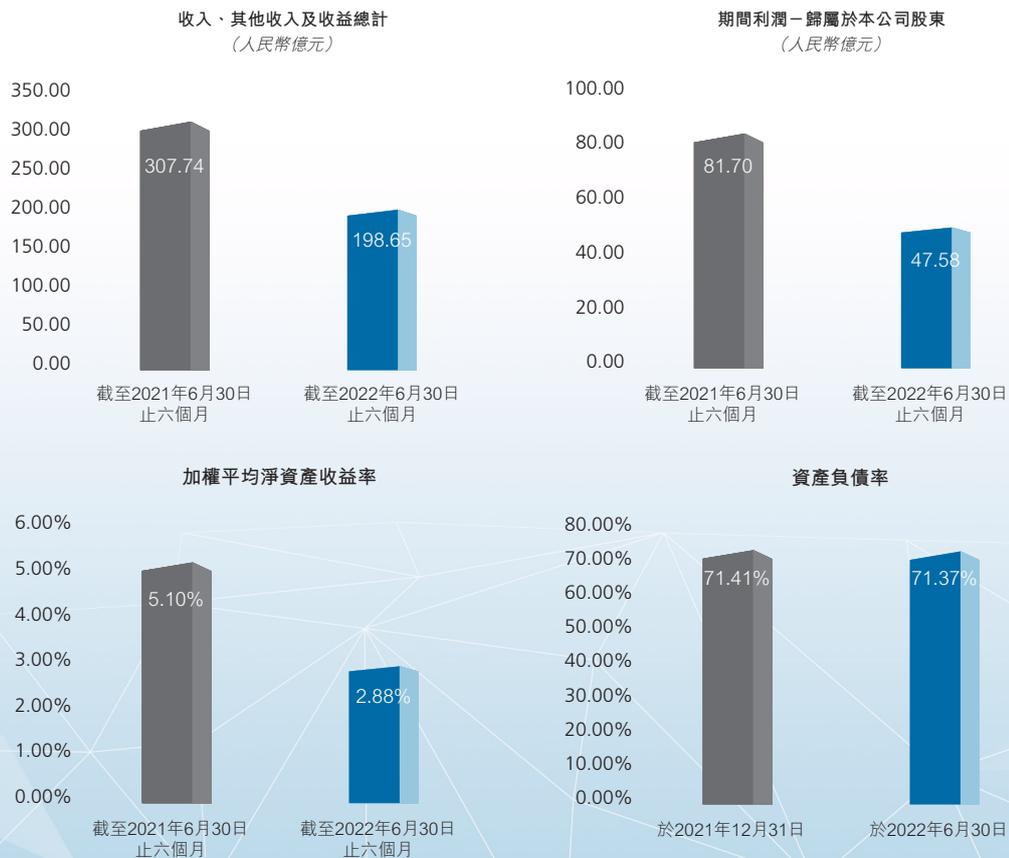
#### （一）主要會計數據和財務指標

| 項目                 | 截至2022年<br>6月30日止<br>六個月 | 截至2021年<br>6月30日止<br>六個月 | 本期比上期     |
|--------------------|--------------------------|--------------------------|-----------|
| <b>經營業績（人民幣千元）</b> |                          |                          |           |
| 收入、其他收益及收益總計       | <b>19,864,831</b>        | 30,773,720               | -35.45%   |
| 所得稅前利潤             | <b>5,886,065</b>         | 11,660,950               | -49.52%   |
| 期間利潤－歸屬於本公司股東      | <b>4,757,725</b>         | 8,170,195                | -41.77%   |
| 來自經營活動的現金淨額        | <b>10,928,558</b>        | 22,661,526               | -51.77%   |
| 其他綜合收益／（損失）        | <b>58,198</b>            | (346,786)                | 不適用       |
| <b>每股計（人民幣元／股）</b> |                          |                          |           |
| 基本每股收益             | <b>0.36</b>              | 0.63                     | -42.86%   |
| 稀釋每股收益             | <b>0.36</b>              | 0.63                     | -42.86%   |
| <b>盈利能力指標</b>      |                          |                          |           |
| 加權平均淨資產收益率（%）      | <b>2.88</b>              | 5.10                     | -2.22個百分點 |

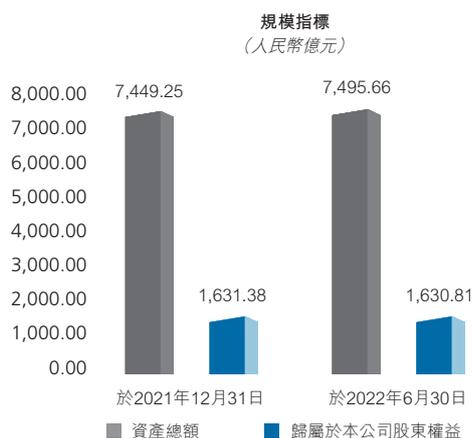
## 第二節 本公司簡介和主要財務指標

| 項目                             | 於2022年<br>6月30日    | 於2021年<br>12月31日 | 本期末比<br>上年期末 |
|--------------------------------|--------------------|------------------|--------------|
| <b>規模指標 (人民幣千元)</b>            |                    |                  |              |
| 資產總額                           | <b>749,565,861</b> | 744,925,149      | 0.62%        |
| 負債總額                           | <b>572,083,286</b> | 567,170,363      | 0.87%        |
| 應付經紀業務客戶賬款                     | <b>129,589,378</b> | 123,202,200      | 5.18%        |
| 歸屬於本公司股東權益                     | <b>163,080,741</b> | 163,137,964      | -0.04%       |
| <b>總股本 (千股)</b>                |                    |                  |              |
|                                | <b>13,064,200</b>  | 13,064,200       | 0.00%        |
| <b>歸屬於本公司股東</b>                |                    |                  |              |
| 每股淨資產 (人民幣元/股)                 | <b>12.48</b>       | 12.49            | -0.08%       |
| <b>資產負債率 (%)<sup>(1)</sup></b> | <b>71.37</b>       | 71.41            | 0.04個百分點     |

註1：資產負債率 = (負債總額 - 應付經紀業務客戶賬款) / (資產總額 - 應付經紀業務客戶賬款)



## 第二節 本公司簡介和主要財務指標



### (二) 境內外會計準則下會計資料差異

本集團按照中國企業會計準則編製的合併財務報表及按照國際財務報告準則編製的合併財務報表中列示的2022年1月至6月及2021年1月至6月的淨利潤、截至2022年6月30日及2021年12月31日的淨資產無差異。

### (三) 母公司的淨資本及風險控制指標

於2022年6月30日，本公司按照中國企業會計準則計算的淨資本為人民幣909.48億元，較上年末(人民幣852.22億元)增加人民幣57.26億元。報告期內，本公司淨資本等各項風險控制指標均符合監管要求。

| 項目                   | 於2022年6月30日               | 於2021年12月31日       |
|----------------------|---------------------------|--------------------|
| 淨資本(人民幣元)            | <b>90,947,668,475.75</b>  | 85,222,467,669.07  |
| 淨資產(人民幣元)            | <b>144,484,498,519.25</b> | 144,509,229,830.85 |
| 風險覆蓋率(%)             | <b>203.98</b>             | 200.25             |
| 資本槓桿率(%)             | <b>21.35</b>              | 22.28              |
| 流動性覆蓋率(%)            | <b>244.45</b>             | 259.39             |
| 淨穩定資金率(%)            | <b>162.18</b>             | 157.72             |
| 淨資本／淨資產(%)           | <b>62.95</b>              | 58.97              |
| 淨資本／負債(%)            | <b>37.16</b>              | 34.48              |
| 淨資產／負債(%)            | <b>59.04</b>              | 58.47              |
| 自營權益類證券及其衍生品／淨資本(%)  | <b>17.15</b>              | 24.03              |
| 自營非收益類證券及其衍生品／淨資本(%) | <b>178.64</b>             | 201.85             |

## 第三節 董事會報告

### 一、報告期內本公司所屬行業及主營業務情況說明

報告期內，本集團所屬行業情況請參見本節「三、管理層討論與分析」。

本集團主要業務有財富管理、投資銀行、資產管理、交易及機構、融資租賃等，所從事的業務情況請參見本節「三、管理層討論與分析」。

報告期內，本集團實現營業收入人民幣198.65億元、歸屬於母公司股東的淨利潤人民幣47.58億元、總資產人民幣7,495.66億元、歸屬於母公司股東的淨資產人民幣1,630.81億元，主要財務指標多年來一直保持行業前列。

### 二、報告期內核心競爭力分析

在長期經營過程中，本公司逐步形成了具有自身特色的六大核心競爭力。

#### 1. 雄厚的資本實力

本公司通過A+H股上市、增發等多次戰略性股權融資和債券融資，迅速增強並持續保持了雄厚的資本實力。2022年上半年，本公司抓住市場機遇，完成多次債務融資，通過發行公司債、次級債、收益憑證等方式完成境內融資超過人民幣300億元，增強了本公司流動性管理能力與風險防控能力。另外，本公司還積極拓展境外融資渠道，確保了境外業務的健康有序發展。充足的資本為本公司業務轉型升級、滿足境內外客戶的多元化金融服務需求、持續提升實體經濟服務能力夯實了基礎。

## 第三節 董事會報告

### 2. 卓越的綜合金融服務平台

以母公司業務出發，通過設立、收購專業子公司，本集團不斷擴充金融產品服務範圍，延伸金融服務邊界，已基本建成涵蓋證券期貨經紀、投行、自營、資產管理、私募股權投資、另類投資、融資租賃、境外銀行等多個業務領域的金融服務集團。本集團經紀業務客戶基礎雄厚；投資銀行業務排名行業前列；資產管理業務主動管理規模持續提升；私募股權投資業務規模及品牌影響力行業領先；在港業務多項數據排名行業首位；融資租賃業務已確立並持續保持行業領先地位；研究服務市場影響力強。本集團綜合化的金融平台具有強大的規模效應和交叉銷售潛力，為業務發展提供了有力支撐，為客戶綜合金融服務創造條件。

### 3. 廣泛的營業網點以及紮實的客戶基礎

本集團營業網點覆蓋「紐、倫、港、滬、新、東」六大國際金融中心。截至報告期末，本集團在中國境內擁有338家證券及期貨營業部（其中證券營業部301家，期貨營業部37家），遍佈30個省、直轄市和自治區；境外方面，在亞洲、歐洲、北美洲、南美洲、大洋洲等全球五大洲15個國家和地區設有分行、代表處或子公司。憑借遍佈全國的營業網點和極具戰略性的國際化佈局，本集團得以建立龐大且穩定的客戶群，截至報告期末，本集團在境內外擁有超2,000萬名客戶。

## 第三節 董事會報告

### 4. 業內領先的國際跨境服務平台

通過收購整合海通國際、海通銀行，設立上海自貿區分公司，本集團建立了業內領先的國際業務平台，獲得了亞太地區先發優勢以及歐美地區前瞻性的戰略儲備。

海通國際持續保持在香港投行中的領先位置。股權融資方面，海通國際IPO及股權融資業務按完成項目數量位居香港所有投行前列，並不斷加強海外市場的項目執行能力及品牌影響力；環球債券融資方面，海通國際按債券發行項目數量位列全球金融機構前列。同時，海通國際努力踐行環境、社會與企業管治（「ESG」）理念，在綠色及可持續發展債券發行領域成為中資金融機構的領頭羊；此外，海通國際已形成一個面向全球機構客戶的全方位交易、研究與銷售平台。資產管理業務方面，海通國際主動優化資產管理規模和產品結構，着力打造特色投研平台，資產管理規模保持穩定；財富管理業務方面，海通國際持續打造面向企業家客戶的私人財富管理模式，升級產品及服務並佈局環球家族辦公室業務。

海通銀行是深化集團國際化戰略的重要儲備，也是本集團踐行國家「一帶一路」戰略的重要承載平台。海通銀行擁有在歐盟及南美市場上的專業知識以及長達20多年的經驗，具有全銀行牌照，圍繞企業銀行、投資銀行以及資產管理三大重點業務領域，在深耕本土業務的基礎上，致力於開拓中國與歐洲、中國與拉丁美洲間的跨境業務合作。2022年，海通銀行巴黎代表處完成註冊，標誌着本集團國際化戰略又向縱深推進了重要的一步。

自貿區跨境業務方面，上海自貿區分公司是首批加入自貿區FTU（自貿區分賬核算單元）體系的證券機構，成功實施了國內券商首單FT（自由貿易賬戶）項下跨境融資項目。2022年上半年，自貿區分公司在抓好疫情防控的同時，持續推動FTU業務的拓展和集團範圍跨境業務的聯動。

業內領先、全方位多地區的國際業務平台有利於集團把握日益增長的跨境業務機會，滿足客戶的跨境業務需求，提升本集團的國際影響力。

## 第三節 董事會報告

### 5. 穩健的經營理念、有效的合規與風險管理和內部控制體系

本公司始終堅持「務實、開拓、穩健、卓越」的經營理念與「穩健乃至保守」的風險控制理念，在三十多年的經營中，成功渡過了多個市場和業務周期、監管改革和行業轉型發展。本公司基本建立了覆蓋全集團的風險管理體系，落實全面風險管理要求，較為有效地管理市場風險、信用風險、流動性風險和操作風險等各類風險。本公司依照監管規定，建立健全合規管理制度和組織體系，不斷夯實合規審查、合規監測及合規檢查等職能履行，保障與促進本公司持續合規穩健發展。同時，本公司始終堅持以風險為本的工作原則，嚴格按照反洗錢法律法規，採取相關措施，控制洗錢及恐怖融資風險。

### 6. 科技引領，數字化轉型進入加速期

本公司秉承「科技引領」發展戰略，科技投入持續保持行業前列，已成為行業數字化轉型的探索者、先行者之一，也是行業首家同時擁有運維服務體系、信息安全體系、軟件研發體系、軟件測試體系四大領域國際權威認證的證券公司。圍繞本公司「十四五」科技發展規劃，「數字海通2.0」建設提檔加速。一是有力支持財富管理數字化轉型，自研的一站式互聯網金融平台「e海通財」APP和PC端，總安裝用戶超4,200萬，月均平台活躍數近550萬，繼續保持行業第一梯隊。二是持續完善機構客戶服務體系，一站式場外衍生品業務平台「e海通衍」集管理、估值、交易、清算、報送等功能於一體，聯通本公司內部各衍生品業務鏈，為客戶提供多樣化、專業化的衍生品業務服務；一體化智能交易平台「e海方舟」整合極速交易和極速行情，為專業投資者量身打造，2022年上半年股基交易量人民幣1.07萬億元，同比增長17%。三是全面賦能中後台管理，在行業內首家探索分支機構印章物聯管理，完善業務办理流程，有效防範操作風險；全面風險管理平台的智能風險預警、風險數據集市和風控指標管理持續優化，有效提升風險管控覆蓋範圍與縱深。四是不斷深化數據中台建設，

## 第三節 董事會報告

數據資產管理與服務系統「e海智數」正式上線，構建了近1,200項經紀業務數據分類分級清單，具有行業特色的數據分類分級管理體系逐漸建立。五是科技創新能力持續增強，引領行業多項科技創新工作，累計獲得11項國家專利和55項軟件著作權，先後榮獲上海市國資委企業十佳優秀課題成果，證券期貨業金融科技研究發展中心(深圳)優秀課題一、二、三等獎，證券期貨業金融科技研究發展中心(上海)優秀課題一、二、三等獎等多個金融科技獎項。

### 三、管理層討論與分析

#### (一) 總體經營情況

2022年上半年，本公司緊抓服務國家戰略和實體經濟主線，通過「投、融、保、研」和財富管理業務緊密聯動，以客戶為中心的業務體系建設不斷完善，業務發展保持良好態勢，各項財務指標保持穩健，為實現全年經營目標打下良好基礎。

本公司大力推動財富管理轉型，完善組織架構體系，金融產品銷售體系逐級完善，加快推動分支機構發展；本公司投資銀行業務始終把握產業鏈的關鍵環節和價值鏈的核心地位，IPO發行數量、承銷金額、申報數量等關鍵指標繼續排名市場前列；本集團資產管理主動管理能力持續提升，管理規模進一步增加；本公司國際化戰略優勢持續鞏固，海通國際保持香港市場領先地位，海通銀行跨境業務與本地業務齊頭並進，積極踐行國家「一帶一路」倡議，提供跨境金融服務支持。

## 第三節 董事會報告

### （二）主營業務分析

#### 1. 財富管理業務

##### 市場環境：

2022年上半年，面對市場持續震蕩，境內股票市場成交依舊保持活躍。根據WIND數據，2022年上半年滬深兩市股票、基金日均成交額人民幣1.06萬億元，同比增長8.5%。資本市場機構化、產品化趨勢不斷深化，企業、機構及高淨值客戶對金融服務需求的廣度、深度進一步擴大，對券商專業化和資源整合能力提出更高的要求。在市場整體調整的背景下，產品銷售市場承受壓力，據基金業協會統計，截至2022年6月末，全市場權益類公募基金規模達人民幣7.89萬億元，較上年末下降8.6%；根據WIND數據，2022年上半年新發基金規模約6,850億份，同比減少約58%。

2022年上半年，受市場行情影響，融資融券業務的市場規模有所下降。截至2022年6月末，市場融資融券餘額為人民幣1.60萬億元，較上年末下降12.5%；其中融資餘額人民幣1.51萬億元，較上年末下降11.8%，融券餘額人民幣935.62億元，較上年末下降22.1%。報告期內，股票質押業務的經營環境更趨規範化，市場規模穩中有降。

## 第三節 董事會報告

### 經營舉措及業績：

本公司堅持以客戶為中心，通過組織架構調整，強化財富管理的「交易服務、投資顧問及基於資產配置的產品銷售」等三大核心能力，進一步優化客戶分級分類服務體系搭建。報告期內，本公司客戶實現高質量增長，財富管理基礎進一步夯實；金融產品銷量及保有規模穩步增長。本公司繼續以金融科技為手段提升服務質量、拓寬服務邊界，通過線上線下協同，打造更加開放的財富管理平台。截至2022年6月末，公司財富管理客戶數量(剔除已銷戶賬戶)1,483.75萬戶，較上年末增長4.0%；期末客戶總資產人民幣2.66萬億元。

### 2022年上半年本公司交易額變化

|                           | 本報告期   | 上年同期   |
|---------------------------|--------|--------|
| 股票交易量(人民幣億元)              | 70,940 | 76,297 |
| 基金交易量(人民幣億元) <sup>1</sup> | 10,227 | 14,166 |
| 合計(人民幣億元)                 | 81,167 | 90,462 |

<sup>1</sup> 不含場內貨幣基金交易量，與市場交易口徑不同

## 第三節 董事會報告

### (1) 零售經紀業務

2022年上半年，本公司深耕客戶需求，構建以客戶為中心，以財富管理轉型為方向，以資訊、產品、投研、投顧及工具為抓手的多層次客戶服務體系，提升服務能級；打造「e海通聚」交易服務品牌，為客戶多樣化的交易需求提供一站式解決方案，重點強化為量化私募客戶提供定制化交易系統服務和為企業客戶提供綜合交易服務；正式推出「盈投顧」特色服務品牌，聚焦配置策略、主題投資、基金定投、中低風險交易等方向推出六大類服務，全面覆蓋股票、債券、基金、ETF等投資研究與服務，實現在內容體系、品牌度、專業度、體驗度、推廣渠道等多維度的全面升級；推動上海和蘇州地區網點創新試點，建設具有特色業務屬性的創新網點；成立投資者權益保護工作領導小組，強化投資者保護的主體責任和擔當，堅持「以客戶為中心」，多維度落實投資者教育工作，構築全方位投資者權益保護體系。

海通國際財富管理團隊堅定私人財富管理業務轉型方向，加強與投行、資產管理及研究等業務團隊的協同，為本集團高淨值及超高淨值客戶群體提供更加多樣化的財富管理及投資選擇。2022年上半年，員工持股計劃(ESOP)業務正式落地，配合家族辦公室及信託業務，積極引入企業家客戶。

## 第三節 董事會報告

### (2) 互聯網金融

本公司以「e海通財」和「e海方舟」兩大品牌為基礎，針對零售、財富、機構及量化交易客戶不斷完善分級交易終端建設。其中，「e海通財APP」月均活躍人數530萬，排名始終保持行業前五；「e海方舟」月均交易資產同比增長超40%，月均活躍客戶數同比增長30%，上半年股票、基金交易量同比增長17%。圍繞「通享會員」打造分級線上客戶服務體系，持續優化智能定投等特色工具，以通財號、直播等內容服務為抓手，聯合內外部機構為客戶提供陪伴式服務。

### (3) 金融產品銷售

本公司以完成有效產品保有量為核心目標，通過強化銷售組織、完善銷售政策、釐清銷售職能、優化系統平台，穩步推進重點產品銷售。2022年上半年，本公司金融產品日均保有量在市場整體下滑的背景下，實現同比增長9.7%。其中，非貨幣基金產品日均保有量同比增長27.2%；公募產品日均保有量同比增長12.1%。持續拓展定投業務，新增定投有效戶近1.5萬戶，新增客戶資產近人民幣4億元。同時，本公司以券結模式公募及頭部量化私募為主要銷售抓手，持續提升客戶對公司金融產品認可度和品牌影響力。

## 第三節 董事會報告

### (4) 融資類業務

2022年上半年，本公司融資融券業務繼續以增量拓展、結構優化為導向，提升徵授信、擔保品、集中度等業務管控質量，強化券源籌集能力，積極探索創新策略，加強高淨值客戶服務能力，業務整體市佔率穩中有升。股票質押式回購交易業務以服務實體為己任，在保持規模穩定的同時持續改善結構，提升全方位風險管控能力。截至報告期末，本公司融資類業務規模人民幣945.67億元，較上年度末減少人民幣108.07億元，其中融資融券業務規模人民幣657.08億元，較上年度末減少人民幣82.18億元；股票質押業務規模人民幣287.09億元，較上年度末減少人民幣25.15億元。

#### 2022年六月末本公司融資類業務規模變化

|                            | 本報告期末         | 上年度末     |
|----------------------------|---------------|----------|
| 融資融券餘額(人民幣億元)              | <b>657.08</b> | 739.26   |
| 股票質押餘額(人民幣億元) <sup>2</sup> | <b>287.09</b> | 312.24   |
| 約定購回餘額(人民幣億元)              | <b>1.50</b>   | 2.24     |
| 合計(人民幣億元)                  | <b>945.67</b> | 1,053.74 |

<sup>2</sup> 上表不含表外資管股票質押式回購業務，本報告期末表外資管股票質押式回購業務規模人民幣45.17億元

## 第三節 董事會報告

### 2. 投資銀行業務

#### 市場環境：

2022年上半年，隨著註冊制改革的不斷推進，資本市場融資效率持續提高，進一步發揮服務實體經濟的作用。2022年上半年全市場384單股權項目共融資人民幣7,378億元；IPO保持常態化但節奏有所放緩，2022年上半年掛牌171家，融資金額人民幣3,119億，其中，科創板掛牌54家，融資金額人民幣1,155億元，規模佔比達37%。再融資方面，2022年上半年增發134家，融資金額人民幣1,929億元。2022年上半年北交所公開發行保持常態化，新增上市企業19家，完成股權融資人民幣28.62億元。

2022年上半年，境內債券發行整體規模較往年增速趨緩，各類債券發行合計人民幣31.37萬億元，同比增長6%。利率債發行達到人民幣11.50萬億元，同比增長24%，其中國債同比增長21%，地方政府債同比增長57%，政策性銀行債同比下降8%。信用債發行人民幣9.04萬億元，同比下降3%。

#### 經營舉措及業績：

##### (1) 股權融資

在境內股權融資方面，本公司繼續鞏固行業優勢，市場排名保持行業前列。2022年上半年完成IPO項目14單，市場排名第三；實現融資金額人民幣247億元，市場排名第四。完成科創板IPO項目9單，市場排名第二；實現融資金額人民幣213億元，市場排名第二。本公司克服疫情不利影響，加大項目推進力度，2022年上半年申報IPO項目39單，創歷史新高；截至報告期末，在審及待發IPO項目68單，排名市場前列。本公司持續推進北交所業務，積極拓展「專精

## 第三節 董事會報告

特新」企業，在審項目3單，儲備項目5單。資本市場團隊進一步強化詢價定價能力，在多個大型項目中展現銷售實力。本公司深度踐行「投、融、保、研」一體化的展業方向，2022年上半年通過發行人IPO員工計劃戰略配售為本公司帶來超百位高淨值客戶，計劃淨值逾人民幣6.6億元；IPO共協調原始股東客戶託管原始股份約26億股，約合發行市值人民幣904億元。

### 境內股權融資項目發行及項目儲備情況

|           |             | 本報告期  | 上年同期  |
|-----------|-------------|-------|-------|
| 首次公開發行    | 承銷金額(人民幣億元) | 246.6 | 165.3 |
|           | 承銷家數        | 14    | 22    |
| 再融資發行     | 承銷金額(人民幣億元) | 71.9  | 237.4 |
|           | 承銷家數        | 5     | 13    |
| 在審及待發項目數量 | 首次公開發行      | 68    | 53    |
|           | 再融資發行       | 13    | 22    |

數據來源：WIND、中國證監會、上海證券交易所、深圳證券交易所

在境外股權融資業務方面，海通國際繼續保持市場領先地位。投行團隊秉承3.0轉型規劃，在進一步深耕傳統產品優勢領域、加強聯動、打造新產品的基礎上，加強項目的早期介入能力和執行能力，積極提升有影響力的項目佔比。截至報告期末，海通國際在香港資本市場共完成11單股權融資項目，位列香港中資投行第三。2022年5月，海通國際憑借豐富的資本市場經驗、深厚的市場根基及卓越的投行業務能力，在激烈的競爭中脫穎而出，獲國際權威金融媒體《亞洲金融》(FinanceAsia)頒發香港地區「最佳股權融資機構」大獎。

## 第三節 董事會報告

### (2) 債券融資

2022年上半年，本公司完成573隻債券發行，承銷金額人民幣1,918億元，其中企業債券承銷金額人民幣159億元，市場排名第二。在國家發改委公佈的2021年度企業債券主承銷商和信用評級機構信用評價結果中連續第七次獲得A類稱號。本公司以創新驅動業務發展，成功發行深交所首單藍色債券、市場首單融資租賃行業科技創新公司債券、市場首單「保障性租賃住房」主體標識公司債券。

#### 境內主承銷債券項目承銷規模變化

|     |             | 本報告期     | 上年同期     |
|-----|-------------|----------|----------|
| 企業債 | 承銷金額(人民幣億元) | 159.40   | 260.05   |
|     | 承銷隻數        | 28       | 32       |
| 公司債 | 承銷金額(人民幣億元) | 619.89   | 767.04   |
|     | 承銷隻數        | 161      | 173      |
| 其他  | 承銷金額(人民幣億元) | 1,138.40 | 1,398.10 |
|     | 承銷隻數        | 384      | 382      |

註：其他包括非政策性金融債、短期融資券、中期票據、定向工具、資產支持證券、可轉債、可交換債及地方政府債。

數據來源：WIND

## 第三節 董事會報告

在境外債券融資業務方面，海通國際繼續保持在香港債券資本市場上的領先地位，截至2022年6月末，在中國風險G3+CNY債券發行市場中，發行數量位列全球投行第四；努力踐行ESG和可持續金融理念，共完成了14筆綠色債券及可持續債券承銷，融資規模達60億美元。海通國際在ESG範疇上表現傑出，更獲納入富時社會責任指數，位列全球金融行業管治類評分前五名。

### 3. 資產管理業務

#### 市場環境：

後資管新規時代，各家資產管理機構已逐步完成了去通道、淨值化管理等要求，促使券商資管步入向公募基金業務轉型的新階段。為了加快推進公募基金行業高質量發展，中國證監會於2022年5月20日發佈了《公開募集證券投資基金管理人監督管理辦法》，調整優化公募基金牌照制度，適度放寬同一主體下公募牌照數量限制，支持證券資管子公司、保險資管公司、銀行理財子公司等專業資產管理機構依法申請公募基金牌照，從事公募基金管理業務。

面對資本市場波動，2022年上半年資管行業整體業績表現欠佳。據基金業協會統計，截至2022年6月末，公募基金業務規模人民幣26.79萬億元，較期初增長4.79%；證券公司及其子公司私募資產管理業務規模人民幣7.68萬億元，較期初下降6.74%。

## 第三節 董事會報告

### 經營舉措及業績：

本公司貫徹落實證監會《關於加快推進公募基金行業高質量發展的意見》要求，積極謀劃資管業務轉型並佈局公募市場，持續提升主動管理能力，推進資產管理業務高質量發展。截至報告期末，全集團資產管理總規模達人民幣2.1萬億元，較期初增長10.5%。

#### (1) 海通資管公司

2022年上半年，海通資管公司一方面積極謀劃資管業務轉型並佈局公募市場，另一方面持續提升主動管理能力，構建產品組合和投資策略，建立不同風險偏好的私募產品體系，滿足客戶個性化的綜合金融服務需求，在發展過程中尋求特色化、差異化發展的路徑和規劃。2022年上半年，海通資管公司在公募固收、公募權益、私募固收、私募FOF領域持續營銷，淨申購明顯。截至報告期末，海通資管公司管理規模人民幣962.87億元，其中主動管理規模人民幣950.71億元，佔比提升至98.74%。海通資管公司積極推進大集合參公改造工作，截至報告期末，全部17隻產品中，有15隻已取得證監會批文，2隻審批中。2022年上半年，海通資管公司管理的集合產品投資業績市場相對排名為市場同類產品的前23.23%，整體表現優異。

## 第三節 董事會報告

### 海通資管公司業務規模及淨收入變化

|        | 本報告期                  |                | 上年同期                  |                |
|--------|-----------------------|----------------|-----------------------|----------------|
|        | 資產<br>管理規模<br>(人民幣億元) | 淨收入<br>(人民幣萬元) | 資產<br>管理規模<br>(人民幣億元) | 淨收入<br>(人民幣萬元) |
| 集合資產管理 | 353                   | 15,162         | 616                   | 75,852         |
| 定向資產管理 | 261                   | 2,573          | 920                   | 9,796          |
| 專項資產管理 | 349                   | 544            | 346                   | 752            |
| 合計     | 963                   | 18,279         | 1,882                 | 86,400         |

#### (2) 基金管理公司

截至報告期末，海富通基金資產管理規模人民幣3,993億元，較報告期初減少4.0%；其中公募基金管理規模人民幣1,473億元。養老金業務規模人民幣2,167億元，較報告期初增長7.4%；職業年金規模人民幣719億元，較報告期初增長19.7%。海富通中證短融ETF規模從年初人民幣65億元增長至人民幣148億元，成為國內債券ETF市場規模最大產品。

2022年上半年，富國基金秉持高質量發展理念，保持了良好的業務發展態勢。截至報告期末，富國基金管理資產總規模超人民幣1.4萬億元，再創歷史新高，其中公募基金管理規模人民幣9,329億元；養老金業務及專戶業務均保持穩健增長，管理規模雙雙創下新高；持續推進產品創新，創新儲備充分。

## 第三節 董事會報告

### (3) 私募投資基金

私募股權投資基金積極推進基金募集設立工作，順利完成長三角G60科創走廊基金及海富半導體專項基金備案，已正式投入運營；有序推進中小企業發展基金、吉林海創長新基金及海通臨沂股權投資基金出資繳款工作。截至報告期末，公司私募股權投資基金管理規模人民幣268億元，新增實繳基金人民幣27.4億元，完成投資項目20個，投資金額人民幣7.8億元；新增上市(含過會)項目16個，在會項目27個，累計實現退出收益人民幣18.8億元。

#### 私募投資基金業務規模變化

|                 | 於本報告期末 | 於上年度末 |
|-----------------|--------|-------|
| 管理基金數量          | 52     | 49    |
| 管理規模餘額(人民幣億元)   | 268    | 271   |
| 累計投資項目數量        | 16     | 42    |
| 累計投資項目金額(人民幣億元) | 6.4    | 28    |
| 項目退出(含部分退出)數量   | 39     | 67    |

### (4) 境外資產管理

海通國際資產管理團隊協同聯動海通國際投行、私人財富管理等業務團隊，建設具有買方投研實力、踐行ESG投資理念的特色投資平台，組建富有市場經驗及前瞻視野的投研團隊，持續優化資產管理業務結構，提升資產質量，強化核心競爭力，堅持不懈地做好投資管理。報告期內，海通國際獲得《投資洞見與委託》《路孚特理柏基金香港年獎》《彭博2021年度離岸中資基金大獎》等多項業界大獎。

## 第三節 董事會報告

### 4. 交易與機構服務業務

#### 市場環境：

2022年上半年，A股市場先抑後揚，走出觸底反彈的「V」字行情，滬深300指數下跌9.22%，創業板指數下跌15.41%。固定收益市場方面，利率維持低位震蕩，信用利差持續收窄，中債總淨價指數下跌0.08%；其中，中債國債總淨價指數上漲0.02%，中債企業債總淨價指數上漲0.16%。

#### 經營舉措及業績：

##### (1) 交易業務

2022年上半年，本公司境內權益投資交易不斷拓展服務品類，夯實服務能力。股指期權做市業務榮獲2021年度中金所股指期權優秀做市商銀獎，考核得分位列上海地區第一；跨境收益互換業務取得實質突破，打通與海通國際的交易通道，收益互換業務累計新增名義本金數百億元；積極開發雙碳ESG創新產品，成功發行掛鈎碳中和ETF的結構化收益憑證；完成中證海通證券大類資產動態配置指數的開發與發佈，為市場提供了具備較低波動率特徵的業績基準和投資標的；堅持科技賦能，集管理、估值、交易、清算、報送為一體的場外衍生品業務一站式平台和對客終端「e海通行」系統初步建成。本公司權益類場外衍生品業務將重回部分交易對手方的白名單池，交易品種更豐富，結構更優化。

本公司固定收益業務充分發揮專業優勢，精準把握固定收益市場走勢，強化交易能力建設，不斷提高信用研究能力和風險定價能力，獲取了較好的投資收益。FICC創新業務穩步推進，大宗商品量化投資業務全面覆蓋國內四大期貨交易所流動性較好品種；場外衍生品業務實現突破，成功落地掛鈎黃金場外期權、債券指數收益互換及收益憑證、跨境債券收益互換。

## 第三節 董事會報告

海通國際環球市場交易實力持續提升，已形成面向全球機構客戶的全方位交易、研究與銷售平台，提供綜合產品解決方案，助力海外機構投資者把握中國的投資機遇；現金股票業務保持穩定發展，客戶結構漸趨多元化，前十大客戶覆蓋國際長線投資者、對沖基金、中資基金，體現了海通國際各類產品在機構客戶中的影響力和銷售能力。

### (2) 機構業務

本公司致力於打造一支強大的專業化機構銷售服務團隊，通過組織架構調整，加快提升面向機構客戶的綜合服務能力。堅持打造業內一流的研究品牌，以研究驅動機構業務發展、投行業務拓展以及零售客戶服務，創新工作方法，以客戶為導向，提升線上服務的質量和效率，通過建立白名單應急響應通道解決客戶應急需求，品牌優勢得到進一步鞏固和發揮。2022年上半年共外發報告2,922篇，舉辦線上電話會議391場，為機構客戶組織路演、反路演等線下拜訪活動共9,500餘場。海通國際股票研究團隊打通境內外研究平台，覆蓋大中華、日本、美國、印度、韓國等多個地區逾1,500隻股票，為客戶提供專業、深入、及時且具備國際視野的研究諮詢服務，不斷夯實研究能力和質量。

本公司繼續保持QFII/RQFII機構客戶服務的市場領先地位，簽約客戶總數達147家，交易量人民幣846億元。公司繼續圍繞着與頭部基金公司的合作，優化託管外包運營流程，深入研究和挖掘產品線，在資管品牌系列產品打造、公募券結基金合作、ETF基金研究、私募基金篩選等方面取得較好成績。2022年上半年，本公司新增託管外包產品1,268個，託管外包總規模人民幣5,860億元，PB系統成交量人民幣5,357億元。

## 第三節 董事會報告

### 5. 融資租賃業務

#### 市場環境：

近年來，隨着監管層面對融資租賃行業監管力度的加強，融資租賃行業迎來統一監管、統一登記、加速出清、轉型優化的關鍵時期。報告期內，融資租賃企業數量與租賃合同餘額均有所下降，中國融資租賃行業儘管短期內面臨一定的挑戰，但從中長期來看仍處於富有活力的良性發展階段：一方面，融資租賃憑借自身「融資+融物」、緊密貼近實體經濟的特點，有效發揮產融結合優勢助力經濟高質量發展；另一方面，隨着銀保監會及各地方金融監管部門陸續發佈融資租賃行業監管規定及落地具體監管措施，行業環境得到大幅淨化，減量提質效應明顯，空殼、失聯的融資租賃企業被大量清退，專注主業、治理完善且實力雄厚的大型融資租賃公司優勢凸顯，行業集中度愈加清晰。

#### 經營舉措及業績：

2022年上半年，海通恒信積極應對疫情衝擊，強化企業責任擔當，精準統籌疫情防控和經營發展「兩手抓、兩促進」，緊跟國家戰略及政策導向，切實立足租賃本源，充分運用金融科技手段，全力保障本公司業務運轉不間斷，為打贏疫情防控攻堅戰和助力實體經濟穩步發展貢獻金融力量，持續推動本公司高質量發展，實現規模與收益的雙增長。2022年上半年，海通恒信生息資產平均收益率為6.88%；截至報告期末，海通恒信資產總額達到人民幣1,161.92億元，較上年末增長1.3%；不良資產率1.07%，不良資產撥備覆蓋率257.49%。

報告期內本公司經營情況的重大變化，以及報告期內發生的對本公司經營情況有重大影響和預計未來會有重大影響的事項

✓不適用

## 第三節 董事會報告

### 四、報告期內主要經營情況

於2022年6月30日，本集團總資產人民幣7,495.66億元，歸屬於母公司淨資產人民幣1,630.81億元。截至2022年6月30日止六個月，本集團實現收入人民幣198.65億元，歸屬於母公司淨利潤人民幣47.58億元；加權平均淨資產收益率2.88%。其中，子公司實現收入人民幣82.90億元，佔比41%；境外業務實現收入人民幣47.43億元，佔比24%。

#### (一) 綜合損益情況分析

##### 1 收入構成

單位：千元 幣種：人民幣

| 項目               | 截至2022年             | 截至2021年             |             | 增減情況    |    |
|------------------|---------------------|---------------------|-------------|---------|----|
|                  | 6月30日<br>止六個月<br>金額 | 6月30日<br>止六個月<br>金額 | 金額          | 金額      | 比例 |
| 佣金及手續費收入         | <b>7,699,311</b>    | 9,131,298           | -1,431,987  | -15.68% |    |
| 利息收入             | <b>8,258,455</b>    | 7,499,427           | 759,028     | 10.12%  |    |
| 融資租賃利息收入         | <b>1,280,942</b>    | 1,771,581           | -490,639    | -27.69% |    |
| 投資收入及收益<br>(淨額)  | <b>692,435</b>      | 6,789,175           | -6,096,740  | -89.80% |    |
| 其他收入及收益          | <b>1,933,688</b>    | 5,582,239           | -3,648,551  | -65.36% |    |
| 收入、其他收入及<br>收益合計 | <b>19,864,831</b>   | 30,773,720          | -10,908,889 | -35.45% |    |

2022年上半年，本集團實現收入、其他收入及其他收益人民幣198.65億元，同比減少人民幣109.09億元，減幅35.45%，主要是投資收入及收益、子公司銷售收入減少。

## 第三節 董事會報告

### a. 佣金及手續費收入

單位：千元 幣種：人民幣

| 項目                           | 截至2022年       | 截至2021年       | 增減金額       | 增減比例    |
|------------------------------|---------------|---------------|------------|---------|
|                              | 6月30日<br>止六個月 | 6月30日<br>止六個月 |            |         |
| 證券、期貨及期權交易<br>及經紀業務手續費<br>收入 | 3,984,888     | 4,528,298     | -543,410   | -12.00% |
| 承銷費及保薦費收入                    | 2,347,204     | 2,392,905     | -45,701    | -1.91%  |
| 資產管理費收入<br>(含基金管理費收入)        | 1,108,055     | 1,845,893     | -737,838   | -39.97% |
| 財務諮詢顧問費收入                    | 203,137       | 291,438       | -88,301    | -30.30% |
| 其他                           | 56,027        | 72,764        | -16,737    | -23.00% |
| 佣金及手續費收入<br>合計               | 7,699,311     | 9,131,298     | -1,431,987 | -15.68% |

佣金及手續費收入為人民幣76.99億元，較去年同期減少人民幣14.32億元，減幅15.68%，主要是資產管理費收入、證券、期貨及期權交易及經紀業務手續費收入減少。

### b. 利息收入

利息收入人民幣82.58億元，較去年同期增加人民幣7.59億元，增幅10.12%，主要是售後回租安排的應收款利息收入增加。

## 第三節 董事會報告

### c. 投資收入及收益(淨額)

投資收入及收益(淨額)人民幣6.92億元，較去年同期減少人民幣60.97億元，減幅89.80%，主要是金融工具投資收益減少。

### 集團主營業務情況表

#### 主營業務分行業情況

單位：千元 幣種：人民幣

| 分部      | 分部收入      | 分部支出      | 分部利潤率  | 分部收入比上年同期增減 | 分部支出比上年同期增減 | 分部利潤率比上年同期增減 |
|---------|-----------|-----------|--------|-------------|-------------|--------------|
| 財富管理業務  | 7,769,418 | 4,310,696 | 44.52% | -8.07%      | -16.89%     | 增加5.89個百分點   |
| 投資銀行業務  | 2,620,583 | 1,623,972 | 38.03% | -17.08%     | 6.25%       | 減少13.61個百分點  |
| 資產管理業務  | 1,420,611 | 745,375   | 47.53% | -36.01%     | -28.51%     | 減少5.50個百分點   |
| 交易及機構服務 | 3,351,145 | 3,672,666 | -9.59% | -61.49%     | -18.40%     | 減少57.87個百分點  |
| 融資租賃業務  | 4,192,674 | 3,376,929 | 19.46% | -1.43%      | -2.42%      | 增加0.82個百分點   |
| 其他      | 510,400   | 552,720   | -8.29% | -87.20%     | -86.24%     | 減少7.50個百分點   |

## 第三節 董事會報告

### 主營業務分地區情況

單位：千元 幣種：人民幣

| 分地區  | 分部收入       | 分部支出       | 分部利潤率   | 分部收入比上年同期增減 | 分部支出比上年同期增減 | 分部利潤率比上年同期增減 |
|------|------------|------------|---------|-------------|-------------|--------------|
| 境內業務 | 15,121,969 | 8,851,409  | 41.47%  | -33.32%     | -34.99%     | 增加1.50個百分點   |
| 境外業務 | 4,742,862  | 5,430,949  | -14.51% | -41.42%     | -11.30%     | 減少38.88個百分點  |
| 小計   | 19,864,831 | 14,282,358 | 28.10%  | -35.45%     | -27.64%     | 減少7.76個百分點   |

2022年上半年，本集團財富管理業務營業收入人民幣77.69億元，同比(人民幣84.51億元)減少人民幣6.82億元，減幅8.07%，本集團持續推動財富管理轉型，以客戶為中心，加快推動分支機構發展，穩步推進金融產品銷售；投資銀行業務營業收入人民幣26.21億元，同比(人民幣31.60億元)減少人民幣5.39億元，減幅17.08%，主要是承銷收入減少；資產管理業務營業收入人民幣14.21億元，同比(人民幣22.20億元)減少人民幣7.99億元，減幅36.01%，主要是管理費收入減少；交易及機構業務營業收入人民幣33.51億元，同比(人民幣87.02億元)減少人民幣53.51億元，減幅61.49%，主要是資本市場震盪調整導致投資收益減少；融資租賃業務營業收入人民幣41.93億元，同比(人民幣42.54億元)減少0.61億元，減幅1.43%，本集團緊跟國家戰略及政策導向，持續完善區域佈局，加大綠色租賃支持力度，資產結構不斷優化；其他業務營業收入人民幣5.10億元，同比(人民幣39.86億元)減少人民幣34.76億元，減幅87.20%。集團堅持穩中求進，做深價值服務鏈，積極服務實體經濟，深化「投、融、保、研」和財富管理聯動，著力推動各項改革，有序推進業務發展，同時做好成本管控，促進降本增效。

## 第三節 董事會報告

### 2 支出構成

單位：千元 幣種：人民幣

| 支出總額     | 截至2022年           | 截至2021年       | 增減情況       |         |
|----------|-------------------|---------------|------------|---------|
|          | 6月30日<br>止六個月     | 6月30日<br>止六個月 | 金額         | 比例      |
| 折舊和攤銷費用  | <b>754,583</b>    | 792,437       | -37,854    | -4.78%  |
| 僱員成本     | <b>3,488,369</b>  | 4,299,089     | -810,720   | -18.86% |
| 佣金及手續費支出 | <b>1,558,630</b>  | 1,966,121     | -407,491   | -20.73% |
| 利息支出     | <b>6,451,309</b>  | 5,909,050     | 542,259    | 9.18%   |
| 預期信用減值損失 | <b>178,663</b>    | 1,024,765     | -846,102   | -82.57% |
| 其他資產減值損失 | <b>25,911</b>     | 44,083        | -18,172    | -41.22% |
| 其他支出     | <b>1,824,893</b>  | 5,701,970     | -3,877,077 | -68.00% |
| 合計       | <b>14,282,358</b> | 19,737,515    | -5,455,157 | -27.64% |

2022年上半年，本集團支出總額人民幣142.82億元，較去年同期減少人民幣54.55億元，減幅27.64%，主要是子公司銷售成本減少。

2022年上半年，本集團實現歸屬於本公司股東的淨利潤人民幣47.58億元，同比下降41.77%；實現基本每股收益人民幣0.36元/股，同比下降42.86%；加權平均淨資產收益率2.88%，同比減少2.22個百分點。

## 第三節 董事會報告

### 3 公益投入

2022年上半年，本集團在環保公益、救災捐款、教育資助、慈善捐款等公益性方面的投入金額共計人民幣10,176千元。

#### 2022年上半年公益性投入構成明細

單位：千元 幣種：人民幣

| 項目   | 本期發生額  |
|------|--------|
| 慈善捐贈 | 10,176 |
| 合計   | 10,176 |

### 4 現金流

2022年上半年，本集團現金及現金等價物淨增加額為人民幣161.85億元，其中：

來自經營活動的現金淨額人民幣109.29億元，主要是以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產和衍生金融資產的減少，導致現金流入人民幣184.50億元；其他貸款及應收款減少，導致現金流入人民幣76.62億元；賣出回購金融資產款減少，導致現金流出人民幣103.44億元。

用於投資活動的現金淨額人民幣24.46億元，主要是購買以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具，導致現金流出人民幣143.60億元；處置收回以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具款項，導致現金流入人民幣96.36億元。

來自籌資活動的現金淨額人民幣77.02億元，主要是發行短期融資券及非可轉換債券等所得款項，導致現金流入人民幣568.51億元；籌集借款所得款項，導致現金流入人民幣434.67億元；還借款、短期融資券及非可轉換債券等支付的款項，導致現金流出人民幣875.30億元。

### 5 其他

報告期內，本集團利潤構成和來源未發生重大變動。

## 第三節 董事會報告

### (二) 綜合財務狀況表主要分析

#### 1 綜合財務狀況主要項目分析

單位：千元 幣種：人民幣

|                              | 於2022年      |       | 於2021年      |       | 增減情況       |         |
|------------------------------|-------------|-------|-------------|-------|------------|---------|
|                              | 6月30日       | 構成    | 12月31日      | 構成    | 金額         | 比例      |
| 非流動資產                        | 165,319,184 |       | 157,943,199 |       | 7,375,985  | 4.67%   |
| 其中：應收融資租賃款                   | 7,958,405   | 1.06% | 11,270,189  | 1.51% | -3,311,784 | -29.39% |
| 售後回租安排的應收款                   | 39,404,886  | 5.26% | 31,521,846  | 4.23% | 7,883,040  | 25.01%  |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>其他全面收益的債務工具 | 38,995,073  | 5.20% | 33,050,889  | 4.44% | 5,944,184  | 17.98%  |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>其他全面收益的權益工具 | 6,612,456   | 0.88% | 10,246,871  | 1.38% | -3,634,415 | -35.47% |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>損益的金融資產     | 23,075,734  | 3.08% | 25,132,195  | 3.37% | -2,056,461 | -8.18%  |
| 其他貸款及應收款項                    | 1,277,711   | 0.17% | 2,394,396   | 0.32% | -1,116,685 | -46.64% |
| 權益法項下投資                      | 6,328,009   | 0.84% | 6,454,420   | 0.87% | -126,411   | -1.96%  |
| 買入返售金融資產                     | 562,418     | 0.08% | 575,403     | 0.08% | -12,985    | -2.26%  |
| 物業及設備                        | 15,117,102  | 2.02% | 15,088,876  | 2.03% | 28,226     | 0.19%   |
| 客戶貸款                         | 4,718,474   | 0.63% | 4,119,086   | 0.55% | 599,388    | 14.55%  |
| 商譽                           | 3,519,765   | 0.47% | 3,365,313   | 0.45% | 154,452    | 4.59%   |

### 第三節 董事會報告

|                              | 於2022年             |        | 於2021年      |        | 增減情況        |         |
|------------------------------|--------------------|--------|-------------|--------|-------------|---------|
|                              | 6月30日              | 構成     | 12月31日      | 構成     | 金額          | 比例      |
| <b>流動資產</b>                  | <b>584,246,677</b> |        | 586,981,950 |        | -2,735,273  | -0.47%  |
| 其中：銀行結餘及現金                   | 179,954,155        | 24.01% | 156,448,163 | 21.00% | 23,505,992  | 15.02%  |
| 結算備付金                        | 15,106,527         | 2.02%  | 16,765,418  | 2.25%  | -1,658,891  | -9.89%  |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>損益的金融資產     | 178,790,503        | 23.85% | 195,277,554 | 26.21% | -16,487,051 | -8.44%  |
| 客戶墊款                         | 69,668,201         | 9.29%  | 75,223,404  | 10.10% | -5,555,203  | -7.38%  |
| 應收賬款                         | 8,496,612          | 1.13%  | 11,372,016  | 1.53%  | -2,875,404  | -25.28% |
| 買入返售金融資產                     | 41,537,039         | 5.54%  | 39,185,614  | 5.26%  | 2,351,425   | 6.00%   |
| 應收融資租賃款                      | 17,382,485         | 2.32%  | 22,202,398  | 2.98%  | -4,819,913  | -21.71% |
| 售後回租安排的應收款                   | 28,796,531         | 3.84%  | 23,566,177  | 3.16%  | 5,230,354   | 22.19%  |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>其他全面收益的債務工具 | 3,060,154          | 0.41%  | 4,002,056   | 0.54%  | -941,902    | -23.54% |
| 交易所儲備及保證金                    | 19,888,627         | 2.65%  | 17,491,923  | 2.35%  | 2,396,704   | 13.70%  |
| 衍生金融資產                       | 2,277,486          | 0.30%  | 1,084,731   | 0.15%  | 1,192,755   | 109.96% |
| 其他貸款及應收款項                    | 6,075,061          | 0.81%  | 12,544,269  | 1.68%  | -6,469,208  | -51.57% |
| <b>資產總額</b>                  | <b>749,565,861</b> |        | 744,925,149 |        | 4,640,712   | 0.62%   |

### 第三節 董事會報告

|               | 於2022年             |        | 於2021年      |        | 增減情況        |         |
|---------------|--------------------|--------|-------------|--------|-------------|---------|
|               | 6月30日              | 構成     | 12月31日      | 構成     | 金額          | 比例      |
| <b>流動負債</b>   | <b>396,510,790</b> |        | 401,513,715 |        | -5,002,925  | -1.25%  |
| 其中：應付經紀業務客戶賬款 | 129,589,378        | 22.65% | 123,202,200 | 21.72% | 6,387,178   | 5.18%   |
| 賣出回購金融資產款     | 81,567,484         | 14.26% | 91,911,952  | 16.21% | -10,344,468 | -11.25% |
| 借款            | 50,053,904         | 8.75%  | 48,402,335  | 8.53%  | 1,651,569   | 3.41%   |
| 拆入資金          | 7,757,132          | 1.36%  | 12,723,438  | 2.24%  | -4,966,306  | -39.03% |
| 以公允價值計量且其變動計入 |                    |        |             |        |             |         |
| 損益的金融負債       | 7,280,889          | 1.27%  | 10,456,105  | 1.84%  | -3,175,216  | -30.37% |
| 衍生金融負債        | 1,275,152          | 0.22%  | 1,548,316   | 0.27%  | -273,164    | -17.64% |
| 其他應付及預計費用     | 28,475,757         | 4.98%  | 28,635,826  | 5.05%  | -160,069    | -0.56%  |
| 應付短期融資款       | 22,660,030         | 3.96%  | 24,986,688  | 4.41%  | -2,326,658  | -9.31%  |
| 客戶存款          | 5,006,434          | 0.88%  | 2,758,837   | 0.49%  | 2,247,597   | 81.47%  |
| 所得稅負債         | 1,339,886          | 0.23%  | 3,477,590   | 0.61%  | -2,137,704  | -61.47% |
| 應付債券          | 58,825,324         | 10.28% | 52,513,925  | 9.26%  | 6,311,399   | 12.02%  |
| <b>流動資產淨值</b> | <b>187,735,887</b> |        | 185,468,235 |        | 2,267,652   | 1.22%   |
| <b>非流動負債</b>  | <b>175,572,496</b> |        | 165,656,648 |        | 9,915,848   | 5.99%   |
| 其中：應付債券       | 114,645,657        | 20.04% | 111,072,145 | 19.58% | 3,573,512   | 3.22%   |
| 長期借款          | 36,975,027         | 6.46%  | 30,751,726  | 5.42%  | 6,223,301   | 20.24%  |
| 以公允價值計量且其變動計入 |                    |        |             |        |             |         |
| 損益的金融負債       | 11,130,499         | 1.95%  | 5,860,112   | 1.03%  | 5,270,387   | 89.94%  |
| 拆入資金          | 2,898,252          | 0.51%  | 2,941,219   | 0.52%  | -42,967     | -1.46%  |
| <b>負債總額</b>   | <b>572,083,286</b> |        | 567,170,363 |        | 4,912,923   | 0.87%   |
| <b>權益總額</b>   | <b>177,482,575</b> |        | 177,754,786 |        | -272,211    | -0.15%  |

\* 構成比例資產類為佔總資產的比例，負債類為佔總負債的比例

截至2022年6月30日，本集團資產總額為人民幣7,495.66億元，較2021年末增加人民幣46.41億元，增幅0.62%；負債總額為人民幣5,720.83億元，較2021年末增加人民幣49.13億元，增幅0.87%。

## 第三節 董事會報告

截至2022年6月30日，非流動資產為人民幣1,653.19億元，較2021年末增加4.67%，主要是售後回租安排的應收款增加；流動資產為人民幣5,842.47億元，較2021年末減少0.47%，主要是以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產減少。流動負債為人民幣3,965.11億元，較2021年末減少1.25%，主要是賣出回購金融資產款減少；流動資產淨值為人民幣1,877.36億元，較2021年末增加1.22%；非流動負債為人民幣1,755.72億元，較2021年末增加5.99%，主要是長期借款增加。

截至2022年6月30日，本集團歸屬於本公司股東的權益為人民幣1,630.81億元，較2021年末減少人民幣0.57億元，減幅0.04%；扣除應付經紀業務客戶賬款的影響因素，本集團資產負債率為71.37%，較2021年末資產負債率71.41%，下降了0.04個百分點，本集團資產負債結構保持相對穩定。

### 借款及債券投資

截至2022年6月30日，本集團的借款及債券融資額為人民幣2,831.60億元，下表載列於2022年6月末本集團的借款及債券融資明細：

單位：千元 幣種：人民幣

|         | 截至2022年<br>6月30日 | 截至2021年<br>12月31日 |
|---------|------------------|-------------------|
| 應付債券    | 173,470,981      | 163,586,070       |
| 借款      | 87,028,931       | 79,154,061        |
| 應付短期融資款 | 22,660,030       | 24,986,688        |
| 合計      | 283,159,942      | 267,726,819       |

有關借款及債務融資的利率及期限，詳見本報告綜合財務資料附註41、42及43。

2022年6月30日，於一年內到期的借款、應付短期融資款及債券金額為人民幣1,315.39億元，本集團扣除於一年內到期的應付債券、借款、應付短期融資款等負債後的流動資產淨值為人民幣1,877.36億元，因此，本集團面臨的流動性風險並不重大。

## 第三節 董事會報告

除在本報告中已披露外，於2022年6月30日，本集團並無未償還按揭、抵押、債券、其他債務資本、承兌負債或其他類似債項、租購及融資租賃承擔、保證或其他重大或然負債。

### (三) 投資狀況分析

#### 1. 對外股權投資總體分析

報告期末，本集團長期股權投資人民幣63.28億元，較上年末人民幣64.54億元減少人民幣1.26億元，減幅1.96%。長期股權投資參見本報告綜合財務資料附註20。

##### (1) 重大的股權投資

報告期內，本集團無重大股權投資。

##### (2) 重大的非股權投資

報告期內，本集團無重大非股權投資。

##### (3) 以公允價值的金融工具

本集團以公允價值計量的金融資產主要為以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產人民幣2,018.66億元，以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債人民幣184.11億元，以公允價值計量且變動計入其他綜合收益的權益工具人民幣66.12億元，以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的債務工具人民幣420.55億元及衍生金融工具人民幣10.02億元。

### (四) 重大資產和股權出售

報告期內，本集團無重大資產或股權出售。

### (五) 主要控股參股公司分析

1. 海通創新證券，註冊資本人民幣115億元，海通證券持有100%的股權。截至2022年6月30日，海通創新證券總資產為人民幣206.05億元，淨資產人民幣200.60億元；2022年上半年，實現營業收入人民幣2.63億元，淨利潤人民幣2.77億元。
2. 海通國際控股，註冊資本111.80億港幣，海通證券持有100%的股權。截至2022年6月30日，海通國際控股總資產為2,743.95億港幣，淨資產362.50億港幣；2022年上半年，實現收入23.63億港幣，淨利潤-11.55億港幣。

## 第三節 董事會報告

3. 海通開元，註冊資本人民幣75億元，海通證券持有100%的股權。截至2022年6月30日，海通開元總資產為人民幣134.18億元，淨資產人民幣116.64億元；2022年上半年，實現營業收入人民幣4.46億元，淨利潤人民幣4.47億元。
4. 海通資管公司，註冊資本人民幣22億元，海通證券持有100%的股權。截至2022年6月30日，海通資管公司的總資產為人民幣71.97億元，淨資產人民幣53.05億元；2022年上半年，實現營業收入人民幣3.81億元，淨利潤人民幣2.52億元。
5. 上海澤春，註冊資本人民幣1億元，海通證券持有100%的股權。截至2022年6月30日，上海澤春的總資產為人民幣4.66億元，淨資產人民幣2.07億元；2022年上半年，實現營業收入人民幣0.36億元，淨利潤人民幣0.18億元。
6. 上海惟泰置業，註冊資本人民幣1,000萬元，海通證券持有100%的股權。截至2022年6月30日，上海惟泰置業的總資產為人民幣2.09億元，淨資產人民幣0.01億元；2022年上半年，實現營業收入人民幣0.19億元，淨利潤人民幣-0.09億元。
7. 海通期貨，註冊資本人民幣13.015億元，海通證券持有73.83%的股權。截至2022年6月30日，海通期貨總資產為人民幣598.02億元，淨資產人民幣34.10億元；2022年上半年，實現營業收入人民幣10.02億元，淨利潤人民幣1.69億元。
8. 海富通基金，註冊資本人民幣3億元，海通證券持有51%的股權。截至2022年6月30日，海富通基金總資產為人民幣37.87億元，淨資產人民幣22.56億元；2022年上半年，實現營業收入人民幣6.68億元，淨利潤人民幣2.09億元。
9. 富國基金，註冊資本人民幣5.2億元，海通證券持有27.775%的股權。截至2022年6月30日，富國基金總資產為人民幣122.44億元，淨資產人民幣67.87億元；2022年上半年，實現營業收入人民幣37.73億元，淨利潤人民幣11.22億元。

## 第三節 董事會報告

### (六) 本公司控制的結構化主體情況

本公司對由子公司作為管理人的結構化主體，綜合考慮合併報表範圍內的公司合計享有這些結構化主體的可變回報，或承擔的風險敞口等因素，認定將66個結構化主體納入合併報表範圍。

## 五、其他披露事項

### (一) 可能面對的風險

#### 1. 風險管理概述

本公司一直以來注重對風險的防範與控制，確立了「務實、開拓、穩健、卓越」的經營理念，樹立了「穩健乃至保守」的風險控制理念，經營管理實行合規優先、風險管理優先的原則。

本公司根據《證券公司全面風險管理規範》等監管要求及內部制度，從全覆蓋、可監測、能計量、有分析、能應對等方面持續完善全面風險管理體系建設，強化風控指標併表管理，健全集團T+1風險數據集市，推進集團風險管理向縱深發展：搭建了層級分明的風險管理組織架構，覆蓋各風險類別、各業務條線、各部門／分支機構／子公司，不斷完善風險識別、評估、計量、監控、報告和應對等風險管理流程，規範各類業務開展，加強風險的事前防範、事中監控和事後檢查處置；建立了監管指標、風險容忍度和風險限額指標、業務風控指標等三層風險控制指標體系，通過系統實現動態監控和自動預警，開展壓力測試以評估極端風險。同時，以同一業務、同一客戶管理為框架，建立集團風險限額體系，向部門、子公司進行拆解，並開展日常監控工作；開展市場風險、信用風險、流動性風險計量，建立模型管理機制和流程，並持續對模型開展評估和驗證；將子公司風險納入報告範圍，定期編製集團風險日報、月報、季報、半年／年報，針對重大風險事件編製專項報告；根據風險評估和預警的結果，選擇合適的應對策略，建立了有效的應對機制以及具有可操作性的應急預案。此外，本公司從文化宣導、制度建設、數據和系統、人才隊伍建設、風控投入等方面為全面風險管理提供保障和支持。

## 第三節 董事會報告

### 2. 風險管理架構

本公司依據《公司法》《證券法》《證券公司內部控制指引》《證券公司全面風險管理規範》等法規及本公司規章制度要求，搭建了多層次的風險管理組織架構，明確了董事會、監事會、經營層、首席風險官、風險管理部門、業務及管理部門、分支機構、子公司等各層級在風險管理工作中的具體職責。

董事會是本公司風險管理戰略目標的制定者和授權人，負責審議批准本公司風險管理的總體目標、基本政策和重要制度、本公司整體風險偏好和風險容忍度、重大風險的解決方案、定期風險評估報告，監督本公司風險管理政策的實施，任免考核首席風險官，建立與首席風險官的直接溝通機制，及公司章程規定的其他職責。董事會設合規與風險管理委員會，具體履行董事會風險管理職責。

監事會是本公司風險管理和內部控制體系的監督者，負責對董事會、經理層建立和實施風險管理及內部控制的情況進行監督，並履行公司章程規定的其他職責。

本公司經營層根據董事會的授權，負責建立責任明確、程序清晰的組織結構，制定本公司風險管理的政策、規章和制度，貫徹執行本公司整體風險偏好和風險容忍度政策，組織實施各類風險的識別、評估及應對工作，建立健全和有效執行風險管理制度和機制，及時處理或者改正存在的問題缺陷，審議處理本公司重大風險事件，建立涵蓋風險管理有效性的全員績效考核體系，建立完備的信息技術系統和數據質量控制機制，及董事會授予的其他風險管理職責。

## 第三節 董事會報告

本公司設首席風險官，由董事會聘任。首席風險官是負責本公司全面風險管理工作的高級管理人員，負責組織實施董事會、經營層確定的風險管理政策、規章和制度，組織對本公司建立健全各項業務風險管理制度進行督導、審查和評估，組織對本公司風險管理政策和流程的執行情況進行監督和檢查，對風險管理中存在的問題提出處理意見並督促整改，組織評估和完善風險管理的工具和方法，定期組織對本公司面臨主要風險水平及其管理狀況進行評估，並向經營層、董事會及監管部門提交評估報告，組織對子公司風險管理工作負責人的提名和考核等。

本公司設立風險管理部，在首席風險官的領導下履行風險管理職責，負責擬定本公司風險管理的政策、規章和制度，督導本公司各單位制定業務風險管理制度和流程，對相關業務的主要風險進行識別和評估，組織對各項業務風險管理制度執行情況的監督、檢查，定期對本公司整體風險水平及其風險管理狀況進行評估和報告，對重大風險隱患或風險事件，及時報告並提出風險處置建議等。此外，本公司合規法務部負責管理本公司合規風險、洗錢及恐怖融資風險，本公司資金管理總部負責管理公司流動性風險，本公司總經理辦公室負責管理本公司聲譽風險，本公司信息技術管理部門負責管理本公司信息技術風險。

本公司各部門、分支機構和子公司負責其經營管理範圍內的風險管理工作，建立健全相應的風險管理制度和流程，落實本公司風險管理政策，組織實施相應的風險管理工作。本公司各部門、各分支機構和子公司負責人承擔本單位風險管理有效性的直接責任。本公司各部門、各分支機構和子公司指定專人具體負責本單位的風險管理工作，對風險管理政策和制度的執行情況進行監督、檢查和報告，履行一線風險管理職責。

本公司稽核部負責定期對本公司風險管理工作進行稽核檢查，定期評估風險管理體系的有效性，並根據評估結果提出改進建議。

## 第三節 董事會報告

各子公司規範運作，依法經營。本公司通過各項機制將子公司風險管理納入全面風險管理體系，從子公司風險管理負責人提名、風險限額與報告、重大事項審批、數據對接、風控指標併表、督導與檢查、評價考核等方面落實對子公司的垂直風險管理。

### 3. 各類風險的應對措施及其報告期內表現

本公司業務經營活動面臨的風險主要有：合規風險、洗錢及恐怖融資風險、信用風險、市場風險、操作風險、流動性風險、聲譽風險具體情況如下：

#### (1) 合規風險

《證券公司和證券投資基金管理公司合規管理辦法》中所稱的「合規風險」，是指因證券基金經營機構或其工作人員的經營管理或執業行為違反法律法規和準則而使證券基金經營機構被依法追究法律責任、採取監管措施、給予紀律處分、出現財產損失或商業信譽損失的風險。

本公司按照合規管理監管要求，並結合本公司的實際情況，建立科學合理、職責分明的合規管理架構體系，明確董事會、監事會、經營管理主要負責人、合規總監、其他高級管理人員的合規管理職責定位，合規部門、其他內控部門、本公司下屬單位（包括各部門、各分支機構、各子公司）分工明確，協調互動。本公司已制定《海通證券股份有限公司合規管理辦法》及相關配套合規管理制度，並配置合規管理人員隊伍體系，嚴格對各業務條線進行合規管理，通過合規事前審查、事中監測、事後檢查、考核及問責，努力提高各項制度、機制及流程的執行力度，同時，本公司加大政策傳導及合規宣導工作力度，積極培育「人人合規、主動合規」的經營環境。

## 第三節 董事會報告

報告期內，本公司進一步加強合規審查、合規檢查、合規監測、合規考核與問責等合規管理基礎工作。同時，本公司確定2022年為「合規內控文化建設年」，在本集團範圍內全面推進合規內控文化建設，貫徹「全員合規、合規從管理層做起、合規創造價值、合規是本公司生存基礎」的合規理念，遵循「人員為抓手、問題為導向、長效機制為保障」的原則，重點抓好培訓宣導、反洗錢工作、隊伍建設、問題查擺、制度執行等五大核心工作，推動本公司建立健全合規內控長效機制，逐步實現本公司合規內控體系提檔升級。

### (2) 洗錢及恐怖融資風險

《法人金融機構洗錢和恐怖融資風險管理指引(試行)》中包含了洗錢、恐怖融資和擴散融資風險管理的具體要求。本公司面臨的洗錢、恐怖融資和擴散融資風險是指公司的產品或服務被不法分子利用從事洗錢、恐怖融資、擴散融資等活動的可能性。本公司已建立健全董事會負責下的反洗錢組織架構，形成本公司反洗錢領導小組統籌協調、合規部門牽頭組織實施、相關業務部門和分支機構落實執行的反洗錢管理體系。本公司建立了包括集團洗錢風險管理制度、本公司反洗錢基本制度及其他配套制度和操作規程等在內的反洗錢管理制度體系。

報告期內，本公司全面推進洗錢和恐怖融資風險管理文化宣導，提升本公司洗錢和恐怖融資風險管理水平。一是開展本公司反洗錢工作自查，全面審視本公司各條線洗錢風險管理情況。二是加強洗錢風險管理文化建設，開展洗錢風險管理系列培訓，努力提升一線洗錢風險管理履職能力。三是積極履行反洗錢宣導義務，通過本公司微信公眾號發佈洗錢宣傳材料，提高投資者洗錢和恐怖融資風險防範意識。

## 第三節 董事會報告

### (3) 信用風險

信用風險是指因融資人、交易對手方或債務發行人無法履行其約定的財務義務或信用資質發生不利變化而可能對本集團經營造成損失的風險。

#### A、 存放在其他金融機構的自有貨幣資金、經紀業務相關風險

貨幣資金主要存放在國有商業銀行或信譽良好的股份制商業銀行，結算備付金存放在中國證券登記結算有限責任公司，此類現金及現金等價物面臨的信用風險相對較低。經紀業務採取全額保證金結算，切實規避相關信用風險。

#### B、 交易性融資業務相關風險

本集團開展的交易性融資業務主要包括：融資融券、股票質押式回購、孖展交易、約定購回式證券交易等。相關主體通過制定和實施各項嚴格的制度和措施，主要從盡職調查、內部評級、項目評審、授信管理、逐日盯市、限額監控、貸後跟蹤、補充增信、平倉處置、司法追索和撥備計提等環節實施管控。

#### C、 信用債券交易與投資業務相關風險

本集團注重通過分散投資控制集中度風險，投資標的主要傾向於高信用評級資產，在信用風險管理中密切跟蹤投資標的的經營情況和信用評級變化，落實內部評級和統一授信管理機制，建立健全債務發行人、行業和地域集中度等信用風險監控指標，在投後跟蹤中及時根據財務指標變動、重大風險事件和負面輿情等信息更新債務發行人內部評級和授信限額指標，動態調整交易策略。

## 第三節 董事會報告

### D、 融資租賃業務相關風險

本集團在開展融資租賃業務、支持實體經濟發展時，堅持以行業與客戶並重的策略確定信用風險管理政策。行業信用風險管理方面，本集團就融資租賃客戶所處行業的景氣程度施行動態跟蹤和評估，以此為基礎制定相應的行業投放政策、管控行業集中度風險。客戶信用風險管控方面，本集團主要通過開展盡職調查、內部評級、授信審核、貸後資產巡檢、風險預警與監測、集中度限額控制等措施對客戶信用風險實施管控。

### E、 債券回購等同業短期拆借、場外衍生品業務相關風險

針對債券回購等同業短期拆借業務，本集團以交易對手准入和授信管理為抓手，審慎篩選信用資質良好的交易對手和信用等級較高的擔保證券，從源頭上控制信用風險水平。針對場外衍生品業務，本集團從交易對手准入和授信管理、標的證券管理、風險應對與處置等方面建立了完善的管理制度與流程，對存續期內的場外衍生品交易進行逐日盯市，並通過嚴格履行淨額結算和履約保障等措施管理交易對手信用風險。本集團同業短期拆借和場外衍生品業務的交易對手主要是商業銀行、證券公司、資產管理計劃等主體，在開展此類業務的過程中，合理選擇業務模式、嚴格控制業務規模並採取合理的風控措施。同時，本集團關注信用風險和市場風險之間的相關性，對市場波動背景下的信用風險採取必要的監控和應對措施，包括但不限於交易保證金安排、交易對手內部評級與授信管理、未來潛在風險暴露計量、錯向風險識別等。

## 第三節 董事會報告

本集團根據行業監管政策、資本市場環境和本集團業務發展戰略，持續完善信用風險管理體系。報告期內，本集團以信用風險管理辦法等制度為依據，全面落實以同一客戶、同一業務為核心的信用風險識別、評估、計量、監控、報告及應對工作，包括以集團T+1風險數據集市為依托，對可覆蓋母子公司業務的信用風險管理信息系統進行持續升級，通過提升風險識別、計量與壓力測試能力持續完善資產質量、風險抵補和集中度風險等維度的信用風險限額體系，持續強化統一評級與集中授信管理機制，對信用評級和授信限額模型進行動態優化，搭建以雲計算、區塊鏈、大數據、人工智能等金融科技為支撐的客戶關係圖譜集團智能預警中心、輿情異動監控、違約預警監控、財報風險監控分析及高風險客戶管控工具，強化信用類業務風險資產系統化管理程序，以此實現對集團整體信用風險狀況和風險限額執行情況的有效跟蹤和監控。本集團以ESG風險管理辦法等制度為依據，建立健全客戶ESG風險准入及跟蹤監控機制，積極落實客戶ESG盡職調查和ESG風險評估等工作。報告期內，本集團核心信用風險監控指標運行平穩，整體信用風險可控。

針對融資類三項業務，本公司主動優化業務結構，審慎評估新做項目，加強存續項目的跟蹤、監控和管理，加大存量風險項目追償力度並審慎、前瞻地計提信用減值準備，確保風險撥備計提充分。截至報告期末，本公司融資融券存量負債客戶的平均維持擔保比例為275.58%，約定購回式證券交易客戶的平均履約保障比例為273.64%，股票質押式回購業務客戶的平均履約保障比例為265.77%，融資人提供的擔保品較為充足，信用風險整體可控。

## 第三節 董事會報告

### (4) 市場風險

市場風險主要指在本集團的經營活動中，因市場價格（股票價格、利率、匯率及商品價格等）的不利變動而使自有資金投資的相關業務發生損失的風險。

- A、 股票價格風險。股票價格風險主要指本集團所投資的權益類證券市場價格發生變化致使本集團承受損失的風險。承擔此類風險的業務主要包括權益類證券自營業務、做市業務和場外衍生品業務等。股票價格風險具有較大的不確定性，是本集團主要面對的市場風險類型之一。本集團密切關注相關資產價格波動，並採取相應措施予以防範，通過每日跟蹤證券持倉的投資規模和風險價值(VaR)變化情況進行監測和管控。本集團通過實施多元化投資策略，對各類證券品種的投資規模進行適當控制和適時調整，並結合各類套期保值工具，較為有效地控制了市場風險。
- B、 利率風險。利率風險是指因市場收益率曲線或信用價差等因素變動導致的風險，承擔此類風險的業務主要包括債券投資業務和利率衍生品業務等。本集團對利率風險的控制，主要採用規模控制和投資組合等方法，合理配置資產，匹配負債與資產的期限結構，並通過定期測算投資組合久期、凸性、DV01等指標衡量利率風險。
- C、 匯率風險。匯率風險是指因外匯匯率變動而導致的風險。報告期內，本集團國際化佈局不斷完善，面對複雜多變的境外市場，主動降低境外資產槓桿水平，整體外幣資產規模有所減少，匯率風險敞口也相應降低。本集團持續跟蹤研究外匯市場，不斷完善制度建設和內部管理，通過套保等一系列措施對沖、緩釋匯率風險。本集團注重外幣資產和負債的匹配，以縮小外匯風險的敞口，還採用境外經營淨投資套期等方法平滑外匯敞口對集團經營成果的影響。截至報告期末，本集團的匯率風險對財務報表無重大影響。

### 第三節 董事會報告

D、商品價格風險。商品價格風險是由各類商品價格發生不利變動引起。報告期內，本集團商品類市場風險敞口相對較低，主要通過商品期貨、期權等商品衍生工具進行對沖，有效管理商品風險。

除上述風險因素之外，本集團所從事的境外投資交易業務也承擔着相關市場風險，全球範圍內各種市場風險因子的波動都可能對本集團的整體損益帶來影響。報告期內，根據本集團市場風險管理辦法的有關要求，本公司不斷推進落實集團層面市場風險的識別、評估、計量、監測、應對和報告等程序，將子公司投資交易業務納入整體市場風險管理體系內。對於本集團下屬子公司進行的投資交易業務，通過制定並分配風險價值限額、止損限額等市場風險限額指標進行管控，要求子公司在日常經營活動中嚴格落實執行，並按要求向母公司提交風險報告。本集團基於T+1風險數據集市、本集團市場風險管理系統、風險報告等工具或手段，對子公司市場風險狀況和風險限額執行情況進行跟蹤和監督。

本集團通過以風險價值為主的市場風險量化指標體系對各項投資交易類業務承擔的市場風險情況進行計量和管控。風險價值指在一定的置信水平下，投資組合在未來特定前瞻期內因市場波動而產生的最大可能損失，是衡量市場風險的主要指標。本集團風險價值模型的具體計量參數為95%置信水平、1日前瞻期，模型計量的覆蓋範圍包括集團層面持有的權益、利率、外匯等各類金融資產和衍生品。本集團通過返回檢驗等手段，持續監控和評估風險價值模型的有效性，並隨着業務發展和風險管理的需要持續完善風險價值模型。此外，本集團建立壓力測試管理機製作為風險價值模型的重要補充，通過構建各類歷史情景和模擬情景以及相應的壓力測試傳導機制，衡量投資交易業務可能面臨的極端損失情況，並評估損失是否在可承受範圍內。報告期內，本公司各月月末風險價值佔本公司淨資產的比例、以及本集團風險價值佔本集團淨資產的比例均保持在0.3%以內，市場風險可控可承受。

## 第三節 董事會報告

### (5) 操作風險

操作風險指由內部流程缺陷、人員失誤或不當行為、信息系統缺陷或故障，以及外部因素等原因給本公司造成損失的風險。操作風險貫穿於本公司業務開展與日常運營過程中的各個環節，並可能導致法律風險、合規風險、聲譽風險等其他風險。本公司根據操作風險管理辦法，利用風險與控制自我評估、關鍵風險指標、損失數據收集等工具，開展操作風險識別、評估、監測、報告等工作。

本公司在本集團範圍內開展年度風險與控制自我評估，並根據監管要求及新業務開展情況等開展專項風險與控制自我評估；建立覆蓋集團主要部門、單位的關鍵風險指標體系，對關鍵風險指標開展定期收集監測工作；在本集團範圍內開展操作風險損失數據收集監測工作，匯總分析相關信息並跟進風險緩釋措施的進展。報告期內，本公司面臨的操作風險性質和程度未發生重大變化，已建立的各項操作風險管理工具持續有效運行，未發生對本公司運營有實質性影響的重大操作風險事件。

信息技術風險方面，本公司持續加強信息技術管理的制度建設，不斷完善網絡與信息安全事件應急預案，定期進行應急演練，並採用定期或不定期的監測、專項檢查等多種手段對系統運行、系統建設、信息安全、科技管理等方面的信息技術相關情況進行監控和管理，防範信息技術風險。本公司持續加強信息技術系統的建設和運維，嚴格按照操作程序進行定期和不定期的檢查和維護，以保證系統的可靠、穩定和安全運轉，報告期內未發生重大信息技術風險事件。

## 第三節 董事會報告

### (6) 流動性風險

流動性風險是指本公司無法以合理成本及時獲得充足資金，以償付到期債務、履行其他支付義務和滿足正常業務開展的資金需求的風險。由於本公司自營業務規模及融資類業務規模較大，本公司經營過程中易受宏觀政策、市場變化、經營狀況、客戶信用等因素影響，並可能因資產負債結構不匹配而引發流動性風險。

在日間流動性風險管理方面，本公司按照制定的流動性風險偏好及風險指標限額的要求，通過合理的監測機制和調控手段，始終確保流動性風險可測、可控和可承受，同時按照管理要求，儲備了充足的優質流動性資產，保障了本公司業務的順利開展和到期負債的順利償付。本公司持續開展日間流動性和風險指標管理，結合資產端和負債端，構建資金、指標聯動體系，完善了包括日間指標頭寸跟進、月度指標前瞻分析和部門指標拆解在內的流動性風險分析框架，豐富了不同期限內流動性風險管理的工具，提升了本公司流動性風險管理和預判的效率。

在中長期流動性風險管理方面，本公司不斷優化資產配置結構，強化對資產負債發展趨勢的分析，從源頭上把控流動性風險。一方面，本公司成立資產負債配置委員會，積極開展資產負債管理工作，通過及時分析業務發展趨勢、潛在中長期資金需求，調整負債期限結構，保持資產負債的期限、規模的合理匹配；另一方面，本公司持續提升流動性精細化管理水平，負債端結構和到期日分佈更趨合理，也保證資產端在安全性、流動性、收益性之間的平衡。報告期內，本公司重視與各大商業銀行保持良好的合作關係，注重規範經營，維繫良好信譽，保持融資渠道暢通。

## 第三節 董事會報告

此外，本公司穩步推進對本集團流動性風險管理的要求，以本集團流動性風險管理辦法為指引，根據各子公司業務特點制定了較為科學有效的流動性風險管理策略，基本實現集團層面流動性風險的統一管理。首先，本公司以流動性風險管理為基礎，從風險和資產負債管理等方面持續對子公司實行分類管理，並從組織制度保障、風險管控框架、風險應對手段三個維度提出不同要求，指導子公司完善其流動性風險管理體系；其次，以流動性風險併表指標為基礎，根據各子公司所處行業、地域和風險特徵的差異，下發各子公司的限額管理要求，以更有效地監測各子公司的流動性風險實質情況；最後，為強化集團流動性風險處置能力，本公司以本集團流動性支持管理辦法作為整體管理方針，持續完善本集團流動性支持體系，牢牢守住本集團不發生流動性風險的底線。

報告期內，面對市場環境的變化和本公司內部資金需求的轉化，本公司積極籌劃，從多個方面着手，通過事前風險識別、事中風險緩釋、事後改進等措施，不斷強化對流動性風險的管控。本公司通過市場研判，抓住利率低位時點及時通過發債增加資金儲備並續作各項到期負債，降低了流動性風險發生的可能，並保證了本公司在複雜市場環境下的平穩運營能力。報告期內，本公司核心流動性監管指標流動性覆蓋率日均286.48%，淨穩定資金率日均165.97%，均高於監管要求及預警標準。

## 第三節 董事會報告

### (7) 聲譽風險

聲譽風險是指由於本公司行為或外部事件，以及工作人員違反廉潔規定、職業道德、業務規範、行規行約等相關行為，導致投資者、發行人、監管機構、自律組織、社會公眾、媒體等對本公司形成負面評價，從而損害公司品牌價值，不利於本公司正常經營，甚至影響到市場穩定和社會穩定的風險。

本公司高度重視聲譽風險管理的前瞻性和主動性，持續滿足監管部門關於聲譽風險系統化管理的要求，加強境內外聲譽風險監測，在中國內地和中國香港建立傳播渠道，圍繞本公司經營業績和業務亮點，強化主動宣傳，為本公司發展營造良好的輿論環境。針對少數負面輿情，能夠科學研判、快速反應、主動應對，及時把握輿情走勢，與主流媒體保持良好溝通，做好輿論引導，維護本公司品牌形象。本公司根據中國證券業協會發佈的《證券公司聲譽風險管理指引》有關要求，及時修訂完成《海通證券股份有限公司聲譽風險管理辦法》並在本公司內部進行全員宣傳和貫徹。報告期內，本集團總體輿論環境良好。

### (二) 其他披露事項

#### 經營計劃進展說明

2022年上半年，面對新冠肺炎疫情帶來的嚴峻考驗和複雜多變的外部環境，在總體戰略的指引下，本公司統一思想，明確任務，堅持疫情防控和經營發展「兩手抓、兩手硬、兩手贏」，以「一個海通」理念總攬「投、融、保、研」和財富管理五個關鍵領域，發揮專業力量積極服務實體經濟，着力推動改革發展，各項工作穩步推進，為實現全年經營目標打下良好基礎。

## 第三節 董事會報告

在投資銀行業務條線，本公司股權融資業務加大項目推進力度，積極拓展「專精特新」企業，鞏固了行業優勢，市場排名保持行業前列；債券融資業務在發揮專業優勢全面助力復工復產復市的同時，積極以創新驅動業務發展，成功完成多個首單債券的發行。在財富管理業務條線，本公司經紀業務通過加大在重點區域的投入和強化本集團範圍的業務協同，加快推動分支機構發展；金融產品業務持續強化銷售組織、完善銷售政策、釐清銷售職能、優化系統平台；融資類業務穩中有進，資產質量保持較好水平，融券業務規模持續增長；期貨業務總體繼續保持行業前列，期貨子公司成功獲批成為廣州期貨交易所會員。在交易及機構業務條線，本公司QFII、RQFII業務繼續保持行業前列，WFOE業務保持行業優勢，對銀行理財子公司的服務轉向提供交易服務；權益投資交易不斷拓展服務品類，夯實服務能力；固定收益投資穩步推進FICC創新業務，並在場外衍生品業務領域實現突破；研究服務創新工作方法，強化線上服務，深化客戶服務力度。在資產管理業務條線，資管子公司按照「做大單品、做優產品、做實收益、做專投研、做好服務」的要求，加快推進高質量發展；公募基金子公司積極把握市場機遇，繼續保持良好的發展態勢；私募股權投資基金子公司積極推進基金募集設立工作，並穩步推進基金「募投管退」全流程管理。在國際業務與租賃業務條線，海通國際繼續保持香港市場領先地位；海通銀行跨境和本地業務齊頭並進，澳門分行業務取得開門紅；海通恒信持續完善區域佈局，並加大綠色租賃支持力度，不斷優化資產結構。

報告期內，本公司各個業務條線均取得穩健業績的同時，在管理工作方面，本公司進一步強化合規風控能力建設，加快數字化轉型步伐，深化人力資源組織保障，優化財資管理能力，通過管理賦能持續強化精耕細作助力本公司在「一個海通」理念下的健康發展。

## 第三節 董事會報告

2022年下半年，本公司將堅持穩中求進工作總基調，統籌疫情防控和經營發展，全面推進各項經營管理工作的開展，具體的業務重點包括：投資銀行業務條線，將聚焦服務國家戰略，繼續深化投行一體化建設，並帶動「投、融、保、研」和財富管理業務全面發展；財富管理條線，將進一步完善產品銷售體系，深耕高淨值客戶的財富管理需求；交易及機構業務條線，將繼續加快提升主動投資管理能力，強化持牌機構服務能力，並推動打造交易、結算、託管、投研、代銷一站式的機構主經紀商服務；資產管理業務條線，將加強投研體系建設，加大投研隊伍的培養，引進優秀投研人才，提升產品獲客能力；私募股權投資及直投業務條線，將圍繞重點區域產業發展和頭部產業資本，發起設立新基金，並進一步加大對戰略新興產業的研究和投資力度；海外業務條線，將繼續強化集團間各業務線協同聯動，並積極投身粵港澳大灣區、珠三角地區發展建設；融資租賃業務條線，將立足租賃主業，持續優化資產結構。與此同時，本公司2022年下半年還將圍繞高質量的合規風控、科技運營、黨建和文化建設、人力資源管理等體系建設，提升管理工作效能，護航本公司高質量發展。

## 第四節 公司治理

### 一、股東大會情況簡介

| 會議屆次            | 召開日期       | 決議刊登的指定網站的<br>查詢索引   | 決議刊登的<br>披露日期            | 會議決議                     |
|-----------------|------------|--|--------------------------|--------------------------|
| 2021年股東<br>週年大會 | 2022年6月21日 | <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a><br><a href="http://www.hkexnews.hk">http://www.hkexnews.hk</a> | 2022年6月22日<br>2022年6月21日 | 詳見下文「股東<br>週年大會情況<br>說明」 |

註：上述會議決議公告請參閱會議當日的香港聯交所披露易網站，次日的上交所網站、《中國證券報》《上海證券報》《證券時報》和《證券日報》及本公司網站。

#### 表決權恢復的優先股股東請求召開股東特別大會

✓不適用

#### 股東週年大會情況說明

本報告期內，本公司於2022年6月21日在海通證券大廈召開了2021年股東週年大會，審議並通過11項議案：1.審議及批准本公司2021年度董事會工作報告；2.審議及批准本公司2021年度監事會工作報告；3.審議及批准本公司2021年年度報告；4.審議及批准本公司2021年度財務決算報告；5.審議及批准本公司2021年度利潤分配預案；6.審議及批准本公司關於續聘2022年度會計師事務所的議案；7.審議及批准關於預計本公司2022年度自營投資業務配置規模的議案；8.審議及批准關於預計本公司2022年度日常關聯／連交易的議案；9.關於本公司發行境內外債務融資工具一般性授權的議案；10.審議及批准關於修訂《公司章程》及其附件的議案；及11.審議及批准關於授予董事會認可、分配或發行A股及／或H股股份的一般性授權的議案。其中議案1至議案8為普通決議案，議案9至議案11為特別決議案。相關決議公告於會議當日刊登在香港聯交所披露易網站(<http://www.hkexnews.hk>)，於會議次日刊登於上交所網站(<http://www.sse.com.cn>)、《中國證券報》《上海證券報》《證券時報》和《證券日報》。

## 第四節 公司治理

### 二、本公司董事、監事、高級管理人員變動情況

| 姓名  | 擔任的職務     | 變動情形     |
|-----|-----------|----------|
| 王建業 | 合規總監      | 離任（年齡原因） |
| 李海超 | 副總經理、合規總監 | 聘任       |

#### 本公司董事、監事、高級管理人員變動的情況說明

茲提述本公司日期為2022年3月3日的《海外監管公告》，本公司召開的第七屆董事會第二十四次會議（臨時會議）審議通過了《關於聘任公司副總經理及合規總監的議案》，同意聘任李海超先生擔任本公司副總經理及合規總監職務，本公司原合規總監王建業先生因年齡原因不再擔任合規總監職務。李海超先生擔任本公司副總經理及合規總監的任期自2022年3月3日起至第七屆董事會任期屆滿之日止。

### 三、本公司董事、監事、高級管理人員及員工其他情況說明

#### （一）董事、監事及有關僱員之證券交易

本公司已採納《標準守則》所訂標準作為本公司董事、監事及相關僱員進行證券交易的行為準則。本公司經查詢全體董事及監事後，已確認他們於本公司2022年1月1日起至6月30日期間一直遵守上述《標準守則》的要求。本公司沒有發現有關僱員違反指引。

## 第四節 公司治理

### (二) 董事、監事相關信息的重大變更

非執行董事屠旋旋先生自2022年1月起擔任上海隧道工程股份有限公司(該公司於上交所上市, 股票代碼為600820)董事。

獨立非執行董事林家禮先生自2022年6月起不再擔任麥格里集團亞洲區高級顧問。林先生自2021年5月起擔任香港航天科技集團有限公司(該公司於香港聯交所上市, 股份代號: 1725)之非執行董事, 並於2022年1月起調任為執行董事; 自2022年6月起擔任仁恒實業控股有限公司(該公司於香港聯交所上市, 股份代號: 3628)獨立非執行董事。

非執行董事許建國先生自2022年6月不再擔任上海亥雅實業有限公司董事長、上海開亥實業有限公司董事長、上海電氣集團置業有限公司監事。許先生自2022年1月起不再擔任上海電氣控股集團有限公司(原稱: 上海電氣(集團)總公司)財務預算部部長, 調任上海電氣控股集團有限公司董事、副總裁、財務總監; 自2022年6月起擔任上海電氣香港有限公司董事長。

職工代表監事武向陽先生自2022年5月起擔任海通恒信監事會主席。

除上述披露者外, 概無其他本公司之董事及監事的資料須根據香港上市規則第13.51B(1)條予以披露。

### (三) 董事、監事服務合約的說明

根據香港上市規則第19A.54及19A.55條, 本公司已與各董事及監事就(其中包括)遵守相關法律及法規和遵從本公司章程及仲裁條文訂立合約。除上述披露者外, 本公司與本公司任何董事或監事以其各自作為董事/監事的身份而言, 並無訂立亦不擬訂立任何服務合約(於一年內屆滿或可由僱主於一年內終止而毋須支付賠償(不包括法定賠償)的合約除外)。

## 第四節 公司治理

### （四）員工及薪酬政策

截至報告期末，本集團僱員人數11,852人。其中本公司僱員人數6,292人，子公司僱員人數5,560人。

本公司重視人才的吸引、激勵、培養和保留，不斷檢視和優化本公司薪酬體系，堅持市場化分配、績效導向、兼顧公平的激勵原則。本公司僱員薪酬由固定薪酬、績效薪酬和福利三部分構成。依據適用的中國法律法規，本公司為僱員建立各項社會保險（養老保險、醫療保險、失業保險、工傷保險及生育保險）、住房公積金，並依據法規足額繳納上述各項社會保險費和住房公積金。本公司建立企業年金計劃，為僱員提供補充養老保障，並為僱員投保補充醫療保險和人身意外保險。

根據適用的中國法律法規，本公司與每位僱員簽訂勞動合同，建立勞動關係。勞動合同包含關於合同期限、工作時間和休息休假、勞動報酬和保險福利、勞動保護和勞動條件、合同的變更及解除等條款。

### （五）員工培訓

2022年上半年，本公司員工培訓工作堅持統籌管理、共建共享，依托海通財富研修院，持續推進數字化學習，構建學習型組織，助力本公司人才發展。持續優化培訓項目，強化新員工文化認同和合規理念，完善學習形式，推動新員工實現「公司融入、文化融合、團隊融洽、職業融通」的學習目標；不斷完善課程體系，通過快閃課程、認證課程等新模式，加強課程體系精準化、定制化，實現應學盡學、隨需隨學；積極強化部門協同，開通直播課堂頻道，協同各部門推出業務熱點、智慧運營、合規內控等系列直播，緊扣監管政策，緊跟市場熱點，賦能業務發展；高效發揮平台效應，借助海通財富研修院，推出「培」伴系列模塊，通過財富講堂、主題活動、課程上新、好書共讀、直播互動等形式，助力海通員工持續成長。

## 第四節 公司治理

### 四、利潤分配或資本公積金轉增預案

#### (一) 報告期實施的利潤分配方案的執行或調整情況

本公司於2022年6月21日召開2021年股東週年大會，審議通過了本公司2021年度利潤分配預案：以截至2021年12月31日本公司A股和H股總股本共計13,064,200,000股為基數，向全體股東每股派發現金紅利人民幣0.30元(含稅)，共計派發現金紅利人民幣3,919,260,000.00元(含稅)；其中A股股本為9,654,631,180股，本次共計派發A股現金紅利人民幣2,896,389,354.00元；H股股本為3,409,568,820股，本次共計派發H股現金紅利港幣1,194,322,859.85元。

本公司在《中國證券報》《上海證券報》《證券時報》《證券日報》、上交所網站、香港聯交所披露易網站及本公司網站刊登了2021年度利潤分配實施的有關公告，並於2022年7月28日實施完畢。

#### (二) 半年度擬定的利潤分配預案、公積金轉增股本預案

|         |   |
|---------|---|
| 是否分配或轉增 | 否 |
|---------|---|

### 五、本公司股權激勵計劃、員工持股計劃或其他員工激勵措施的情況及其影響

報告期內，本公司未實行股權激勵計劃。

#### 海通國際購股權計劃

於2015年6月8日(「採納日期」)，海通國際股東批准採納一項新購股權計劃(「2015年購股權計劃」)。2015年購股權計劃主要條款的概要根據上市規則的規定披露如下：

#### 2015年購股權計劃的目的：

計劃旨在吸引、挽留及鼓勵具才幹的僱員致力達成海通國際所設定的長期表現目標，讓他們有機會獲得海通國際的股權，使他們的利益與海通國際利益相符一致，從而進一步激勵他們更努力為海通國際利益作出貢獻。

## 第四節 公司治理

### 2015年購股權計劃參與人士：

海通國際董事會全權認為對海通國際作出貢獻的海通國際（基於聘用或訂約或義務安排委聘而不論有薪或無薪）任何海通國際董事（不論執行或非執行亦不論獨立與否）或僱員（不論全職或兼職）。

根據2015年購股權計劃可供發行的股份總數及於本中期報告日期佔海通國際已發行股本的百分比：

根據2015年購股權計劃及海通國際任何其他購股權計劃而將授出的所有購股權獲行使時可能發行的股份總數，合共不得超逾212,924,439股（「計劃上限」），佔2014年11月30日（即海通國際管理層暫定批准2015年購股權計劃當日）海通國際已發行股份約10%。在採納日期起計12個月的期間及往後每個自前一個採納日期周年日起計12個月的期間（該等12個月期間在下文各稱為「計劃年度」），每計劃年度授予的購股權獲行使時可能發行的海通國際股份總數不得超逾21,292,444股（「年度上限」）。海通國際可不時於各自的股東大會上尋求海通國際股東及本公司股東（只要海通國際為根據上市規則規定為海通證券附屬公司）批准更新計劃上限及／或年度上限，但海通國際董事根據2015年購股權計劃而可能授出的購股權所涉及的海通國際股份總數，(i)計劃上限不得超逾批准更新當日海通國際已發行股本的10%；及(ii)年度上限不得超逾批准更新當日海通國際已發行股本的1%。當計算該等經更新上限時，先前根據2015年購股權計劃及海通國際任何其他購股權計劃授出的購股權（包括該等尚未行使、已註銷、已失效或已行使的購股權）將不會計算在內。儘管有本段以上所述規定，根據2015年購股權計劃及海通國際任何其他購股權計劃已授出但尚未行使的購股權若獲悉數行使，因此而可予發行的海通國際股份的最高數目，不得超過海通國際不時已發行股份總數30%（或上市規則可能容許的較高百分比）。

於海通國際2021年年報刊發日期，根據2015年購股權計劃可供發行的股份總數為170,498,869股，佔海通國際於當日已發行股本約2.82%。

## 第四節 公司治理

### **2015年購股權計劃項下各參與人士的最高配額：**

於任何12個月期間，各參與者根據2015年購股權計劃及海通國際任何其他購股權計劃獲授予的購股權（包括已行使及尚未行使的購股權）獲行使而已發行及將予發行的最高股份數目，不得超過海通國際已發行股份總數1%。如欲進一步授出超越此限額的任何購股權，須獲海通國際股東於股東大會上批准。向海通國際董事、主要行政人員或主要股東或其任何聯繫人士授出購股權，須事先獲海通國際獨立非執行董事批准。此外，向海通國際主要股東或獨立非執行董事或其任何聯繫人士授出任何購股權，如於任12個月期間內，超過於海通國際董事會作出授出購股權建議之日海通國際已發行股份總數的0.1%，及總值（按海通國際股份於董事會作出授出購股權建議之日的收市價計算）超過500萬港元，均須事先獲得股東在海通國際股東大會上批准，而所有海通國際的關連人士應放棄投票表決（除任何可在該股東大會就有關決議案投反對票的關連人士除外，惟其投反對票的意願須已載於致海通國際股東的通函當中並已遵守相關上市規則）。

### **根據購股權須認購股份的期間及購股權可予行使前必須持有的最短期間：**

購股權的行使期限由海通國際董事會釐定，在授出購股權的6個月期限後，該購股權可於授出購股權日期起計5年內行使。

### **申請或接納購股權時應付的款項及必須或可能須繳付款項或催繳款項或就此而須償還貸款的期間：**

承讓人須於建議授出日期起計28日內繳付1港元代價以接納獲授購股權的建議。

### **釐定行使價的基準：**

購股權的行使價由海通國際董事會釐定，不得少於下列各項的最高數值：(i)相當於海通國際股份在要約日期於聯交所每日報價表所示的收市價的110%的價格；(ii)海通國際股份於緊接要約日期前5個營業日於聯交所每日報價表所示的平均收市價；及(iii)海通國際股份的面值。

### **2015年購股權計劃尚餘年期：**

2015年購股權計劃將由海通國際股東於股東大會上以海通國際決議案有條件地採納計劃當日起計10年期間內有效及生效，並將於2025年6月7日屆滿。

## 第四節 公司治理

截至2021年12月31日止年度，根據2015年購股權計劃的購股權變動載列如下：

| 參與者的姓名或類別               | 購股權數目          |         |       |       |                    |                    | 海通國際股價***        |              |                            |                      |                        |                        |
|-------------------------|----------------|---------|-------|-------|--------------------|--------------------|------------------|--------------|----------------------------|----------------------|------------------------|------------------------|
|                         | 於2021年<br>1月1日 | 於年內授出   | 於年內調整 | 於年內行使 | 於年內註銷              | 於年內失效              | 於2021年<br>12月31日 | 購股權<br>授出日期* | 購股權行使期限                    | 購股權<br>行使價**<br>每股港元 | 緊接購股權<br>授出日期前<br>每股港元 | 緊接購股權<br>行使日期前<br>每股港元 |
| <b>海通國際董事</b>           |                |         |       |       |                    |                    |                  |              |                            |                      |                        |                        |
| 霍秋平<br>(於2021年10月19日辭任) | 501,146        | -       | -     | -     | -                  | (501,146)<br>(附註2) | -                | 2018年11月1日   | 2019年5月28日-<br>2023年10月31日 | 2.898                | 2.56                   | 不適用                    |
|                         | 501,146        | -       | -     | -     | -                  | (501,146)<br>(附註2) | -                | 2019年5月31日   | 2019年12月27日-<br>2024年5月30日 | 2.554                | 2.39                   | 不適用                    |
|                         | 500,000        | -       | -     | -     | -                  | 500,000<br>(附註2)   | -                | 2020年5月29日   | 2020年12月25日-<br>2025年5月28日 | 1.727                | 1.55                   | 不適用                    |
|                         | -              | 500,000 | -     | -     | (500,000)<br>(附註1) | -                  | -                | 2021年7月21日   | 2022年2月17日-<br>2026年7月20日  | 2.398                | 2.16                   | 不適用                    |
| 林涌                      | 807,116        | -       | -     | -     | -                  | (807,116)<br>(附註3) | -                | 2016年5月12日   | 2016年12月8日-<br>2021年5月11日  | 4.635                | 4.25                   | 不適用                    |
|                         | 805,672        | -       | -     | -     | -                  | -                  | 805,672          | 2017年11月10日  | 2018年6月7日-<br>2022年11月9日   | 5.002                | 4.58                   | 不適用                    |
|                         | 1,804,127      | -       | -     | -     | -                  | -                  | 1,804,127        | 2018年11月1日   | 2019年5月28日-<br>2023年10月31日 | 2.898                | 2.56                   | 不適用                    |
|                         | 902,064        | -       | -     | -     | -                  | -                  | 902,064          | 2019年5月31日   | 2019年12月27日-<br>2024年5月30日 | 2.554                | 2.39                   | 不適用                    |
|                         | 900,000        | -       | -     | -     | -                  | -                  | 900,000          | 2020年5月29日   | 2020年12月25日-<br>2025年5月28日 | 1.727                | 1.55                   | 不適用                    |
|                         | -              | 900,000 | -     | -     | -                  | -                  | 900,000          | 2021年7月21日   | 2022年2月17日-<br>2026年7月20日  | 2.398                | 2.16                   | 不適用                    |
| 李建國                     | 605,334        | -       | -     | -     | -                  | (605,334)<br>(附註3) | -                | 2016年5月12日   | 2016年12月8日-<br>2021年5月11日  | 4.635                | 4.25                   | 不適用                    |
|                         | 302,127        | -       | -     | -     | -                  | -                  | 302,127          | 2017年11月10日  | 2018年6月7日-<br>2022年11月9日   | 5.002                | 4.58                   | 不適用                    |
|                         | 300,689        | -       | -     | -     | -                  | -                  | 300,689          | 2018年11月1日   | 2019年5月28日-<br>2023年10月31日 | 2.898                | 2.56                   | 不適用                    |
|                         | 150,343        | -       | -     | -     | -                  | -                  | 150,343          | 2019年5月31日   | 2019年12月27日-<br>2024年5月30日 | 2.554                | 2.39                   | 不適用                    |
|                         | 200,000        | -       | -     | -     | -                  | -                  | 200,000          | 2020年5月29日   | 2020年12月25日-<br>2025年5月28日 | 1.727                | 1.55                   | 不適用                    |
|                         | -              | 200,000 | -     | -     | -                  | -                  | 200,000          | 2021年7月21日   | 2022年2月17日-<br>2026年7月20日  | 2.398                | 2.16                   | 不適用                    |
| 潘慕堯                     | 706,224        | -       | -     | -     | -                  | (706,224)<br>(附註3) | -                | 2016年5月12日   | 2016年12月8日-<br>2021年5月11日  | 4.635                | 4.25                   | 不適用                    |
|                         | 302,127        | -       | -     | -     | -                  | -                  | 302,127          | 2017年11月10日  | 2018年6月7日-<br>2022年11月9日   | 5.002                | 4.58                   | 不適用                    |
|                         | 701,604        | -       | -     | -     | -                  | -                  | 701,604          | 2018年11月1日   | 2019年5月28日-<br>2023年10月31日 | 2.898                | 2.56                   | 不適用                    |
|                         | 350,802        | -       | -     | -     | -                  | -                  | 350,802          | 2019年5月31日   | 2019年12月27日-<br>2024年5月30日 | 2.554                | 2.39                   | 不適用                    |
|                         | 350,000        | -       | -     | -     | -                  | -                  | 350,000          | 2020年5月29日   | 2020年12月25日-<br>2025年5月28日 | 1.727                | 1.55                   | 不適用                    |
|                         | -              | 400,000 | -     | -     | -                  | -                  | 400,000          | 2021年7月21日   | 2022年2月17日-<br>2026年7月20日  | 2.398                | 2.16                   | 不適用                    |

## 第四節 公司治理

| 參與者的姓名或類別     | 購股權數目          |         |       |       |       |                    | 海通國際股價***        |              |                            |                      |                        |                        |
|---------------|----------------|---------|-------|-------|-------|--------------------|------------------|--------------|----------------------------|----------------------|------------------------|------------------------|
|               | 於2021年<br>1月1日 | 於年內授出   | 於年內調整 | 於年內行使 | 於年內註銷 | 於年內失效              | 於2021年<br>12月31日 | 購股權<br>授出日期* | 購股權行使期限                    | 購股權<br>行使價**<br>每股港元 | 緊接購股權<br>授出日期前<br>每股港元 | 緊接購股權<br>行使日期前<br>每股港元 |
| <b>海通國際董事</b> |                |         |       |       |       |                    |                  |              |                            |                      |                        |                        |
| 孫劍峰           | 504,446        | -       | -     | -     | -     | (504,446)<br>(附註3) | -                | 2016年5月12日   | 2016年12月8日-<br>2021年5月11日  | 4.635                | 4.25                   | 不適用                    |
|               | 503,545        | -       | -     | -     | -     | -                  | 503,545          | 2017年11月10日  | 2018年6月7日-<br>2022年11月9日   | 5.002                | 4.58                   | 不適用                    |
|               | 1,202,751      | -       | -     | -     | -     | -                  | 1,202,751        | 2018年11月1日   | 2019年5月28日-<br>2023年10月31日 | 2.898                | 2.56                   | 不適用                    |
|               | 601,375        | -       | -     | -     | -     | -                  | 601,375          | 2019年5月31日   | 2019年12月27日-<br>2024年5月30日 | 2.554                | 2.39                   | 不適用                    |
|               | 600,000        | -       | -     | -     | -     | -                  | 600,000          | 2020年5月29日   | 2020年12月25日-<br>2025年5月28日 | 1.727                | 1.55                   | 不適用                    |
|               | -              | 600,000 | -     | -     | -     | -                  | 600,000          | 2021年7月21日   | 2022年2月17日-<br>2026年7月20日  | 2.398                | 2.16                   | 不適用                    |
| 孫彤            | 504,446        | -       | -     | -     | -     | (504,446)<br>(附註3) | -                | 2016年5月12日   | 2016年12月8日-<br>2021年5月11日  | 4.635                | 4.25                   | 不適用                    |
|               | 503,545        | -       | -     | -     | -     | -                  | 503,545          | 2017年11月10日  | 2018年6月7日-<br>2022年11月9日   | 5.002                | 4.58                   | 不適用                    |
|               | 1,002,293      | -       | -     | -     | -     | -                  | 1,002,293        | 2018年11月1日   | 2019年5月28日-<br>2023年10月31日 | 2.898                | 2.56                   | 不適用                    |
|               | 501,146        | -       | -     | -     | -     | -                  | 501,146          | 2019年5月31日   | 2019年12月27日-<br>2024年5月30日 | 2.554                | 2.39                   | 不適用                    |
|               | 600,000        | -       | -     | -     | -     | -                  | 600,000          | 2020年5月29日   | 2020年12月25日-<br>2025年5月28日 | 1.727                | 1.55                   | 不適用                    |
|               | -              | 600,000 | -     | -     | -     | -                  | 600,000          | 2021年7月21日   | 2021年2月17日-<br>2026年7月20日  | 2.398                | 2.16                   | 不適用                    |
| 鄭志明           | 302,664        | -       | -     | -     | -     | (302,664)<br>(附註3) | -                | 2016年5月12日   | 2016年12月8日-<br>2021年5月11日  | 4.635                | 4.25                   | 不適用                    |
|               | 302,127        | -       | -     | -     | -     | -                  | 302,127          | 2017年11月10日  | 2018年6月7日-<br>2022年11月9日   | 5.002                | 4.58                   | 不適用                    |
|               | 300,689        | -       | -     | -     | -     | -                  | 300,689          | 2018年11月1日   | 2019年5月28日-<br>2023年10月31日 | 2.898                | 2.56                   | 不適用                    |
|               | 150,343        | -       | -     | -     | -     | -                  | 150,343          | 2019年5月31日   | 2019年12月27日-<br>2024年5月30日 | 2.554                | 2.39                   | 不適用                    |
|               | 150,000        | -       | -     | -     | -     | -                  | 150,000          | 2020年5月29日   | 2020年12月25日-<br>2025年5月28日 | 1.727                | 1.55                   | 不適用                    |
|               | -              | 200,000 | -     | -     | -     | -                  | 200,000          | 2021年7月21日   | 2022年2月17日-<br>2026年7月20日  | 2.398                | 2.16                   | 不適用                    |
| 張信軍           | 504,446        | -       | -     | -     | -     | (504,446)<br>(附註3) | -                | 2016年5月12日   | 2016年12月8日-<br>2021年5月11日  | 4.635                | 4.25                   | 不適用                    |
|               | 503,545        | -       | -     | -     | -     | -                  | 503,545          | 2017年11月10日  | 2018年6月7日-<br>2022年11月9日   | 5.002                | 4.58                   | 不適用                    |
|               | 1,002,293      | -       | -     | -     | -     | -                  | 1,002,293        | 2018年11月1日   | 2019年5月28日-<br>2023年10月31日 | 2.898                | 2.56                   | 不適用                    |
|               | 300,688        | -       | -     | -     | -     | -                  | 300,688          | 2019年5月31日   | 2019年12月27日-<br>2024年5月30日 | 2.554                | 2.39                   | 不適用                    |
|               | 200,000        | -       | -     | -     | -     | -                  | 200,000          | 2020年5月29日   | 2020年12月25日-<br>2025年5月28日 | 1.727                | 1.55                   | 不適用                    |
|               | -              | 200,000 | -     | -     | -     | -                  | 200,000          | 2021年7月21日   | 2022年2月17日-<br>2026年7月20日  | 2.398                | 2.16                   | 不適用                    |

## 第四節 公司治理

| 參與者的姓名或類別               | 購股權數目          |         |       |           |       |           | 海通國際股價***        |              |                            |                      |                        |                        |
|-------------------------|----------------|---------|-------|-----------|-------|-----------|------------------|--------------|----------------------------|----------------------|------------------------|------------------------|
|                         | 於2021年<br>1月1日 | 於年內授出   | 於年內調整 | 於年內行使     | 於年內註銷 | 於年內失效     | 於2021年<br>12月31日 | 購股權<br>授出日期* | 購股權行使期限                    | 購股權<br>行使價**<br>每股港元 | 緊接購股權<br>授出日期前<br>每股港元 | 緊接購股權<br>行使日期前<br>每股港元 |
| <b>海通國際董事</b>           |                |         |       |           |       |           |                  |              |                            |                      |                        |                        |
| 尹錦滔                     | 300,689        | -       | -     | -         | -     | -         | 300,689          | 2018年11月1日   | 2019年5月28日-<br>2023年10月31日 | 2.898                | 2.56                   | 不適用                    |
|                         | 150,343        | -       | -     | -         | -     | -         | 150,343          | 2019年5月31日   | 2019年12月27日-<br>2024年5月30日 | 2.554                | 2.39                   | 不適用                    |
|                         | 150,000        | -       | -     | -         | -     | -         | 150,000          | 2020年5月29日   | 2020年12月25日-<br>2025年5月28日 | 1.727                | 1.55                   | 不適用                    |
|                         | -              | 150,000 | -     | -         | -     | -         | 150,000          | 2021年7月21日   | 2022年2月17日-<br>2026年7月20日  | 2.398                | 2.16                   | 不適用                    |
| 劉瑞隆<br>(於2021年5月28日獲委任) | -              | 150,000 | -     | -         | -     | -         | 150,000          | 2021年7月21日   | 2022年2月17日-<br>2026年7月20日  | 2.398                | 2.16                   | 不適用                    |
| 張化橋<br>(於2021年5月28日獲委任) | -              | 150,000 | -     | -         | -     | -         | 150,000          | 2021年7月21日   | 2022年2月17日-<br>2026年7月20日  | 2.398                | 2.16                   | 不適用                    |
| 曾偉<br>(於2021年5月28日辭任)   | 302,664        | -       | -     | -         | -     | (302,664) | -                | 2016年5月12日   | 2016年12月8日-<br>2021年5月11日  | 4.635                | 4.25                   | 不適用                    |
|                         | 302,127        | -       | -     | -         | -     | (302,127) | -                | 2017年11月10日  | 2018年6月7日-<br>2022年11月9日   | 5.002                | 4.58                   | 不適用                    |
|                         | 300,689        | -       | -     | -         | -     | (300,689) | -                | 2018年11月1日   | 2019年5月28日-<br>2023年10月31日 | 2.898                | 2.56                   | 不適用                    |
|                         | 150,343        | -       | -     | -         | -     | (150,343) | -                | 2019年5月31日   | 2019年12月27日-<br>2024年5月30日 | 2.554                | 2.39                   | 不適用                    |
|                         | 150,000        | -       | -     | -         | -     | (150,000) | -                | 2020年5月29日   | 2020年12月25日-<br>2025年5月28日 | 1.727                | 1.55                   | 不適用                    |
| 徐震全<br>(於2021年5月28日退任)  | 302,664        | -       | -     | -         | -     | (302,664) | -                | 2016年5月12日   | 2016年12月8日-<br>2021年5月11日  | 4.635                | 4.25                   | 不適用                    |
|                         | 302,127        | -       | -     | -         | -     | (302,127) | -                | 2017年11月10日  | 2018年6月7日-<br>2022年11月9日   | 5.002                | 4.58                   | 不適用                    |
|                         | 300,689        | -       | -     | -         | -     | (300,689) | -                | 2018年11月1日   | 2019年5月28日-<br>2023年10月31日 | 2.898                | 2.56                   | 不適用                    |
|                         | 150,343        | -       | -     | -         | -     | (150,343) | -                | 2019年5月31日   | 2019年12月27日-<br>2024年5月30日 | 2.554                | 2.39                   | 不適用                    |
|                         | 150,000        | -       | -     | -         | -     | (150,000) | -                | 2020年5月29日   | 2020年12月25日-<br>2025年5月28日 | 1.727                | 1.55                   | 不適用                    |
| 劉偉彪<br>(於2021年5月28日退任)  | 302,664        | -       | -     | -         | -     | (302,664) | -                | 2016年5月12日   | 2016年12月8日-<br>2021年5月11日  | 4.635                | 4.25                   | 不適用                    |
|                         | 302,127        | -       | -     | -         | -     | (302,127) | -                | 2017年11月10日  | 2018年6月7日-<br>2022年11月9日   | 5.002                | 4.58                   | 不適用                    |
|                         | 300,689        | -       | -     | -         | -     | (300,689) | -                | 2018年11月1日   | 2019年5月28日-<br>2023年10月31日 | 2.898                | 2.56                   | 不適用                    |
|                         | 150,343        | -       | -     | -         | -     | (150,343) | -                | 2019年5月31日   | 2019年12月27日-<br>2024年5月30日 | 2.554                | 2.39                   | 不適用                    |
|                         | 150,000        | -       | -     | (150,000) | -     | -         | -                | 2020年5月29日   | 2020年12月25日-<br>2025年5月28日 | 1.727                | 1.55                   | 2.58                   |

## 第四節 公司治理

| 參與者的姓名或類別              | 購股權數目          |            |       |             |           |              | 海通國際股價***        |              |                            |                      |                        |                        |
|------------------------|----------------|------------|-------|-------------|-----------|--------------|------------------|--------------|----------------------------|----------------------|------------------------|------------------------|
|                        | 於2021年<br>1月1日 | 於年內授出      | 於年內調整 | 於年內行使       | 於年內註銷     | 於年內失效        | 於2021年<br>12月31日 | 購股權<br>授出日期* | 購股權行使期限                    | 購股權<br>行使價**<br>每股港元 | 緊接購股權<br>授出日期前<br>每股港元 | 緊接購股權<br>行使日期前<br>每股港元 |
| <b>海通國際董事</b>          |                |            |       |             |           |              |                  |              |                            |                      |                        |                        |
| 魏國強<br>(於2021年5月28日退任) | 302,664        | -          | -     | -           | -         | (302,664)    | -                | 2016年5月12日   | 2016年12月8日-<br>2021年5月11日  | 4.635                | 4.25                   | 不適用                    |
|                        | 302,127        | -          | -     | -           | -         | (302,127)    | -                | 2017年11月10日  | 2018年6月7日-<br>2022年11月9日   | 5.002                | 4.58                   | 不適用                    |
|                        | 300,689        | -          | -     | -           | -         | (300,689)    | -                | 2018年11月1日   | 2019年5月28日-<br>2023年10月31日 | 2.898                | 2.56                   | 不適用                    |
|                        | 150,343        | -          | -     | -           | -         | (150,343)    | -                | 2019年5月31日   | 2019年12月27日-<br>2024年5月30日 | 2.554                | 2.39                   | 不適用                    |
|                        | 150,000        | -          | -     | (150,000)   | -         | -            | -                | 2020年5月29日   | 2020年12月25日-<br>2025年5月28日 | 1.727                | 1.55                   | 2.21                   |
| 劉鵬<br>(於2021年8月25日辭任)  | 300,689        | -          | -     | -           | -         | (300,689)    | -                | 2018年11月1日   | 2019年5月28日-<br>2023年10月31日 | 2.898                | 2.56                   | 不適用                    |
|                        | 150,343        | -          | -     | -           | -         | (150,343)    | -                | 2019年5月31日   | 2019年12月27日-<br>2024年5月30日 | 2.554                | 2.39                   | 不適用                    |
|                        | 150,000        | -          | -     | (150,000)   | -         | -            | -                | 2020年5月29日   | 2020年12月25日-<br>2025年5月28日 | 1.727                | 1.55                   | 2.27                   |
|                        | -              | 150,000    | -     | -           | -         | (150,000)    | -                | 2021年7月21日   | 2022年2月17日-<br>2026年7月20日  | 2.398                | 2.16                   | 不適用                    |
| 合計                     | 26,956,219     | 4,200,000  | -     | (450,000)   | (500,000) | (10,561,292) | 19,644,927       |              |                            |                      |                        |                        |
| 海通國際持續合約僱員             | 7,465,648      | -          | -     | -           | -         | (7,465,648)  | -                | 2016年5月12日   | 2016年12月8日-<br>2021年5月11日  | 4.635                | 4.25                   | 不適用                    |
|                        | 6,646,799      | -          | -     | -           | -         | (3,323,403)  | 3,323,396        | 2017年11月10日  | 2018年6月7日-<br>2022年11月9日   | 5.002                | 4.58                   | 不適用                    |
|                        | 8,990,559      | -          | -     | -           | -         | (4,480,243)  | 4,510,316        | 2018年11月1日   | 2019年5月28日-<br>2023年10月31日 | 2.898                | 2.56                   | 不適用                    |
|                        | 5,798,274      | -          | -     | -           | -         | (2,565,872)  | 3,232,402        | 2019年5月31日   | 2019年12月27日-<br>2024年5月30日 | 2.554                | 2.39                   | 不適用                    |
|                        | 6,245,000      | -          | -     | (1,300,000) | -         | (750,000)    | 4,195,000        | 2020年5月29日   | 2020年12月25日-<br>2025年5月28日 | 1.727                | 1.55                   | 2.297                  |
|                        | -              | 6,445,000  | -     | -           | (300,000) | (500,000)    | 5,645,000        | 2021年7月21日   | 2022年2月17日-<br>2026年7月20日  | 2.398                | 2.16                   | 不適用                    |
| 合計                     | 35,146,280     | 6,445,000  | -     | (1,300,000) | (300,000) | (19,085,166) | 20,906,114       |              |                            |                      |                        |                        |
|                        | 62,102,499     | 10,645,000 | -     | (1,750,000) | (800,000) | (29,646,458) | 40,551,041       |              |                            |                      |                        |                        |

## 第四節 公司治理

- \* 購股權的歸屬期由授出日期起計，至行使期開始為止。上述所有購股權的歸屬期均為6個月。
- \*\* 若海通國際股本因供股或發行紅股或其他類似事項而出現變動，購股權行使價可予調整。
- \*\*\* 上表所披露於緊接購股權授出日期前的海通國際股價，乃緊接購股權授出日期前一個交易日的香港聯交所收市價格。上表披露於緊接購股權行使日期前的海通國際股價，乃香港聯交所收市價相對於披露範圍內所有購股權行使的加權平均價。

附註：

1. 該等購股權於2021年12月31日止年度因授出之購股權未獲接納而失效。
2. 由於海通國際董事及／或海通國際員工辭任，該等購股權已於截至2021年12月31日止年度註銷或失效。
3. 由於行使期到期，該等購股權已於2021年12月31日止年度失效。

## 第四節 公司治理

截至2022年6月30日止六個月期間，2015年購股權計劃項下的購股權的變動載列如下：

| 參與者的姓名或類別     | 購股權數目          |       |                  |       |       | 於2022年<br>6月30日 | 購股權授出日期*    | 購股權行使期限                | 海通國際股價***            |                        |                        |
|---------------|----------------|-------|------------------|-------|-------|-----------------|-------------|------------------------|----------------------|------------------------|------------------------|
|               | 於2022年<br>1月1日 | 於期內授出 | 於期內調整            | 於期內行使 | 於期內失效 |                 |             |                        | 購股權<br>行使價**<br>每股港元 | 緊接購股權<br>授出日期前<br>每股港元 | 緊接購股權<br>行使日期前<br>每股港元 |
| <b>海通國際董事</b> |                |       |                  |       |       |                 |             |                        |                      |                        |                        |
| 林涌            | 805,672        | -     | 80,568<br>(附註1)  | -     | -     | 886,240         | 2017年11月10日 | 2018年6月7日-2022年11月9日   | 4.547<br>(附註1)       | 4.58                   | 不適用                    |
|               | 1,804,127      | -     | 180,412<br>(附註1) | -     | -     | 1,984,539       | 2018年11月1日  | 2019年5月28日-2023年10月31日 | 2.635<br>(附註1)       | 2.56                   | 不適用                    |
|               | 902,064        | -     | 90,206<br>(附註1)  | -     | -     | 992,270         | 2019年5月31日  | 2019年12月27日-2024年5月30日 | 2.322<br>(附註1)       | 2.39                   | 不適用                    |
|               | 900,000        | -     | 90,000<br>(附註1)  | -     | -     | 990,000         | 2020年5月29日  | 2020年12月25日-2025年5月28日 | 1.570<br>(附註1)       | 1.55                   | 不適用                    |
|               | 900,000        | -     | 90,000<br>(附註1)  | -     | -     | 990,000         | 2021年7月21日  | 2022年2月17日-2026年7月20日  | 2.180<br>(附註1)       | 2.16                   | 不適用                    |
| 李建國           | 302,127        | -     | 30,212<br>(附註1)  | -     | -     | 332,339         | 2017年11月10日 | 2018年6月7日-2022年11月9日   | 4.547<br>(附註1)       | 4.58                   | 不適用                    |
|               | 300,689        | -     | 30,068<br>(附註1)  | -     | -     | 330,757         | 2018年11月1日  | 2019年5月28日-2023年10月31日 | 2.635<br>(附註1)       | 2.56                   | 不適用                    |
|               | 150,343        | -     | 15,034<br>(附註1)  | -     | -     | 165,377         | 2019年5月31日  | 2019年12月27日-2024年5月30日 | 2.322<br>(附註1)       | 2.39                   | 不適用                    |
|               | 200,000        | -     | 20,000<br>(附註1)  | -     | -     | 220,000         | 2020年5月29日  | 2020年12月25日-2025年5月28日 | 1.570<br>(附註1)       | 1.55                   | 不適用                    |
|               | 200,000        | -     | 20,000<br>(附註1)  | -     | -     | 220,000         | 2021年7月21日  | 2022年2月17日-2026年7月20日  | 2.180<br>(附註1)       | 2.16                   | 不適用                    |
| 潘慕堯           | 302,127        | -     | 30,212<br>(附註1)  | -     | -     | 332,339         | 2017年11月10日 | 2018年6月7日-2022年11月9日   | 4.547<br>(附註1)       | 4.58                   | 不適用                    |
|               | 701,604        | -     | 70,160<br>(附註1)  | -     | -     | 771,764         | 2018年11月1日  | 2019年5月28日-2023年10月31日 | 2.635<br>(附註1)       | 2.56                   | 不適用                    |
|               | 350,802        | -     | 35,081<br>(附註1)  | -     | -     | 385,883         | 2019年5月31日  | 2019年12月27日-2024年5月30日 | 2.322<br>(附註1)       | 2.39                   | 不適用                    |
|               | 350,000        | -     | 35,000<br>(附註1)  | -     | -     | 385,000         | 2020年5月29日  | 2020年12月25日-2025年5月28日 | 1.570<br>(附註1)       | 1.55                   | 不適用                    |
|               | 400,000        | -     | 40,000<br>(附註1)  | -     | -     | 440,000         | 2021年7月21日  | 2022年2月17日-2026年7月20日  | 2.180<br>(附註1)       | 2.16                   | 不適用                    |

## 第四節 公司治理

| 參與者的姓名或類別     | 購股權數目          |       |                  |       |       | 海通國際股價***       |             |                        |                      |                        |                        |
|---------------|----------------|-------|------------------|-------|-------|-----------------|-------------|------------------------|----------------------|------------------------|------------------------|
|               | 於2022年<br>1月1日 | 於期內授出 | 於期內調整            | 於期內行使 | 於期內失效 | 於2022年<br>6月30日 | 購股權授出日期*    | 購股權行使期限                | 購股權<br>行使價**<br>每股港元 | 緊接購股權<br>授出日期前<br>每股港元 | 緊接購股權<br>行使日期前<br>每股港元 |
| <b>海通國際董事</b> |                |       |                  |       |       |                 |             |                        |                      |                        |                        |
| 孫劍峰           | 503,545        | -     | 50,354<br>(附註1)  | -     | -     | 553,899         | 2017年11月10日 | 2018年6月7日-2022年11月9日   | 4.547<br>(附註1)       | 4.58                   | 不適用                    |
|               | 1,202,751      | -     | 120,275<br>(附註1) | -     | -     | 1,323,026       | 2018年11月1日  | 2019年5月28日-2023年10月31日 | 2.635<br>(附註1)       | 2.56                   | 不適用                    |
|               | 601,375        | -     | 60,137<br>(附註1)  | -     | -     | 661,512         | 2019年5月31日  | 2019年12月27日-2024年5月30日 | 2.322<br>(附註1)       | 2.39                   | 不適用                    |
|               | 600,000        | -     | 60,000<br>(附註1)  | -     | -     | 660,000         | 2020年5月29日  | 2020年12月25日-2025年5月28日 | 1.570<br>(附註1)       | 1.55                   | 不適用                    |
|               | 600,000        | -     | 60,000<br>(附註1)  | -     | -     | 660,000         | 2021年7月21日  | 2022年2月17日-2026年7月20日  | 2.180<br>(附註1)       | 2.16                   | 不適用                    |
| 孫彤            | 503,545        | -     | 50,354<br>(附註1)  | -     | -     | 553,899         | 2017年11月10日 | 2018年6月7日-2022年11月9日   | 4.547<br>(附註1)       | 4.58                   | 不適用                    |
|               | 1,002,293      | -     | 100,229<br>(附註1) | -     | -     | 1,102,522       | 2018年11月1日  | 2019年5月28日-2023年10月31日 | 2.635<br>(附註1)       | 2.56                   | 不適用                    |
|               | 501,146        | -     | 50,114<br>(附註1)  | -     | -     | 551,260         | 2019年5月31日  | 2019年12月27日-2024年5月30日 | 2.322<br>(附註1)       | 2.39                   | 不適用                    |
|               | 600,000        | -     | 60,000<br>(附註1)  | -     | -     | 660,000         | 2020年5月29日  | 2020年12月25日-2025年5月28日 | 1.570<br>(附註1)       | 1.55                   | 不適用                    |
|               | 600,000        | -     | 60,000<br>(附註1)  | -     | -     | 660,000         | 2021年7月21日  | 2022年2月17日-2026年7月20日  | 2.180<br>(附註1)       | 2.16                   | 不適用                    |
| 鄭志明           | 302,127        | -     | 30,212<br>(附註1)  | -     | -     | 332,339         | 2017年11月10日 | 2018年6月7日-2022年11月9日   | 4.547<br>(附註1)       | 4.58                   | 不適用                    |
|               | 300,689        | -     | 30,068<br>(附註1)  | -     | -     | 330,757         | 2018年11月1日  | 2019年5月28日-2023年10月31日 | 2.635<br>(附註1)       | 2.56                   | 不適用                    |
|               | 150,343        | -     | 15,034<br>(附註1)  | -     | -     | 165,377         | 2019年5月31日  | 2019年12月27日-2024年5月30日 | 2.322<br>(附註1)       | 2.39                   | 不適用                    |
|               | 150,000        | -     | 15,000<br>(附註1)  | -     | -     | 165,000         | 2020年5月29日  | 2020年12月25日-2025年5月28日 | 1.570<br>(附註1)       | 1.55                   | 不適用                    |
|               | 200,000        | -     | 20,000<br>(附註1)  | -     | -     | 220,000         | 2021年7月21日  | 2022年2月17日-2026年7月20日  | 2.180<br>(附註1)       | 2.16                   | 不適用                    |

## 第四節 公司治理

| 參與者的姓名或類別     | 購股權數目          |       |                  |       |       | 海通國際股價***       |             |                        |                        |                        |     |
|---------------|----------------|-------|------------------|-------|-------|-----------------|-------------|------------------------|------------------------|------------------------|-----|
|               | 於2022年<br>1月1日 | 於期內授出 | 於期內調整            | 於期內行使 | 於期內失效 | 於2022年<br>6月30日 | 購股權授出日期*    | 購股權<br>行使價**<br>每股港元   | 緊接購股權<br>授出日期前<br>每股港元 | 緊接購股權<br>行使日期前<br>每股港元 |     |
| <b>海通國際董事</b> |                |       |                  |       |       |                 |             |                        |                        |                        |     |
| 張信軍           | 503,545        | -     | 50,354<br>(附註1)  | -     | -     | 553,899         | 2017年11月10日 | 2018年6月7日-2022年11月9日   | 4.547<br>(附註1)         | 4.58                   | 不適用 |
|               | 1,002,293      | -     | 100,229<br>(附註1) | -     | -     | 1,102,522       | 2018年11月1日  | 2019年5月28日-2023年10月31日 | 2.635<br>(附註1)         | 2.56                   | 不適用 |
|               | 300,688        | -     | 30,068<br>(附註1)  | -     | -     | 330,756         | 2019年5月31日  | 2019年12月27日-2024年5月30日 | 2.322<br>(附註1)         | 2.39                   | 不適用 |
|               | 200,000        | -     | 20,000<br>(附註1)  | -     | -     | 220,000         | 2020年5月29日  | 2020年12月25日-2025年5月28日 | 1.570<br>(附註1)         | 1.55                   | 不適用 |
|               | 200,000        | -     | 20,000<br>(附註1)  | -     | -     | 220,000         | 2021年7月21日  | 2022年2月17日-2026年7月20日  | 2.180<br>(附註1)         | 2.16                   | 不適用 |
| 尹錦滔           | 300,689        | -     | 30,068<br>(附註1)  | -     | -     | 330,757         | 2018年11月1日  | 2019年5月28日-2023年10月31日 | 2.635<br>(附註1)         | 2.56                   | 不適用 |
|               | 150,343        | -     | 15,034<br>(附註1)  | -     | -     | 165,377         | 2019年5月31日  | 2019年12月27日-2024年5月30日 | 2.322<br>(附註1)         | 2.39                   | 不適用 |
|               | 150,000        | -     | 15,000<br>(附註1)  | -     | -     | 165,000         | 2020年5月29日  | 2020年12月25日-2025年5月28日 | 1.570<br>(附註1)         | 1.55                   | 不適用 |
|               | 150,000        | -     | 15,000<br>(附註1)  | -     | -     | 165,000         | 2021年7月21日  | 2022年2月17日-2026年7月20日  | 2.180<br>(附註1)         | 2.16                   | 不適用 |
| 劉瑞隆           | 150,000        | -     | 15,000<br>(附註1)  | -     | -     | 165,000         | 2021年7月21日  | 2022年2月17日-2026年7月20日  | 2.180<br>(附註1)         | 2.16                   | 不適用 |
| 張化橋           | 150,000        | -     | 15,000<br>(附註1)  | -     | -     | 165,000         | 2021年7月21日  | 2022年2月17日-2026年7月20日  | 2.180<br>(附註1)         | 2.16                   | 不適用 |
| 合計            | 19,644,927     | -     | 1,964,483        | -     | -     | 21,609,410      |             |                        |                        |                        |     |

## 第四節 公司治理

| 參與者的姓名或類別  | 購股權數目          |       |                  |       |                    | 於2022年<br>6月30日 | 購股權授出日期*    | 購股權行使期限                | 海通國際股價***            |                        |                        |
|------------|----------------|-------|------------------|-------|--------------------|-----------------|-------------|------------------------|----------------------|------------------------|------------------------|
|            | 於2022年<br>1月1日 | 於期內授出 | 於期內調整            | 於期內行使 | 於期內失效              |                 |             |                        | 購股權<br>行使價**<br>每股港元 | 緊接購股權<br>授出日期前<br>每股港元 | 緊接購股權<br>行使日期前<br>每股港元 |
| 海通國際持續合約僱員 |                |       |                  |       |                    |                 |             |                        |                      |                        |                        |
|            | 3,323,396      | -     | 307,165<br>(附註1) | -     | (251,772)<br>(附註2) | 3,378,789       | 2017年11月10日 | 2018年6月7日-2022年11月9日   | 4.547<br>(附註1)       | 4.58                   | 不適用                    |
|            | 4,510,316      | -     | 442,015<br>(附註1) | -     | (90,206)<br>(附註2)  | 4,862,125       | 2018年11月1日  | 2019年5月28日-2023年10月31日 | 2.635<br>(附註1)       | 2.56                   | 不適用                    |
|            | 3,232,402      | -     | 315,725<br>(附註1) | -     | (75,173)<br>(附註2)  | 3,472,954       | 2019年5月31日  | 2019年12月27日-2024年5月30日 | 2.322<br>(附註1)       | 2.39                   | 不適用                    |
|            | 4,195,000      | -     | 409,500<br>(附註1) | -     | (210,000)<br>(附註2) | 4,394,500       | 2020年5月29日  | 2020年12月25日-2025年5月28日 | 1.570<br>(附註1)       | 1.55                   | 不適用                    |
|            | 5,645,000      | -     | 559,500<br>(附註1) | -     | (105,000)<br>(附註2) | 6,099,500       | 2021年7月21日  | 2022年2月17日-2026年7月20日  | 2.180<br>(附註1)       | 2.16                   | 不適用                    |
| 合計         | 20,906,114     | -     | 2,033,905        | -     | (732,151)          | 22,207,868      |             |                        |                      |                        |                        |
|            | 40,551,041     | -     | 3,998,388        | -     | (732,151)          | 43,817,278      |             |                        |                      |                        |                        |

\* 購股權的歸屬期由授出日期起計，至行使期開始為止。上述所有購股權的歸屬期均為6個月。

\*\* 若海通國際股本因供股或發行紅股或其他類似事項而出現變動，購股權行使價可予調整。

\*\*\* 上表所披露於緊接購股權授出日期前的海通國際股價，乃緊接購股權授出日期前一個交易日的聯交所收市價格。上表披露於緊接購股權行使日期前的海通國際股價，乃聯交所收市價相對於披露範圍內所有購股權行使的加權平均價。

附註：

1. 因應海通國際於2022年6月23日發行紅股，購股權的行使價及數目於同日起獲調整。
2. 由於員工辭任，該等購股權已於截至2022年6月30日止六個月失效。

## 第四節 公司治理

### 六、本公司治理的其他情況

報告期內，本公司經營和管理規範有序，符合《上市公司治理準則》《證券公司治理準則》《證券公司監督管理條例》以及中國證監會相關法律法規的要求，同時，於報告期內及截至本報告日期，本公司遵守《守則》，全面遵循《守則》中的所有守則條文（如適用），並符合其中所列明的絕大多數建議最佳常規條文的要求。

報告期內，本公司召開股東大會1次，董事會6次，監事會2次，審計委員會3次，獨立董事年報工作會議2次，提名與薪酬考核委員會1次，發展戰略與ESG管理委員會4次，合規與風險管理委員會2次，共計21次會議。

報告期內，本公司根據中共上海市國有資產監督管理委員會、上海市國有資產監督管理委員會聯合印發的《關於印發〈市國資委監管企業主要負責人履行推進法治建設第一責任人職責規定〉的通知》（滬國資黨委[2021]121號），中國證券監督管理委員會公佈的《上市公司章程指引（2022年修訂）》《上市公司股東大會規則（2022年修訂）》，上海證券交易所發佈的《上海證券交易所股票上市規則（2022年1月修訂）》《上海證券交易所上市公司自律監管指引第1號—規範運作》，中國證券監督管理委員會、中國銀行保險監督管理委員會聯合公佈的《證券投資基金託管業務管理辦法》等相關規定，結合本公司的實際情況對現行《公司章程》中的相關條款進行修訂，同時對應修訂了章程的附件《海通證券股份有限公司股東大會議事規則》《海通證券股份有限公司董事會議事規則》《海通證券股份有限公司監事會議事規則》。本次修訂主要涉及公司的經營宗旨、股東大會及董監事會職責和審議程序、定期報告的報送規定等內容。上述章程修訂的議案已經2022年6月21日召開的本公司2021年度股東週年大會審議通過，具體修訂情況詳見本公司日期為2022年5月20日的《2021年度股東週年大會通函》。所修訂的《公司章程》自本公司2021年股東週年大會決議通過之日起生效。

## 第四節 公司治理

### （一）關於股東和股東大會

本公司嚴格按照《公司章程》和《公司股東大會議事規則》的要求召集、召開股東大會，確保所有股東享有平等地位，能夠充分行使自己的權利。

### （二）關於董事和董事會

本公司嚴格按照《公司章程》的規定聘任和變更董事，董事人數構成和任職資格符合法律、法規的要求。截至2022年6月30日，本公司董事會由11名董事組成，其中執行董事3名，分別為：周杰先生、李軍先生及任澎先生；非執行董事4名，分別為：屠旋旋先生、周東輝先生、余莉萍女士及許建國先生；獨立非執行董事4名，分別為：張鳴先生、林家禮先生、朱洪超先生及周宇先生。各位董事能夠勤勉盡責地履行職責，維護本公司和全體股東的利益。董事會下設發展戰略與ESG管理委員會、審計委員會、合規與風險管理委員會及提名與薪酬考核委員會，各委員會分工明確，權責分明，有效運作，四個委員會中，發展戰略與ESG管理委員會主席由董事長周杰先生擔任，合規與風險管理委員會主席由執行董事李軍先生擔任，另兩個委員會的主席均由獨立非執行董事擔任。

董事會設有審計委員會，符合中國證監會、上交所的有關規定及香港上市規則第三章的規定，成員有五名，包括張鳴先生（主席）、余莉萍女士、許建國先生、林家禮先生和周宇先生。審計委員會主要負責本公司內、外部審計的溝通、監督及核查等工作，並向董事會提供專業意見。審計委員會已審閱並確認本集團截至2022年6月30日六個月的中期業績及半年度財務報告，未對本集團所採用的會計政策及常規提出異議。

### （三）關於監事和監事會

截至2022年6月30日，監事會由八名監事組成，其中職工代表監事三名，非職工代表監事五名，人員任職資格和構成符合法律、法規的要求。本公司監事能夠勤勉盡責地履行職責，本着對股東負責的精神，對本公司財務、董事會成員以及高級管理人員履行職責的合法合規性進行監督，並就有關事項向董事會和高級管理層提出建議和改進意見。

## 第四節 公司治理

### (四) 關於高級管理層

本公司高級管理層產生的程序符合《公司法》和《公司章程》的規定，本公司高級管理層能夠依照法律、法規和董事會的授權，依法合規經營，努力實現股東利益和社會效益的最大化。

### (五) 關於相關利益者

本公司充分尊重和維護相關利益者的合法權益，共同推進本公司持續健康發展。

### (六) 關於信息披露和投資者關係管理

報告期內，本公司能夠嚴格按照中國大陸和香港兩個上市地的法律、法規及相關規範性文件的要求，真實、準確、完整、及時、公平地披露本公司的信息，能夠嚴格按照《公司內幕信息知情人登記制度》的有關規定，加強對公司內幕信息的管理，做好內幕信息知情人登記工作。

2022年上半年，在疫情防控的特殊時期，本公司積極響應監管部門號召，以「網絡直播+電話會議」的形式組織2021年度業績發佈會，會議面向全市場投資者，進一步提升了投資者的參會體驗、擴大了發佈會的覆蓋面及影響力，本公司提前發佈業績說明會公告並徵集投資者關注問題，本公司董事長、總經理等高級管理人員出席會議，對投資者提問予以詳細解答。本公司日常通過電話、網絡平台等線上方式，及時有效地向資本市場傳導本公司發展戰略和經營業績，並多次受邀參加境內外投行、券商舉辦的策略會。本公司高度重視中小投資者溝通和維護工作，耐心回覆投資者問詢，回答上交所e互動平台153個問題，接聽投資者熱線近500起。同時，本公司積極發揮投資者關係工作雙向傳導作用，及時將投資者建議反饋至經營層及相關部門，推動本公司形成更加關注市場表現、更加注重價值創造的氛圍。

## 第四節 公司治理

報告期內參加境內外投行策略會、投資論壇、電話會議情況如下：

| 會議            | 接待時間       | 接待方式 | 調研對象                          | 溝通內容                  |
|---------------|------------|------|-------------------------------|-----------------------|
| 申萬宏源2022夏季策略會 | 2022年6月2日  | 電話   | 申萬宏源、景順長城基金、泰康養老、工銀瑞信基金等(24人) | 本公司發展戰略、業務開展情況、財務指標解讀 |
| 花旗大中華金融會議     | 2022年1月11日 | 電話   | 花旗銀行等(5人)                     |                       |
| 天風證券2022春季策略會 | 2022年2月24日 | 電話   | 天風證券、鵬華基金等(15人)               |                       |
| 國泰君安電話調研會     | 2022年4月21日 | 電話   | 國泰君安(3人)                      |                       |
| 美銀美林金融論壇      | 2022年5月12日 | 電話   | 美銀美林等(8人)                     |                       |

### (七) 合規體系建設

報告期內，本公司嚴格按照中國證監會的要求，結合自身實際情況，不斷完善本公司合規管理。本公司合規總監嚴格依法履行合規管理職責。本公司股東、董事和高級管理人員未發生違反規定的職責和程序直接向合規總監下達指令或者干涉其工作的情形。本公司為合規總監全面履職和合規管理提供了人力、物力、財力和技術支持，為合規管理提供了保障。報告期內，本公司加強合規審查、合規檢查、合規監測等基礎職能履行，穩步有序開展合規管理基礎工作。同時，本公司確定2022年為「合規內控文化建設年」，在本集團範圍內全面推進合規內控文化建設，貫徹「全員合規、合規從管理層做起、合規創造價值、合規是公司生存基礎」的合規理念，遵循「人員為抓手、問題為導向、長效機制為保障」的原則，重點抓好培訓宣導、反洗錢工作、隊伍建設、問題查擺、制度執行等五大核心工作，推動本公司建立健全合規內控長效機制，逐步實現本公司合規內控體系提檔升級。

## 第五節 環境與社會責任

### 一、環境信息情況

#### (一) 屬於環境保護部門公佈的重點排污單位的本公司及其主要子公司的環保情況說明

✓不適用

#### (二) 重點排污單位之外的公司的環保情況說明

##### 1. 因環境問題受到行政處罰的情況

經核查，本公司及子公司不屬於環境保護部門公佈的重點排污單位。

本集團嚴格遵守《中華人民共和國環境保護法》《中華人民共和國水污染防治法》《中華人民共和國大氣污染防治法》等環保方面的法律法規，報告期內未出現因違反環保相關法規而受到處罰的情況。

##### 2. 參照重點排污單位披露其他環境信息

✓不適用

##### 3. 未披露其他環境信息的原因

✓不適用

#### (三) 報告期內披露環境信息內容的後續進展或變化情況的說明

✓不適用

#### (四) 有利於保護生態、防治污染、履行環境責任的相關信息

本公司持續推進ESG管理體系建設，成立ESG建設領導小組及工作小組，逐步建立起由本公司董事會、管理層及相關部門共同參與的ESG工作模式；研究制定《海通證券「十四五」期間助力碳達峰碳中和行動方案》，夯實綠色發展的能力。本公司嚴格遵守《中華人民共和國環境保護法》《中華人民共和國水污染防治法》《中華人民共和國大氣污染防治法》等法律法規，通過系列舉措提升全體員工節約環保意識，倡導綠色生活方式，踐行可持續發展理念。

## 第五節 環境與社會責任

本公司鼓勵員工節約用水，優先採購節水器具，發現跑冒滴漏後及時維修，下班後由巡視員檢查關閉水龍頭，避免水資源浪費；同時，本公司嚴格按照《上海市生活垃圾管理條例》對廢棄物進行分類處理，對於辦公及生活垃圾，由本公司物業統一收集後進行清運；對於電子廢棄物、硒鼓墨盒、碳粉盒等有害廢棄物，本公司設置定點存放，定期委託有資質的公司進行回收處置；合理做好公司餐廳食材及設備管理，減少冷庫發動機啟動次數，降低能源消耗。

此外，隨着信息技術水平的不斷提升，本公司借助協同辦公系統、RPA智能流程自動化機器人、投行類業務工作底稿管理系統、場外衍生品管理系統、智能審核系統等，營造信息化、無紙化的辦公模式，在提升工作效率的同時，減少紙張等的使用。

報告期內，本公司推進企業數字化辦公服務，啟用電子印章，實現全程網辦，助力實現電子化審批，全面保障本公司公文流轉報送及各業務條線工作的高效推進。辦公系統日均在線超過3,000人，其中移動端日均在線超過400人；視頻會議總共召開約2,000場，總共線上會議時長約6,300小時；在線總計處理各類流程業務單140萬餘次。本公司智能審核系統於報告期累計完成2,600餘篇文檔審核、90餘萬項數據檢查，節省人工近60%的覆核時間，同時將傳統的線下審核場景線上化，每個項目減少近1,000張打印文檔。

## 第五節 環境與社會責任

### (五) 在報告期內為減少其碳排放所採取的措施及效果

作為金融服務企業，本公司碳排放的主要來源為日常運營過程中耗電、天然氣以及公務用車耗油產生的碳排放。報告期內，本公司大力推行節能減排措施，以實際行動踐行環保理念。

在辦公過程中，本公司倡導合理用電，夏天空調溫度不低於26℃，冬天不高於20℃；辦公設備未使用時設置休眠，避免燈光及辦公設備的無效運作；定期保養自有車輛，以保障車輛性能，提高汽油利用率，逐步更新購買新能源汽車，減少廢氣排放；合理利用視頻會議系統，減少差旅出行頻次，降低因差旅產生的溫室氣體排放；合理擺放辦公區域綠色植被，根據不同植物屬性實現淨化空氣、吸收有害氣體、減少電子產品產生的電磁輻射等效果；製作「以儉修身低碳生活從我做起」主題海報，並擺放於員工辦公區域，將可持續發展理念根植於員工心中。

與此同時，本公司積極響應《關於加強綠色數據中心建設的指導意見》，加快綠色數據中心建設。數據中心充分利用雲計算、虛擬化技術的優勢，將規模化和智能化有序結合，建設的混合金融雲平台具有智能按需配置、動態管控資源的特點，可以最大化利用硬件平台的各類資源，進一步降低設備能耗。

截至報告期末，混合金融雲平台桌面雲使用了82台計算資源主機節點，運行桌面虛擬機5,000個，半年實現節電約56.1萬度；測試雲和生產雲平台共使用宿主機約600台，運行虛擬機5,500餘台，半年節約用電約247.5萬度。

此外，本公司張江數據中心採用水冷系統供冷，並配置制冷量大小不等的1台螺桿式冷水機組及2台離心式冷水機組，在不同IT負載情況下，可選擇最優方式開啟對應的冷水機組節能運行。系統配置了2台換熱量為5,800KW的板式熱交換器，冬季低溫環境下，可充分利用自然冷源節能運行。同時，系統中冷卻塔、冷卻水泵、冷凍水泵均配置了變頻器，可根據IT負載，通過水冷群控系統，實時調整運行頻率，節能用電約24.1萬度。

## 第五節 環境與社會責任

### 二、鞏固拓展脫貧攻堅成果、鄉村振興等工作具體情況

2022年上半年，在中國證監會、上海市委、市政府的正確領導下，本公司克服疫情困難，持續開展「一司一縣」、「百企幫百村」結對幫扶工作，助力安徽利辛、安徽舒城、江西寧都、雲南西疇、新疆葉城等五個脫貧縣鞏固脫貧攻堅成果，積極開展援藏援疆工作，紮實做好上海市農村綜合幫扶和城鄉黨組織結對幫扶工作。本公司結合「3.5學雷鋒」日，開展「喜迎二十大 海通志願行」系列活動，努力解決幫扶地區群眾實際問題，推動區域經濟提升，實現結對鄉村地區實現高質量發展。

#### （一）多措並舉，深入開展結對幫扶支援工作

##### 1. 項目導向，持續做好幫扶支援工作

本公司以項目建設為導向，依托分支機構，持續加強與安徽利辛、安徽舒城、江西寧都、雲南西疇、新疆葉城等結對縣的溝通交流，繼續投入幫扶資金助力結對幫扶縣產業項目建設。雲南分公司黨總支與西疇縣雞街鄉、董馬鄉黨組織達成黨建聯建簽約意向，並支持兩縣建設黨建活動陣地。江西分公司黨總支組織志願者赴寧都縣面向縣屬國有企業、鄉鎮單位開展金融培訓。子公司海通期貨黨委開展「共期美好」鄉村振興項目，與黑龍江省大慶市林甸縣人民政府簽訂鄉村振興框架協議，投入專項幫扶資金助力黑龍江省佳木斯市湯原縣太平川鄉文化廣場建設及路燈安裝，並積極謀劃推動當地農林種養、鄉村旅遊、光伏項目、農村小水電建設等鄉村振興項目。

##### 2. 金融賦能，為幫扶縣注入發展動力

2022年，本公司作為主承銷商成功發行2022年第一期寧都縣城市發展投資有限公司公司債券，發行規模人民幣4億元，募集資金主要用於寧都縣現代農業的重點項目——高標準大棚蔬菜產業基地建設，助力寧都縣三農產業結構升級。

## 第五節 環境與社會責任

### 3. 消費助力，將幫扶工作融入企業文化建設

2022年以來，本公司通過上海市消費幫扶渠道採購雲南省特色滇紅茶作為本公司禮品，傳遞「愛在海通」公益品牌理念，累計投入人民幣106.74萬元。子公司海通期貨充分發揮工會優勢，自2019年起，每年採購結對幫扶地區黑龍江樺川縣星火大米。2022年1月，海通期貨採購該地特色農產品星火大米人民幣13.25萬元，助力當地農戶增收。

### 4. 播撒愛心，認真落實「愛在海通」公益清單

2022年3月，本公司啟動「喜迎二十大海通志願行」系列公益項目，充分利用組織覆蓋「點多面廣」的特點，組織本公司系統全體黨工團組織認真落實「愛在海通」公益清單項目。依托本公司國家級投資者教育基地平台優勢，本公司各級黨團組織走進幫扶地區開展投教活動，幫助結對幫扶地區幹部群眾提升金融素養、增強防範金融風險意識。持續推進「海通·愛朗讀」第三季推普助力鄉村振興公益項目，該項目於2021年10月啟動，受疫情影響，500套「海通·愛朗讀」愛心盲盒和1,100個普通話魔法盒終於在2022年5月陸續運抵海拔近4,000米的西藏日喀則市，全部贈送給日喀則市上海實驗學校小學部的學生；近3萬冊愛心圖書及紅色音頻課堂在2022年6月陸續運抵新疆喀什地區葉城縣、麥蓋提縣、西藏日喀則市的幼兒園和中小學，累計覆蓋約22,000名學生。此外，本公司持續在新疆莎車縣和麥蓋提縣開展「愛在海通·美麗新疆」助學助教項目。本公司連續第四年在西藏日喀則市開展「愛在海通·美麗西藏」項目，累計結對70名藏族大學生，支持他們完成大學四年本科學業。本公司各級黨團組織主動關心學生，定期回訪，幫助他們更好融入大學生活。首批資助的30名學生已於今年6月大學畢業。

## 第五節 環境與社會責任

### （二）攜手共進，積極參與農村綜合幫扶、城鄉黨組織結對幫扶工作

#### 1. 聚焦重點產業，助力崇明區新一輪發展振興

本公司立足專業優勢，有效配置工作力量和幫扶資金，紮實開展綜合幫扶和城鄉黨組織結對幫扶工作。自2013年以來，本公司每年向崇明區投入人民幣500萬元幫扶資金，2022年上半年完成撥付專項資金人民幣500萬元。10年來累計投入幫扶資金人民幣5,000萬元，支持崇明區推進實施長興海洋科技港一期、二期等重點「造血」項目建設。

#### 2. 入戶慰問，志願送暖，傳遞結對幫扶真情真意

本公司黨委始終關心關注結對地區人民生活、幫助困難群眾解決難題。2022年2月，本公司黨委領導帶隊赴崇明開展走訪慰問活動，為結對幫扶的富安村困難家庭送去慰問金和慰問品，並向長期合作的陽光中心社工代表、結對青少年送上慰問禮包和關心祝福。本公司黨委下屬八家黨團組織也定期前往結對村鎮黨組織開展入戶慰問。疫情期間，本公司還將「一個海通青春戰疫」系列線上活動與幫扶工作有機結合，邀請金山區、崇明區的100名困難青少年參加線上心理健康講座、「彩虹課堂」財商課等，幫助孩子們舒緩壓力、應對疫情、增長知識。

## 第五節 環境與社會責任

### (三) 全力抗疫，彰顯金融國企社會責任與擔當

2022年上半年，新一輪新冠疫情先後在全國多地高位流行，本公司各級黨組織和全體黨員幹部職工，積極投身疫情防控，累計捐贈抗疫資金及物資人民幣1,352.8萬元。面對嚴峻的疫情防控形勢，本公司黨委第一時間向廣大黨組織和黨員幹部員工發出抗疫倡議，並組建了2,000餘人的抗疫志願服務隊。在本公司黨團組織的號召下，全體員工積極投身抗疫志願服務，截至2022年6月底，累計參與抗疫志願服務近7,500人次。

下一步，本公司將繼續深入貫徹黨中央關於鞏固脫貧成果和鄉村振興的指示精神，認真履行金融國企職責使命，為助力鄉村振興戰略貢獻更大力量。同時，以「愛在海通」黨建公益品牌為引領，重點關注結對幫扶地區和邊疆民族地區，持續在教育幫扶領域發力，為促進民族團結、維護邊疆地區穩定發展貢獻力量。

## 第六節 重要事項

### 一、承諾事項履行情況

(一) 本公司實際控制人、股東、關聯方、收購人以及本公司等承諾相關方在報告期內或持續到報告期內的承諾事項

| 承諾背景      | 承諾類型 | 承諾方          | 承諾內容                      | 承諾時間及期限             | 是否有<br>履行期限 | 是否及時<br>嚴格履行 | 如未能及時           | 如未能及時          |
|-----------|------|--------------|---------------------------|---------------------|-------------|--------------|-----------------|----------------|
|           |      |              |                           |                     |             |              | 未履行應說明<br>的具體原因 | 履行應說明<br>下一步計劃 |
| 與再融資相關的承諾 | 股份限售 | 上海國盛(集團)有限公司 | 再融資認購的股份自發行結束之日起48個月內不得轉讓 | 自2020年8月5日起<br>48個月 | 是           | 是            | -               | -              |
|           | 股份限售 | 上海海煙投資管理有限公司 | 再融資認購的股份自發行結束之日起18個月內不得轉讓 | 自2020年8月5日起<br>18個月 | 是           | 是            | -               | -              |
|           | 股份限售 | 光明食品(集團)有限公司 | 再融資認購的股份自發行結束之日起18個月內不得轉讓 | 自2020年8月5日起<br>18個月 | 是           | 是            | -               | -              |
|           | 股份限售 | 上海電氣控股集團有限公司 | 再融資認購的股份自發行結束之日起18個月內不得轉讓 | 自2020年8月5日起<br>18個月 | 是           | 是            | -               | -              |

## 第六節 重要事項

| 承諾背景 | 承諾類型 | 承諾方       | 承諾內容  | 承諾時間及期限         | 是否有<br>履行期限 | 是否及時<br>嚴格履行 | 如未能及時<br>履行應說明 | 如未能及時<br>履行應說明 |
|------|------|-----------|---|-----------------|-------------|--------------|----------------|----------------|
|      |      |           |   |                 |             |              | 未完成履行<br>的具體原因 | 下一步計劃          |
| 其他   |      | 董事、高級管理人員 | 1. 承諾不無償或以不公平條件向其它單位或者個人輸送利益，也不採用其它方式損害公司利益；2. 承諾對職務消費行為進行約束；3. 承諾不動用本公司資產從事與其履行職責無關的投資、消費活動；4. 承諾由董事會或提名與薪酬考核委員會制定的薪酬制度與本公司填補回報措施的執行情況相掛鉤；5. 若本公司後續推出本公司重要交易和事項政策，承諾擬公佈的本公司股權激勵的行權條件與本公司填補回報措施的執行情況相掛鉤 | 作為公司董事、高級管理人員期間 | 是           | 是            | -              | -              |

## 第六節 重要事項

### 二、報告期內控股股東及其他關聯方非經營性佔用資金情況

✓不適用

### 三、違規擔保情況

✓不適用

### 四、半年報審計情況

✓不適用

### 五、上年年度報告非標準審計意見涉及事項的變化及處理情況

✓不適用

### 六、破產重整相關事項

✓不適用

## 第六節 重要事項

### 七、重大訴訟、仲裁事項

報告期內，本公司不存在《上交所上市規則》中要求披露的涉案金額超過人民幣1,000萬元並且佔本公司最近一期經審計淨資產絕對值10%以上的重大訴訟、仲裁事項。

自報告期初至本報告披露日，本集團尚未披露的新增(金額超過人民幣1億元)或已披露且有新進展的訴訟、仲裁事項如下：

#### 本公司與泰元擔保保證合同糾紛案

因案外人侯建芳未依約回購其質押股票，保證人河南泰元投資擔保有限公司(「泰元擔保」)應承擔保證責任，本公司向上海金融法院起訴，要求泰元擔保承擔本金人民幣10,691.08萬元以及相應的利息、違約金、債權實現費用等保證責任，2021年11月29日，上海金融法院正式受理本案，並於2022年2月23日開庭。2022年6月30日，上海金融法院作出一審判決，支持本公司訴訟請求。

#### 本公司與南一農公司、紅太陽集團、南京世界村質押式證券回購糾紛案

因南京第一農藥集團有限公司(「南一農公司」)拒絕依約履行股票質押購回義務，本公司向上海金融法院起訴，要求融資人南一農公司支付本金人民幣30,000萬元以及相應的利息、違約金、債權實現費用等，要求擔保人紅太陽集團有限公司(「紅太陽集團」)、南京世界村汽車動力有限公司(「南京世界村」)承擔保證責任。2020年5月19日，上海金融法院正式受理本案，並於2020年11月12日開庭，2021年4月上海金融法院作出一審判決，支持本公司訴訟請求。2021年6月南一農公司已被南京高淳區法院裁定破產重整，本公司已向南一農破產重整項目管理人申報債權，並參加了第一次債權人會議。2022年6月1日，南京高淳區法院出具《民事裁定書》，裁定對南一農公司、江蘇國星投資有限公司、南京蘇皖現代農業有限公司、江蘇蘇農農資連鎖集團股份有限公司進行實質合併重整。

## 第六節 重要事項

### 本公司與紅太陽集團、南一農公司、楊壽海、楊柳、南京振邦、江蘇振邦融資融券交易糾紛案

因紅太陽集團融資融券期限到期後未能按照《融資融券合同》約定按時歸還融資本金、證券及利息等相關費用，構成違約。本公司向上海金融法院起訴，要求融資人紅太陽集團支付融資負債本金人民幣25,771.18萬元以及相應的利息、違約金、債權實現費用等，並要求南一農公司、楊壽海、楊柳、南京振邦投資發展有限公司(「南京振邦」)、江蘇振邦農作物科技有限公司(「江蘇振邦」)承擔相應擔保責任。2021年1月13日，上海金融法院正式受理本案，並於2022年1月25日開庭審理。2022年1月30日，上海金融法院作出一審判決，支持本公司訴訟請求。

### 四川信託與海通資管、本公司等金融委託理財合同糾紛案

因金融委託理財合同糾紛，四川信託有限公司(「四川信託」)向四川省成都市中級人民法院起訴，要求海通資管公司、本公司等13個被告返還或賠償原告委託財產人民幣51,455萬元及相應利息。2021年9月13日，四川省成都市中級人民法院正式受理本案，目前尚未開庭。

### 郵儲銀行與富誠海富通等證券虛假陳述責任糾紛案

因「華泰美吉特燈都資產支持專項計劃」發生實質性違約，專項計劃持有人之一中國郵政儲蓄銀行股份有限公司(「郵儲銀行」)向上海金融法院起訴，要求原始權益人昆山美吉特燈都管理有限公司及包括上海富誠海富通資產管理有限公司(「富誠海富通」)在內的相關中介機構對其全部損失承擔連帶賠償責任，其訴請金額為本金人民幣52,657.98萬元以及相應的利息等。2020年11月12日，法院正式受理本案並進行了多次開庭，目前法院尚未作出一審判決。

## 第六節 重要事項

### 海通開元、西安航天新能源及上海文化與ChinaEdu Corporation及北京弘成股權轉讓協議爭議案

因ChinaEdu Corporation及北京弘成立業科技股份有限公司(「北京弘成」)拒絕依約履行股權回購義務，海通開元、西安航天新能源產業基金投資有限公司(「西安航天新能源」)及上海文化產業股權投資基金合夥企業(有限合夥)(「上海文化」)共同向中國國際經濟貿易仲裁委員會提交仲裁申請，要求ChinaEdu Corporation及北京弘成履行回購義務並支付股權回購價款，涉及本金金額合計人民幣2.5億元。2022年6月20日，中國國際經濟貿易仲裁委員會正式受理本案，目前尚未開庭。

上述案件中涉及的潛在損失已根據相關規定進行了充分計提。

### 海通資管與南一農公司質押式證券回購糾紛案

因南一農公司質押其持有的紅太陽(證券代碼：000525)股票並向海通資管管理的資管計劃融入資金，質押交易違約，海通資管向上海金融法院起訴，要求債務人支付本金人民幣32,000萬元以及相應的利息、違約金、債權實現費用等。2020年1月2日，法院正式受理該案件，2020年8月7日一審開庭，2020年12月31日，法院作出一審判決，支持海通資管訴訟請求。南一農公司後上訴至上海市高級人民法院，上海市高級人民法院已於2021年6月23日維持原判。南京市高淳區人民法院已於2021年6月3日受理南一農公司破產重整申請，法院已指定管理人。海通資管已代表資管計劃向管理人申報債權。2022年6月1日，南京高淳區法院出具《民事裁定書》，裁定對南一農公司、江蘇國星投資有限公司、南京蘇皖現代農業有限公司、江蘇蘇農農資連鎖集團股份有限公司進行實質合併重整。該案件涉及的潛在損失已在交易之前予以充分考慮，未來對本公司及海通資管的潛在損失風險較小。

除上述案件外，本集團內(除境外上市子公司)尚處於執行階段的案件共3起，涉及案件金額人民幣63,082.25萬元。本公司境外上市子公司的重大訴訟、仲裁事宜由其按照相關上市規則自行履行信息披露義務。

## 第六節 重要事項

### 八、上市公司及其董事、監事、高級管理人員、控股股東、實際控制人涉嫌違法違規、受到處罰及整改情況

- 1· 截至報告期末，本公司無控股股東且無實際控制人。
- 2· 報告期內，本公司及本公司董事、監事、高級管理人員、第一大股東不存在被有權機關調查、被司法機關或紀檢監察機關採取強制措施、被移送司法機關或追究刑事責任、被中國證監會立案調查或行政處罰、被採取市場禁入、被認定為不適當人選、被其他行政管理部門給予重大行政處罰以及被證券交易所公開譴責等情形。本公司董事、監事、高級管理人員不存在違反相關規定買賣公司股票的情形。
- 3· 報告期內，本公司存在以下被中國證監會或其派出機構採取行政監管措施、被交易所採取紀律處分的情況：

2022年1月，全國股轉公司出具《關於給予海通證券股份有限公司及相關責任主體紀律處分的決定》（[2022]1號），給予本公司通報批評的紀律處分。該監管函件認定本公司未按規定建立健全並有效執行持續督導工作制度。本公司收到該監管函件後，高度重視，中小企業融資部優化了持續督導流程，加固持續督導業務防線，在原有的覆核制度基礎上，設立獨立的督導覆核專崗，提高督導和信息披露質量。

## 第六節 重要事項

2022年6月，中國證監會出具《關於對海通證券股份有限公司採取責令改正措施的決定》([2022]25號)、《關於對任澎、王建業採取監管談話措施的決定》([2022]26號)，對本公司採取責令改正措施，對高級管理人員採取監管談話措施。該監管函認定本公司在境外子公司規範整改過程中，存在境外子公司未按規定履行備案程序、境外經營機構股權架構梳理及整改方案制定存在重大錯漏等情況。本公司收到該監管函後，高度重視，第一時間召開專題會議，統一思想、提高認識，對監管措施所提出的問題逐條研究與整改，嚴格遵循監管要求，優化完善子公司管理專項制度，建立健全子公司長效管控機制，加強對子公司的督導與綜合管理，強化子公司管理的責任約束與責任追究。

### 九、報告期內本公司及其控股股東、實際控制人誠信狀況的說明

截至報告期末，本公司無控股股東且無實際控制人。報告期內，本公司及第一大股東不存在未履行法院生效判決、不存在所負數額較大的債務到期未清償等情況。

### 十、重大關聯交易

#### (一) 與日常經營相關的關聯交易

本公司建立了基本完整的關聯／連交易制度體系，構建了較為科學完善的關聯／連交易組織管理框架，相關內部控制總體有效。本公司按照《公司法》《證券法》《上海證券交易所上市公司自律監管指引第5號—交易與關聯交易》《香港上市規則》《上交所上市規則》等相關法律和監管規則，依據《公司章程》《關聯交易管理辦法》《關聯(連)交易管理實施細則(試行)》等內部規章，嚴格履行關聯／連交易審議流程及信息披露要求，對各項業務的關聯／連交易形成了恰當的約束機制。

報告期內，本公司嚴格按照2021年股東週年大會審議通過的《關於預計公司2022年度日常關聯／連交易的議案》，開展日常關聯／連交易。

## 第六節 重要事項

本章節所載關聯／連交易的披露系依據《上交所上市規則》與香港上市規則確定，與財務報表附註中的關聯交易數額（依據企業會計準則編製）可能存在差異。本報告之合併財務報表附註62所載關聯方交易不構成香港上市規則第14A章項下本公司的關連交易，惟本公司與上海國盛集團及其聯繫人之關聯方交易構成香港上市規則第14A章項下之持續關連交易，本公司已遵守香港上市規則第14A章之要求。有關該等關連交易詳情，請參見本公司日期為2020年8月6日的持續關連交易公告。除上述關連交易外，報告期內，本公司概無根據香港上市規則第14A章的規定而須披露的任何關連交易。

相關執行情況如下：

### ➤ 香港上市規則項下的持續關連交易

茲提述本公司日期為2020年8月6日的關於持續關連交易的公告。截至報告期末，國盛集團直接及間接持有本公司10.38%權益。依據香港上市規則第14A.07條，國盛集團及其聯繫人構成本公司於香港上市規則項下之關連人士。本公司與上海國盛集團於2020年8月6日訂立持續關連交易框架協議，期限為自2020年8月6日起至2022年12月31日止。根據持續關連交易框架協議，本集團與上海國盛集團及其聯繫人將在日常業務過程中進行證券和金融產品交易以及證券和金融服務。

## 第六節 重要事項

報告期內本集團與上海國盛集團及其聯繫人之間涉及證券和金融產品交易及證券和金融服務相關的持續關連交易執行情況如下：

單位：萬元 幣種：人民幣

| 交易內容                                 | 截至2022年<br>6月30日 |                |
|--------------------------------------|------------------|----------------|
|                                      | 2022年度<br>預計交易上限 | 止六個月<br>實際發生金額 |
| <b>證券及金融產品交易</b>                     |                  |                |
| 流入 <sup>(1)</sup>                    | 290,000.00       | 6,154.66       |
| 流出 <sup>(2)</sup>                    | 540,000.00       | 2,788.94       |
| <b>證券及金融服務</b>                       |                  |                |
| 本集團向上海國盛集團及其聯繫人提供證券<br>和金融服務收取的收入總額  | 7,000.00         | 100.89         |
| 本集團接受上海國盛集團及其聯繫人提供證券<br>和金融服務產生的支出總額 | 2,000.00         | —              |

- (1) 「流入」是指本集團從證券和金融產品交易產生的現金流入總額，包括固定收益產品和權益類產品銷售、固定收益產品相關的衍生產品所得利息及通過融資交易的借入／購回所產生的現金流入總額。
- (2) 「流出」是指本集團從證券和金融產品交易產生的現金流出總額，包括固定收益產品及權益類產品購買、固定收益產品相關的衍生產品所付利息及通過融資交易的借出／買入返售所產生的現金流出總額。

## 第六節 重要事項

### ➤ 上交所上市規則項下的日常關聯交易

#### (1) 與上海國盛(集團)有限公司及上海國盛集團資產有限公司的關聯交易

單位：萬元 幣種：人民幣

| 交易內容               | 截至2022年<br>6月30日<br>止六個月<br>發生金額 | 佔同類交易<br>金額的比例(%) | 備註   |
|--------------------|----------------------------------|-------------------|--|
| 手續費及佣金收入           | 8.63                             | 0.00%             | 向關聯人收取的證券交易手續費及佣金收入                                |
| 利息淨收入              | 53.53                            | 0.02%             | 關聯人保證金產生的利息淨收入                                     |
| 衍生金融工具交易<br>淨損益(註) | 240.20                           | 0.24%             | 報告期內名義本金發生金額<br>人民幣0.571億元，期末名義<br>本金餘額人民幣0.571億元。 |

註：關聯人作為交易對手方與本公司進行衍生品交易產生的已實現及未實現投資收益。

單位：萬元 幣種：人民幣

| 往來項目    | 於2022年<br>6月30日餘額 | 佔同類交易<br>金額的比例(%) | 備註                         |
|---------|-------------------|-------------------|----------------------------|
| 應收款項    | 40.50             | 0.00%             | 應向關聯人收取的債券承銷<br>服務費餘額      |
| 代理買賣證券款 | 0.01              | 0.00%             | 關聯人存放公司的客戶保證金<br>餘額        |
| 應付款項    | 5,851.11          | 0.54%             | 公司應付關聯人衍生金融工具<br>保證金餘額     |
| 衍生金融負債  | 155.40            | 0.07%             | 與關聯人進行衍生品交易產生<br>的衍生金融資產餘額 |

## 第六節 重要事項

(2) 與本公司董事、監事、高級管理人員擔任董事、高級管理人員的除本公司及其控股子公司以外的企業等其它關聯法人的關聯交易

單位：萬元 幣種：人民幣

| 交易內容           | 截至2022年<br>6月30日<br>止六個月<br>發生金額 | 佔同類交易<br>金額的比例(%) | 備註                                      |
|----------------|----------------------------------|-------------------|---|
| 手續費及佣金淨收入      | 15,478.07                        | 2.52%             | 向關聯人收取的資產管理業務收入、銷售服務費收入、投資諮詢服務費收入等      |
| 手續費及佣金淨收入      | 44.04                            | 0.01%             | 向關聯人收取的證券交易手續費及佣金收入                     |
| 利息淨收入          | 24.16                            | 0.01%             | 關聯人保證金產生的利息淨收入                          |
| 業務及管理費         | 0.10                             | 0.00%             | 向關聯人支付的基金銷售服務費等支出                       |
| 衍生金融工具交易淨損益(註) | 6,941.79                         | 6.97%             | 報告期內，名義本金發生額人民幣65.60億元，期末名義本金餘額人民幣100億元 |

註：關聯人作為交易對手方與本公司進行衍生品交易產生的已實現及未實現投資收益。

單位：萬元 幣種：人民幣

| 往來項目    | 於2022年<br>6月30日餘額 | 佔同類交易<br>金額的比例(%) | 備註                     |
|---------|-------------------|-------------------|------------------------|
| 應收款項    | 5,462.64          | 0.64%             | 應收關聯人各項業務報酬餘額          |
| 應付款項    | 0.05              | 0.00%             | 應付關聯人各項業務服務費餘額         |
| 代理買賣證券款 | 11,965.90         | 0.09%             | 關聯人存放本公司的客戶保證金餘額       |
| 衍生金融資產  | 5,999.87          | 2.63%             | 與關聯人進行衍生品交易產生的衍生金融資產餘額 |
| 衍生金融負債  | 284.17            | 0.22%             | 與關聯人進行衍生品交易產生的衍生金融負債餘額 |

## 第六節 重要事項

另外，部分證券公司關聯法人作為合格交易對手方與本公司開展現券買賣交易，報告期內累計成交金額人民幣35.44億元。

### （二）資產收購或股權收購、出售發生的關聯交易

報告期內，本公司並未涉及任何資產收購或股權收購、出售的關聯交易。

### （三）共同對外投資的重大關聯交易

報告期內，本公司並未涉及任何共同對外投資的重大關聯交易。

### （四）關聯債權債務往來

報告期內，本公司並未涉及任何關聯債權債務往來。

### （五）本公司與存在關聯關係的財務公司、本公司控股財務公司與關聯方之間的金融業務

報告期內，本公司並未涉及與存在關聯關係的財務公司、本公司控股財務公司與關聯方之間的金融業務。

### （六）其他重大關聯交易

報告期內，本公司並未涉及任何其他重大關聯交易。

### （七）其他

✓不適用

## 第六節 重要事項

### 十一、重大合同及其履行情况

#### 1 託管、承包、租賃事項

報告期內，本公司無重大託管、承包、租賃事項。

#### 2 報告期內履行的及尚未履行完畢的重大擔保情況

單位：元 幣種：人民幣

##### 本公司對外擔保情況 (不包括對子公司的擔保)

報告期內擔保發生額合計 (不包括對子公司的擔保)

報告期末擔保餘額合計(A) (不包括對子公司的擔保)

##### 本公司對子公司的擔保情況

報告期內對子公司擔保發生額合計 3,976,430,455

報告期末對子公司擔保餘額合計(B) 20,080,054,730

##### 本公司擔保總額情況 (包括對子公司的擔保)

擔保總額(A+B) 20,080,054,730

擔保總額佔本公司淨資產的比例(%) 11.31

其中：

為股東、實際控制人及其關聯方提供擔保的金額(C)

直接或間接為資產負債率超過70%的被擔保對象提供的債務擔保金額(D) 16,910,271,781

擔保總額超過淨資產50%部分的金額(E)

上述三項擔保金額合計(C+D+E) 16,910,271,781

未到期擔保可能承擔連帶清償責任說明

## 第六節 重要事項

### 擔保情況說明

1. 2021年3月30日，本公司召開第七屆董事會第十五次會議，審議通過了《關於為境外全資附屬公司境外債務融資提供連帶責任保證擔保的議案》，同意本公司為在境外的全資子公司海通銀行Haitong Bank,S.A.或其附屬公司境外債券融資提供連帶責任保證擔保，擔保金額不超過7.5億歐元債券本金（含7.5億歐元或等值其他幣種）、利息、借款人應當承擔的其他費用等，擔保期限不超過9年（含9年）。

本公司於2022年2月8日簽署《擔保函》，為本公司境外全資附屬公司海通銀行發行金額為2.3億歐元、於2025年到期的歐元債券提供連帶責任保證擔保。

本公司於2022年5月31日簽署《擔保協議》，為境外全資附屬公司海通銀行發行金額為1.5億美元、於2027年到期的債券提供連帶責任保證擔保，擔保期限66個月。

2. 2020年8月28日，本公司召開第七屆董事會第十一次會議，審議通過了《關於為境外全資附屬公司境外債務融資提供連帶責任保證擔保的議案》。同意本公司為在境外的全資附屬公司海通銀行或其附屬公司境外債務融資（包括但不限於發行境外債券、中長期商業借款及其他符合監管要求的融資方式）提供連帶責任保證擔保，擔保金額不超過3.75億歐元債務融資本金（含3.75億歐元或等值其他幣種）、利息、借款人應當承擔的其他費用等，擔保期限不超過6年（含6年）。

本公司於2021年5月17日作為擔保人簽署《貸款協議》，為境外全資附屬公司海通銀行3.75億歐元（含3.75億歐元或等值其他貨幣）銀團貸款提供連帶責任保證擔保。

## 第六節 重要事項

3. 本公司全資子公司海通開元將所持有的海通恒信2,440,846,824股內資股劃轉給公司全資子公司海通創新證券。海通開元將註冊資本從人民幣106.50億元減至人民幣75億元，減資人民幣31.50億元。公司為海通開元減資過程中未清償債務105,502.08萬元提供一般保證擔保。此擔保事項經過公司於2021年1月29日召開的第七屆董事會第十四次會議(臨時會議)審議通過。

截止2022年6月30日，本公司的該項擔保責任餘額為人民幣16,978.29萬元。

4. 2019年4月25日，本公司召開第六屆董事會第三十七次會議，審議通過了《關於為境外全資附屬公司境外債務融資提供連帶責任保證擔保的議案》，同意公司為在境外的全資子公司海通國際控股及其全資附屬公司境外債務融資(包括但不限於發行境外債券、中長期商業借款及其他符合監管要求的融資方式)提供連帶責任保證擔保，擔保金額不超過6.7億美元債務融資本金(含6.7億美元或等值其他幣種)、利息、借款人應當承擔的其他費用等，擔保期限不超過10年(含10年)。

本公司於2020年3月12日簽署《擔保協議》，為公司境外全資附屬公司Haitong International Finance Holdings 2015 Limited發行金額為6.7億美元、於2025年到期、票面利率為2.107%的美元債券，提供連帶責任保證擔保。

5. 2017年8月29日，本公司召開第六屆董事會第二十五次會議，審議通過了《關於為境外全資附屬公司境外債務融資提供連帶責任保證擔保的議案》。本公司於2018年5月14日作為擔保人簽署了《貸款協議》，為境外全資附屬子公司海通國際控股的銀團貸款提供6億美元連帶責任保證擔保。

## 第六節 重要事項

6. 本公司第五屆董事會第十二次會議審議通過了《關於對上海海通證券資產管理有限公司提供淨資本擔保承諾的議案》，董事會同意本公司隨時對海通資管公司提供不超過十五億元的淨資本擔保承諾，以保證其淨資本保持充足。2013年6月9日，上海證監局下發《關於海通證券股份有限公司向上海海通證券資產管理有限公司出具淨資本擔保承諾書的無異議函》(滬證監機構字[2013]145號)，同意本公司向海通資管公司提供人民幣8億元的擔保承諾。本公司扣減了人民幣8億元淨資本，並相應增加海通資管公司人民幣8億元淨資本。

2016年8月29日，本公司第六屆董事會第十八次會議審議通過了《關於公司為海通資管追加淨資本擔保承諾及對其增加註冊資本的議案》，同意本公司對海通資管公司追加不超過人民幣40億元的淨資本擔保承諾。本公司為海通資管公司提供最高額度為人民幣40億元的淨資本擔保承諾，並承諾當海通資管公司開展業務需要現金支持時，本公司將無條件在上述額度內提供現金。淨資本擔保承諾期限自本公司董事會審議通過之日起生效。就本次淨資本擔保事宜，海通資管公司已獲得中國證監會上海監管局出具的《關於對海通證券股份有限公司向上海海通證券資產管理有限公司出具淨資本擔保承諾書的無異議函》(滬證監機構字[2016]325號)。

2021年12月，本公司對海通資管公司減少提供淨資本擔保承諾金額人民幣18億元。就本次淨資本擔保減少事宜，海通資管公司已收到中國證監會上海監管局《關於對海通證券股份有限公司向上海海通證券資產管理有限公司減少提供部分淨資本擔保承諾事項的無異議函》(滬證監機構字[2021]532號)。截止2022年6月30日，本公司對海通資管公司提供淨資本擔保承諾金額為人民幣30億元。

註： 報告期內子公司海通銀行對外擔保發生額合計(不包括對子公司的擔保)為12,019,438歐元，按2022年6月30日銀行間外匯市場人民幣匯率中間價1歐元對人民幣7.0084元換算，合計為84,237,031元人民幣。報告期末對外擔保餘額合計(不包括對子公司的擔保)為131,401,101歐元，按2022年6月30日銀行間外匯市場人民幣匯率中間價1歐元對人民幣7.0084元換算，合計為920,911,475元人民幣。

## 第六節 重要事項

報告期內子公司海通國際對內擔保無新增。按2022年6月30日中國外匯交易中心公佈的人民幣匯率中間價公告1港元對人民幣0.85519元、1美元對人民幣6.7114元、1新加坡元對人民幣4.817元換算，報告期末海通國際對內擔保餘額合計8,428,110,960元人民幣。

### 3 其他重大合同

報告期內，本公司無其他應披露而未披露的重大合同。

## 十二、其他重大事項的說明

### 劃轉對海富產業的股權至海通開元

茲提述本公司日期為2022年6月23日的《海外監管公告》，本公司第七屆董事會第二十八次會議（臨時會議）審議通過了《關於公司劃轉海富產業投資基金管理有限公司股份的議案》，同意本公司將所持有的海富產業67%的股份劃轉至海通開元。上述工商變更工作已於2022年6月28日完成。

## 十三、報告期後事項

除本報告所披露者外，於2022年6月30日後截至本報告日期，本公司並無發生任何重大事項。

## 十四、持有的重大投資、有關附屬公司、聯營公司及合營企業的重大收購及出售、以及未來作重大投資或購入資本資產的計劃

除本報告所披露者外，於報告期內，本公司沒有持有任何重大投資（持有的各項個別投資概不構成本集團截至2022年6月30日總資產5%或以上），亦沒有進行有關附屬公司，聯營公司或合營企業的任何重大收購或出售；於本報告日期，本公司並無任何董事會批准的重大投資或購入資本資產。

## 第七節 股份變動及股東情況

### 一、股本變動情況

#### （一）股份變動情況表

##### 1、 股份變動情況表

報告期內，本公司股份總數及股本結構未發生變化。本公司的股份總數為13,064,200,000股，其中，A股為9,654,631,180股，H股為3,409,568,820股。

##### 2、 股份變動情況說明

報告期內，本公司無股份變動情況。

##### 3、 報告期後到半年報披露日期間發生股份變動對每股收益、每股淨資產等財務指標的影響（如有）

✓不適用

##### 4、 本公司認為必要或證券監管機構要求披露的其他內容

✓不適用

#### （二）限售股份變動情況

單位：股

| 股東名稱         | 期初限售股數        | 報告期解除<br>限售股數 | 報告期增加<br>限售股數 | 報告期末<br>限售股數 | 限售原因      | 解除限售日期    |
|--------------|---------------|---------------|---------------|--------------|-----------|-----------|
| 上海國盛(集團)有限公司 | 781,250,000   | 0             | 0             | 781,250,000  | 非公開發行股份限售 | 2024年8月5日 |
| 上海海煙投資管理有限公司 | 234,375,000   | 234,375,000   | 0             | 0            | 非公開發行股份限售 | 2022年2月7日 |
| 上海電氣控股集團有限公司 | 78,203,125    | 78,203,125    | 0             | 0            | 非公開發行股份限售 | 2022年2月7日 |
| 光明食品(集團)有限公司 | 78,125,000    | 78,125,000    | 0             | 0            | 非公開發行股份限售 | 2022年2月7日 |
| 合計           | 1,171,953,125 | 390,703,125   | 0             | 781,250,000  | /         | /         |

## 第七節 股份變動及股東情況

### 二、股東情況

#### (一) 股東總數：

截至報告期末普通股股東總數(戶) 288,907 (其中A股288,758；H股149)

#### (二) 截至報告期末前十名股東、前十名流通股東(或無限售條件股東)持股情況表

單位：股

| 股東名稱(全稱)        | 報告期內增減     | 期末持股數量        | 比例(%) | 持有有限售條      |    | 質押、標記或凍結情況 |    | 股東性質 |
|-----------------|------------|---------------|-------|-------------|----|------------|----|------|
|                 |            |               |       | 件           | 數量 | 股份狀態       | 數量 |      |
| 香港中央結算(代理人)有限公司 | -42,800    | 3,408,741,495 | 26.09 | 0           |    | 未知         | -  | 境外法人 |
| 上海國盛(集團)有限公司    | 0          | 862,489,059   | 6.60  | 781,250,000 |    | 無          | 0  | 國有法人 |
| 上海海煙投資管理有限公司    | 0          | 635,084,623   | 4.86  | 0           |    | 無          | 0  | 國有法人 |
| 光明食品(集團)有限公司    | 8,124,400  | 480,275,000   | 3.68  | 0           |    | 無          | 0  | 國有法人 |
| 上海電氣控股集團有限公司    | 38,924,400 | 340,192,818   | 2.60  | 0           |    | 無          | 0  | 國家   |
| 申能(集團)有限公司      | 6,373,000  | 322,162,086   | 2.47  | 0           |    | 無          | 0  | 國有法人 |
| 中國證券金融股份有限公司    | 0          | 258,104,024   | 1.98  | 0           |    | 無          | 0  | 其他   |
| 上海國盛集團資產有限公司    | 0          | 238,382,008   | 1.82  | 0           |    | 無          | 0  | 國有法人 |
| 上海久事(集團)有限公司    | 0          | 235,247,280   | 1.80  | 0           |    | 無          | 0  | 國有法人 |
| 上海百聯集團股份有限公司    | 0          | 214,471,652   | 1.64  | 0           |    | 無          | 0  | 國有法人 |

## 第七節 股份變動及股東情況

單位：股

### 前十名無限售條件股東持股情況

| 股東名稱  | 持有無限售條件流通股的數量  | 股份種類及數量 |               |
|---|--|---------|---------------|
|   |  | 種類      | 數量            |
| 香港中央結算（代理人）有限公司                               | 3,408,741,495  | 境外上市外資股 | 3,408,741,495 |
| 上海海煙投資管理有限公司                                  | 635,084,623  | 人民幣普通股  | 635,084,623   |
| 光明食品（集團）有限公司                                  | 480,275,000  | 人民幣普通股  | 480,275,000   |
| 上海電氣控股集團有限公司                                  | 340,192,818  | 人民幣普通股  | 340,192,818   |
| 申能（集團）有限公司                                    | 322,162,086  | 人民幣普通股  | 322,162,086   |
| 中國證券金融股份有限公司                                  | 258,104,024  | 人民幣普通股  | 258,104,024   |
| 上海國盛集團資產有限公司                                  | 238,382,008  | 人民幣普通股  | 238,382,008   |
| 上海久事（集團）有限公司                                  | 235,247,280  | 人民幣普通股  | 235,247,280   |
| 上海百聯集團股份有限公司                                  | 214,471,652  | 人民幣普通股  | 214,471,652   |
| 中國建設銀行股份有限公司－國泰中證<br>全指證券公司交易型開放式指數證券<br>投資基金 | 199,500,348  | 人民幣普通股  | 199,500,348   |
| 前十名股東中回購專戶情況說明                                |  |         | -             |
| 上述股東委託表決權、受託表決權、<br>放棄表決權的說明                  |  |         | -             |
| 上述股東關聯關係或一致行動的說明                              | 上海國盛集團資產有限公司為上海國盛集團的全資子公司，此外，未知其他股東之間是否存在關聯關係，也未知是否屬於《上市公司收購管理辦法》規定的一致行動人。 |         |               |
| 表決權恢復的優先股股東及持股數量的說明                           |  |         | -             |

註： 1. 人民幣普通股（A股）股東性質為股東在中國證券登記結算有限責任公司上海分公司登記的賬戶性質。

2. 上表中，境外上市外資股為H股。本公司H股股東中，非登記股東的股份由香港中央結算（代理人）有限公司代為持有。

## 第七節 股份變動及股東情況

3. 上海國盛集團及其全資子公司上海國盛集團資產有限公司持有本公司A股和H股共計135,632.75萬股，佔公司總股本的10.38%；上海電氣控股集團有限公司持有本公司A股和H股共計60,334.64萬股，佔公司總股本的4.62%。
4. 因本公司股票為融資融券標的證券，股東持股數量按照其通過普通證券賬戶、信用證券賬戶持有的股票及權益數量合併計算。

### 前十名有限售條件股東持股數量及限售條件

單位：股

| 序號 | 有限售條件股東名稱    | 有限售條件股份可上市交易情況 |           |             | 限售條件    |
|----|--------------|----------------|-----------|-------------|---------|
|    |              | 持有的有限售條件股份數量   | 可上市交易時間   | 新增可上市交易股份數量 |         |
| 1  | 上海國盛(集團)有限公司 | 781,250,000    | 2024年8月5日 | -           | 限售期48個月 |

上述股東關聯關係或一致行動的說明

無

2020年8月5日，本公司向上海國盛集團等13家特定對象非公開發行人民幣普通股（A股）1,562,500,000股完成後，本公司的股份總數由11,501,700,000股增加至13,064,200,000股，其中，H股仍為3,409,568,820股，A股從8,092,131,180股增加到9,654,631,180股。增發完成後，本公司無限售條件流通股為11,501,700,000股，有限售條件流通股為1,562,500,000股（均為本次非公開發行的A股股票）。本公司非公開發行的部分限售股已分別於2021年2月5日及2022年2月7日限售期屆滿並解禁，具體內容詳見本公司日期為2021年1月29日及2022年1月21日於香港聯交所披露易網站披露的關於非公開發行限售股上市流通的海外監管公告。截至報告期末，本公司股份總數中無限售條件的流通股為12,282,950,000，有限售條件的流通股為781,250,000股。

## 第七節 股份變動及股東情況

### (三) 主要股東及其他人士於股份及相關股份擁有的權益及淡倉

於2022年6月30日，據本公司董事合理查詢所知，以下人士（並非本公司董事、監事或最高行政人員）於股份或相關股份中，擁有根據《證券及期貨條例》第XV部第2及第3分部須向本公司披露並根據《證券及期貨條例》第336條已記錄於本公司須存置的登記冊內的權益或淡倉：

| 序號 | 主要股東名稱   | 股份類別 | 權益性質                    | 持有的股份<br>數目(股) | 佔本公司<br>已發行股份<br>總數的比例(%) | 佔本公司<br>已發行A股/H股<br>總數的比例(%) | 好倉(註3)/<br>淡倉(註4)/<br>可供借出的股份 |
|----|--|------|-------------------------|----------------|---------------------------|------------------------------|-------------------------------|
| 1. | Maunakai Capital Partners<br>(Hong Kong) Limited | H股   | 投資經理                    | 272,590,000    | 2.09                      | 7.99                         | 好倉                            |
| 2. | BSA Strategic Fund I                             | H股   | 實益擁有人                   | 272,590,000    | 2.09                      | 7.99                         | 好倉                            |
| 3. | 史靜   | H股   | 酌情信託的成立人                | 228,000,000    | 1.75                      | 6.69                         | 好倉                            |
| 4. | Wickhams Cay Trust Company<br>Limited            | H股   | 受託人(註1)                 | 228,000,000    | 1.75                      | 6.69                         | 好倉                            |
| 5. | Abhaya Limited                                   | H股   | 受控制的法團的權益<br>(註1)       | 228,000,000    | 1.75                      | 6.69                         | 好倉                            |
| 6. | Heyday Trend Limited                             | H股   | 實益擁有人(註1)               | 228,000,000    | 1.75                      | 6.69                         | 好倉                            |
| 7. | 上海國盛(集團)有限公司(註5)                                 | H股   | 實益擁有人                   | 241,206,000    | 1.85                      | 7.07                         | 好倉                            |
|    |  | A股   | 實益擁有人                   | 1,100,871,067  | 8.43                      | 11.40                        | 好倉                            |
| 8. | 上海電氣控股集團有限公司                                     | H股   | 實益擁有人及受控制的<br>法團的權益(註2) | 239,300,400    | 1.83                      | 7.02                         | 好倉                            |
| 9. | 中國煙草總公司  | A股   | 實益擁有人                   | 635,084,623    | 4.86                      | 6.58                         | 好倉                            |

註1：Heyday Trend Limited持有本公司228,000,000股H股。Abhaya Limited透過其全資擁有的Heyday Trend Limited持有本公司228,000,000股H股。Abhaya Limited由Wickhams Cay Trust Company Limited全資擁有，史玉柱為Abhaya Limited的董事，而Abhaya Limited的董事慣於按照史玉柱的指令行事，故Wickhams Cay Trust Company Limited及史玉柱均被視為於Abhaya Limited持有的228,000,000股H股中擁有權益。

## 第七節 股份變動及股東情況

註2：上海電氣集團香港有限公司持有本公司4,746,800股H股。上海電氣集團香港有限公司由上海電氣控股集團有限公司全資擁有，故上海電氣控股集團有限公司被視為於上海電氣集團香港有限公司持有的4,746,800股H股中擁有權益。

註3：如股東對股份本身持有權益，包括透過持有、沽出或發行金融文書（包括衍生工具）而持有權益，並因而具有如下的權利與責任，該股東便屬於持有「好倉」：(i)其有權購入相關股份；(ii)其有責任購入相關股份；(iii)如相關股份價格上升，其有權收取款項；或(iv)如相關股份價格上升，其有權避免或減低損失。

註4：如股東根據證券借貸協議借入股份，或如股東因持有、沽出或發行金融文書（包括衍生工具）而具有以下的權利與責任，該股東便屬於持有「淡倉」：(i)其有權要求另一人購入相關股份；(ii)其有責任交付相關股份；(iii)如相關股份價格下降，其有權收取款項；或(iv)如相關股份價格下降，其有權避免或減低損失。

註5：為免疑議，因上述權益披露的範圍不限於有關股東實際持有的股份，本表格中顯示的有關股東持有權益的股份數目及比例與中期報告其他部分所披露的有關股東實質持有的股份數目和比例可能存在差異。

除上述披露外，於2022年6月30日，本公司並不知悉任何其他人士（本公司董事、監事及最高行政人員除外）於本公司股份或相關股份中擁有根據《證券及期貨條例》第336條規定須記錄於登記冊內之權益或淡倉。

### 董事、監事及最高行政人員於本公司及相聯法團的股份、相關股份或債券之權益及淡倉

於2022年6月30日，就本公司所獲得的資料及據董事所知，概無本公司董事、監事或最高行政人員在本公司或其相關法團（定義見《證券及期貨條例》第XV部）的股份、相關股份或債權證中擁有根據《證券及期貨條例》第XV部第7及8分部須通知本公司及香港聯交所的權益及淡倉（包括根據《證券及期貨條例》的該等條文被當作或視為擁有的權益或淡倉），或根據《證券及期貨條例》第352條規定須在存置之權益登記冊中記錄，或根據《標準守則》的規定需要通知本公司和香港聯交所之權益或淡倉。

### （四）戰略投資者或一般法人因配售新股成為前10名股東

✓不適用

## 第七節 股份變動及股東情況

### 三、董事、監事和高級管理人員情況

#### (一) 現任及報告期內離任董事、監事和高級管理人員持股變動情況

✓不適用

#### (二) 董事、監事、高級管理人員報告期內被授予的股權激勵情況

報告期內，本公司的董事、監事、高級管理人員不存在被授予股權激勵的情況。

#### (三) 其他說明

✓不適用

### 四、控股股東或實際控制人變更情況

✓不適用

本公司無控股股東且無實際控制人，本公司第一大股東上海國盛集團及其全資子公司上海國盛集團資產有限公司持有本公司股份比例為10.38%，公司第一大股東情況如下：

|             |  |
|-------------|--|
| 名稱          | 上海國盛(集團)有限公司   |
| 單位負責人或法定代表人 | 壽偉光  |
| 成立日期        | 2007年9月26日   |
| 主要經營業務      | 開展以非金融為主，金融為輔的投資，資本運作與資產管理，產業研究，社會經濟諮詢。[依法經批准的項目，經相關部門批准後方可開展經營活動] |

### 五、購回、出售或贖回上市證券

報告期內，本公司及其附屬公司未有購回、出售或贖回本公司的任何上市證券(惟代表本公司或附屬公司的客戶以代理人身份進行買賣者除外)。

## 第八節 優先股相關情況

報告期內，本公司無優先股事項。



## 第九節 債券相關情況

### 一、企業債券、公司債券和非金融企業債務融資工具

#### （一）企業債券

✓不適用

#### （二）公司債券

##### 1. 公司債券基本情況

以下為本公司在半年度報告批准報出日存續的公司債券基本情況。

單位：億元 幣種：人民幣

| 債券名稱                          | 簡稱     | 代碼     | 發行日        | 起息日        | 到期日        | 債券餘額 | 利率(%) | 還本付息方式 | 交易場所 | 投資者適當性<br>安排(如有) | 交易機制          | 是否存在終止      |
|-------------------------------|--------|--------|------------|------------|------------|------|-------|--------|------|------------------|---------------|-------------|
|                               |        |        |            |            |            |      |       |        |      |                  |               | 上市交易<br>的風險 |
| 2013年公司債券(第一期)                | 13海通03 | 122282 | 2013/11/25 | 2013/11/25 | 2023/11/25 | 23.9 | 6.18  | 單利按年計息 | 上交所  | 社會公眾投資者、機構投資者    | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否           |
| 2013年公司債券(第二期)                | 13海通06 | 122313 | 2014/07/14 | 2014/07/14 | 2024/07/14 | 8    | 5.85  | 單利按年計息 | 上交所  | 社會公眾投資者、機構投資者    | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否           |
| 面向合格投資者公開發行<br>2017年公司債券(第二期) | 17海通03 | 143301 | 2017/9/20  | 2017/9/22  | 2027/9/22  | 55   | 4.99  | 單利按年計息 | 上交所  | 合格投資者            | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否           |
| 面向合格投資者公開發行<br>2019年公司債券(第二期) | 19海通02 | 155830 | 2019/11/14 | 2019/11/15 | 2022/11/15 | 45   | 3.52  | 單利按年計息 | 上交所  | 合格投資者            | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否           |
| 面向合格投資者公開發行<br>2020年公司債券(第一期) | 20海通01 | 163148 | 2020/2/26  | 2020/2/27  | 2023/2/27  | 50   | 3.01  | 單利按年計息 | 上交所  | 合格投資者            | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否           |
| 面向合格投資者公開發行<br>2020年公司債券(第二期) | 20海通02 | 163290 | 2020/3/18  | 2020/3/19  | 2023/3/19  | 35   | 2.99  | 單利按年計息 | 上交所  | 合格投資者            | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否           |

## 第九節 債券相關情況

| 債券名稱                                   | 簡稱     | 代碼     | 發行日        | 起息日        | 到期日        | 債券餘額 | 利率(%) | 還本付息方式 | 交易場所 | 投資者適當性  | 交易機制          | 是否存在禁止 |
|--|--------|--------|------------|------------|------------|------|-------|--------|------|---------|---------------|--------|
|  |        |        |            |            |            |      |       |        |      | 安排(如有)  |               | 上市交易   |
|  |        |        |            |            |            |      |       |        |      |         |               | 的風險    |
| 面向專業投資者公開發行<br>2020年公司債券(第一期)<br>(品種一) | 20海通04 | 163507 | 2020/4/29  | 2020/4/30  | 2023/4/30  | 56   | 2.38  | 單利按年計息 | 上交所  | 專業投資者   | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否      |
| 面向專業投資者公開發行<br>2020年公司債券(第一期)<br>(品種二) | 20海通05 | 163508 | 2020/4/29  | 2020/4/30  | 2025/4/30  | 7    | 2.88  | 單利按年計息 | 上交所  | 專業投資者   | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否      |
| 面向專業投資者公開發行<br>2020年公司債券(第二期)          | 20海通06 | 163568 | 2020/5/22  | 2020/5/25  | 2023/5/25  | 67   | 2.7   | 單利按年計息 | 上交所  | 專業投資者   | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否      |
| 面向專業投資者公開發行<br>2020年公司債券(第三期)          | 20海通08 | 163903 | 2020/8/10  | 2020/8/11  | 2023/8/11  | 60   | 3.53  | 單利按年計息 | 上交所  | 專業投資者   | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否      |
| 2020年非公開發行公司債券<br>(第一期)(品種二)           | 20海通F2 | 167897 | 2020/10/20 | 2020/10/21 | 2022/10/21 | 50   | 3.82  | 單利按年計息 | 上交所  | 合格機構投資者 | 報價、詢價、協議交易    | 否      |
| 面向專業投資者公開發行<br>2021年公司債券(第一期)          | 21海通01 | 175630 | 2021/11/12 | 2021/11/13 | 2024/11/13 | 60   | 3.58  | 單利按年計息 | 上交所  | 專業投資者   | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否      |
| 面向專業投資者公開發行<br>2021年公司債券(第二期)          | 21海通02 | 175741 | 2021/2/5   | 2021/2/8   | 2024/2/8   | 54   | 3.79  | 單利按年計息 | 上交所  | 專業投資者   | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否      |
| 面向專業投資者公開發行<br>2021年公司債券(第三期)          | 21海通03 | 175975 | 2021/4/22  | 2021/4/23  | 2024/4/23  | 50   | 3.45  | 單利按年計息 | 上交所  | 專業投資者   | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否      |
| 面向專業投資者公開發行<br>2021年公司債券(第四期)          | 21海通04 | 188150 | 2021/5/26  | 2021/5/27  | 2024/5/27  | 28   | 3.35  | 單利按年計息 | 上交所  | 專業投資者   | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否      |

## 第九節 債券相關情況

| 債券名稱                                   | 簡稱     | 代碼     | 發行日        | 起息日        | 到期日        | 債券餘額 | 利率(%) | 還本付息方式 | 投資者適當性 |       | 交易場所              | 交易機制 | 是否存在終止 |
|--|--------|--------|------------|------------|------------|------|-------|--------|--------|-------|-------------------|------|--------|
|  |        |        |            |            |            |      |       |        | 安排(如有) | 上市交易  |                   |      | 的風險    |
| 面向專業投資者公開發行<br>2021年公司債券(第五期)          | 21海通05 | 188202 | 2021/6/9   | 2021/6/10  | 2024/6/10  | 21   | 3.4   | 單利按年計息 | 上交所    | 專業投資者 | 競價、報價、詢價和協<br>議交易 | 否    |        |
| 面向專業投資者公開發行<br>2021年公司債券(第六期)<br>(品種二) | 21海通06 | 188458 | 2021/7/28  | 2021/7/29  | 2024/7/29  | 20   | 3.14  | 單利按年計息 | 上交所    | 專業投資者 | 競價、報價、詢價和協<br>議交易 | 否    |        |
| 面向專業投資者公開發行<br>2021年公司債券(第七期)          | 21海通07 | 188571 | 2021/8/19  | 2021/8/20  | 2024/8/20  | 30   | 3.04  | 單利按年計息 | 上交所    | 專業投資者 | 競價、報價、詢價和協<br>議交易 | 否    |        |
| 面向專業投資者公開發行<br>2021年公司債券(第八期)<br>(品種一) | 21海通08 | 188663 | 2021/8/27  | 2021/8/30  | 2024/8/30  | 20   | 3.1   | 單利按年計息 | 上交所    | 專業投資者 | 競價、報價、詢價和協<br>議交易 | 否    |        |
| 面向專業投資者公開發行<br>2021年公司債券(第八期)<br>(品種二) | 21海通09 | 188664 | 2021/8/27  | 2021/8/30  | 2026/8/30  | 20   | 3.43  | 單利按年計息 | 上交所    | 專業投資者 | 競價、報價、詢價和協<br>議交易 | 否    |        |
| 面向專業投資者公開發行<br>2021年公司債券(第九期)          | 21海通10 | 188962 | 2021/11/9  | 2021/11/10 | 2024/11/10 | 50   | 3.1   | 單利按年計息 | 上交所    | 專業投資者 | 競價、報價、詢價和協<br>議交易 | 否    |        |
| 面向專業投資者公開發行<br>2021年公司債券(第十期)          | 21海通11 | 185010 | 2021/11/19 | 2021/11/22 | 2024/11/22 | 50   | 3.09  | 單利按年計息 | 上交所    | 專業投資者 | 競價、報價、詢價和協<br>議交易 | 否    |        |
| 2022年面向專業投資者公開發行<br>次級債券(第一期)          | 22海通C1 | 185219 | 2022/1/11  | 2022/1/12  | 2025/1/12  | 50   | 3.18  | 單利按年計息 | 上交所    | 專業投資者 | 競價、報價、詢價和協<br>議交易 | 否    |        |

## 第九節 債券相關情況

| 債券名稱                         | 簡稱     | 代碼     | 發行日       | 起息日       | 到期日        | 債券總額 | 利率(%) | 還本付息方式          | 交易場所 | 投資者適當性 | 交易機制          | 是否存在禁止上市交易的風險 |
|------------------------------|--------|--------|-----------|-----------|------------|------|-------|-----------------|------|--------|---------------|---------------|
|                              |        |        |           |           |            |      |       |                 |      | 安排(如有) |               |               |
| 2022年面向專業投資者公開發行公司債券(第一期)    | 22海通01 | 185285 | 2022/1/19 | 2022/1/20 | 2024/12/25 | 50   | 2.84  | 單利按年計息，到期一次還本付息 | 上交所  | 專業投資者  | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否             |
| 2022年面向專業投資者公開發行公司債券(第二期)    | 22海通02 | 185359 | 2022/2/17 | 2022/2/21 | 2025/2/21  | 29   | 2.9   | 單利按年計息          | 上交所  | 專業投資者  | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否             |
| 2022年面向專業投資者公開發行次級債券(第二期)    | 22海通C2 | 185400 | 2022/2/24 | 2022/2/25 | 2025/2/25  | 20   | 3.15  | 單利按年計息          | 上交所  | 專業投資者  | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否             |
| 2022年面向專業投資者公開發行公司債券(第三期)    | 22海通03 | 185448 | 2022/3/4  | 2022/3/7  | 2025/3/7   | 5    | 3.03  | 單利按年計息          | 上交所  | 專業投資者  | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否             |
| 2022年面向專業投資者公開發行次級債券(第三期)    | 22海通C3 | 185472 | 2022/3/8  | 2022/3/9  | 2025/3/9   | 24.8 | 3.29  | 單利按年計息          | 上交所  | 專業投資者  | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否             |
| 2022年面向專業投資者非公開發行短期公司債券(第一期) | 22海通D1 | 194598 | 2022/6/7  | 2022/6/9  | 2023/6/9   | 45   | 2.5   | 到期一次還本付息        | 上交所  | 專業投資者  | 報價、詢價和協議交易    | 否             |
| 2022年面向專業投資者公開發行公司債券(第四期)    | 22海通04 | 137555 | 2022/7/25 | 2022/7/26 | 2025/7/26  | 50   | 2.75  | 單利按年計息          | 上交所  | 專業投資者  | 競價、報價、詢價和協議交易 | 否             |

## 第九節 債券相關情況

*本公司對債券終止上市交易風險的應對措施*

本公司所有債券不存在終止上市交易的風險。

*逾期末償還債券*

本公司不存在逾期末償還債券。

*關於逾期債項的說明*

✓不適用

### 2. 發行人或投資者選擇權條款、投資者保護條款的觸發和執行情況

✓不適用

### 3. 信用評級結果調整情況

✓不適用

### 4. 擔保情況、償債計劃及其他償債保障措施在報告期內的執行和變化情況及其影響

| 現狀   | 執行情況 | 是否發生變更 | 變更後情況 | 變更原因 | 變更是否<br>已取得有權<br>機構批准 | 變更對債券<br>投資者權益<br>的影響 |
|--|------|--------|-------|------|-----------------------|-----------------------|
| 存續的本公司債券均為無擔保債券  | 正常   | 否      | -     | -    | -                     | -                     |
| 嚴格按照債券募集說明書中有關償債計劃的約定履行兌付兌息職責                              | 正常   | 否      | -     | -    | -                     | -                     |
| 償債保障措施包括制定《債券持有人會議規則》、設立專門的償付工作小組、充分發揮受託管理人的作用、嚴格履行信息披露義務等 | 正常   | 否      | -     | -    | -                     | -                     |

## 第九節 債券相關情況

### 其他說明

本公司於2022年6月21日召開的2021年股東週年大會審議通過了《關於公司發行境內外債務融資工具一般性授權的議案》，約定償債保障措施。「在出現預計不能按期償付境內外債務融資工具本息或者到期未能按期償付境內外債務融資工具本息時，至少採取如下措施：①不向股東分配利潤；②暫緩重大對外投資、收購兼併等資本性支出項目的實施；③調減或停發公司董事和高級管理人員的工資和獎金；④主要責任人員不得調離。」

### 5. 本公司債券其他情況的說明

#### (1) 為本公司債券發行及存續期業務提供服務的中介機構

| 中介機構名稱                   | 辦公地址                                    | 簽字會計師姓名    | 聯繫人     | 聯繫電話            |
|--------------------------|---|------------|---------|-----------------|
| 普華永道中天會計師事務所<br>(特殊普通合夥) | 上海市浦東新區東育路588號前灘中心<br>50樓               | 許康璋<br>劉偉  | 許康璋     | 86-021-23238888 |
| 德勤華永會計師事務所(特殊<br>普通合夥)   | 上海市延安東路222號外灘中心21樓                      | 胡小駿<br>宮明亮 | 胡小駿     | 86-021-61412068 |
| 上海市錦天城律師事務所              | 上海市浦東新區銀城中路501號上海中<br>心大廈11、12層         | -          | 肖文艷     | 86-021-20511000 |
| 中誠信國際信用評級有限責任<br>公司      | 北京市東城區南竹桿胡同2號1幢60101                    | -          | 喬爽      | 86-010-66428877 |
| 中信證券股份有限公司               | 北京市朝陽區亮馬橋路48號中信證券大<br>廈22層              | -          | 聶磊、宋頤嵐  | 86-010-60833046 |
| 中信建投證券股份有限公司             | 北京市東城區朝內大街2號凱恒中心B、<br>E座2層              | -          | 房蓓蓓、呂宏圖 | 86-010-65608396 |
| 申萬宏源證券有限公司               | 上海市徐匯區長樂路989號45層                        | -          | 張勝寒     | 86-021-33389437 |
| 興業證券股份有限公司               | 上海市浦東新區長柳路36號丁香國際商<br>業中心東塔6樓           | -          | 張振華、杭雨  | 86-021-38565436 |
| 國信證券股份有限公司               | 北京市西城區金融大街興盛街6號國信<br>證券大廈四層             | -          | 郭睿、柯方鈺  | 86-010-88005384 |
| 民生證券股份有限公司               | 中國(上海)自由貿易試驗區世紀大道<br>1168號B座2101、2104A室 | -          | 李躍林     | 86-021-80508899 |

## 第九節 債券相關情況

### (2) 本公司債券報告期內募集資金使用情況

單位：億元 幣種：人民幣

| 債券名稱                             | 募集資金 |       | 未使用金額 | 募集資金專項 | 募集資金違規 | 是否與募集                   |
|----------------------------------|------|-------|-------|--------|--------|-------------------------|
|                                  | 總金額  | 已使用金額 |       | 賬戶運作情況 | 使用的整改  | 說明書承諾                   |
|                                  |      |       |       | (如有)   | 情況(如有) | 的用途、使用<br>計劃及其他<br>約定一致 |
| 2022年面向專業投資者公開發行<br>次級債券(第一期)    | 50   | 50    | 0     | 無      | 無      | 是                       |
| 2022年面向專業投資者公開發行<br>公司債券(第一期)    | 50   | 50    | 0     | 無      | 無      | 是                       |
| 2022年面向專業投資者公開發行<br>公司債券(第二期)    | 29   | 29    | 0     | 無      | 無      | 是                       |
| 2022年面向專業投資者公開發行<br>次級債券(第二期)    | 20   | 20    | 0     | 無      | 無      | 是                       |
| 2022年面向專業投資者公開發行<br>公司債券(第三期)    | 5    | 5     | 0     | 無      | 無      | 是                       |
| 2022年面向專業投資者公開發行<br>次級債券(第三期)    | 24.8 | 24.8  | 0     | 無      | 無      | 是                       |
| 2022年面向專業投資者非公開發<br>行短期公司債券(第一期) | 45   | 45    | 0     | 無      | 無      | 是                       |
| 2022年面向專業投資者公開發行<br>公司債券(第四期)    | 50   | 50    | 0     | 無      | 無      | 是                       |

## 第九節 債券相關情況

### (三) 其他債券

單位：億元 幣種：見明細表

| 債券名稱             | 簡稱                | 代碼        | 債券餘額   | 利率(%)               | 發行日期       | 兌付日期       | 還本付息方式  | 交易場所  |
|------------------|-------------------|-----------|--------|---------------------|------------|------------|---------|-------|
| 金融債(境外)          | 海通證券4.5%<br>B2023 | 5482      | 3億美元   | 4.50                | 2018/12/13 | 2023/12/13 | 單利按半年計息 | 香港聯交所 |
| 金融債(境外)          | 海通證券FRN<br>B2023  | 5483      | 2.3億歐元 | 3M EURIBOR<br>+1.65 | 2018/12/13 | 2023/12/13 | 單利按季計息  | 香港聯交所 |
| 2019年第一期<br>金融債券 | 19海通證券金<br>融債01   | 091900022 | 70億人民幣 | 3.39                | 2019/08/29 | 2022/08/29 | 單利按年計息  | 銀行間市場 |

### (四) 銀行間債券市場非金融企業債務融資工具

✓不適用

### (五) 本公司報告期內合併報表範圍虧損超過上年末淨資產10%

✓不適用

## 第九節 債券相關情況

### （六）主要會計數據和財務指標

單位：億元 幣種：人民幣

| 主要指標             | 本報告期末 | 上年度末  | 本報告期末<br>比上年度末增減 |        | 變動原因                    |
|------------------|-------|-------|------------------|--------|-------------------------|
|                  |       |       |                  | (%)    |                         |
| 流動比率             | 2.15  | 1.99  |                  | 8.04   |                         |
| 速動比率             | 2.15  | 1.99  |                  | 8.04   |                         |
| 資產負債率(%)         | 71.37 | 71.41 |                  | -0.06  |                         |
|                  |       |       | 本報告期<br>比上年同期增減  |        |                         |
|                  | 本報告期  | 上年同期  |                  | (%)    | 變動原因                    |
| 扣除非經常性損益後<br>淨利潤 | 42.35 | 78.97 |                  | -46.38 | 利潤總額減少                  |
| EBITDA全部債務比      | 0.03  | 0.05  |                  | -40.00 | 利潤總額減少                  |
| 利息保障倍數           | 1.97  | 3.06  |                  | -35.64 | 利潤總額減少                  |
| 現金利息保障倍數         | 4.44  | 7.92  |                  | -43.94 | 經營活動產生的<br>現金流量淨額<br>減少 |
| EBITDA利息保障倍數     | 2.09  | 3.17  |                  | -34.07 | 利潤總額減少                  |
| 貸款償還率(%)         | 100   | 100   |                  | -      |                         |
| 利息償付率(%)         | 100   | 100   |                  | -      |                         |

註：扣除非經常性損益的淨利潤即歸屬於母公司股東的扣除非經常性損益的淨利潤。

### 二、可轉換公司債券情況

✓不適用

## 第十節 財務報告

- 一、 本集團按國際財務報告準則編製的2022年中期簡明綜合財務資料未經審計。羅兵咸永道會計師事務所已根據國際審閱準則第2410號對該中期財務數據進行審閱並出具了審閱報告，審閱報告附後。
- 二、 中期財務報告(附後)。

## 第十一節 證券公司信息披露

### 一、本公司重大行政許可事項的相關情況

| 日期        | 批覆標題        | 批覆單位     | 批文號         |
|-----------|-------------|----------|-------------|
| 2022年1月1日 | 內部資料性出版物准印證 | 上海市新聞出版局 | 准印證號(K)0772 |

### 二、監管部門對本公司的分類結果

✓不適用

|        |  |
|--------|--|
| 備查文件目錄 | <p>載有本公司法定代表人簽名的半年度報告文本</p> <p>載有本公司法定代表人、主管會計工作負責人兼會計機構負責人簽名蓋章的財務報告文本</p> <p>報告期內在符合國務院證券監督管理機構規定條件的媒體上公開披露過的<br/>所有本公司文件的正本及公告原稿</p> <p>其他有關資料</p> |
|--------|--|

承董事會命  
海通證券股份有限公司  
董事長  
周杰

中國上海  
2022年8月26日

## 中期簡明綜合財務資料審閱報告

致海通證券股份有限公司董事會

(於中華人民共和國註冊成立的有限公司)

### 引言

本核數師(以下簡稱「我們」)已審閱列載於第127至204頁的中期財務資料,此中期財務資料包括海通證券股份有限公司(以下簡稱「貴公司」)及其附屬公司(以下統稱「貴集團」)於二零二二年六月三十日的中期簡明綜合財務狀況表與截至該日止六個月期間的中期簡明綜合損益表、中期簡明綜合全面收益表、中期簡明綜合權益變動表和中期簡明綜合現金流量表,以及附註,包括主要會計政策和其他解釋信息。香港聯合交易所有限公司證券上市規則規定,就中期財務資料擬備的報告必須符合以上規則的有關條文以及國際會計準則第34號「中期財務報告」。貴公司董事須負責根據國際會計準則第34號「中期財務報告」擬備及列報該等中期財務資料。我們的責任是根據我們的審閱對該等中期財務資料作出結論,並僅按照我們協定的業務約定條款向閣下(作為整體)報告我們的結論,除此之外本報告別無其他目的。我們不會就本報告的內容向任何其他人士負上或承擔任何責任。

### 審閱範圍

我們已根據國際審閱準則第2410號「由實體的獨立核數師執行中期財務資料審閱」進行審閱。審閱中期財務資料包括主要向負責財務和會計事務的人員作出查詢,及應用分析性和其他審閱程序。審閱的範圍遠較根據《國際審計準則》進行審計的範圍為小,故不能令我們可保證我們將知悉在審計中可能被發現的所有重大事項。因此,我們不會發表審計意見。

### 結論

按照我們的審閱,我們並無發現任何事項,令我們相信貴集團的中期財務資料未有在各重大方面根據國際會計準則第34號「中期財務報告」擬備。

羅兵咸永道會計師事務所

執業會計師

香港,二零二二年八月二十六日

該報告已以英文出具,中文版本作為翻譯版本僅供參考,若有任何中英文含義不同之處,應以英文含義為準。

## 中期簡明綜合損益表

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

|                        | 附註 | 截至6月30日止六個月期間       |                |
|------------------------|----|---------------------|----------------|
|                        |    | 2022<br>(未經審計)      | 2021<br>(未經審計) |
| <b>收入</b>              |    |                     |                |
| — 佣金及手續費收入             | 4  | 7,699,311           | 9,131,298      |
| — 利息收入                 | 5  | 8,258,455           | 7,499,427      |
| — 融資租賃收入               | 5  | 1,280,942           | 1,771,581      |
| — 投資收入及收益(淨額)          | 6  | 692,435             | 6,789,175      |
|                        |    | <b>17,931,143</b>   | 25,191,481     |
| 其他收入及收益                | 7  | 1,933,688           | 5,582,239      |
| <b>收入、其他收入及收益總計</b>    |    | <b>19,864,831</b>   | 30,773,720     |
| 佣金及手續費支出               | 8  | (1,558,630)         | (1,966,121)    |
| 利息支出                   | 9  | (6,451,309)         | (5,909,050)    |
| 折舊和攤銷費用                | 10 | (754,583)           | (792,437)      |
| 僱員成本                   |    | (3,488,369)         | (4,299,089)    |
| 預期信用損失模式下的減值損失         | 11 | (178,663)           | (1,024,765)    |
| 其他資產減值損失               |    | (25,911)            | (44,083)       |
| 其他支出                   | 12 | (1,824,893)         | (5,701,970)    |
| <b>支出總額</b>            |    | <b>(14,282,358)</b> | (19,737,515)   |
| 攤分聯營及合營企業業績            |    | 303,592             | 624,745        |
| <b>所得稅前利潤</b>          |    | <b>5,886,065</b>    | 11,660,950     |
| 所得稅費用                  | 13 | (1,420,704)         | (2,772,210)    |
| <b>期間利潤</b>            |    | <b>4,465,361</b>    | 8,888,740      |
| <b>歸屬於：</b>            |    |                     |                |
| 本公司股東                  |    | 4,757,725           | 8,170,195      |
| 非控制性權益                 |    | (292,364)           | 718,545        |
|                        |    | <b>4,465,361</b>    | 8,888,740      |
| <b>每股收益(以每股人民幣元列示)</b> |    |                     |                |
| — 基本                   | 14 | 0.36                | 0.63           |
| — 稀釋                   | 14 | 0.36                | 0.63           |

相應附註系該未經審計的中期簡明綜合財務資料的組成部分。

## 中期簡明綜合全面收益表

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

|  | 截至6月30日止六個月期間    |                  |
|--|------------------|------------------|
|  | 2022<br>(未經審計)   | 2021<br>(未經審計)   |
| 本期間利潤                                      | 4,465,361        | 8,888,740        |
| <b>其他全面收益／(損失)：</b>                        |                  |                  |
| 後續不能重分類至損益的項目：                             |                  |                  |
| 設定受益計劃的精算收益                                | 55,466           | 48,007           |
| 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的<br>權益工具的公允價值變動損失      | (1,035,114)      | (473,910)        |
| 所得稅影響                                      | 238,928          | 117,845          |
| 小計   | (740,720)        | (308,058)        |
| 後續或重分類至損益的項目：                              |                  |                  |
| 外幣折算產生的匯兌差額                                | 760,242          | (224,529)        |
| 指定為現金流量套期的套期工具公允價值變動收益                     | 39,527           | 44,236           |
| 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的<br>債務工具的公允價值變動收益／(損失) |                  |                  |
| － 期間公允價值變動淨額                               | 62,933           | 79,884           |
| － 出售損益的重分類調整                               | (16,263)         | 627,928          |
| － 減值損失的重分類調整                               | (54,550)         | (523,359)        |
| － 有關其他全面收益部分的所得稅                           | 2,664            | (42,888)         |
| 攤分聯營及合營企業的其他全面收益(稅後)                       | 4,365            | –                |
| 小計   | 798,918          | (38,728)         |
| 本期其他全面收益／(損失)(稅後)                          | 58,198           | (346,786)        |
| <b>本期全面收益總額</b>                            | <b>4,523,559</b> | <b>8,541,954</b> |
| <b>歸屬於：</b>                                |                  |                  |
| 本公司股東                                      | 3,875,350        | 7,975,225        |
| 非控制性權益                                     | 648,209          | 566,729          |
|  | <b>4,523,559</b> | <b>8,541,954</b> |
| <b>歸屬於股東的本期全面收益總額來自於：</b>                  |                  |                  |
| 持續經營                                       | 4,523,559        | 7,975,193        |
| 終止經營                                       | –                | 32               |
|  | <b>4,523,559</b> | <b>7,975,225</b> |

相應附註系該未經審計的中期簡明綜合財務資料的組成部分。

## 中期簡明綜合財務狀況表

於二零二二年六月三十日

（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

|                          | 附註 | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|--------------------------|----|--------------------------|--------------------------|
| <b>非流動資產</b>             |    |                          |                          |
| 物業及設備                    | 15 | 15,117,102               | 15,088,876               |
| 使用權資產                    | 16 | 1,726,041                | 1,778,639                |
| 投資物業                     | 17 | 2,310,229                | 57,595                   |
| 商譽                       | 18 | 3,519,765                | 3,365,313                |
| 其他無形資產                   | 19 | 474,641                  | 531,391                  |
| 權益法項下投資                  | 20 | 6,328,009                | 6,454,420                |
| 應收融資租賃款                  | 21 | 7,958,405                | 11,270,189               |
| 售後回租安排的應收款               | 22 | 39,404,886               | 31,521,846               |
| 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具 | 23 | 6,612,456                | 10,246,871               |
| 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具 | 24 | 38,995,073               | 33,050,889               |
| 以攤餘成本計量的債務工具             | 25 | 4,862,067                | 3,626,108                |
| 以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產     | 26 | 23,075,734               | 25,132,195               |
| 買入返售金融資產                 | 27 | 562,418                  | 575,403                  |
| 其他貸款及應收款項                | 28 | 1,277,711                | 2,394,396                |
| 客戶貸款                     | 29 | 4,718,474                | 4,119,086                |
| 遞延稅項資產                   | 30 | 4,435,588                | 5,171,925                |
| 交易所儲備及保證金                | 31 | 154,085                  | 163,245                  |
| 受限制銀行存款                  | 32 | 1,630,380                | 1,503,454                |
| 其他非流動資產                  | 34 | 2,156,120                | 1,891,358                |
| <b>非流動資產總額</b>           |    | <b>165,319,184</b>       | 157,943,199              |

## 中期簡明綜合財務狀況表

於二零二二年六月三十日

(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

|                          |    | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|--------------------------|----|--------------------------|--------------------------|
|                          | 附註 |                          |                          |
| <b>流動資產</b>              |    |                          |                          |
| 孖展融資客戶墊款                 | 35 | 69,668,201               | 75,223,404               |
| 應收賬款                     | 36 | 8,496,612                | 11,372,016               |
| 應收融資租賃款                  | 21 | 17,382,485               | 22,202,398               |
| 售後回租安排的應收款               | 22 | 28,796,531               | 23,566,177               |
| 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具 | 24 | 3,060,154                | 4,002,056                |
| 以攤餘成本計量的債務工具             | 25 | 429,093                  | 1,099,101                |
| 以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產     | 26 | 178,790,503              | 195,277,554              |
| 衍生金融資產                   | 37 | 2,277,486                | 1,084,731                |
| 買入返售金融資產                 | 27 | 41,537,039               | 39,185,614               |
| 其他貸款及應收款項                | 28 | 6,075,061                | 12,544,269               |
| 客戶貸款                     | 29 | 629,224                  | 593,565                  |
| 其他流動資產                   | 38 | 7,383,779                | 6,242,087                |
| 拆出資金                     |    | 80,225                   | 352,928                  |
| 交易所儲備及保證金                | 31 | 19,888,627               | 17,491,923               |
| 結算備付金                    | 39 | 15,106,527               | 16,765,418               |
| 存放中央銀行款項                 | 40 | 4,443,655                | 3,304,209                |
| 存放同業                     | 40 | 247,320                  | 226,337                  |
| 銀行結餘及現金                  | 32 | 179,954,155              | 156,448,163              |
| <b>流動資產總額</b>            |    | <b>584,246,677</b>       | 586,981,950              |
| <b>資產總額</b>              |    | <b>749,565,861</b>       | 744,925,149              |

## 中期簡明綜合財務狀況表

於二零二二年六月三十日

（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

|                      | 附註 | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|----------------------|----|--------------------------|--------------------------|
| <b>流動負債</b>          |    |                          |                          |
| 借款                   | 41 | 50,053,904               | 48,402,335               |
| 應付短期融資款              | 42 | 22,660,030               | 24,986,688               |
| 應付債券                 | 43 | 58,825,324               | 52,513,925               |
| 應付經紀業務客戶賬款           | 44 | 129,589,378              | 123,202,200              |
| 客戶存款                 | 45 | 5,006,434                | 2,758,837                |
| 合同負債                 |    | 25,969                   | 156,746                  |
| 其他應付款項及預計費用          | 46 | 28,475,757               | 28,635,826               |
| 租賃負債                 | 16 | 294,800                  | 307,759                  |
| 預計負債                 | 47 | 185,791                  | 203,800                  |
| 所得稅負債                |    | 1,339,886                | 3,477,590                |
| 以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債 | 48 | 7,280,889                | 10,456,105               |
| 衍生金融負債               | 37 | 1,275,152                | 1,548,316                |
| 賣出回購金融資產款            | 49 | 81,567,484               | 91,911,952               |
| 拆入資金                 | 50 | 7,757,132                | 12,723,438               |
| 向中央銀行借款              |    | 2,157,352                | 155,411                  |
| 同業及其他金融機構存放款項        |    | 15,508                   | 72,787                   |
| <b>流動負債總額</b>        |    | <b>396,510,790</b>       | 401,513,715              |
| <b>流動資產淨額</b>        |    | <b>187,735,887</b>       | 185,468,235              |
| <b>資產總額減流動負債</b>     |    | <b>353,055,071</b>       | 343,411,434              |

## 中期簡明綜合財務狀況表

於二零二二年六月三十日

(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

|                      | 附註 | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|----------------------|----|--------------------------|--------------------------|
| <b>非流動負債</b>         |    |                          |                          |
| 長期應付款                | 51 | 5,415,935                | 6,230,344                |
| 遞延稅項負債               | 30 | 965,254                  | 1,320,651                |
| 客戶存款                 | 45 | 1,371,640                | 3,185,654                |
| 長期借款                 | 41 | 36,975,027               | 30,751,726               |
| 應付債券                 | 43 | 114,645,657              | 111,072,145              |
| 向中央銀行借款              |    | 77,102                   | 2,150,202                |
| 其他應付款項及預計費用          | 46 | 1,374,977                | 1,405,175                |
| 以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債 | 48 | 11,130,499               | 5,860,112                |
| 租賃負債                 | 16 | 718,153                  | 739,420                  |
| 拆入資金                 | 50 | 2,898,252                | 2,941,219                |
| <b>非流動負債總額</b>       |    | <b>175,572,496</b>       | 165,656,648              |
| <b>負債總額</b>          |    | <b>572,083,286</b>       | 567,170,363              |
| <b>權益</b>            |    |                          |                          |
| 股本                   | 52 | 13,064,200               | 13,064,200               |
| 資本公積                 |    | 74,906,579               | 74,913,916               |
| 投資重估儲備               | 53 | (43,592)                 | 305,179                  |
| 外幣報表折算儲備             |    | (1,204,821)              | (962,857)                |
| 一般儲備                 | 54 | 28,372,669               | 28,313,210               |
| 未分配利潤                | 54 | 47,985,706               | 47,504,316               |
| <b>歸屬於本公司股東權益</b>    |    | <b>163,080,741</b>       | 163,137,964              |
| 非控制性權益               |    | 14,401,834               | 14,616,822               |
| <b>權益總額</b>          |    | <b>177,482,575</b>       | 177,754,786              |
| <b>權益及負債總額</b>       |    | <b>749,565,861</b>       | 744,925,149              |

相應附註系該未經審計的中期簡明綜合財務資料的組成部分。

未經審計的中期簡明綜合財務資料已於2022年8月26日由海通證券股份有限公司董事會批准並許可，並由以下代表簽署：

周杰

董事長

李軍

執行董事及總經理

張信軍

首席財務官

## 中期簡明綜合權益變動表

截至二零二二年六月三十日止六個月期間

（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

|                       | 歸屬於本公司股東權益 |              |                  |                  |            |                  |                  |                |                  |
|-----------------------|------------|--------------|------------------|------------------|------------|------------------|------------------|----------------|------------------|
|                       | 股本         | 資本公積<br>(附註) | 投資<br>重估儲備       | 外幣報表<br>折算儲備     | 一般儲備       | 未分配<br>利潤        | 合計               | 非控制性<br>權益     | 權益總額             |
| (未經審計)                |            |              |                  |                  |            |                  |                  |                |                  |
| 於2021年12月31日          | 13,064,200 | 74,913,916   | 305,179          | (962,857)        | 28,313,210 | 47,504,316       | 163,137,964      | 14,616,822     | 177,754,786      |
| 本期間利潤                 | -          | -            | -                | -                | -          | 4,757,725        | 4,757,725        | (292,364)      | 4,465,361        |
| 本期間其他全面收益/(損失)        | -          | -            | (640,411)        | (241,964)        | -          | -                | (882,375)        | 940,573        | 58,198           |
| <b>本期間全面收益/(損失)總額</b> | <b>-</b>   | <b>-</b>     | <b>(640,411)</b> | <b>(241,964)</b> | <b>-</b>   | <b>4,757,725</b> | <b>3,875,350</b> | <b>648,209</b> | <b>4,523,559</b> |
| 子公司發行的其他權益工具          | -          | -            | -                | -                | -          | -                | -                | (231,686)      | (231,686)        |
| 劃撥至一般儲備               | -          | -            | -                | -                | 59,459     | (59,459)         | -                | -              | -                |
| 確認為分派的現金股利(附註58)      | -          | -            | -                | -                | -          | (3,919,260)      | (3,919,260)      | -              | (3,919,260)      |
| 向非控制性權益方和其他           |            |              |                  |                  |            |                  |                  |                |                  |
| 權益工具持有者分派股利           | -          | -            | -                | -                | -          | -                | -                | (189,227)      | (189,227)        |
| 子公司股份支付               | -          | (32,903)     | -                | -                | -          | -                | (32,903)         | (16,070)       | (48,973)         |
| 以公允價值計量且其變動計入         |            |              |                  |                  |            |                  |                  |                |                  |
| 其他全面收益的權益工具處置         | -          | -            | 291,640          | -                | -          | (291,640)        | -                | -              | -                |
| 非控制性權益變動              | -          | 25,566       | -                | -                | -          | -                | 25,566           | (428,339)      | (402,773)        |
| 其他                    | -          | -            | -                | -                | -          | (5,976)          | (5,976)          | 2,125          | (3,851)          |
| 於2022年6月30日           | 13,064,200 | 74,906,579   | (43,592)         | (1,204,821)      | 28,372,669 | 47,985,706       | 163,080,741      | 14,401,834     | 177,482,575      |

## 中期簡明綜合權益變動表

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

|                                | 歸屬於本公司股東權益 |              |            |              |            |             |             |            |             |
|--------------------------------|------------|--------------|------------|--------------|------------|-------------|-------------|------------|-------------|
|                                | 股本         | 資本公積<br>(附註) | 投資<br>重估儲備 | 外幣報表<br>折算儲備 | 一般儲備       | 未分配<br>利潤   | 合計          | 非控制性<br>權益 | 權益總額        |
| (未經審計)                         |            |              |            |              |            |             |             |            |             |
| 於2020年12月31日                   | 13,064,200 | 74,888,284   | 282,378    | (932,948)    | 24,924,156 | 41,222,398  | 153,448,468 | 14,677,844 | 168,126,312 |
| 本期間利潤                          | -          | -            | -          | -            | -          | 8,170,195   | 8,170,195   | 718,545    | 8,888,740   |
| 本期間其他全面收益/(損失)                 | -          | -            | (129,668)  | (65,302)     | -          | -           | (194,970)   | (151,816)  | (346,786)   |
| 本期間全面收益/(損失)總額                 | -          | -            | (129,668)  | (65,302)     | -          | 8,170,195   | 7,975,225   | 566,729    | 8,541,954   |
| 子公司發行的其他權益工具                   | -          | -            | -          | -            | -          | -           | -           | 271,330    | 271,330     |
| 劃撥至一般儲備                        | -          | -            | -          | -            | 94,732     | (94,732)    | -           | -          | -           |
| 確認為分派的現金股利(附註58)               | -          | -            | -          | -            | -          | (3,266,050) | (3,266,050) | -          | (3,266,050) |
| 向非控制性權益方和其他<br>權益工具持有者分派股利     | -          | -            | -          | -            | -          | -           | -           | (405,802)  | (405,802)   |
| 子公司股份支付                        | -          | 8,212        | -          | -            | -          | -           | 8,212       | 44,862     | 53,074      |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>其他全面收益的權益工具處置 | -          | -            | (22,051)   | -            | -          | 22,051      | -           | -          | -           |
| 非控制性權益變動                       | -          | 14,092       | -          | -            | -          | -           | 14,092      | (41,611)   | (27,519)    |
| 其他                             | -          | -            | -          | -            | -          | (1,322)     | (1,322)     | 1,322      | -           |
| 於2021年6月30日                    | 13,064,200 | 74,910,588   | 130,659    | (998,250)    | 25,018,888 | 46,052,540  | 158,178,625 | 15,114,674 | 173,293,299 |

附註：本集團的資本公積主要為(i)發行本公司股份所產生的股份溢價；(ii)所支付或收到對價與所佔資產淨值(因集團對子公司未喪失控制權的權益變動)份額之間的差額。

相應附註系該未經審計的中期簡明綜合財務資料的組成部分。

## 中期簡明綜合現金流量表

截至二零二二年六月三十日止六個月期間

（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

|   | 截至6月30日止六個月期間      |                |
|---|--------------------|----------------|
|   | 2022<br>(未經審計)     | 2021<br>(未經審計) |
| <b>經營活動</b>                             |                    |                |
| 所得稅前利潤                                  | <b>5,886,065</b>   | 11,660,950     |
| 就下列各項作出調整：                              |                    |                |
| 利息支出                                    | <b>6,451,309</b>   | 5,909,050      |
| 攤分聯營合營企業業績                              | <b>(303,592)</b>   | (624,745)      |
| 折舊及攤銷費用                                 | <b>754,583</b>     | 792,437        |
| 預期信用損失模式下的減值損失                          | <b>178,663</b>     | 1,024,765      |
| 其他資產減值損失計提                              | <b>25,911</b>      | 44,083         |
| 子公司權益結算的股份支付確認的費用                       | <b>(32,903)</b>    | 45,408         |
| 處置物業、設備及其它無形資產的損失                       | <b>652</b>         | 890            |
| 匯兌損失／(收益)淨額                             | <b>297,910</b>     | (80,348)       |
| 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具的利息收入           | <b>(665,732)</b>   | (311,083)      |
| 以攤餘成本計量的債務工具的利息收入                       | <b>(50,015)</b>    | (17,373)       |
| 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具產生的<br>股利收入     | <b>(68,037)</b>    | (1,001,781)    |
| 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具產生的<br>已實現收益淨額  | <b>(33,523)</b>    | (666,996)      |
| 以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產產生的已實現<br>(收益)／損失淨額 | <b>(220,143)</b>   | 1,425,389      |
| 以公允價值計量且其變動計入損益的金融工具的公允價值變動             | <b>(1,358,310)</b> | (1,324,131)    |
| <b>營運資金變動前的營運現金流量</b>                   | <b>10,862,838</b>  | 16,876,515     |

## 中期簡明綜合現金流量表

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

|                                 | 截至6月30日止六個月期間  |                |
|---------------------------------|----------------|----------------|
|                                 | 2022<br>(未經審計) | 2021<br>(未經審計) |
| 應收融資租賃款和售後回租安排的應收款的(增加)/減少      | (5,767,145)    | 200,316        |
| 以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產和衍生金融資產的減少  | 18,449,870     | 5,557,473      |
| 買入返售金融資產(增加)/減少                 | (2,734,982)    | 14,085,539     |
| 其他貸款及應收款減少                      | 7,662,084      | 2,481,653      |
| 客戶貸款(增加)/減少                     | (635,682)      | 52,703         |
| 客戶墊款減少/(增加)                     | 5,210,668      | (7,382,796)    |
| 應收賬款及其他流動資產減少/(增加)              | 3,523,309      | (7,667,984)    |
| 拆出資金減少/(增加)                     | 272,229        | (19,055)       |
| 交易所保證金增加                        | (2,387,543)    | (1,819,351)    |
| 存放中央銀行款項減少                      | 5,650          | 3,561          |
| 受限制的銀行存款減少/(增加)                 | 85,588         | (467,548)      |
| 代客戶持有的現金增加                      | (6,395,573)    | (11,291,943)   |
| 應付經紀業務客戶款項及其他應付款項及預計費用增加        | 420,289        | 10,174,953     |
| 客戶存款增加                          | 433,583        | 926,112        |
| 合同負債(減少)/增加                     | (130,777)      | 103,447        |
| 預計負債減少                          | (17,702)       | (3,462)        |
| 以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債以及衍生金融負債的增加 | 2,820,403      | 5,703,249      |
| 賣出回購金融資產款減少                     | (10,344,468)   | (737,431)      |
| 拆入資金(減少)/增加                     | (5,009,274)    | 971,553        |
| 向中央銀行借款減少                       | (71,159)       | (53,327)       |
| 同業存款(減少)/增加                     | (57,279)       | 2,120          |
| 來自經營業務的現金                       | 16,194,927     | 27,696,297     |
| 已付所得稅淨額                         | (3,274,447)    | (3,551,097)    |
| 已付利息                            | (1,991,922)    | (1,483,674)    |
| 來自經營活動的現金淨額                     | 10,928,558     | 22,661,526     |

## 中期簡明綜合現金流量表

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

|  | 截至6月30日止六個月期間      |                  |
|--|--------------------|------------------|
|  | 2022<br>(未經審計)     | 2021<br>(未經審計)   |
| <b>投資活動</b>                                  |                    |                  |
| 從聯營企業和其他投資收到的股利                              | 403,573            | 248,150          |
| 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具收到的股利                | 68,037             | 1,001,781        |
| 收到以攤餘成本計量的債務工具及以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具的利息收入 | 564,267            | —                |
| 購買物業、設備及其他無形資產                               | (1,852,868)        | (793,665)        |
| 出售子公司收到的現金淨額                                 | 132,053            | —                |
| 處置物業及設備所得款項                                  | 1,204              | 780              |
| 注資聯營企業和合營企業                                  | (72,373)           | —                |
| 部分處置聯營企業的所得款項                                | 103,168            | 96,531           |
| 購買以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具的現金流出              | (14,360,041)       | (5,415,617)      |
| 購買以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產的現金流出                  | (1,220,454)        | (2,683,541)      |
| 購買以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具的現金流出              | (1,511,170)        | (4,206,518)      |
| 購買以攤餘成本計量的債務工具的現金流出                          | (1,133,406)        | (85,168)         |
| 處置收回以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具款項               | 4,534,861          | 10,714,470       |
| 處置收回以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具款項               | 9,635,835          | 298,347          |
| 處置收回以攤餘成本計量的債務工具款項                           | 318,535            | 261,800          |
| 處置收回以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產款項                   | 1,943,205          | 446,216          |
| <b>用於投資活動的現金淨額</b>                           | <b>(2,445,574)</b> | <b>(116,434)</b> |

## 中期簡明綜合現金流量表

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

|                          | 截至6月30日止六個月期間     |                    |
|--------------------------|-------------------|--------------------|
|                          | 2022<br>(未經審計)    | 2021<br>(未經審計)     |
| <b>籌資活動</b>              |                   |                    |
| 借款、債券支付的利息及已付股利          | (4,283,454)       | (4,411,462)        |
| 吸收少數股東投資                 | -                 | 295,543            |
| 少數股東收回投資款項               | (406,543)         | (88,370)           |
| 籌集借款所得款項                 | 43,467,339        | 45,748,721         |
| 永續債支付的利息                 | (77,424)          | (57,336)           |
| 短期融資券及非可轉換債券等發行費用        | (92,731)          | (149,688)          |
| 償還租賃負債的款項                | (211,224)         | (245,568)          |
| 償還借款、短期融資券及非可轉換債券等支付的款項  | (87,529,796)      | (114,406,837)      |
| 發行短期融資券及非可轉換債券等所得款項      | 56,850,897        | 65,566,997         |
| 為股權激勵計劃回購股份              | (14,679)          | 88,370             |
| <b>來自／(用於)籌資活動的現金淨額</b>  | <b>7,702,385</b>  | <b>(7,659,630)</b> |
| 現金及現金等價物增加淨額             | 16,185,369        | 14,885,462         |
| 外匯變動影響                   | 405,189           | 294,623            |
| 期初的現金及現金等價物              | 57,705,067        | 37,307,276         |
| <b>期末的現金及現金等價物(附註33)</b> | <b>74,295,625</b> | <b>52,487,361</b>  |

相應附註系該未經審計的中期簡明綜合財務資料的組成部分。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 1 一般資料

海通證券股份有限公司「本公司」前身為成立於1988年的上海海通證券公司，於1994年9月經中國人民銀行批准，改制為全國性的有限責任公司，更名為「海通證券有限公司」。2001年12月，本公司經中國證券監督管理委員會（「中國證監會」）批准，進一步改制為股份有限公司。2002年1月，本公司由海通證券有限公司更名為「海通證券股份有限公司」。2007年6月，本公司與原上海市都市農商社股份有限公司的合併事宜獲中國證監會批准，同年7月在上交所上市，上市後，名稱變更為「海通證券」。2012年4月27日公司H股在香港聯合交易所有限公司（以下簡稱「香港聯交所」）主板掛牌上市。

本公司的註冊地址及辦公地址為中華人民共和國上海市廣東路689號海通證券大廈。

本公司經營範圍為：證券經紀；證券自營；證券承銷與保薦；證券投資諮詢；與證券交易、證券投資活動有關的財務顧問；直接投資業務；證券投資基金代銷；為期貨公司提供中間介紹業務；融資融券業務；代銷金融產品；股票期權做市業務；中國證監會批准的其他業務，本公司可以對外投資設立子公司從事金融產品等投資業務（依法須經批准的項目，經相關部門批准後方可開展經營活動）。

中期簡明綜合財務資料乃以人民幣列示，而人民幣為本公司的功能貨幣。

### 2 編制基礎及重要會計政策

本簡明綜合中期財務資料已根據國際會計準則第34號「中期財務報告」以及香港證券交易所證券上市規則要求的披露編制。

除某些金融工具以公允價值計量外，本中期簡明綜合財務資料是以歷史成本作為計量基礎。

本集團採用持續經營基礎，編制其中期簡明財務資料。

簡明綜合財務資料並不包括年度財務報表中通常包含的所有附註。本中期簡明綜合財務資料應與按照國際會計準則理事會頒佈的國際財務報告準則編制的2021年度財務報表及本公司於本報告期的公開披露一併閱覽。

除下述附註2.1提及的採用新增及修訂的準則外，本中期簡明綜合財務資料採用的會計政策與2021年度綜合財務報表和2021年度中期財務資料所採用的會計政策一致。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 2 編制基礎及重要會計政策 (續)

#### 2.1 集團採用的新增及修訂標準

自2022年1月1日起，本集團首次在中期財務資料中採用了以下新增或修訂準則：

- (a) 不動產、廠房和設備 — 對《國際財務報告準則第16號》的修訂；
- (b) 準備、或有負債和或有資產 — 對《國際財務報告準則第37號》的修訂；
- (c) 企業合併 — 對《國際財務報告準則第3號》的修訂

##### (a) 國際會計準則第16號 (修訂)：不動產、廠房和設備

該修訂禁止企業將固定資產達到預定可使用狀態前投入生產而產生的產品銷售收入抵減固定資產成本，企業應當將這些銷售收入和相關成本在損益表中予以確認。上述修訂的採用沒有對本集團的中期簡明綜合財務資料產生重大影響。

##### (b) 國際會計準則第37號 (修訂)：準備、或有負債和或有資產

該修訂明確了企業在評估合同是否虧損時應當考慮的成本因素。上述修訂的採用沒有對本集團的中期簡明綜合財務資料產生重大影響。

##### (c) 國際財務報告準則第3號 (修訂)：企業合併

國際會計準則理事會發佈了對國際財務報告準則第3號中對財務報告概念框架引用的更新修訂，未改變企業合併的會計處理。上述修訂的採用沒有對本集團中期簡明綜合財務資料產生重大影響。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 2 編制基礎及重要會計政策 (續)

#### 2.2 已頒佈但本集團尚未採用的新準則的影響

|     |                               |                          | 於此日期起／之後的<br>年度內生效                                   |
|-----|-------------------------------|--------------------------|--|
| (a) | 國際財務報告準則第17號                  | 保險合同                     | 2023年1月1日  |
| (b) | 國際會計準則第1號(修訂)                 | 負債的分類                    | 2023年1月1日  |
| (c) | 國際會計準則第1號和國際財務報告準則實務公告第2號(修訂) | 會計政策的披露                  | 2023年1月1日  |
| (d) | 國際會計準則第8號(修訂)                 | 會計估計的定義                  | 2023年1月1日  |
| (e) | 國際會計準則第12號(修訂)                | 與單一交易產生的資產和負債相關的遞延所得稅    | 2023年1月1日  |
| (f) | 國際財務報告準則第10號和國際會計準則第28號(修訂)   | 投資者與其合營及聯營企業之間的資產出售／資產出資 | 該修訂原定於自2016年1月1日或之後的年度內生效。目前，其生效日期已無限期推遲，但允許提前採用本次修訂 |

本集團預期上述修訂的採用不會對本集團的財務報表產生重大影響。

#### 2.3 關鍵會計估計及判斷

本集團持續評估基於歷史經驗和其他因素(包括對未來事件的合理預期)所採用的重大會計估計和判斷。具有導致資產和負債賬面金額重大調整的重大風險會計估計和關鍵假設，與編制截至2021年12月31日止年度財務報表時採用的政策一致。

### 3 分部報告

為作出資源配置及評估分部表現，向本公司董事會(作為首席營運決策者)報告的信息主要集中於由本集團銷售要求、內部報告制度為依據確定經營分部，以經營分部為基礎確定報告分部。經營分部是指公司內同時滿足下列條件的組成部分：(1)該組成部分能夠在日常活動中產生收入、發生費用；(2)本公司董事會能定期評價該組成部分的經營成果，以決定向其配置資源、評價其業績；(3)公司能夠取得該組成部分的財務狀況、經營成果和現金流量等有關會計信息。如果兩個或多個經營分部存在相似經濟特徵且同時具有相同或相似性的經營方式，可以合併為一個經營分部。根據公司戰略規劃及內部管理要求，公司確定六大經營分部：財富管理、投資銀行、資產管理、交易及機構、融資租賃及其他。公司報告分部劃分與經營分部一致。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 3 分部報告 (續)

分部信息按照各分部向本公司董事會報告時所採用的會計政策和計量標準進行計量，這些標準與編制中期簡明綜合財務資料時的會計和計量標準一致。

具體來說，本集團經營分部如下：

- (1) 財富管理分部：主要向零售及高淨值客戶提供綜合的金融服務和投資解決方案，提供的服務包括證券及期貨經紀服務、投資顧問服務、財富管理服務、以及向客戶提供融資融券、股票質押等融資類業務服務。
- (2) 投資銀行分部：主要向企業和政府客戶提供股票資本市場和債券資本市場融資活動的保薦和承銷服務，為企業客戶的收購兼併、資產重組等提供財務顧問服務，同時提供新三板服務。
- (3) 資產管理分部：主要向個人、企業和機構客戶提供綜合的多元產品投資管理服務，提供的服務包括資產管理、基金管理和股權投資服務。
- (4) 交易及機構分部：主要向全球機構投資者提供全球主要金融市場的股票銷售交易、大宗經紀、股票借貸、全球主要市場的股票研究。亦為世界各地主要交易所的固定收益產品、貨幣及商品產品、期貨及期權、及衍生品提供市場製作服務。
- (5) 融資租賃分部：主要向個人、企業和政府提供創新型金融服務解決方案，提供的服務包括融資租賃、經營租賃、保理、委託貸款和相關諮詢服務。
- (6) 其他分部：為機構客戶提供其他綜合性金融及信息服務，提供的服務包括倉單服務等。

分部利潤／虧損指各分部在未經分配所得稅支出前所賺得的利潤／所錄得的虧損。該等計算乃為資源配置及評估業績而報告予首席營運決策者。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間

(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 3 分部報告 (續)

#### 經營和可報告分部

截至2022年6月30日止六個月期間 (未經審計)

|                | 財富管理<br>分部  | 投資銀行<br>分部  | 資產管理<br>分部 | 交易及機構<br>分部 | 融資租賃<br>分部  | 其他分部      | 合計           |
|----------------|-------------|-------------|------------|-------------|-------------|-----------|--------------|
| <b>分部收益及業績</b> |             |             |            |             |             |           |              |
| 收入             | 7,500,561   | 2,461,139   | 1,281,327  | 3,317,740   | 3,352,119   | 18,257    | 17,931,143   |
| 其他收入及收益        | 268,857     | 159,444     | 139,284    | 33,405      | 840,555     | 492,143   | 1,933,688    |
| 分部收入           | 7,769,418   | 2,620,583   | 1,420,611  | 3,351,145   | 4,192,674   | 510,400   | 19,864,831   |
| 分部支出           | (4,310,696) | (1,623,972) | (745,375)  | (3,672,666) | (3,376,929) | (552,720) | (14,282,358) |
| 分部業績           | 3,458,722   | 996,611     | 675,236    | (321,521)   | 815,745     | (42,320)  | 5,582,473    |
| 應佔聯營企業業績       | -           | -           | 311,695    | (8,103)     | -           | -         | 303,592      |
| 所得稅前利潤         | 3,458,722   | 996,611     | 986,931    | (329,624)   | 815,745     | (42,320)  | 5,886,065    |

截至2021年6月30日止六個月期間 (未經審計)

|                | 財富管理<br>分部  | 投資銀行<br>分部  | 資產管理<br>分部  | 交易及機構<br>分部 | 融資租賃<br>分部  | 其他分部        | 合計           |
|----------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|--------------|
| <b>分部收益及業績</b> |             |             |             |             |             |             |              |
| 收入             | 8,274,357   | 2,972,125   | 2,100,512   | 8,587,321   | 3,264,332   | (7,166)     | 25,191,481   |
| 其他收入及收益        | 177,094     | 188,341     | 119,683     | 114,401     | 989,240     | 3,993,480   | 5,582,239    |
| 分部收入           | 8,451,451   | 3,160,466   | 2,220,195   | 8,701,722   | 4,253,572   | 3,986,314   | 30,773,720   |
| 分部支出           | (5,187,034) | (1,528,397) | (1,042,688) | (4,500,682) | (3,460,652) | (4,018,062) | (19,737,515) |
| 分部業績           | 3,264,417   | 1,632,069   | 1,177,507   | 4,201,040   | 792,920     | (31,748)    | 11,036,205   |
| 應佔聯營企業業績       | -           | -           | 337,672     | 287,073     | -           | -           | 624,745      |
| 所得稅前利潤         | 3,264,417   | 1,632,069   | 1,515,179   | 4,488,113   | 792,920     | (31,748)    | 11,660,950   |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 3 分部報告 (續)

#### 經營和可報告分部 (續)

於2022年6月30日 (未經審計)

|                | 財富管理<br>分部  | 投資銀行<br>分部 | 資產管理<br>分部 | 交易及機構<br>分部 | 融資租賃<br>分部  | 其他分部      | 合計                 |
|----------------|-------------|------------|------------|-------------|-------------|-----------|--------------------|
| <b>分部資產及負債</b> |             |            |            |             |             |           |                    |
| 分部資產           | 243,587,326 | 9,731,563  | 13,451,605 | 352,326,372 | 115,924,570 | 3,780,828 | 738,802,264        |
| 權益法項下投資        | -           | -          | 1,885,105  | 4,442,904   | -           | -         | 6,328,009          |
| 遞延稅項資產         |             |            |            |             |             |           | 4,435,588          |
| <b>集團資產總額</b>  |             |            |            |             |             |           | <b>749,565,861</b> |
| 分部負債           | 198,140,503 | 9,779,329  | 6,566,702  | 248,302,934 | 107,528,821 | 799,743   | 571,118,032        |
| 遞延稅項負債         |             |            |            |             |             |           | 965,254            |
| <b>集團負債總額</b>  |             |            |            |             |             |           | <b>572,083,286</b> |

於2021年12月31日 (經審計)

|                | 財富管理<br>分部  | 投資銀行<br>分部 | 資產管理<br>分部 | 交易及機構<br>分部 | 融資租賃<br>分部  | 其他分部      | 合計                 |
|----------------|-------------|------------|------------|-------------|-------------|-----------|--------------------|
| <b>分部資產及負債</b> |             |            |            |             |             |           |                    |
| 分部資產           | 241,389,287 | 10,094,708 | 13,824,798 | 350,203,976 | 114,017,446 | 3,768,589 | 733,298,804        |
| 權益法項下投資        | -           | -          | 1,957,895  | 4,496,525   | -           | -         | 6,454,420          |
| 遞延稅項資產         |             |            |            |             |             |           | 5,171,925          |
| <b>集團資產總額</b>  |             |            |            |             |             |           | <b>744,925,149</b> |
| 分部負債           | 192,472,695 | 9,040,397  | 7,705,572  | 250,499,642 | 106,049,411 | 81,995    | 565,849,712        |
| 遞延稅項負債         |             |            |            |             |             |           | 1,320,651          |
| <b>集團負債總額</b>  |             |            |            |             |             |           | <b>567,170,363</b> |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 4 佣金及手續費收入

|                      | 截至6月30日止六個月期間    |                  |
|----------------------|------------------|------------------|
|                      | 2022<br>(未經審計)   | 2021<br>(未經審計)   |
| 證券、期貨及期權交易及經紀業務手續費收入 | 3,984,888        | 4,528,298        |
| 承銷費及保薦費收入            | 2,347,204        | 2,392,905        |
| 資產管理費收入(含基金管理費收入)    | 1,108,055        | 1,845,893        |
| 財務諮詢顧問費收入            | 203,137          | 291,438          |
| 其他                   | 56,027           | 72,764           |
|                      | <b>7,699,311</b> | <b>9,131,298</b> |

與本集團取得佣金及手續費收入相關的主要業務類型如下：

#### (1) 經紀業務收入

本集團從事代理買賣證券及期貨經紀業務在交易完成時點按照成交金額及約定費率確認收入；本集團從事金融產品代銷業務在代銷完成時點按照代銷規模及約定費率確認收入。

#### (2) 投資銀行業務收入

本集團從事證券和債券承銷業務在承銷合同中約定的履約義務完成時點按照合同或協議約定的金額確認收入；本集團從事證券發行上市保薦業務和企業客戶財務顧問服務，本集團認為作為保薦人或企業顧問的特定合約所承諾的所有服務均相互依存及相互關聯，因此以單一履約義務確認收入。

#### (3) 資產管理業務收入

本集團接受客戶委託負責經營管理受託資產，由於在本集團履約的同時委託客戶即取得並消耗本集團履約所帶來的經濟利益，因此本集團在履約義務履行期間內根據受託管理資產規模及約定費率確認收入；本集團提供資產管理業務根據受託資產業績狀況可能收取額外的業績報酬，本集團在業績評價週期期末，在與業績報酬相關的不確定性消除、已確認的累計收入金額很可能不會發生重大轉回時，按照合同或協議約定的計算方法確認為當期收入。

截至2022年6月30日，本集團與客戶簽訂的大部分合同的原始預期存續期小於一年。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 5 利息收入

|   | 截至6月30日止六個月期間    |                |
|---|------------------|----------------|
|   | 2022<br>(未經審計)   | 2021<br>(未經審計) |
| 客戶墊款的利息收入                                     | 2,321,896        | 2,638,593      |
| 售後回租安排的應收款利息收入                                | 1,937,065        | 1,248,140      |
| 銀行利息收入  | 1,774,838        | 1,485,798      |
| 買入返售金融資產利息收入                                  | 1,016,331        | 1,119,155      |
| 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具和<br>以攤餘成本計量的債務工具利息收入 | 715,747          | 328,456        |
| 貸款及應收款項利息收入                                   | 487,593          | 678,900        |
| 其他利息收入  | 4,985            | 385            |
|   | <b>8,258,455</b> | 7,499,427      |
| 融資租賃收入  | <b>1,280,942</b> | 1,771,581      |

### 6 投資收入及收益 (淨額)

|   | 截至6月30日止六個月期間  |                |
|---|----------------|----------------|
|   | 2022<br>(未經審計) | 2021<br>(未經審計) |
| 以公允價值計量且其變動計入損益的金融工具的公允價值變動                 | 1,358,310      | 1,324,131      |
| 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具產生的股利收入             | 68,037         | 1,001,781      |
| 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具產生的<br>已實現收益/(損失)淨額 | 33,523         | (771,470)      |
| 以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產/負債產生的<br>已實現(損失)/收益淨額  | (742,738)      | 5,454,821      |
| 其他  | (24,697)       | (220,088)      |
|   | <b>692,435</b> | 6,789,175      |

### 7 其他收入及收益

|           | 截至6月30日止六個月期間    |                |
|-----------|------------------|----------------|
|           | 2022<br>(未經審計)   | 2021<br>(未經審計) |
| 政府補助      | 676,499          | 543,328        |
| 服務收入      | 488,559          | 588,161        |
| 大宗商品貿易收入  | 479,252          | 3,974,660      |
| 經營租賃的租金收入 | 262,553          | 234,863        |
| 投資物業的租金收入 | 5,003            | 4,439          |
| 匯兌(損失)/收益 | (297,910)        | 80,349         |
| 其他        | 319,732          | 156,439        |
|           | <b>1,933,688</b> | 5,582,239      |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間

(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 8 佣金及手續費支出

|                | 截至6月30日止六個月期間    |                |
|----------------|------------------|----------------|
|                | 2022<br>(未經審計)   | 2021<br>(未經審計) |
| 證券及期貨買賣及經紀業務費用 | 1,386,710        | 1,664,541      |
| 經紀人佣金支出        | 124,170          | 239,034        |
| 證券承銷、財務顧問等服務支出 | 47,750           | 62,546         |
|                | <b>1,558,630</b> | 1,966,121      |

### 9 利息支出

|                              | 截至6月30日止六個月期間    |                |
|------------------------------|------------------|----------------|
|                              | 2022<br>(未經審計)   | 2021<br>(未經審計) |
| 利息支出源自：                      |                  |                |
| — 借款及透支                      | 1,217,834        | 1,325,051      |
| — 銀行及其他金融機構拆入資金              | 57,745           | 88,465         |
| — 賣出回購金融資產款                  | 981,576          | 718,688        |
| — 應付經紀業務客戶款項                 | 377,406          | 255,851        |
| — 轉融通支付於中國證券金融股份有限公司(「證金公司」) | 188,062          | 152,290        |
| — 應付債券和應付短期融資款               | 3,220,642        | 3,080,056      |
| — 租賃負債                       | 20,912           | 20,269         |
| — 其他                         | 387,132          | 268,380        |
|                              | <b>6,451,309</b> | 5,909,050      |

### 10 折舊和攤銷費用

|          | 截至6月30日止六個月期間  |                |
|----------|----------------|----------------|
|          | 2022<br>(未經審計) | 2021<br>(未經審計) |
| 物業及設備折舊  | 437,732        | 455,650        |
| 使用權資產折舊  | 221,589        | 237,188        |
| 投資物業折舊   | 1,514          | 1,919          |
| 其他無形資產攤銷 | 93,748         | 97,680         |
|          | <b>754,583</b> | 792,437        |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 11 預期信用損失模式下的減值損失

|                            | 截至6月30日止六個月期間  |                  |
|----------------------------|----------------|------------------|
|                            | 2022<br>(未經審計) | 2021<br>(未經審計)   |
| 預期信用損失源自：                  |                |                  |
| — 應收融資租賃款                  | 639,862        | 497,562          |
| — 售後回租安排的應收款               | 145,587        | 131,908          |
| — 孖展融資客戶墊款                 | 312,635        | 284,991          |
| — 買入返售金融資產                 | (822,810)      | (133,368)        |
| — 其他貸款及應收款項                | (82,843)       | 160,973          |
| — 以攤餘成本計量的債務工具             | 1,238          | 3,324            |
| — 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具 | (54,550)       | 37,700           |
| — 客戶貸款                     | (2,562)        | (13,275)         |
| — 其他金融資產及其他項目              | 42,106         | 54,950           |
|                            | <b>178,663</b> | <b>1,024,765</b> |

### 12 其他支出

|          | 截至6月30日止六個月期間    |                  |
|----------|------------------|------------------|
|          | 2022<br>(未經審計)   | 2021<br>(未經審計)   |
| 管理費用     | 1,138,973        | 1,524,196        |
| 大宗商品貿易成本 | 474,761          | 3,918,072        |
| 稅金及附加    | 156,695          | 151,626          |
| 其他       | 54,464           | 108,076          |
|          | <b>1,824,893</b> | <b>5,701,970</b> |

### 13 所得稅費用

|        | 截至6月30日止六個月期間    |                  |
|--------|------------------|------------------|
|        | 2022<br>(未經審計)   | 2021<br>(未經審計)   |
| 當期稅項   | 838,021          | 2,041,667        |
| 調整以前年度 | 45,612           | (71,513)         |
| 遞延稅項   | 537,071          | 802,056          |
|        | <b>1,420,704</b> | <b>2,772,210</b> |

根據中華人民共和國企業所得稅法(「企業所得稅法」)及企業所得稅法實施條例，自2008年1月1日開始稅率為25%。

本集團在香港經營的子公司適用香港利得稅。香港利得稅是就在香港產生的估計應課稅溢利按稅率16.5%計算。

其他司法權區的稅項是根據有關司法權區的現行稅率計算。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間

（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

### 14 每股收益

|                     | 截至6月30日止六個月期間  |                |
|---------------------|----------------|----------------|
|                     | 2022<br>(未經審計) | 2021<br>(未經審計) |
| 用以計算每股基本收益的收益：      |                |                |
| 本公司股東應佔期間利潤         | 4,757,725      | 8,170,195      |
| 子公司稀釋潛在普通股的影響（附註）：  |                |                |
| 子公司可轉換債券利息          | -              | (1,765)        |
| 子公司的認股權／股份獎勵        | -              | (765)          |
| 用以計算每股稀釋收益的收益       | 4,757,725      | 8,167,665      |
| 用以計算基本／稀釋每股收益的股份數目： |                |                |
| 已發行股數（千股）           | 13,064,200     | 13,064,200     |
| 基本每股收益（以每股人民幣元列示）   | 0.36           | 0.63           |
| 稀釋每股收益（以每股人民幣元列示）   | 0.36           | 0.63           |

附註：稀釋每股收益的計算在歸屬於母公司普通股股東的當期淨利潤進行調整所得。本集團計算稀釋每股收益時當期淨利潤考慮了子公司發行的可轉換債券，假設已發行的可轉換債券在當期起初已轉換為子公司普通股；並考慮了子公司的各類員工股票期權和員工股票獎勵行權後攤薄每股收益的影響。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 15 物業及設備

|                   | 土地及<br>建築物 | 租賃物<br>改良 | 電子設備      | 交通運輸<br>設備 | 傢俱、<br>裝置及設備 | 在建工程     | 總計         |
|-------------------|------------|-----------|-----------|------------|--------------|----------|------------|
| (未經審計)            |            |           |           |            |              |          |            |
| <b>成本</b>         |            |           |           |            |              |          |            |
| 於2022年1月1日        | 9,518,750  | 888,291   | 1,756,610 | 6,212,464  | 298,082      | 330,123  | 19,004,320 |
| 增加                | -          | 20,191    | 61,953    | 1,556      | 5,632        | 89,830   | 179,162    |
| 處置                | -          | (20,415)  | (26,393)  | (1,431)    | (7,768)      | -        | (56,007)   |
| 轉移                | -          | 14,945    | 2,125     | -          | 4,382        | (21,452) | -          |
| 匯兌差額              | 18,396     | 4,644     | 7,056     | 318,781    | 2,402        | (298)    | 350,981    |
| 於2022年6月30日       | 9,537,146  | 907,656   | 1,801,351 | 6,531,370  | 302,730      | 398,203  | 19,478,456 |
| <b>累計折舊</b>       |            |           |           |            |              |          |            |
| 於2022年1月1日        | 952,231    | 633,768   | 1,192,217 | 859,267    | 201,318      | -        | 3,838,801  |
| 增加                | 129,085    | 55,528    | 112,476   | 128,172    | 12,471       | -        | 437,732    |
| 處置                | -          | (15,743)  | (25,251)  | (1,360)    | (7,384)      | -        | (49,738)   |
| 匯兌差額              | 2,053      | 4,075     | 5,508     | 42,187     | 1,657        | -        | 55,480     |
| 於2022年6月30日       | 1,083,369  | 677,628   | 1,284,950 | 1,028,266  | 208,062      | -        | 4,282,275  |
| <b>減值損失備抵</b>     |            |           |           |            |              |          |            |
| 於2022年1月1日        | 30,382     | -         | -         | 46,261     | -            | -        | 76,643     |
| 匯兌差額              | -          | -         | -         | 2,436      | -            | -        | 2,436      |
| 於2022年6月30日       | 30,382     | -         | -         | 48,697     | -            | -        | 79,079     |
| <b>賬面價值</b>       |            |           |           |            |              |          |            |
| 於2022年6月30日(未經審計) | 8,423,395  | 230,028   | 516,401   | 5,454,407  | 94,668       | 398,203  | 15,117,102 |
| 於2021年12月31日(經審計) | 8,536,137  | 254,523   | 564,393   | 5,306,936  | 96,764       | 330,123  | 15,088,876 |

本集團交通運輸工具中包括用於開展經營租賃業務的飛機。於2022年6月30日，其原值為人民幣6,372,631千元(2021年12月31日：人民幣6,053,876千元)；累計折舊為人民幣892,719千元(2021年12月31日：人民幣726,263千元)；減值損失備抵為人民幣48,697千元(2021年12月31日：人民幣46,261千元)；淨值為人民幣5,431,216千元(2021年12月31日：人民幣5,281,352千元)。

截止2022年6月30日，本集團建築物中金額為人民幣28,860千元的房產產權證有待取得(2021年12月31日：人民幣29,460千元)。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 16 使用權資產及租賃負債

#### 使用權資產

|                   | 租賃土地及<br>房屋 | 電子設備 | 交通運輸<br>設備 | 其他    | 總計        |
|-------------------|-------------|------|------------|-------|-----------|
| (未經審計)            |             |      |            |       |           |
| <b>成本</b>         |             |      |            |       |           |
| 於2022年1月1日        | 2,992,253   | 803  | 4,160      | 2,108 | 2,999,324 |
| 期內添置              | 170,788     | -    | -          | 48    | 170,836   |
| 期內處置              | (385,827)   | -    | (977)      | -     | (386,804) |
| 匯兌差額              | 17,618      | (12) | 130        | (4)   | 17,732    |
| 於2022年6月30日       | 2,794,832   | 791  | 3,313      | 2,152 | 2,801,088 |
| <b>累計折舊</b>       |             |      |            |       |           |
| 於2022年1月1日        | 1,217,362   | 215  | 1,965      | 1,143 | 1,220,685 |
| 期內折舊              | 220,783     | 102  | 454        | 250   | 221,589   |
| 處置抵銷              | (371,283)   | -    | (771)      | -     | (372,054) |
| 匯兌差額              | 4,828       | (7)  | 7          | (1)   | 4,827     |
| 於2022年6月30日       | 1,071,690   | 310  | 1,655      | 1,392 | 1,075,047 |
| <b>賬面價值</b>       |             |      |            |       |           |
| 於2022年6月30日(未經審計) | 1,723,142   | 481  | 1,658      | 760   | 1,726,041 |
| 於2021年12月31日(經審計) | 1,774,891   | 588  | 2,195      | 965   | 1,778,639 |

#### 租賃負債

|                          | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 1年以內                     | 294,800                  | 307,759                  |
| 1年至2年                    | 243,152                  | 238,764                  |
| 2年至5年                    | 258,904                  | 249,731                  |
| 5年以上                     | 216,097                  | 250,925                  |
|                          | 1,012,953                | 1,047,179                |
| 於流動負債項下顯示的12個月內到期結算的金額   | 294,800                  | 307,759                  |
| 於非流動負債項下顯示的12個月以後到期結算的金額 | 718,153                  | 739,420                  |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 16 使用權資產及租賃負債(續)

#### 租賃負債(續)

本集團租賃各種土地和建築物，電子設備，及其他用於其運營。大多數租賃合同簽訂的租賃期限為1年到40年。租賃條款是根據個別情況協商確定的，其中包含各種不同的條款和條件。本集團在確定租賃期限和評估不可撤銷的期限時，採用合同的定義並確定合同可強制執行的期限。

截至2022年6月30日止六個月期間，租賃金額的總現金流出為人民幣227,340千元(截至2021年6月30日止六個月期間：人民幣276,565千元)。

截至2022年6月30日止六個月期間，租賃負債的利息支出為人民幣20,912千元(截至2021年6月30日止六個月期間：人民幣20,269千元)。

於2022年6月30日，租賃協議除出租人持有的租賃資產中的抵押權益外，不得簽訂任何其他契約。租賃資產不得用作借貸擔保。

於2022年6月30日，本集團未訂立尚未開始的任何重大租賃。

### 17 投資物業

#### 房屋、建築物

#### 成本

|            |           |
|------------|-----------|
| 於2022年1月1日 | 86,062    |
| 本期增加       | 2,254,148 |

|             |           |
|-------------|-----------|
| 於2022年6月30日 | 2,340,210 |
|-------------|-----------|

#### 累積折舊

|            |        |
|------------|--------|
| 於2022年1月1日 | 28,467 |
| 期內折舊       | 1,514  |

|             |        |
|-------------|--------|
| 於2022年6月30日 | 29,981 |
|-------------|--------|

#### 賬面價值

|                   |           |
|-------------------|-----------|
| 於2022年6月30日(未經審計) | 2,310,229 |
|-------------------|-----------|

|                   |        |
|-------------------|--------|
| 於2021年12月31日(經審計) | 57,595 |
|-------------------|--------|

於2022年6月30日，本集團投資物業的公允價值為人民幣3,004,813千元(2021年12月31日，人民幣308,710千元)，系參考相同或相似地點及狀況的類似物業的近期市價釐定公允價值。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 18 商譽

| 被投資單位名稱  | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) | 匯兌調整     | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) |
|--|--------------------------|----------|--------------------------|
| 海通期貨股份有限公司   | 5,896                    | -        | 5,896                    |
| 海通國際證券集團有限公司   | 641,800                  | 29,508   | 671,308                  |
| 海通恆信金融集團有限公司   | 2,047,416                | 94,132   | 2,141,548                |
| Haitong International Holdings (UK) Limited                    | 120,877                  | 5,557    | 126,434                  |
| Haitong Bank, S.A.   | 953,606                  | 43,843   | 997,449                  |
| Haitong International Financial Services (Singapore) Pte. Ltd. | 4,518                    | 207      | 4,725                    |
|  | 3,774,113                | 173,247  | 3,947,360                |
| 減：減值準備   |                          |          |                          |
| Haitong Bank, S.A.   | (408,800)                | (18,795) | (427,595)                |
|  | 3,365,313                | 154,452  | 3,519,765                |

### 19 其他無形資產

|                   | 交易席位費   | 電腦軟件      | 其他      | 在建工程     | 總計        |
|-------------------|---------|-----------|---------|----------|-----------|
| (未經審計)            |         |           |         |          |           |
| <b>成本</b>         |         |           |         |          |           |
| 於2022年1月1日        | 224,043 | 1,745,004 | 107,023 | 29,403   | 2,105,473 |
| 期內添置              | -       | 30,359    | -       | 4,474    | 34,833    |
| 期內處置              | -       | (9,299)   | -       | -        | (9,299)   |
| 期內轉移              | -       | 10,750    | 52      | (10,802) | -         |
| 匯兌差額              | 286     | 13,572    | 1,598   | (257)    | 15,199    |
| 於2022年6月30日       | 224,329 | 1,790,386 | 108,673 | 22,818   | 2,146,206 |
| <b>累積攤銷</b>       |         |           |         |          |           |
| 於2022年1月1日        | 116,601 | 1,377,802 | 79,679  | -        | 1,574,082 |
| 期內攤銷              | -       | 90,645    | 3,103   | -        | 93,748    |
| 處置抵銷              | -       | (9,041)   | -       | -        | (9,041)   |
| 匯兌差額              | -       | 11,533    | 1,243   | -        | 12,776    |
| 於2022年6月30日       | 116,601 | 1,470,939 | 84,025  | -        | 1,671,565 |
| <b>賬面價值</b>       |         |           |         |          |           |
| 於2022年6月30日(未經審計) | 107,728 | 319,447   | 24,648  | 22,818   | 474,641   |
| 於2021年12月31日(經審計) | 107,442 | 367,202   | 27,344  | 29,403   | 531,391   |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 19 其他無形資產(續)

交易席位費主要包括上交所、深交所、香港聯交所及香港期貨交易所有限公司的交易席位，本集團通過交易席位可以於該等交易所或通過該等交易所進行證券及期貨合約買賣。本集團將交易席位費視作一項使用壽命不確定的無形資產。

### 20 權益法項下投資

|                         | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|-------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 於聯營公司及合營企業的非上市投資成本      | 4,051,771                | 4,082,549                |
| 攤分收購後利潤及其他全面收益，並扣除已收的股利 | 2,276,238                | 2,371,871                |
| 總計                      | <b>6,328,009</b>         | 6,454,420                |

採用權益法核算的投資明細：

富國基金管理有限公司為對於本集團單體重要的聯營企業，本集團持有富國基金管理有限公司27.775%的股份。其財務信息概述載列如下：

|      | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|------|--------------------------|--------------------------|
| 資產總額 | 12,243,844               | 12,646,262               |
| 負債總額 | 5,456,875                | 5,597,222                |
| 資產淨值 | <b>6,786,969</b>         | 7,049,040                |

|        | 截至2022年<br>6月30日<br>止六個月期間<br>(未經審計) | 截至2021年<br>6月30日<br>止六個月期間<br>(未經審計) |
|--------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 營業收入   | 3,772,562                            | 3,998,339                            |
| 淨利潤    | 1,122,213                            | 1,241,936                            |
| 綜合全面收益 | <b>1,137,929</b>                     | 1,239,352                            |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 21 應收融資租賃款

|             | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|-------------|--------------------------|--------------------------|
| 最低租賃收款額     |                          |                          |
| – 1年以內      | 20,251,732               | 25,533,151               |
| – 1年至2年     | 6,290,485                | 9,925,219                |
| – 2年至3年     | 1,462,104                | 1,871,410                |
| – 3年至4年     | 375,149                  | 396,805                  |
| – 4年至5年     | 263,847                  | 296,806                  |
| – 5年以上      | 1,068,581                | 597,410                  |
| 應收融資租賃款總額   | 29,711,898               | 38,620,801               |
| 減：未實現融資收益   | (2,783,126)              | (3,584,005)              |
| 應收融資租賃款現值   | 26,928,772               | 35,036,796               |
| 減：預期信用損失    | (1,587,882)              | (1,564,209)              |
| 應收融資租賃款賬面價值 | 25,340,890               | 33,472,587               |
| 最低租賃收款額的現值  |                          |                          |
| – 1年以內      | 18,357,861               | 23,211,519               |
| – 1年至2年     | 5,722,755                | 9,021,983                |
| – 2年至3年     | 1,325,217                | 1,697,408                |
| – 3年至4年     | 336,745                  | 352,818                  |
| – 4年至5年     | 233,453                  | 256,240                  |
| – 5年以上      | 952,741                  | 496,828                  |
| 合計          | 26,928,772               | 35,036,796               |
| 就報告目的分析如下：  |                          |                          |
| 流動資產        | 17,382,485               | 22,202,398               |
| 非流動資產       | 7,958,405                | 11,270,189               |
| 總計          | 25,340,890               | 33,472,587               |

本集團訂立融資租賃安排，租賃資產為基礎設施、交通物流等行業之機器設備。本集團絕大部分融資租賃以人民幣計價。簽訂的融資租賃期限為一至十年。

2022年6月30日，本集團應收融資租賃款淨額計人民幣536,299千元（2021年12月31日：人民幣1,137,119千元）質押用於借款。

應收融資租賃款之浮動利率參照市場相關利率。應收融資租賃款之浮動利率定期參照市場基準利率進行調整。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 21 應收融資租賃款 (續)

預期信用損失的本期變動：

|                 | 12個月的<br>預期信用損失<br>階段1 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(未發生信用減值)<br>階段2 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(發生信用減值)<br>階段3 | 總計        |
|-----------------|------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|-----------|
| (未經審計)          |                        |                                      |                                     |           |
| 於2022年1月1日      | 523,852                | 496,926                              | 543,431                             | 1,564,209 |
| 預期信用損失的變動：      |                        |                                      |                                     |           |
| — 預期信用損失(轉回)/確認 | (8,121)                | 317,483                              | 330,500                             | 639,862   |
| — 本期核銷          | —                      | —                                    | (207,437)                           | (207,437) |
| — 階段間的轉換        | (37,007)               | (128,188)                            | 165,195                             | —         |
| — 收回以前年度核銷款項    | —                      | —                                    | 38,788                              | 38,788    |
| — 其他終止確認情況      | —                      | —                                    | (447,540)                           | (447,540) |
| 於2022年6月30日     | 478,724                | 686,221                              | 422,937                             | 1,587,882 |

下表詳細說明了應收融資租賃款的信用風險敞口，這些工具需要進行預期信用損失評估：

#### 最低租賃收款額現值分析

|                   | 12個月的<br>預期信用損失<br>階段1 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(未發生信用減值)<br>階段2 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(發生信用減值)<br>階段3 | 總計         |
|-------------------|------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|------------|
| 於2022年6月30日(未經審計) | 24,007,171             | 2,047,090                            | 874,511                             | 26,928,772 |
| 於2021年12月31日(經審計) | 32,415,838             | 1,647,131                            | 973,827                             | 35,036,796 |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 22 售後回租安排的應收款

下表列舉了售後回租安排的應收款的總額和淨額：

|                | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|----------------|--------------------------|--------------------------|
| – 1年以內         | 32,235,072               | 26,278,930               |
| – 1年至2年        | 23,094,549               | 18,371,251               |
| – 2年至3年        | 12,408,719               | 10,718,660               |
| – 3年至4年        | 5,214,284                | 3,873,796                |
| – 4年至5年        | 2,674,958                | 1,991,889                |
| – 5年以上         | 632,948                  | 158,862                  |
| 售後回租安排的應收款總額   | 76,260,530               | 61,393,388               |
| 減：利息調整         | (7,144,915)              | (5,535,329)              |
| 售後回租安排的應收款現值   | 69,115,615               | 55,858,059               |
| 減：預期信用損失       | (914,198)                | (770,036)                |
| 售後回租安排的應收款賬面價值 | 68,201,417               | 55,088,023               |
| 售後回租安排的應收款現值   |                          |                          |
| – 1年以內         | 29,219,221               | 23,910,557               |
| – 1年至2年        | 20,931,940               | 16,714,899               |
| – 2年至3年        | 11,243,126               | 9,751,609                |
| – 3年至4年        | 4,724,279                | 3,524,290                |
| – 4年至5年        | 2,423,582                | 1,812,175                |
| – 5年以上         | 573,467                  | 144,529                  |
| 總計             | 69,115,615               | 55,858,059               |
| 就報告目的分析如下：     |                          |                          |
| 流動資產           | 28,796,531               | 23,566,177               |
| 非流動資產          | 39,404,886               | 31,521,846               |
|                | 68,201,417               | 55,088,023               |

於2022年6月30日，本集團售後回租安排的應收款淨額計人民幣6,063,863千元（2021年12月31日：人民幣8,024,083千元）質押用於借款。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 22 售後回租安排的應收款 (續)

預期信用損失的本期變動：

|              | 12個月的<br>預期信用損失<br>階段1 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(未發生信用減值)<br>階段2 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(發生信用減值)<br>階段3 | 總計      |
|--------------|------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|---------|
| (未經審計)       |                        |                                      |                                     |         |
| 於2022年1月1日   | 699,717                | 41,974                               | 28,345                              | 770,036 |
| 預期信用損失的變動：   |                        |                                      |                                     |         |
| — 預期信用損失確認   | 80,738                 | 26,656                               | 38,193                              | 145,587 |
| — 本期核銷       | —                      | —                                    | (2,850)                             | (2,850) |
| — 階段間的轉換     | (4,858)                | (15,313)                             | 20,171                              | —       |
| — 收回以前年度核銷款項 | —                      | —                                    | 1,425                               | 1,425   |
| 於2022年6月30日  | 775,597                | 53,317                               | 85,284                              | 914,198 |

下表詳細說明了售後回租安排的應收款的信用風險敞口，這些工具需要進行預期信用損失評估：

售後回租安排的應收款現值分析

|                   | 12個月的<br>預期信用損失<br>階段1 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(未發生信用減值)<br>階段2 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(發生信用減值)<br>階段3 | 總計         |
|-------------------|------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|------------|
| 於2022年6月30日(未經審計) | 68,699,362             | 259,413                              | 156,840                             | 69,115,615 |
| 於2021年12月31日(經審計) | 55,618,393             | 179,113                              | 60,553                              | 55,858,059 |

### 23 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具

|             | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|-------------|--------------------------|--------------------------|
| 其他權益投資(附註i) | 6,612,456                | 10,246,871               |
| 分析如下：       |                          |                          |
| — 上市股權證券    | 5,539,522                | 9,860,664                |
| — 非上市股權證券   | 1,072,934                | 386,207                  |
|             | 6,612,456                | 10,246,871               |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 23 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具（續）

附註：

- (i) 於2022年6月30日，以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具包括本集團持有的非交易性股權及股票。以上權益工具並非持作交易目的，本集團將該等權益工具投資指定為以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具投資。

由於戰略調整，本集團處置了若干以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具，人民幣291,640千元的相應損失自投資重新估值儲備重新分類至未分配利潤。

- (ii) 2022年6月30日，以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具有承諾條件的金融資產，系用於融出證券業務，其公允價值為人民幣2,436,741千元（2021年12月31日：2,569,298千元）。

以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具投資的股利收入披露於附註6。

### 24 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具

|            | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|------------|--------------------------|--------------------------|
| 未上市債券投資    | 13,800,240               | 10,531,176               |
| 上市債券投資     | 28,254,987               | 26,521,769               |
|            | <b>42,055,227</b>        | 37,052,945               |
| 就報告目的分析如下： |                          |                          |
| 流動資產       | 3,060,154                | 4,002,056                |
| 非流動資產      | 38,995,073               | 33,050,889               |
|            | <b>42,055,227</b>        | 37,052,945               |
| 預期信用損失     | <b>213,240</b>           | 259,658                  |

於2022年6月30日，以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具有承諾條件的金融資產，系用於賣出回購業務、債券借貸業務、轉融通業務和衍生業務質押等，其公允價值為人民幣33,145百萬元（2021年12月31日：人民幣27,051百萬元）。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 24 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具 (續)

#### 預期信用損失的本期變動

|             | 12個月的<br>預期信用損失<br>階段1 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(未發生信用減值)<br>階段2 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(發生信用減值)<br>階段3 | 總計       |
|-------------|------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|----------|
| (未經審計)      |                        |                                      |                                     |          |
| 於2022年1月1日  | 100,389                | 159,003                              | 266                                 | 259,658  |
| 預期信用損失的變動：  |                        |                                      |                                     |          |
| — 預期信用損失轉回  | (31,214)               | (23,336)                             | —                                   | (54,550) |
| — 階段間的轉換    | 12,920                 | (12,659)                             | (261)                               | —        |
| — 外匯變動及其他   | 151                    | 7,986                                | (5)                                 | 8,132    |
| 於2022年6月30日 | 82,246                 | 130,994                              | —                                   | 213,240  |

下表詳細說明了以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具的信用風險敞口，這些工具需要進行預期信用損失評估：

#### 賬面總額

|                    | 12個月的<br>預期信用損失<br>階段1 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(未發生信用減值)<br>階段2 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(發生信用減值)<br>階段3 | 總計         |
|--------------------|------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|------------|
| 於2022年6月30日 (未經審計) | 38,165,545             | 3,700,105                            | —                                   | 41,865,650 |
| 於2021年12月31日 (經審計) | 33,469,181             | 3,436,585                            | 38,434                              | 36,944,200 |

### 25 以攤餘成本計量的債務工具

|            | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|------------|--------------------------|--------------------------|
| 債務證券       | 5,313,066                | 4,745,698                |
| 減：預期信用損失   | (21,906)                 | (20,489)                 |
|            | 5,291,160                | 4,725,209                |
| 就報告目的分析如下： |                          |                          |
| 流動資產       | 429,093                  | 1,099,101                |
| 非流動資產      | 4,862,067                | 3,626,108                |
|            | 5,291,160                | 4,725,209                |

附註：

於2022年6月30日，以攤餘成本計量的債務工具有承諾條件的金融資產，系用於賣出回購、向葡萄牙央行融資等，其賬面價值為人民幣3,452百萬元(2021年12月31日：人民幣2,565百萬元)。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 25 以攤餘成本計量的債務工具（續）

#### 預期信用損失的本期變動

|             | 12個月的<br>預期信用損失<br>階段1 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(未發生信用減值)<br>階段2 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(發生信用減值)<br>階段3 | 總計     |
|-------------|------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|--------|
| (未經審計)      |                        |                                      |                                     |        |
| 於2022年1月1日  | 20,489                 | -                                    | -                                   | 20,489 |
| 預期信用損失的變動：  |                        |                                      |                                     |        |
| — 預期信用損失確認  | 1,238                  | -                                    | -                                   | 1,238  |
| — 外匯變動及其他   | 179                    | -                                    | -                                   | 179    |
| 於2022年6月30日 | 21,906                 | -                                    | -                                   | 21,906 |

下表詳細說明了以攤餘成本計量的債務工具的信用風險敞口，這些工具需要進行預期信用損失評估：

#### 賬面總額

|                   | 12個月的<br>預期信用損失<br>階段1 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(未發生信用減值)<br>階段2 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(發生信用減值)<br>階段3 | 總計        |
|-------------------|------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|-----------|
| 於2022年6月30日(未經審計) | 5,313,066              | -                                    | -                                   | 5,313,066 |
| 於2021年12月31日(經審計) | 4,745,698              | -                                    | -                                   | 4,745,698 |

### 26 以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產

|            | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|------------|--------------------------|--------------------------|
| 債務證券       | 93,074,282               | 117,085,317              |
| 股權證券       | 33,721,553               | 34,954,924               |
| 基金         | 56,210,201               | 48,625,818               |
| 其他         | 18,860,201               | 19,743,690               |
|            | 201,866,237              | 220,409,749              |
| 就報告目的分析如下： |                          |                          |
| 流動資產       | 178,790,503              | 195,277,554              |
| 非流動資產      | 23,075,734               | 25,132,195               |
|            | 201,866,237              | 220,409,749              |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 26 以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產(續)

附註：

- (i) 於2022年6月30日，以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產中包括作為賣出回購業務、債券借貸業務、轉融通業務和衍生業務等擔保物的金融資產，其公允價值為人民幣48,701百萬元(2021年12月31日：人民幣62,710百萬元)，其中包括存在限售期的以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產人民幣892百萬元(2021年12月31日：人民幣1,729百萬元)。
- (ii) 於2022年6月30日，本集團的以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產中約人民幣6,496百萬元(2021年12月31日：人民幣9,045百萬元)為上市的受限制權益性證券，該等證券附有依法必須履行的限制，本集團在指定期限內不得出售該股份。該等金融資產的公允價值已考慮到該股份相關特性，包括出售限制。
- (iii) 與剩餘到期期限超過一年的結構化產品相關的金融資產，由於預計不會先於一年內清償，因此被列為非流動資產。

### 27 買入返售金融資產

|            | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|------------|--------------------------|--------------------------|
| 按抵押品種類劃分：  |                          |                          |
| 股票(註)      | 29,073,664               | 31,968,603               |
| 債券         | 13,745,438               | 9,584,043                |
| 減：預期信用損失   | (719,645)                | (1,791,629)              |
|            | <b>42,099,457</b>        | 39,761,017               |
| 按市場劃分：     |                          |                          |
| 交易所        | 38,959,038               | 37,044,102               |
| 銀行間市場      | 3,860,064                | 4,508,544                |
| 減：預期信用損失   | (719,645)                | (1,791,629)              |
|            | <b>42,099,457</b>        | 39,761,017               |
| 就報告目的分析如下： |                          |                          |
| 流動資產       | 41,537,039               | 39,185,614               |
| 非流動資產      | 562,418                  | 575,403                  |
|            | <b>42,099,457</b>        | 39,761,017               |

註：

該以股票為質押物的買入返售金融資產為符合條件的投資者以約定價格向本集團賣出特定證券，並約定在未來某一日期，按照另一約定價格購回。截至2022年6月30日，本集團以上買入返售期限為1年以內為人民幣28,510,923千元(2021年12月31日：人民幣31,392,851千元)，期限為1年以上為人民幣562,741千元(2021年12月31日：人民幣575,752千元)。

截至2022年6月30日，買入返售金融資產的擔保物公允價值為人民幣110,104,427千元(截至2021年12月31日：人民幣121,478,644千元)。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 27 買入返售金融資產 (續)

#### 預期信用損失的本期變動

|                 | 12個月的<br>預期信用損失<br>階段1 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(未發生信用減值)<br>階段2 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(發生信用減值)<br>階段3 | 總計        |
|-----------------|------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|-----------|
| (未經審計)          |                        |                                      |                                     |           |
| 於2022年1月1日      | 13,905                 | 1,180                                | 1,776,544                           | 1,791,629 |
| 預期信用損失的變動：      |                        |                                      |                                     |           |
| — 預期信用損失(轉回)/確認 | (2,458)                | 1,772                                | (822,124)                           | (822,810) |
| — 階段間的轉換        | 2,243                  | (2,475)                              | 232                                 | —         |
| — 其他終止確認情況      | —                      | —                                    | (249,176)                           | (249,176) |
| — 外匯變動及其他       | 2                      | —                                    | —                                   | 2         |
| 於2022年6月30日     | 13,692                 | 477                                  | 705,476                             | 719,645   |

下表詳細說明了買入返售金融資產的信用風險敞口，這些工具需要進行預期信用損失評估：

#### 賬面總額

|                   | 12個月的<br>預期信用損失<br>階段1 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(未發生信用減值)<br>階段2 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(發生信用減值)<br>階段3 | 總計         |
|-------------------|------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|------------|
| 於2022年6月30日(未經審計) | 40,551,449             | 76,448                               | 2,191,205                           | 42,819,102 |
| 於2021年12月31日(經審計) | 37,068,437             | 214,814                              | 4,269,395                           | 41,552,646 |

### 28 其他貸款及應收款項

|            | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|------------|--------------------------|--------------------------|
| 應收保理款      | —                        | 6,030,532                |
| 委託貸款及其他    | 598,992                  | 720,224                  |
| 其他貸款及應收款項  | 7,144,892                | 8,926,484                |
| 賬面總額       | 7,743,884                | 15,677,240               |
| 減：預期信用損失   | (391,112)                | (738,575)                |
|            | 7,352,772                | 14,938,665               |
| 就報告目的分析如下： |                          |                          |
| 流動資產       | 6,075,061                | 12,544,269               |
| 非流動資產      | 1,277,711                | 2,394,396                |
|            | 7,352,772                | 14,938,665               |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 28 其他貸款及應收款項 (續)

#### 預期信用損失的本期變動

|                 | 12個月的<br>預期信用損失<br>階段1 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(未發生信用減值)<br>階段2 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(發生信用減值)<br>階段3 | 總計        |
|-----------------|------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|-----------|
| (未經審計)          |                        |                                      |                                     |           |
| 於2022年1月1日      | 130,639                | 249,589                              | 358,347                             | 738,575   |
| 預期信用損失的變動：      |                        |                                      |                                     |           |
| — 預期信用損失(轉回)/確認 | (117,662)              | 637                                  | 34,182                              | (82,843)  |
| — 本期核銷          | —                      | —                                    | (184,793)                           | (184,793) |
| — 其他終止確認情況      | —                      | (101,866)                            | 9,044                               | (92,822)  |
| — 外匯變動及其他       | 784                    | —                                    | 12,211                              | 12,995    |
| 於2022年6月30日     | 13,761                 | 148,360                              | 228,991                             | 391,112   |

下表詳細說明了其他貸款及應收款項的信用風險敞口，這些工具需要進行預期信用損失評估：

#### 賬面總額

|                   | 12個月的<br>預期信用損失<br>階段1 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(未發生信用減值)<br>階段2 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(發生信用減值)<br>階段3 | 總計         |
|-------------------|------------------------|--------------------------------------|-------------------------------------|------------|
| 於2022年6月30日(未經審計) | 3,858,288              | 378,612                              | 3,506,984                           | 7,743,884  |
| 於2021年12月31日(經審計) | 10,575,552             | 935,291                              | 4,166,397                           | 15,677,240 |

### 29 客戶貸款

|            | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|------------|--------------------------|--------------------------|
| 客戶貸款       | 5,444,510                | 4,808,748                |
| 減：預期信用損失   | (96,812)                 | (96,097)                 |
|            | 5,347,698                | 4,712,651                |
| 就報告目的分析如下： |                          |                          |
| 流動資產       | 629,224                  | 593,565                  |
| 非流動資產      | 4,718,474                | 4,119,086                |
|            | 5,347,698                | 4,712,651                |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 29 客戶貸款 (續)

預期信用損失的本期變動：

|             | 12個月的<br>預期信用損失<br>階段1 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(未發生信用<br>減值)<br>階段2 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(發生信用<br>減值)<br>階段3 | 總計      |
|-------------|------------------------|--|---|---------|
| (未經審計)      |                        |  |   |         |
| 於2022年1月1日  | 18,529                 | 37,737                                   | 39,831                                  | 96,097  |
| 預期信用損失的變動：  |                        |  |   |         |
| — 預期信用損失轉回  | (1,048)                | (812)                                    | (702)                                   | (2,562) |
| — 階段間的轉換    | 530                    | (530)                                    | —                                       | —       |
| — 外匯變動及其他   | 218                    | 2,726                                    | 333                                     | 3,277   |
| 於2022年6月30日 | 18,229                 | 39,121                                   | 39,462                                  | 96,812  |

下表詳細說明了客戶貸款的信用風險敞口，這些工具需要進行預期信用損失評估：

賬面總額：

|                    | 12個月的<br>預期信用損失<br>階段1 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(未發生信用<br>減值)<br>階段2 | 整個存續期內<br>預期信用損失<br>(發生信用<br>減值)<br>階段3 | 總計        |
|--------------------|------------------------|--|---|-----------|
| 於2022年6月30日 (未經審計) | 4,653,348              | 723,694                                  | 67,468                                  | 5,444,510 |
| 於2021年12月31日 (經審計) | 4,116,862              | 596,883                                  | 95,003                                  | 4,808,748 |

### 30 遞延稅項

就本集團綜合財務狀況表的呈列而言，若干遞延稅項資產及負債已經抵銷。下表乃就財務報告目的而作出的遞延稅項結餘分析：

|        | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|--------|--------------------------|--------------------------|
| 遞延稅項資產 | 4,435,588                | 5,171,925                |
| 遞延稅項負債 | (965,254)                | (1,320,651)              |
|        | 3,470,334                | 3,851,274                |

## 30 遞延稅項 (續)

以下為有關年度獲確認的主要遞延稅項資產(負債)以及其變動:

|   | 以公允價值計量<br>且其變動<br>計入損益的金融<br>資產/(負債) | 加速折舊     | 衍生金融工具    | 應計但未<br>繳付支出 | 以公允價值<br>計量且其變動<br>計入其他全面<br>收益的債務<br>工具 | 以公允價值<br>計量且其變動<br>計入其他全面<br>收益的權益<br>工具 | 減值損失      | 稅務損失及<br>其他 | 合計        |
|---|---------------------------------------|----------|-----------|--------------|--|--|-----------|-------------|-----------|
| (經審計)   |                                       |          |           |              |  |  |           |             |           |
| 於2021年1月1日                                    | (859,460)                             | (81,608) | 54,231    | 1,324,938    | 187,026                                  | (180,706)                                | 2,603,868 | 535,737     | 3,584,026 |
| 於損益中(扣減)/計入<br>於其他全面收益中<br>計入/(扣減)<br>匯率影響及其他 | (346,392)                             | 11,774   | 32,971    | 33,044       | (135,131)                                | -  | 619,840   | (8,253)     | 207,853   |
|   | -                                     | -        | (4,053)   | -            | (86,644)                                 | 108,150                                  | -         | -           | 17,453    |
|   | -                                     | 1,744    | (930)     | 15,631       | 6,252                                    | 39,969                                   | (7,001)   | (13,723)    | 41,942    |
| 於2021年12月31日                                  | (1,205,852)                           | (68,090) | 82,219    | 1,373,613    | (28,497)                                 | (32,587)                                 | 3,216,707 | 513,761     | 3,851,274 |
| (未經審計)  |                                       |          |           |              |  |  |           |             |           |
| 於損益中(扣減)/計入<br>於其他全面收益中<br>計入<br>匯率影響及其他      | 74,276                                | (6,556)  | (372,007) | 117,345      | 11,933                                   | -  | (341,697) | (20,365)    | (537,071) |
|   | -                                     | -        | 17,069    | -            | 2,665                                    | 238,928                                  | -         | -           | 258,662   |
|   | -                                     | (2,727)  | 1,454     | 23,420       | (21,338)                                 | (135,748)                                | 10,948    | 21,460      | (102,531) |
| 於2022年6月30日                                   | (1,131,576)                           | (77,373) | (271,265) | 1,514,378    | (35,237)                                 | 70,593                                   | 2,885,938 | 514,856     | 3,470,334 |

於報告期末，本集團就子公司未分配利潤產生的暫時性差異未確認遞延所得稅負債，因為本集團能夠控制暫時性差異的轉回時點，且在可預測的未來該暫時性差異不會轉回。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間

（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

### 31 交易所儲備及保證金

|                         | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|-------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 交易所儲備及保證金               |                          |                          |
| — 上交所                   | 623,951                  | 1,083,784                |
| — 深交所                   | 186,673                  | 196,785                  |
| — 全國中小企業股份轉讓系統          | 2,827                    | 3,183                    |
| — 香港聯合交易所有限公司           | 1,618                    | 1,788                    |
| 小計                      | 815,069                  | 1,285,540                |
| 期貨衍生及商品交易所保證金           |                          |                          |
| — 中國金融期貨交易所             | 10,626,946               | 8,715,967                |
| — 上海期貨交易所               | 3,177,815                | 2,909,388                |
| — 大連商品交易所               | 2,784,867                | 2,241,738                |
| — 鄭州商品交易所               | 1,165,840                | 1,083,011                |
| — 上海黃金交易所               | 18,613                   | 15,694                   |
| — 香港期貨結算有限公司            | 1,904                    | 5,430                    |
| — 付予其他地區的保證金            | 659,189                  | 594,660                  |
| 小計                      | 18,435,174               | 15,565,888               |
| 交易席位費及其他保證金             |                          |                          |
| — 存於證金公司的保證金            | 463,159                  | 440,150                  |
| — 付予香港中央結算有限公司的保證金      | 137,187                  | 142,223                  |
| — 存於上海清算所的保證金           | 118,087                  | 117,659                  |
| — 付予深交所的保證金             | 32,911                   | 49,113                   |
| — 付予上交所的保證金             | 27,748                   | 40,792                   |
| — 付予香港聯合交易所期權結算有限公司的保證金 | 3,310                    | 4,241                    |
| — 其他                    | 10,067                   | 9,562                    |
| 小計                      | 792,469                  | 803,740                  |
| 合計                      | 20,042,712               | 17,655,168               |
| 就報告目的分析如下：              |                          |                          |
| 流動資產                    | 19,888,627               | 17,491,923               |
| 非流動資產                   | 154,085                  | 163,245                  |
|                         | 20,042,712               | 17,655,168               |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 32 銀行結餘及現金

|                    | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|--------------------|--------------------------|--------------------------|
| 自有賬戶               | 67,504,684               | 51,045,568               |
| 代客戶持有的現金(附註i)      | 114,094,553              | 106,920,251              |
| 減：預期信用損失           | (14,702)                 | (14,202)                 |
|                    | <b>181,584,535</b>       | 157,951,617              |
| 減：非流動受限制銀行存款(附註ii) | (1,630,380)              | (1,503,454)              |
|                    | <b>179,954,155</b>       | 156,448,163              |

銀行結餘及現金包括庫存現金及按現行市場利率計息的活期存款。

附註：

- (i) 本集團於銀行設有指定的銀行賬戶，以持有來自一般業務交易所產生的客戶存款。本集團已於應付經紀業務客戶款項中確認應付客戶的賬款(附註44)。本集團從法律上無可執行的抵銷權將該客戶存款與相應的應付款項相互抵銷。
- (ii) 非流動受限制銀行存款為風險準備金以及一年以上的保證金存款。

### 33 現金及現金等價物

現金及現金等價物包括下列各項：

|                   | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|-------------------|--------------------------|--------------------------|
| 銀行結餘及現金－自有(除應計利息) | 67,407,407               | 50,949,331               |
| 減：受限制銀行存款(i)      | (2,449,162)              | (2,534,750)              |
| 存放同業款項(除應計利息)     | 247,294                  | 226,311                  |
| 存放央行超額準備金         | 4,429,531                | 3,284,435                |
| 結算備付金－自有          | 4,660,555                | 5,779,740                |
|                   | <b>74,295,625</b>        | 57,705,067               |

- (i) 其中受限制銀行存款是風險準備專戶存款、銀票保證金存款、飛機維修基金等。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 34 其他非流動資產

|                  | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|------------------|--------------------------|--------------------------|
| 長期應收政府與社會資本合作項目款 | 816,073                  | 885,385                  |
| 抵債資產             | 93,446                   | 250,330                  |
| 收回融資租賃資產         | 161,394                  | 219,013                  |
| 其他               | 1,085,207                | 536,630                  |
|                  | <b>2,156,120</b>         | 1,891,358                |

### 35 孖展融資客戶墊款

|             | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|-------------|--------------------------|--------------------------|
| 孖展客戶的貸款(附註) | 71,688,061               | 76,937,089               |
| 減：預期信用損失    | <b>(2,019,860)</b>       | (1,713,685)              |
|             | <b>69,668,201</b>        | 75,223,404               |
| 就報告目的分析如下   |                          |                          |
| 流動資產        | <b>69,668,201</b>        | 75,223,404               |

附註：

孖展客戶的信貸融資限額乃根據本集團接納的抵押證券的折讓市值而釐定。

大部分給予孖展客戶的貸款由相關已質押證券作抵押且計息。本集團設有一份認可股份清單，以按特定貸款抵押比率給予孖展借款。倘超逾借款比率，則將觸發保證金追繳通知，而客戶須追補該差額。

於2022年6月30日的給予孖展客戶的貸款，藉客戶向本集團抵押未貼現市值約為人民幣231,031,213千元（2021年12月31日：人民幣263,615,471千元）的證券作為抵押品而擔保。

於2022年6月30日，應付經紀業務客戶賬款包括根據證券借貸協議和客戶墊款向客戶收取的現金抵押款項人民幣9,000,047千元（2021年12月31日：人民幣8,073,655千元）。

鑑於業務的性質，賬齡分析不能產生附加值，故本公司董事認為無須披露賬齡分析。本集團根據對可收回性的評估與管理層的判斷，包括評估信貸質量變動、抵押品以及每位客戶過往的收款歷史，以釐定減值債項的備抵。由於客戶群龐大及無關聯，故此信用風險的集中程度有限。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 35 孖展融資客戶墊款 (續)

下表列示了孖展融資客戶墊款的預期信用損失變動。

|             | 12個月的<br>預期信用損失<br>階段1 | 整個存續期<br>預期信用損失<br>(未發生信用<br>減值)<br>階段2 | 整個存續期<br>預期信用損失<br>(發生信用<br>減值)<br>階段3 | 總計        |
|-------------|------------------------|---|--|-----------|
| (未經審計)      |                        |   |  |           |
| 於2022年1月1日  | 55,087                 | 11,811                                  | 1,646,787                              | 1,713,685 |
| 預期信用損失的變動：  |                        |   |  |           |
| — 預期信用損失確認  | 24,463                 | 16,726                                  | 271,446                                | 312,635   |
| — 本期核銷      | —                      | —                                       | (38,360)                               | (38,360)  |
| — 階段間的轉換    | (2,240)                | (8,705)                                 | 10,945                                 | —         |
| — 外匯變動及其他   | 1,626                  | 640                                     | 29,634                                 | 31,900    |
| 於2022年6月30日 | 78,936                 | 20,472                                  | 1,920,452                              | 2,019,860 |

下表詳細說明了孖展融資客戶墊款的信用風險敞口，這些工具需要進行預期信用損失評估：

#### 賬面總額

|                   | 12個月的<br>預期信用損失<br>階段1 | 整個存續期<br>預期信用損失<br>(未發生信用<br>減值)<br>階段2 | 整個存續期<br>預期信用損失<br>(發生信用<br>減值)<br>階段3 | 總計         |
|-------------------|------------------------|---|--|------------|
| 於2022年6月30日(未經審計) | 66,979,232             | 1,607,586                               | 3,101,243                              | 71,688,061 |
| 於2021年12月31日(經審計) | 73,158,320             | 1,019,080                               | 2,759,689                              | 76,937,089 |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間

（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

### 36 應收賬款

|              | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|--------------|--------------------------|--------------------------|
| 應收賬款來自：      |                          |                          |
| — 經紀、交易商及結算所 | 4,628,458                | 7,007,206                |
| — 現金客戶       | 1,564,000                | 1,503,403                |
| — 資產及基金管理    | 732,506                  | 847,026                  |
| — 顧問及財務規劃    | 37,274                   | 28,354                   |
| — 認購新股客戶     | 1,424                    | -                        |
| — 其他         | 1,747,698                | 2,189,133                |
|              | <b>8,711,360</b>         | 11,575,122               |
| 減：預期信用損失     | <b>(214,748)</b>         | (203,106)                |
|              | <b>8,496,612</b>         | 11,372,016               |

賬齡分析如下：

|        | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|--------|--------------------------|--------------------------|
| 3個月以內  | 6,756,859                | 9,918,027                |
| 3-6個月  | 330,556                  | 490,884                  |
| 6-12個月 | 1,034,093                | 432,920                  |
| 超過1年   | 375,104                  | 530,185                  |
|        | <b>8,496,612</b>         | 11,372,016               |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 37 衍生金融工具

|               | 2022年6月30日(未經審計) |           |           |
|---------------|------------------|-----------|-----------|
|               | 合約價值             | 資產        | 負債        |
| 套期會計下衍生投資：    |                  |           |           |
| 利率互換合約        | 2,490,532        | 39,399    | 15,486    |
| 外匯互換          | 2,170,369        | 44,033    | 35,899    |
| 遠期合同          | 841,184          | 3,528     | 57,063    |
| 持作交易的衍生投資：    |                  |           |           |
| 股指期貨合約(附註i)   | 24,399,117       | -         | -         |
| 國債期貨合約(附註ii)  | 17,687,936       | -         | -         |
| 商品期貨合約(附註iii) | 16,407,978       | -         | -         |
| 利率互換合約(附註iv)  | 66,812,467       | 398,491   | 320,755   |
| 權益互換          | 14,070,838       | 660,192   | 468,241   |
| 遠期合同          | 19,040,203       | 187,976   | 174,775   |
| 期權(附註v)       | 94,466,885       | 895,270   | 177,497   |
| 嵌入式權益工具       | 526,376          | 249       | 15,159    |
| 外匯互換          | 1,749,636        | 48,348    | 9,359     |
| 信用違約互換        | 342,000          | -         | 918       |
| 合計            | 261,005,521      | 2,277,486 | 1,275,152 |

|               | 2021年12月31日(經審計) |           |           |
|---------------|------------------|-----------|-----------|
|               | 合約價值             | 資產        | 負債        |
| 套期會計下衍生投資：    |                  |           |           |
| 利率互換合約        | 2,594,286        | 11,079    | 67,973    |
| 外匯互換          | 2,080,552        | -         | 88,985    |
| 遠期合同          | 820,273          | -         | 74,157    |
| 持作交易的衍生投資：    |                  |           |           |
| 股指期貨合約(附註i)   | 15,488,680       | -         | -         |
| 國債期貨合約(附註ii)  | 22,279,016       | -         | -         |
| 商品期貨合約(附註iii) | 11,394,851       | -         | -         |
| 利率互換合約(附註iv)  | 62,486,693       | 453,337   | 382,558   |
| 權益互換          | 6,551,915        | 208,790   | 292,057   |
| 遠期合同          | 18,835,143       | 167,665   | 102,935   |
| 期權(附註v)       | 127,949,347      | 192,765   | 325,999   |
| 嵌入式權益工具       | 2,860,711        | -         | 186,354   |
| 外匯互換          | 2,137,298        | 51,095    | 25,093    |
| 信用違約互換        | 422,000          | -         | 2,205     |
| 合計            | 275,900,765      | 1,084,731 | 1,548,316 |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 37 衍生金融工具(續)

附註：

#### (i) 股指期貨

在每日無負債結算制度下，結算備付金已包括本集團於2022年6月30日所有的股指期貨合約產生的持倉損益金額。因此衍生金融工具項下的股指期貨投資按抵銷後的淨額列示，為人民幣零元。2022年6月30日，本集團用於非套期的未到期股指期貨合約的合約價值為人民幣24,399,117千元(2021年12月31日：人民幣15,488,680千元)，結算前確認衍生資產淨額為人民幣625,158千元(2021年12月31日：衍生資產淨額為人民幣167,825千元)。

#### (ii) 國債期貨合約

在每日無負債結算制度下，結算備付金已包括本集團於2022年6月30日所有的國債期貨合約產生的持倉損益金額。因此報告期末衍生金融工具項下的國債期貨投資按抵銷後的淨額列示，為人民幣零元(2021年12月31日：人民幣零元)。

|          | 2022年6月30日(未經審計) |          |
|----------|------------------|----------|
|          | 合約價值             | 公允價值     |
| T2209    | 116,988          | 153      |
| TF2209   | 8,689,367        | 17,321   |
| TS2209   | 8,881,581        | 840      |
| 合計       | 17,687,936       | 18,314   |
| 加：結算     |                  | (18,314) |
| 國債期貨合約淨額 |                  | -        |

|          | 2021年12月31日(經審計) |           |
|----------|------------------|-----------|
|          | 合約價值             | 公允價值      |
| T2103    | 2,808,181        | (30,324)  |
| TF2103   | 8,386,402        | (62,172)  |
| TS2103   | 11,084,433       | (23,127)  |
| 合計       | 22,279,016       | (115,623) |
| 加：結算     |                  | 115,623   |
| 國債期貨合約淨額 |                  | -         |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 37 衍生金融工具 (續)

附註：(續)

#### (iii) 商品期貨合約

在每日無負債結算制度下，結算備付金已包括本集團於2022年6月30日所有的商品期貨合約產生的持倉損益金額。於2022年6月30日，本集團在每日無負債結算制度下持有的商品期貨合約的淨額為人民幣零元(2021年12月31日：人民幣零元)。

|      | 2022年6月30日(未經審計) |         | 2021年12月31日(經審計) |          |
|------|------------------|---------|------------------|----------|
|      | 合約價值             | 公允價值    | 合約價值             | 公允價值     |
| 合計   | 16,407,978       | (6,546) | 11,394,851       | (13,426) |
| 加：結算 |                  | 6,546   |                  | 13,426   |
| 淨額   |                  | -       |                  | -        |

#### (iv) 利率互換合約

在每日無負債結算制度下，本集團於利率互換業務中的頭寸在上海清算所每日結算，於2022年6月30日，相應收支計入「結算備付金」。因此，於報告期期末，衍生金融工具項下的利率互換業務的淨頭寸為人民幣零元。

對於中國大陸及香港市場未在每日無負債結算制度下的利率互換合同於報告期期末以全額列示。

|               | 2022年6月30日(未經審計) |           |           |
|---------------|------------------|-----------|-----------|
|               | 合約價值             | 資產        | 負債        |
| 利率互換－於上海清算所清算 | 66,592,333       | 246,024   | 203,314   |
| 利率互換－非集中清算    | 220,134          | 398,491   | 320,755   |
| 合計            | 66,812,467       | 644,515   | 524,069   |
| 加：結算          |                  | (246,024) | (203,314) |
| 利率互換合約淨值      |                  | 398,491   | 320,755   |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 37 衍生金融工具(續)

附註：(續)

(iv) 利率互換合約(續)

|               | 2021年12月31日(經審計) |          |         |
|---------------|------------------|----------|---------|
|               | 合約價值             | 資產       | 負債      |
| 利率互換－於上海清算所清算 | 62,456,693       | 73,513   | 382,558 |
| 利率互換－非集中清算    | 30,000           | 453,337  | –       |
| 合計            | 62,486,693       | 526,850  | 382,558 |
| 加：結算          |                  | (73,513) | –       |
| 利率互換合約淨值      |                  | 453,337  | 382,558 |

(v) 期權

於2022年6月30日，本集團在中國大陸境內投資的期權的名義本金分別約為人民幣92,023,620千元(2021年12月31日：人民幣120,134,799千元)。本集團在境外投資的期權名義本金約為人民幣2,443,265千元(2021年12月31日：人民幣7,814,548千元)。

### 38 其他流動資產

|                | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|----------------|--------------------------|--------------------------|
| 預付款項           | 1,522,402                | 1,458,367                |
| 應收股利           | 397,083                  | 3,042                    |
| 存貨             | 168,555                  | 166,906                  |
| 其他應收(附註i)      | 5,806,875                | 5,109,234                |
|                | 7,894,915                | 6,737,549                |
| 減：預期信用損失(附註ii) | (511,136)                | (495,462)                |
|                | 7,383,779                | 6,242,087                |

附註：

- (i) 其他應收及預付款項包括經營性租賃的短期租賃押金、日常經營活動的其他預付費用及預付稅項等其他應收及預付款項。
- (ii) 本集團的減值損失主要為應收獨立第三方的款項人民幣429,994千元。於先前年度，本公司董事認為收回應收賬款的機會渺茫，故以前年度全數計提。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 39 結算備付金

|                    | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|--------------------|--------------------------|--------------------------|
| 為下列人士於結算所持有的結算備付金： |                          |                          |
| 自有                 | 4,660,556                | 5,779,740                |
| 客戶                 | 10,445,971               | 10,985,678               |
|                    | <b>15,106,527</b>        | 16,765,418               |

該等結算備付金由結算所為本集團持有，本集團可自由提取。該等結餘按現行市場利率計息。

### 40 存放中央銀行款項及存放同業款項

|                    | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|--------------------|--------------------------|--------------------------|
| 存放中央銀行除法定存款準備金以外款項 | 4,429,531                | 3,284,435                |
| 法定存款準備金            | 14,124                   | 19,774                   |
|                    | <b>4,443,655</b>         | 3,304,209                |
| 存放同業款項             | 247,323                  | 226,343                  |
| 減：預期信用損失           | (3)                      | (6)                      |
|                    | <b>247,320</b>           | 226,337                  |
| 合計                 | <b>4,690,975</b>         | 3,530,546                |

存放中央銀行除法定存款準備金以外款項為即期償還，法定存款準備金不計息。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間

（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

### 41 借款

|            | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|------------|--------------------------|--------------------------|
| 短期借款：      |                          |                          |
| 有抵押（附註）    | 2,014,762                | 1,906,267                |
| 無抵押        | 30,584,900               | 27,668,766               |
|            | <b>32,599,662</b>        | 29,575,033               |
| 長期借款：      |                          |                          |
| 有抵押（附註）    | 20,418,062               | 17,576,036               |
| 無抵押        | 34,011,207               | 32,002,992               |
|            | <b>54,429,269</b>        | 49,579,028               |
| 合計         | <b>87,028,931</b>        | 79,154,061               |
| 流動負債：      |                          |                          |
| 短期借款       | 32,599,662               | 29,575,033               |
| 一年內到期的長期借款 | 17,454,242               | 18,827,302               |
|            | <b>50,053,904</b>        | 48,402,335               |
| 非流動負債：     |                          |                          |
| 長期借款       | 36,975,027               | 30,751,726               |
|            | <b>87,028,931</b>        | 79,154,061               |
| 到期日分析如下：   |                          |                          |
| 1年以內       | 50,053,904               | 48,402,335               |
| 1-2年       | 11,372,350               | 10,633,261               |
| 2-5年       | 25,101,790               | 19,987,997               |
| 5年以上       | 500,887                  | 130,468                  |
|            | <b>87,028,931</b>        | 79,154,061               |

附註：

截止2022年6月30日，約有人民幣13.33億元借款（2021年12月31日：人民幣13.33億元）以本公司持有的上海市黃浦區中山南路858號綠地外灘中心B2辦公樓作為抵押。

截止2022年6月30日，約有人民幣7.54億元借款（2021年12月31日：人民幣7.59億元）以本公司持有的上海市黃浦區中山南路888號綠地外灘中心B3辦公樓作為抵押。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 41 借款(續)

附註：(續)

截止2022年6月30日，約有人民幣6.8億元借款(2021年12月31日：無)以本公司持有的上海市黃浦區中山南路868號綠地外灘中心B1辦公樓作為抵押。

截至2022年6月30日，約有人民幣8.55億元的流動借款(2021年12月31日：人民幣8.18億元)以集團持有的大成海通中國債券基金1號作為抵押，該抵押品的公允價值約為人民幣27.85億元(2021年12月31日：人民幣26.13億元)。

截至2022年6月30日，約有人民幣96.92億元的銀行貸款(2021年12月31日：人民幣67.56億元)以本集團下屬子公司海通恆信金融集團有限公司和海通銀行的股權作為質押。

截至2022年6月30日，本集團下屬子公司海通國際的銀行質押借款餘額合計港幣3.39億元(折合人民幣2.90億元)(2021年12月31日：港幣0.78億元，折合人民幣0.64億元)，該款項部分系本公司在客戶同意下，以其給予客戶的融資款而取得的質押品(持有的上市公司股份)作為質押借入，截止2022年6月30日，該質押品期末市值為港幣17.70億元(折合人民幣15.14億元)(2021年12月31日：港幣24.37億元，折合人民幣19.92億元)。

截至2022年6月30日，本集團持有短期及長期借款餘額(含應付利息)合計人民幣87.82億元(2021年12月31日：人民幣97.41億元)，以應收融資租賃款項、售後回租安排的應收款項、下屬子公司股權作為質押及飛機租賃固定資產作為抵押。截止2022年6月30日，質押的應收融資租賃款項帳面價值為人民幣5.36億元(2021年12月31日：人民幣11.37億元)，質押的售後回租安排的應收款項帳面價值為人民幣60.64億元(2021年12月31日：人民幣80.24億元)，抵押的飛機租賃計入固定資產的帳面價值為人民幣49.76億元(2021年12月31日：人民幣48.39億元)。

基於貸款合同對息稅折舊及攤銷前利潤與融資成本比率約定了相關要求，海通國際證券集團有限公司已於本財務報表批准報出前就其截至2022年6月30日帳面價值為港幣138.00億元(折合人民幣118.02億元)的銀行貸款潛在無法滿足貸款合同約定比率獲得了有關銀行的豁免。

基於貸款合同對息稅折舊及攤銷前利潤與融資成本比率約定了相關要求，海通國際控股有限公司已於本財務報表批准報出前就其截至2022年6月30日帳面價值為港幣119.09億元(折合人民幣101.84億元)的銀行貸款潛在無法滿足貸款合同約定比率獲得了有關銀行的豁免。

### 42 應付短期融資款

|        | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|--------|--------------------------|--------------------------|
| 超短期融資券 | 5,021,404                | 6,076,732                |
| 中期票據   | 5,532,438                | 5,593,378                |
| 短期收益憑證 | 2,473,840                | 2,178,256                |
| 短期公司債券 | 9,632,348                | 11,138,322               |
|        | <b>22,660,030</b>        | <b>24,986,688</b>        |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間

(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

| 發債主體             | 債券名稱   | 起息日期                  | 到期日期                   | 票面利率        | 期初餘額<br>(千元) | 本期增加<br>(千元) | 本期減少<br>(千元) | 期末餘額<br>(千元) |
|------------------|--------|-----------------------|------------------------|-------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 海通證券股份有限公司       | 短期公司債券 | 7/12/2021             | 6/16/2022              | 2.82%       | 6,080,196    | 76,950       | 6,157,146    | -            |
| 海通證券股份有限公司       | 短期公司債券 | 7/29/2021             | 7/29/2022              | 2.72%       | 5,058,126    | 67,441       | -            | 5,125,567    |
| 海通證券股份有限公司       | 短期公司債券 | 6/9/2022              | 6/9/2023               | 2.50%       | -            | 4,506,781    | -            | 4,506,781    |
| 海通證券股份有限公司       | 短期收益憑證 | 2021/7/5至<br>2022/7/1 | 2022/7/3至<br>2023/6/29 | 0.00%-3.30% | 2,178,256    | 9,167,849    | 8,872,265    | 2,473,840    |
| 海通恒信國際融資租賃股份有限公司 | 超短期融資券 | 4/30/2021             | 1/21/2022              | 3.35%       | 1,022,452    | 1,836        | 1,024,288    | -            |
| 海通恒信國際融資租賃股份有限公司 | 超短期融資券 | 5/21/2021             | 1/21/2022              | 3.25%       | 1,019,896    | 1,781        | 1,021,677    | -            |
| 海通恒信國際融資租賃股份有限公司 | 超短期融資券 | 5/24/2021             | 2/18/2022              | 3.30%       | 509,908      | 2,170        | 512,078      | -            |
| 海通恒信國際融資租賃股份有限公司 | 超短期融資券 | 8/6/2021              | 4/22/2022              | 2.97%       | 1,011,492    | 9,032        | 1,020,524    | -            |
| 海通恒信國際融資租賃股份有限公司 | 超短期融資券 | 8/23/2021             | 3/11/2022              | 2.83%       | 504,893      | 2,675        | 507,568      | -            |
| 海通恒信國際融資租賃股份有限公司 | 超短期融資券 | 10/13/2021            | 3/25/2022              | 2.85%       | 1,005,768    | 6,481        | 1,012,249    | -            |
| 海通恒信國際融資租賃股份有限公司 | 超短期融資券 | 11/25/2021            | 4/15/2022              | 2.85%       | 1,002,324    | 8,121        | 1,010,445    | -            |
| 海通恒信國際融資租賃股份有限公司 | 超短期融資券 | 1/11/2022             | 5/27/2022              | 2.60%       | -            | 1,009,688    | 1,009,688    | -            |
| 海通恒信國際融資租賃股份有限公司 | 超短期融資券 | 1/19/2022             | 6/17/2022              | 2.60%       | -            | 505,307      | 505,307      | -            |
| 海通恒信國際融資租賃股份有限公司 | 超短期融資券 | 2/16/2022             | 8/26/2022              | 2.43%       | -            | 504,335      | -            | 504,335      |
| 海通恒信國際融資租賃股份有限公司 | 超短期融資券 | 3/8/2022              | 8/25/2022              | 2.46%       | -            | 503,710      | -            | 503,710      |
| 海通恒信國際融資租賃股份有限公司 | 超短期融資券 | 3/23/2022             | 8/12/2022              | 2.46%       | -            | 1,006,455    | -            | 1,006,455    |
| 海通恒信國際融資租賃股份有限公司 | 超短期融資券 | 4/13/2022             | 10/28/2022             | 2.49%       | -            | 502,368      | -            | 502,368      |
| 海通恒信國際融資租賃股份有限公司 | 超短期融資券 | 4/20/2022             | 11/18/2022             | 2.28%       | -            | 1,003,761    | -            | 1,003,761    |
| 海通恒信國際融資租賃股份有限公司 | 超短期融資券 | 5/25/2022             | 2/17/2023              | 2.05%       | -            | 1,000,957    | -            | 1,000,957    |
| 海通恒信國際融資租賃股份有限公司 | 超短期融資券 | 6/15/2022             | 3/10/2023              | 2.06%       | -            | 499,819      | -            | 499,819      |
| 海通國際證券集團有限公司     | 中期票據   | 4/8/2021              | 1/10/2022              | 0.72%       | 320,486      | 14,735       | 335,221      | -            |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 42 應付短期融資款 (續)

| 發債主體         | 債券名稱 | 起息日期       | 到期日期       | 票面利率  | 期初餘額<br>(千元) | 本期增加<br>(千元) | 本期減少<br>(千元) | 期末餘額<br>(千元) |
|--------------|------|------------|------------|-------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 海通國際證券集團有限公司 | 中期票據 | 7/16/2021  | 1/18/2022  | 0.60% | 655,867      | 30,154       | 686,021      | -            |
| 海通國際證券集團有限公司 | 中期票據 | 7/16/2021  | 7/15/2022  | 0.70% | 207,420      | 10,383       | -            | 217,803      |
| 海通國際證券集團有限公司 | 中期票據 | 7/29/2021  | 1/28/2022  | 0.60% | 311,477      | 14,320       | 325,797      | -            |
| 海通國際證券集團有限公司 | 中期票據 | 8/3/2021   | 2/7/2022   | 0.60% | 311,454      | 14,319       | 325,773      | -            |
| 海通國際證券集團有限公司 | 中期票據 | 8/18/2021  | 2/18/2022  | 0.50% | 655,193      | 30,123       | 685,316      | -            |
| 海通國際證券集團有限公司 | 中期票據 | 8/26/2021  | 8/25/2022  | 0.58% | 319,295      | 17,863       | -            | 337,158      |
| 海通國際證券集團有限公司 | 中期票據 | 9/14/2021  | 3/14/2022  | 0.00% | 246,644      | 11,340       | 257,984      | -            |
| 海通國際證券集團有限公司 | 中期票據 | 9/20/2021  | 9/19/2022  | 0.59% | 638,366      | 35,715       | -            | 674,081      |
| 海通國際證券集團有限公司 | 中期票據 | 12/8/2021  | 12/7/2022  | 0.75% | 636,686      | 36,633       | -            | 673,319      |
| 海通國際證券集團有限公司 | 中期票據 | 12/13/2021 | 6/13/2022  | 0.65% | 653,938      | 30,065       | 684,003      | -            |
| 海通國際證券集團有限公司 | 中期票據 | 12/16/2021 | 12/15/2022 | 0.75% | 636,551      | 36,626       | -            | 673,177      |
| 海通國際證券集團有限公司 | 中期票據 | 1/13/2022  | 7/13/2022  | 0.75% | -            | 404,030      | -            | 404,030      |
| 海通國際證券集團有限公司 | 中期票據 | 1/31/2022  | 8/1/2022   | 0.60% | -            | 134,523      | -            | 134,523      |
| 海通國際證券集團有限公司 | 中期票據 | 2/17/2022  | 2/16/2023  | 1.00% | -            | 878,665      | -            | 878,665      |
| 海通國際證券集團有限公司 | 中期票據 | 6/8/2022   | 1/9/2023   | 2.10% | -            | 1,454,174    | -            | 1,454,174    |
| 海通國際證券集團有限公司 | 中期票據 | 6/9/2022   | 1/10/2023  | 2.00% | -            | 85,507       | -            | 85,507       |
| 合計           |      |            |            |       | 24,986,688   | 23,626,692   | 25,953,350   | 22,660,030   |

註：於2022年6月30日，應付短期融資款包括未到期償付的短期公司債券以及原始期限為1年以內的收益憑證。於2022年6月30日及2021年12月31日，本集團發行的應付短期融資款沒有出現本金、利息或贖回款項的違約情況。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間

(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

| 債券類型 | 幣種  | 面值<br>(原幣千元) | 起息日期       | 到期日期       | 票面利率           | 期初餘額<br>(人民幣千元) | 本期增加<br>(人民幣千元) | 本期減少<br>(人民幣千元) | 期末餘額<br>(人民幣千元) |
|------|-----|--------------|------------|------------|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 公司債券 | 人民幣 | 2,390,000    | 11/25/2013 | 11/25/2023 | 6.18%          | 2,401,346       | 74,150          | -               | 2,475,496       |
| 公司債券 | 人民幣 | 800,000      | 7/14/2014  | 7/14/2024  | 5.85%          | 821,925         | 23,208          | -               | 845,133         |
| 公司債券 | 人民幣 | 1,000,000    | 8/11/2017  | 8/11/2022  | 4.80%          | 1,018,551       | 24,010          | -               | 1,042,561       |
| 公司債券 | 人民幣 | 5,500,000    | 9/22/2017  | 9/22/2027  | 4.99%          | 5,569,377       | 136,595         | -               | 5,705,972       |
| 公司債券 | 美元  | 300,000      | 12/13/2018 | 12/13/2023 | 4.50%          | 1,913,075       | 170,891         | 69,363          | 2,014,603       |
| 公司債券 | 歐元  | 230,000      | 12/13/2018 | 12/13/2023 | Euribor+165bps | 1,661,502       | 66,087          | 114,783         | 1,612,806       |
| 公司債券 | 人民幣 | 5,000,000    | 4/11/2019  | 4/11/2022  | 3.75%          | 5,136,130       | 51,370          | 5,187,500       | -               |
| 公司債券 | 人民幣 | 4,500,000    | 11/15/2019 | 11/15/2022 | 3.52%          | 4,520,397       | 78,549          | -               | 4,598,946       |
| 公司債券 | 人民幣 | 5,000,000    | 2/27/2020  | 2/27/2023  | 3.01%          | 5,126,997       | 74,632          | 150,500         | 5,051,129       |
| 公司債券 | 人民幣 | 3,500,000    | 3/19/2020  | 3/19/2023  | 2.99%          | 3,582,573       | 51,895          | 104,650         | 3,529,818       |
| 公司債券 | 人民幣 | 5,600,000    | 4/30/2020  | 4/30/2023  | 2.38%          | 5,689,827       | 66,092          | 133,280         | 5,622,639       |
| 公司債券 | 人民幣 | 700,000      | 4/30/2020  | 4/30/2025  | 2.88%          | 713,587         | 9,997           | 20,160          | 703,424         |
| 公司債券 | 人民幣 | 6,700,000    | 5/25/2020  | 5/25/2023  | 2.70%          | 6,809,531       | 89,707          | 180,900         | 6,718,338       |
| 公司債券 | 人民幣 | 6,000,000    | 8/11/2020  | 8/11/2023  | 3.53%          | 6,082,979       | 105,030         | -               | 6,188,009       |
| 公司債券 | 人民幣 | 5,000,000    | 10/21/2020 | 10/21/2022 | 3.82%          | 5,037,677       | 94,715          | -               | 5,132,392       |
| 公司債券 | 人民幣 | 5,000,000    | 11/19/2020 | 1/13/2022  | 3.70%          | 5,206,795       | 6,081           | 5,212,876       | -               |
| 公司債券 | 人民幣 | 6,000,000    | 1/13/2021  | 1/13/2024  | 3.58%          | 6,207,738       | 106,517         | 214,800         | 6,099,455       |
| 公司債券 | 人民幣 | 5,400,000    | 2/8/2021   | 2/8/2024   | 3.79%          | 5,583,353       | 101,489         | 204,660         | 5,480,182       |
| 公司債券 | 人民幣 | 5,000,000    | 4/23/2021  | 4/23/2024  | 3.45%          | 5,119,568       | 85,541          | 172,499         | 5,032,610       |
| 公司債券 | 人民幣 | 2,800,000    | 5/27/2021  | 5/27/2024  | 3.35%          | 2,856,280       | 46,515          | 93,800          | 2,808,995       |
| 公司債券 | 人民幣 | 2,100,000    | 6/10/2021  | 6/10/2024  | 3.40%          | 2,140,101       | 35,407          | 71,400          | 2,104,108       |
| 公司債券 | 人民幣 | 2,000,000    | 7/29/2021  | 7/29/2024  | 3.14%          | 2,026,841       | 31,141          | -               | 2,057,982       |
| 公司債券 | 人民幣 | 3,000,000    | 8/20/2021  | 8/20/2024  | 3.04%          | 3,033,482       | 45,225          | -               | 3,078,707       |
| 公司債券 | 人民幣 | 2,000,000    | 8/30/2021  | 8/30/2024  | 3.10%          | 2,021,063       | 30,745          | -               | 2,051,808       |
| 公司債券 | 人民幣 | 2,000,000    | 8/30/2021  | 8/30/2026  | 3.43%          | 2,023,305       | 34,018          | -               | 2,057,323       |
| 公司債券 | 人民幣 | 5,000,000    | 11/10/2021 | 11/10/2024 | 3.10%          | 5,022,082       | 76,863          | -               | 5,098,945       |
| 公司債券 | 人民幣 | 5,000,000    | 11/22/2021 | 11/22/2024 | 3.09%          | 5,016,932       | 76,615          | -               | 5,093,547       |
| 公司債券 | 人民幣 | 5,000,000    | 1/20/2022  | 12/25/2024 | 2.84%          | -               | 5,063,025       | -               | 5,063,025       |
| 公司債券 | 人民幣 | 2,900,000    | 2/11/2022  | 2/11/2025  | 2.90%          | -               | 2,929,953       | -               | 2,929,953       |
| 公司債券 | 人民幣 | 500,000      | 3/7/2022   | 3/7/2025   | 3.03%          | -               | 504,815         | -               | 504,815         |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

## 43 應付債券 (續)

| 發債主體             | 債券類型 | 幣種  | 面值<br>(原幣千元) | 起息日期                   | 到期日期                    | 票面利率        | 期初餘額<br>(人民幣千元) | 本期增加<br>(人民幣千元) | 本期減少<br>(人民幣千元) | 期末餘額<br>(人民幣千元) |
|------------------|------|-----|--------------|------------------------|-------------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 海通證券股份有限公司       | 次級債券 | 人民幣 | 3,300,000    | 2/28/2019              | 2/28/2022               | 4.09%       | 3,413,523       | 21,447          | 3,434,970       | -               |
| 海通證券股份有限公司       | 次級債券 | 人民幣 | 5,000,000    | 1/12/2022              | 1/12/2025               | 3.18%       | -               | 5,074,055       | -               | 5,074,055       |
| 海通證券股份有限公司       | 次級債券 | 人民幣 | 2,000,000    | 2/25/2022              | 2/25/2025               | 3.15%       | -               | 2,021,748       | -               | 2,021,748       |
| 海通證券股份有限公司       | 次級債券 | 人民幣 | 2,480,000    | 3/9/2022               | 3/9/2025                | 3.29%       | -               | 2,505,484       | -               | 2,505,484       |
| 海通證券股份有限公司       | 金融債券 | 人民幣 | 7,000,000    | 8/29/2019              | 8/29/2022               | 3.39%       | 7,081,267       | 117,675         | -               | 7,198,942       |
| 海通證券股份有限公司       | 收益憑證 | 人民幣 | 506,007      | 2020/7/14至<br>2022/7/1 | 2022/7/13至<br>2024/6/27 | 0.00%-3.70% | 395,855         | 191,531         | 73,689          | 513,697         |
| 上海海通證券資產管理有限公司   | 公司債券 | 人民幣 | 1,000,000    | 11/4/2020              | 11/4/2025               | 3.85%       | 1,006,012       | 19,092          | -               | 1,025,104       |
| 上海海通證券資產管理有限公司   | 次級債券 | 人民幣 | 1,000,000    | 4/4/2018               | 4/4/2023                | 5.00%       | 103,726         | 2,479           | 5,000           | 101,205         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 公司債券 | 人民幣 | 500,000      | 2/28/2019              | 2/28/2022               | 5.20%       | 521,679         | 4,132           | 525,811         | -               |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 公司債券 | 人民幣 | 500,000      | 7/24/2019              | 7/24/2022               | 4.83%       | 510,204         | 12,652          | -               | 522,856         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 公司債券 | 人民幣 | 1,000,000    | 5/11/2020              | 5/11/2023               | 3.50%       | 1,019,973       | 17,356          | 34,111          | 1,003,218       |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 公司債券 | 人民幣 | 700,000      | 6/19/2020              | 6/19/2022               | 3.95%       | 713,762         | 12,802          | 726,564         | -               |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 公司債券 | 人民幣 | 1,200,000    | 7/28/2020              | 7/28/2023               | 4.00%       | 1,216,709       | 25,018          | -               | 1,241,727       |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 公司債券 | 人民幣 | 1,000,000    | 9/10/2020              | 9/10/2022               | 4.40%       | 1,011,399       | 23,292          | -               | 1,034,691       |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 公司債券 | 人民幣 | 1,000,000    | 9/17/2020              | 9/17/2023               | 4.20%       | 1,008,703       | 21,799          | -               | 1,030,502       |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 公司債券 | 人民幣 | 800,000      | 10/30/2020             | 10/30/2023              | 4.15%       | 802,798         | 17,241          | -               | 820,039         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 公司債券 | 人民幣 | 1,000,000    | 4/26/2021              | 4/26/2025               | 4.10%       | 1,024,573       | 20,332          | 39,708          | 1,005,197       |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 公司債券 | 人民幣 | 800,000      | 6/18/2021              | 6/18/2025               | 3.85%       | 812,964         | 15,273          | 29,036          | 799,201         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 公司債券 | 人民幣 | 600,000      | 8/12/2021              | 8/12/2024               | 3.90%       | 606,340         | 12,100          | -               | 618,440         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 公司債券 | 人民幣 | 1,000,000    | 10/25/2021             | 10/25/2023              | 3.80%       | 1,001,517       | 20,369          | -               | 1,021,886       |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 公司債券 | 人民幣 | 1,000,000    | 12/24/2021             | 12/24/2024              | 3.70%       | 995,925         | 19,165          | -               | 1,015,090       |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間

(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

| 發債主體             | 債券類型   | 幣種  | 面值<br>(原幣千元) | 起息日期       | 到期日期       | 票面利率        | 期初餘額<br>(人民幣千元) | 本期增加<br>(人民幣千元) | 本期減少<br>(人民幣千元) | 期末餘額<br>(人民幣千元) |
|------------------|--------|-----|--------------|------------|------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 公司債券   | 人民幣 | 1,500,000    | 4/21/2022  | 4/21/2024  | 3.48%       | -               | 1,503,444       | -               | 1,503,444       |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 公司債券   | 人民幣 | 500,000      | 5/5/2022   | 5/5/2025   | 3.57%       | -               | 500,404         | -               | 500,404         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 公司債券   | 人民幣 | 1,000,000    | 6/21/2022  | 6/21/2024  | 3.16%       | -               | 995,943         | -               | 995,943         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 中期票據   | 人民幣 | 500,000      | 8/31/2020  | 8/31/2023  | 4.20%       | 505,673         | 10,834          | -               | 516,507         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 中期票據   | 人民幣 | 1,000,000    | 11/6/2020  | 11/6/2022  | 3.97%       | 1,004,602       | 20,492          | -               | 1,025,094       |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 中期票據   | 人民幣 | 500,000      | 1/20/2021  | 1/20/2023  | 4.00%       | 518,052         | 9,918           | 19,585          | 508,385         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 中期票據   | 人民幣 | 1,000,000    | 12/9/2021  | 12/9/2024  | 3.70%       | 997,363         | 19,242          | -               | 1,016,605       |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 中期票據   | 人民幣 | 800,000      | 1/13/2022  | 1/13/2025  | 3.64%       | -               | 810,012         | -               | 810,012         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 中期票據   | 人民幣 | 1,000,000    | 5/27/2022  | 5/27/2025  | 3.42%       | -               | 998,470         | -               | 998,470         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持票據 | 人民幣 | 950,000      | 11/11/2019 | 3/19/2022  | 4.57%       | 22              | -               | 22              | -               |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持票據 | 人民幣 | 950,000      | 3/25/2020  | 11/19/2022 | 4.10%       | 118,445         | 1,387           | 102,023         | 17,809          |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持票據 | 人民幣 | 950,000      | 8/16/2021  | 3/27/2023  | 3.40%、4.00% | 367,063         | 5,059           | 270,183         | 101,939         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持票據 | 人民幣 | 950,000      | 8/18/2021  | 8/26/2022  | 3.50%       | 339,796         | 3,601           | 285,100         | 58,297          |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持票據 | 人民幣 | 970,000      | 11/18/2021 | 5/17/2022  | 3.25%       | 972,226         | 11,746          | 983,972         | -               |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持票據 | 人民幣 | 950,000      | 11/29/2021 | 5/26/2023  | 3.70%、3.95% | 947,283         | 16,007          | 491,977         | 471,313         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持票據 | 人民幣 | 950,000      | 3/10/2022  | 8/26/2024  | 3.00%-3.50% | -               | 953,664         | -               | 953,664         |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 43 應付債券 (續)

| 發債主體             | 債券類型     | 幣種  | 面值<br>(原幣千元) | 起息日期       | 到期日期       | 票面利率        | 期初餘額<br>(人民幣千元) | 本期增加<br>(人民幣千元) | 本期減少<br>(人民幣千元) | 期末餘額<br>(人民幣千元) |
|------------------|----------|-----|--------------|------------|------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持專項計劃 | 人民幣 | 1,440,000    | 6/14/2019  | 2/24/2022  | 4.50%       | 109             | -               | 109             | -               |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持專項計劃 | 人民幣 | 926,000      | 12/24/2019 | 5/26/2022  | 4.60%       | 62,770          | 651             | 63,421          | -               |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持專項計劃 | 人民幣 | 950,000      | 4/15/2020  | 2/27/2023  | 3.40%       | 131,229         | 1,355           | 113,310         | 19,274          |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持專項計劃 | 人民幣 | 880,000      | 5/28/2020  | 7/26/2022  | 3.40%       | 203,538         | 1,736           | 169,380         | 35,894          |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持專項計劃 | 人民幣 | 950,000      | 6/17/2020  | 2/27/2023  | 3.70%       | 248,767         | 3,224           | 164,551         | 87,440          |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持專項計劃 | 人民幣 | 950,000      | 6/19/2020  | 1/26/2022  | 3.80%       | 26,979          | 70              | 27,049          | -               |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持專項計劃 | 人民幣 | 190,000      | 4/7/2020   | 2/13/2023  | 5.00%       | 190,498         | 4,711           | 4,404           | 190,805         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持專項計劃 | 人民幣 | 950,000      | 7/28/2020  | 5/26/2023  | 4.10%       | 280,675         | 3,892           | 193,308         | 91,259          |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持專項計劃 | 人民幣 | 950,000      | 8/14/2020  | 4/26/2022  | 3.68%、3.99% | 153,060         | 628             | 153,688         | -               |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持專項計劃 | 人民幣 | 950,000      | 9/9/2020   | 4/26/2023  | 4.00%、4.20% | 320,240         | 3,828           | 216,160         | 107,908         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持專項計劃 | 人民幣 | 950,000      | 10/22/2020 | 6/26/2023  | 4.00%、4.30% | 311,193         | 5,200           | 209,759         | 106,634         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持專項計劃 | 人民幣 | 950,000      | 11/24/2020 | 4/26/2022  | 4.15%、4.30% | 240,693         | 1,881           | 242,574         | -               |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持專項計劃 | 人民幣 | 950,000      | 12/9/2020  | 7/26/2023  | 4.24%、4.30% | 419,463         | 5,819           | 235,027         | 190,255         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持專項計劃 | 人民幣 | 950,000      | 2/2/2021   | 8/28/2023  | 3.80%、4.55% | 432,615         | 6,534           | 243,519         | 195,630         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持專項計劃 | 人民幣 | 950,000      | 3/25/2021  | 8/28/2023  | 4.00%、4.50% | 501,058         | 7,860           | 263,336         | 245,582         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司 | 資產支持專項計劃 | 人民幣 | 950,000      | 3/31/2021  | 11/28/2022 | 4.00%、4.40% | 388,691         | 5,502           | 264,585         | 129,608         |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間

(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

| 發債主體  | 債券類型            | 幣種  | 面值<br>(原幣千元) | 起息日期       | 到期日期       | 票面利率        | 期初餘額<br>(人民幣千元) | 本期增加<br>(人民幣千元) | 本期減少<br>(人民幣千元) | 期末餘額<br>(人民幣千元) |
|---|-----------------|-----|--------------|------------|------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司                            | 資產支持專項計劃        | 人民幣 | 950,000      | 4/29/2021  | 9/26/2023  | 4.00%、4.50% | 515,133         | 9,070           | 244,967         | 279,236         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司                            | 資產支持專項計劃        | 人民幣 | 950,000      | 5/31/2021  | 1/26/2023  | 3.85%、4.35% | 610,326         | 8,119           | 307,530         | 310,915         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司                            | 資產支持專項計劃        | 人民幣 | 950,000      | 6/17/2021  | 8/28/2023  | 3.80%、4.40% | 587,188         | 8,687           | 303,964         | 291,911         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司                            | 資產支持專項計劃        | 人民幣 | 950,000      | 8/5/2021   | 9/26/2023  | 3.50%、4.20% | 594,324         | 8,916           | 295,043         | 308,197         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司                            | 資產支持專項計劃        | 人民幣 | 950,000      | 9/24/2021  | 4/26/2023  | 3.17%-3.99% | 954,384         | 9,638           | 574,075         | 389,947         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司                            | 資產支持專項計劃        | 人民幣 | 950,000      | 11/19/2021 | 8/28/2023  | 3.50%-3.95% | 947,632         | 15,530          | 453,073         | 510,089         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司                            | 資產支持專項計劃        | 人民幣 | 950,000      | 12/8/2021  | 8/28/2023  | 3.35%-4.00% | 944,485         | 11,990          | 540,046         | 416,429         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司                            | 資產支持專項計劃        | 人民幣 | 950,000      | 1/26/2022  | 5/26/2023  | 3.00%-3.40% | -               | 960,118         | -               | 960,118         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司                            | 資產支持專項計劃        | 人民幣 | 950,000      | 6/29/2022  | 2/26/2025  | 2.69%-3.60% | -               | 942,444         | -               | 942,444         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司                            | 非公開定向債務融資<br>工具 | 人民幣 | 300,000      | 4/23/2019  | 4/23/2022  | 4.65%       | 309,506         | 4,281           | 313,787         | -               |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司                            | 非公開定向債務融資<br>工具 | 人民幣 | 1,000,000    | 5/31/2019  | 5/31/2022  | 4.70%       | 1,027,051       | 19,315          | 1,046,366       | -               |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司                            | 非公開定向債務融資<br>工具 | 人民幣 | 1,400,000    | 12/4/2019  | 12/4/2022  | 4.50%       | 1,402,664       | 32,313          | -               | 1,434,977       |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司                            | 非公開定向債務融資<br>工具 | 人民幣 | 1,000,000    | 6/4/2021   | 6/4/2023   | 3.95%       | 1,020,318       | 19,587          | 38,645          | 1,001,260       |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司                            | 非公開定向債務融資<br>工具 | 人民幣 | 1,000,000    | 11/11/2021 | 11/11/2024 | 4.19%       | 1,001,267       | 21,582          | -               | 1,022,849       |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司/<br>海通恆信小微融資租賃(上海)有限<br>公司 | 資產支持專項計劃        | 人民幣 | 1,140,000    | 5/18/2022  | 3/26/2024  | 2.69%-3.20% | -               | 1,136,558       | -               | 1,136,558       |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 43 應付債券 (續)

| 發債主體   | 債券類型     | 幣種    | 面值<br>(原幣千元) | 起息日期                     | 到期日期                     | 票面利率         | 期初餘額<br>(人民幣千元) | 本期增加<br>(人民幣千元) | 本期減少<br>(人民幣千元) | 期末餘額<br>(人民幣千元) |
|--|----------|-------|--------------|--------------------------|--------------------------|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司/<br>海通恆信小微融資租賃(上海)有限<br>公司            | 資產支持專項計劃 | 人民幣   | 760,000      | 12/29/2021               | 8/15/2023                | 3.60%-3.95%  | 754,450         | 11,102          | 305,437         | 460,115         |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司/<br>海通恆信小微融資租賃(上海)有限<br>公司            | 資產支持專項計劃 | 人民幣   | 1,140,000    | 4/13/2022                | 12/26/2023               | 3.00%-3.40%  | -               | 1,139,996       | 355,701         | 784,295         |
| Unican Limited   | 境外私募債    | 美元    | 150,000      | 7/31/2019                | 7/31/2022                | 3.80%        | 970,422         | 64,803          | 12,607          | 1,022,618       |
| Haitong UT Brilliant Limited                           | 中期票據     | 美元    | 100,000      | 6/3/2021                 | 6/3/2024                 | 3.00%        | 601,447         | 43,638          | 4,510           | 640,575         |
| Haitong UT Brilliant Limited                           | 中期票據     | 美元    | 200,000      | 4/27/2022                | 4/27/2025                | 4.20%        | -               | 1,346,621       | -               | 1,346,621       |
| 海通國際證券集團有限公司   | 公司債券     | 美元    | 700,000      | 7/19/2019                | 7/19/2024                | 3.38%        | 4,517,314       | 239,908         | -               | 4,757,222       |
| 海通國際證券集團有限公司   | 公司債券     | 美元    | 400,000      | 11/18/2019               | 5/18/2025                | 3.13%        | 2,545,221       | 135,792         | -               | 2,681,013       |
| 海通國際證券集團有限公司   | 公司債券     | 美元    | 400,000      | 7/2/2020                 | 7/2/2023                 | 2.13%        | 2,570,703       | 137,211         | -               | 2,707,914       |
| 海通國際證券集團有限公司   | 公司債券     | 美元    | 300,000      | 5/20/2021                | 5/20/2026                | 2.13%        | 1,909,960       | 101,138         | -               | 2,011,098       |
| Haitong International Finance Holdings<br>2015 Limited | 公司債券     | 美元    | 670,000      | 3/12/2020                | 3/11/2025                | 2.11%        | 4,291,224       | 279,467         | 52,281          | 4,518,410       |
| Haitong Investment Ireland PLC                         | 中期票據     | 歐元    | 6,799        | 2017/12/30至<br>2018/7/25 | 2022/12/10至<br>2026/1/25 | 0.98%-1.71%  | 45,880          | -               | 2,206           | 43,674          |
| Haitong Bank, S.A.                                     | 金融債券     | 歐元    | 230,000      | 2/10/2022                | 2/10/2025                | 0.90%        | -               | 1,605,569       | -               | 1,605,569       |
| Haitong Bank, S.A.                                     | 金融債券     | 美元    | 150,000      | 5/25/2022                | 5/31/2027                | 4.00%        | -               | 1,013,205       | -               | 1,013,205       |
| Haitong Banco de Investimento do<br>Brasil S.A.        | 金融債券     | 巴西雷亞爾 | 538,317      | 2018/5/21至<br>2022/6/30  | 2022/1/3至<br>2026/3/30   | 5.47%-17.36% | 193,125         | 551,282         | 4,663           | 739,744         |
| 合計   |          |       |              |                          |                          |              | 163,586,070     | 36,256,914      | 26,372,003      | 173,470,981     |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間

(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 43 應付債券(續)

|            | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|------------|--------------------------|--------------------------|
| 就報告目的分析如下： |                          |                          |
| 流動負債       | 58,825,324               | 52,513,925               |
| 非流動負債      | 114,645,657              | 111,072,145              |
|            | <b>173,470,981</b>       | 163,586,070              |

### 44 應付經紀業務客戶賬款

|            | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|------------|--------------------------|--------------------------|
| 應付經紀業務客戶賬款 | <b>129,589,378</b>       | 123,202,200              |

大部分應付經紀業務客戶賬款須按要求償還，惟若干應付予經紀業務客戶的賬款除外，該等賬款乃就客戶於正常業務過程中進行交易活動而收取客戶的孖展按金。只有超出規定孖展按金的金額可應要求發還客戶。

本集團的應付經紀業務客戶賬款主要有代客戶於銀行及結算所持有的現金，應付經紀業務客戶款項按照現行基準利率計提相應的應付利息。

### 45 客戶存款

|        | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|--------|--------------------------|--------------------------|
| 公司活期存款 | 223,305                  | 321,006                  |
| 公司定期存款 | 3,857,574                | 3,833,794                |
| 個人活期存款 | 2,050                    | 55                       |
| 個人定期存款 | 2,295,145                | 1,789,636                |
|        | <b>6,378,074</b>         | 5,944,491                |
| 分析如下：  |                          |                          |
| 流動負債   | 5,006,434                | 2,758,837                |
| 非流動負債  | 1,371,640                | 3,185,654                |
|        | <b>6,378,074</b>         | 5,944,491                |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 46 其他應付款項及預計費用

|             | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|-------------|--------------------------|--------------------------|
| 應付僱員成本(附註i) | 6,819,398                | 7,498,187                |
| 應付股利        | 3,959,036                | 7,536                    |
| 短期融資租賃保證金   | 3,415,258                | 3,832,682                |
| 應付客戶清算款     | 2,005,859                | 750,543                  |
| 應付票據        | 1,578,972                | 2,899,881                |
| 應付經紀商款項     | 1,563,471                | 1,659,651                |
| 應付結算所款項     | 1,437,059                | 2,037,970                |
| 風險準備金       | 792,790                  | 821,412                  |
| 其他稅費        | 408,611                  | 722,417                  |
| 應付手續費及佣金    | 16,222                   | 19,481                   |
| 其他(附註ii)    | 7,854,058                | 9,791,241                |
|             | <b>29,850,734</b>        | 30,041,001               |
| 分析如下：       |                          |                          |
| 流動負債        | 28,475,757               | 28,635,826               |
| 非流動負債(附註i)  | 1,374,977                | 1,405,175                |
|             | <b>29,850,734</b>        | 30,041,001               |

附註：

- (i) 本集團設立的職工獎金詳細支付計劃。根據該計劃，總計人民幣400,804千元將於一年後償付(2021年12月31日：人民幣424,063千元)，因此被分類為非流動負債。
- (ii) 本集團其他主要是預收的應付款項並不計算利息，須予一年內結轉。

### 47 預計負債

|         | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|---------|--------------------------|--------------------------|
| 未決訴訟及其它 | 179,106                  | 196,697                  |
| 對外提供擔保  | 6,685                    | 7,103                    |
|         | <b>185,791</b>           | 203,800                  |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間

（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

### 48 以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債

|                            | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|----------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 交易性金融負債                    | 973,880                  | 2,382,470                |
| 合併結構化主體形成的金融負債             | 871,250                  | 1,828,521                |
| 指定以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債(附註) |                          |                          |
| — 結構化收益產品                  | 10,277,529               | 8,078,933                |
| — 黃金期權                     | 58,651                   | —                        |
| — 收益憑證                     | 6,230,078                | 4,026,293                |
|                            | <b>18,411,388</b>        | 16,316,217               |
| 就報告目的分析如下：                 |                          |                          |
| 流動負債                       | 7,280,889                | 10,456,105               |
| 非流動負債                      | 11,130,499               | 5,860,112                |
|                            | <b>18,411,388</b>        | 16,316,217               |

附註：

於2022年6月30日及2021年12月31日，本集團指定以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債的公允價值與到期合同付款之間的差異不顯著。截至2022年6月30日止六個月期間和2021年12月31日止年度，由於集團自身信用風險的變化而導致的公允價值變動並不顯著。

於2022年6月30日及2021年12月31日，本集團指定以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債中包括本集團發行的結構化收益產品、收益憑證及合併結構化主體歸屬於第三方權益等。

### 49 賣出回購金融資產款

|            | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|------------|--------------------------|--------------------------|
| 按抵押品分類劃分：  |                          |                          |
| 股票         | 1,523,164                | 876,186                  |
| 債券         | 69,158,727               | 80,060,042               |
| 黃金         | 10,885,593               | 10,975,724               |
|            | <b>81,567,484</b>        | 91,911,952               |
| 按市場所分類劃分：  |                          |                          |
| 交易所        | 23,859,435               | 38,841,695               |
| 銀行間市場      | 46,822,456               | 42,094,533               |
| 場外交易市場     | 10,885,593               | 10,975,724               |
|            | <b>81,567,484</b>        | 91,911,952               |
| 就報告目的分析如下： |                          |                          |
| 流動負債       | <b>81,567,484</b>        | 91,911,952               |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 49 賣出回購金融資產款(續)

賣出回購協議是集團與對手方之間的交易，將證券或者資產出售並同時達成回購協議，在未來某個時間以固定價格購回。即使回購價格是固定的，集團仍然面臨著顯著的信用風險，市場風險和出售這些債券的收益。這些證券不會從財務報表中終止確認，但被視為該負債的抵押品，因為本集團保留了證券的所有風險與收益。

以下表格列示了關於被轉移的金融資產及相關負債的賬面價值或公允價值：

於2022年6月30日

|            | 以公允價值計量<br>且變動計入損益的<br>金融資產 | 以公允價值計量<br>且變動計入<br>其他綜合收益的<br>債務工具 | 以攤餘<br>成本計量的<br>債務工具 | 買入返售<br>金融資產 | 其他         | 合計         |
|------------|-----------------------------|-------------------------------------|----------------------|--------------|------------|------------|
| 已轉移資產的賬面價值 | 42,864,001                  | 28,459,095                          | 947,573              | 351,398      | 18,052,664 | 90,674,731 |
| 相關負債的賬面價值  | 39,086,047                  | 24,571,760                          | 899,290              | 332,506      | 16,677,881 | 81,567,484 |
| 淨頭寸        | 3,777,954                   | 3,887,335                           | 48,283               | 18,892       | 1,374,783  | 9,107,247  |

於2021年12月31日

|            | 以公允價值計量<br>且變動計入損益的<br>金融資產 | 以公允價值計量<br>且變動計入<br>其他綜合收益的<br>債務工具 | 以攤餘<br>成本計量的<br>債務工具 | 買入返售<br>金融資產 | 其他         | 合計         |
|------------|-----------------------------|-------------------------------------|----------------------|--------------|------------|------------|
| 已轉移資產的賬面價值 | 49,477,280                  | 23,966,069                          | 101,712              | 719,802      | 25,187,767 | 99,452,630 |
| 相關負債的賬面價值  | 44,991,712                  | 22,425,310                          | 99,526               | 569,279      | 23,826,125 | 91,911,952 |
| 淨頭寸        | 4,485,568                   | 1,540,759                           | 2,186                | 150,523      | 1,361,642  | 7,540,678  |

### 50 拆入資金

|            | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|------------|--------------------------|--------------------------|
| 銀行拆入資金     | 4,642,601                | 6,649,257                |
| 從證金公司融入資金  | 6,012,783                | 9,015,400                |
|            | <b>10,655,384</b>        | 15,664,657               |
| 就報告目的分析如下： |                          |                          |
| 流動負債       | 7,757,132                | 12,723,438               |
| 非流動負債      | 2,898,252                | 2,941,219                |
|            | <b>10,655,384</b>        | 15,664,657               |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 51 長期應付款

|         | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|---------|--------------------------|--------------------------|
| 融資租賃保證金 | 4,401,118                | 5,207,591                |
| 遞延收益    | 403,375                  | 435,446                  |
| 其它      | 611,442                  | 587,307                  |
|         | <b>5,415,935</b>         | 6,230,344                |

長期應付款主要系本集團從事融資租賃業務收取的保證金。根據合同約定，保證金的到期日均在一年以上，分類為非流動負債。

### 52 股本

|                          | 上市A股             |                  | 上市H股             |                  | 合計                |                   |
|--------------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|-------------------|-------------------|
|                          | 股份數目<br>(千股)     | 金額               | 股份數目<br>(千股)     | 金額               | 股份數目<br>(千股)      | 金額                |
| 按每股人民幣1.00元註冊、<br>發行及繳足： |                  |                  |                  |                  |                   |                   |
| 於2021年12月31日(經審計)        | 9,654,631        | 9,654,631        | 3,409,569        | 3,409,569        | 13,064,200        | 13,064,200        |
| 於2022年6月30日(未經審計)        | <b>9,654,631</b> | <b>9,654,631</b> | <b>3,409,569</b> | <b>3,409,569</b> | <b>13,064,200</b> | <b>13,064,200</b> |

於2022年6月30日，本公司股本總數為13,064,200千股，其中有限售條件的股份為781,250千股(於2021年12月31日：有限售條件的股份為1,171,953千股)。

### 53 投資重估儲備

|                        | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 於期／年初                  | 305,179                  | 282,378                  |
| 其他債權投資                 |                          |                          |
| — 於期內公允價值變動淨額          | 64,329                   | 275,043                  |
| — 處置重分類調整對損益的影響        | (16,263)                 | 73,630                   |
| — 預期信用損失重分類調整對損益的影響    | (54,550)                 | 83,512                   |
| — 所得稅影響                | 2,038                    | (87,535)                 |
| 其他權益工具投資               |                          |                          |
| — 於期內公允價值變動淨額          | (955,123)                | (432,146)                |
| — 轉至未分配利潤              | 388,853                  | (150,792)                |
| — 所得稅影響                | 128,516                  | 143,478                  |
| 所佔聯營企業及合營企業的投資重估損失份額   | 4,365                    | (2,193)                  |
| 設定受益計劃的精算收益            | 55,466                   | 39,131                   |
| 指定為現金流量套期的套期工具公允價值變動收益 | 33,598                   | 80,673                   |
| 於期／年末                  | <b>(43,592)</b>          | 305,179                  |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 54 儲備及未分配利潤

本集團儲備之金額及年內變動於綜合權益變動表呈列。

#### (a) 資本公積

資本公積主要包括應按高於面值發行新股份而產生的歸屬於公司股東的股份溢價及權益交易產生的資本公積。

#### (b) 投資重估儲備

投資重估儲備主要包括以公允價值計量且變動計入其他全面收益的債務工具及以公允價值計量且變動計入其他全面收益的權益工具的公允價值變動。

#### (c) 一般儲備

一般儲備包括法定儲備、一般風險儲備及交易風險儲備。

根據中華人民共和國公司法，本公司淨利潤的10% (按中國會計規定釐定) 在對股東作出分派前須轉入法定儲備，該儲備達到本公司股本50%時可不再計提。根據公司章程或者經股東大會批准可撥出儲備彌補虧損，擴大生產規模及轉增資本。

根據金融企業適用的金融規則，本公司須在對股東作出分派前，從未分配利潤中撥出按中國相關會計準則核算的利潤淨額的10%的作為一般風險儲備。

根據中華人民共和國證券法，本公司須在對股東作出分派前，從未分配利潤中撥出按中國相關會計準則核算的利潤淨額的10%作為交易風險儲備，用於彌補交易損失，不能用於利潤分配和轉增資本。

#### (d) 未分配利潤

根據相關法律，本公司的未分配利潤視作(i)根據中國公認會計準則釐定的未分配利潤或(ii)根據國際財務報告準則釐定的未分配利潤，以較低者為準。

### 55 信用承諾

|            | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|------------|--------------------------|--------------------------|
| 或有負債：      |                          |                          |
| — 保函和備用信用證 | 920,911                  | 963,048                  |
| 承諾：        |                          |                          |
| — 不可撤銷信貸承諾 | 1,035,368                | 1,824,989                |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 55 信用承諾（續）

保函和備用信用證屬於發生代付情況下才可能導致集團資本流出的銀行業務。

不可撤銷信貸承諾為向海通銀行客戶提供的信貸協定（如未使用的信貸額度）。這些協議通常約定了固定期限或其他要素，且需要客戶支付一定的手續費。所有的信貸承諾在授信時都需要客戶維持一定的已核實的條件。

### 56 經營租賃安排

#### 本集團作為出租人

於期末，本集團與租戶已就下列未來最低租金簽訂合約：

|        | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|--------|--------------------------|--------------------------|
| 1年內    | 539,138                  | 503,180                  |
| 第1至第2年 | 566,753                  | 552,931                  |
| 第2至第3年 | 512,638                  | 506,236                  |
| 第3至第4年 | 444,108                  | 467,847                  |
| 第4至第5年 | 436,213                  | 431,314                  |
| 超過5年   | 944,397                  | 1,072,989                |
|        | <b>3,443,247</b>         | <b>3,534,497</b>         |

### 57 資本承擔

|                              | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 有關收購物業及設備的資本開支：<br>— 已訂約但未計提 | <b>1,246,148</b>         | 2,226,331                |

### 58 股利

|          | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|----------|--------------------------|--------------------------|
| 確認為分派的股利 | <b>3,919,260</b>         | 3,266,050                |

根據海通證券2022年6月21日召開的2021年度股東週年大會審議批准向全體股東宣派2021年度現金股利每10股人民幣3.0元（含稅），宣派總額為人民幣3,919百萬元（含稅）。於2022年7月28日，該現金股利已發放。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 59 於子公司的投資

通過設立或投資等方式取得的重要子公司

本集團主要子公司組成如下：

| 子公司名稱  | 按照中國法律註冊的<br>法人實體類型   | 註冊<br>成立/成立地點 | 本集團持有的股本權益                |                           | 註冊資本(元)           | 主要業務                    |
|--|---|---------------|---------------------------|---------------------------|-------------------|-------------------------|
|  |   |               | 於2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 於2021年<br>12月31日<br>(經審計) |                   |                         |
| 海富通基金管理有限公司<br>HFT Investment Management Co.,<br>Ltd.*                             | 有限責任公司(中外合資)<br>Limited liability company<br>(equity joint venture) | 上海            | 51%                       | 51%                       | 人民幣300,000,000    | 基金管理                    |
| 海通開元投資有限公司<br>Haitong Capital Investment Co.,<br>Ltd.*                             | 有限責任公司(法人獨資)<br>Limited liability company<br>(wholly owned)         | 上海            | 100%                      | 100%                      | 人民幣7,500,000,000  | 私募股權投資管理                |
| 海通國際控股有限公司<br>Haitong International Holdings<br>Limited*                           | 不適用<br>N/A  | 香港            | 100%                      | 100%                      | 港幣11,179,726,140  | 投資控股                    |
| 海通期貨股份有限公司<br>Haitong Futures Co., Ltd.*   | 股份有限公司(新三板上市)<br>Joint stock limited company<br>(listed on NEEQ)    | 上海            | 74%                       | 67%                       | 人民幣1,301,500,000  | 期貨代理                    |
| 海通國際證券集團有限公司<br>Haitong International Securities<br>Group Limited*                 | 不適用<br>N/A  | 百慕達           | 66%                       | 65%                       | 港幣664,156,359     | 投資控股                    |
| 海通創新證券投資有限公司<br>Haitong Innovation Securities<br>Investment Company Limited*       | 有限責任公司(法人獨資)<br>Limited liability company<br>(wholly owned)         | 上海            | 100%                      | 100%                      | 人民幣11,500,000,000 | 金融產品投資、股權投<br>資及證券投資    |
| 上海海通證券資產管理有限公司<br>Shanghai Haitong Securities Asset<br>Management Company Limited* | 有限責任公司(法人獨資)<br>Limited liability company<br>(wholly owned)         | 上海            | 100%                      | 100%                      | 人民幣2,200,000,000  | 證券資產管理                  |
| 海通恆信金融集團有限公司<br>Haitong UT Capital Group Co.,<br>Limited*                          | 不適用<br>N/A  | 香港            | 100%                      | 100%                      | 港幣4,146,162,881   | 投資控股                    |
| 海通恆信國際融資租賃股份有限公司<br>Haitong UniTrust International<br>Financial Leasing Co., Ltd.* | 股份有限公司(上市)<br>Joint stock limited company<br>(listed)               | 上海            | 85%                       | 85%                       | 人民幣8,235,300,000  | 租賃                      |
| 海通銀行<br>Haitong Bank, S.A.*  | 不適用<br>N/A  | 葡萄牙           | 100%                      | 100%                      | 歐元844,769,000     | 銀行                      |
| 上海惟泰置業管理有限公司<br>Shanghai Weitai Properties<br>Management Co., Ltd.*                | 有限責任公司(法人獨資)<br>Limited liability company<br>(wholly owned)         | 上海            | 100%                      | 100%                      | 人民幣10,000,000     | 物業管理、房地產開發經<br>營、餐飲企業管理 |
| 上海澤春投資發展有限公司<br>Shanghai Zechun Investment &<br>Development Co., Ltd.*             | 有限責任公司(法人獨資)<br>Limited liability company<br>(wholly owned)         | 上海            | 100%                      | 100%                      | 人民幣100,000,000    | 實業投資、房地產開發<br>經營、投資管理   |

附註：

(i) 英語翻譯名稱僅供參考。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 60 合併結構性主體之權益

本集團併入了部分結構性主體，這些主體主要為集合資產管理計劃。對於本集團作為集合資產管理計劃的管理人或作為投資者的情形，本集團綜合評估其因持有投資份額如有而享有的回報、其他利益以及作為集合資產管理計劃管理人的管理人報酬是否將使本集團面臨可變回報的影響重大，從而本集團應作委託人。

本集團持有的上述納入合併財務報表範圍的結構化主體對本集團於2022年6月30日及2021年12月31日的財務狀況及截至2022年6月30日止六個月期間及2021年度的經營成果和現金流量影響並不重大，因此，本集團未對這些被合併結構化主體的財務信息進行單獨披露。

於2022年6月30日，本集團於所有合併結構化主體之直接權益的公允價值為人民幣33,309,050千元（2021年12月31日：人民幣30,119,941千元）。該等本集團所有直接權益包括本集團於分級產品中認購的風險級產品，本集團作為風險級產品持有人為優先級產品持有人提供增信支持。於2022年6月30日，本集團認購的上述風險級產品公允價值為人民幣10,441千元（2021年12月31日：人民幣370,590千元）。

### 61 未合併結構性主體之權益

除已於附註60中所述已經合併的結構性主體以外，本公司董事認為，本集團所面臨與本集團作為結構性主體管理人相關的可變回報並不顯著或不擁有對被投資者的權利。因此，本集團沒有合併這些結構性主體。

於2022年6月30日，由本集團擔任投資管理人且持有權益之未合併結構性主體的賬面價值為人民幣13,224,829千元（2021年12月31日：人民幣13,448,955千元），本集團所面臨風險敞口與賬面價值相若。截至2022年6月30日止六個月期間本集團作為投資管理人，於未納入合併範圍的結構性主體獲取的管理費收入為人民幣964,123千元（截至2021年6月30日止六個月期間：人民幣1,722,421千元）。

除上述披露的本集團管理的未納入合併範圍的結構性主體中的權益之外，本集團還在其不作為投資管理人的未納入合併範圍的結構化主體中享有權益。與本集團在結構化產品和信託產品有關的最大風險敞口接近於各自的賬面價值。

### 62 關聯方交易

截至2022年6月30日，持有公司5%及以上股份和重大影響的股東列示如下：

| 關聯方名稱          | 關聯方關係     |
|----------------|-----------|
| — 上海國盛（集團）有限公司 | 持股5%以上的股東 |
| — 光明食品（集團）有限公司 | 重大影響      |
| — 上海電氣控股集團有限公司 | 重大影響      |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 62 關聯方交易 (續)

於本資產負債表日及本報告期間與本公司有重大交易的其他關聯方名稱及關聯方關係列示如下：

| 關聯方名稱                         | 關聯方關係 |
|-------------------------------|-------|
| — 上海彤關投資管理合夥企業(有限合夥)          | 合營企業  |
| — 富國基金管理有限公司                  | 聯營企業  |
| — 央視融媒體產業投資基金(有限合夥)           | 聯營企業  |
| — 遼寧海通新動能股權投資基金合夥企業(有限合夥)     | 聯營企業  |
| — 遼寧中德產業股權投資基金合夥企業(有限合夥)      | 聯營企業  |
| — 上海併購股權投資基金二期合夥企業(有限合夥)      | 聯營企業  |
| — 吉林省現代農業和新興產業投資基金有限公司        | 聯營企業  |
| — 西安航天新能源產業基金投資有限公司           | 聯營企業  |
| — 西安軍融電子衛星基金投資有限公司            | 聯營企業  |
| — 廣東南方媒體融合發展投資基金(有限合夥)        | 聯營企業  |
| — 安徽省皖能海通雙碳產業併購投資基金合夥企業(有限合夥) | 聯營企業  |
| — 許昌海通創新股權投資基金合夥企業(有限合夥)      | 聯營企業  |
| — 海通(吉林)股權投資基金合夥企業(有限合夥)      | 聯營企業  |
| — 西安航天海通創新新材料股權投資合夥企業(有限合夥)   | 聯營企業  |
| — 上海併購股權投資基金合夥企業(有限合夥)        | 聯營企業  |
| — 嘉興海通旭初股權投資基金合夥企業(有限合夥)      | 聯營企業  |
| — 上海文化產業股權投資基金合夥企業(有限合夥)      | 聯營企業  |
| — 海通興泰(安徽)新興產業投資基金(有限合夥)      | 聯營企業  |
| — 海通(吉林)現代服務業創業投資基金合夥企業(有限合夥) | 聯營企業  |
| — 遼寧海通新能源低碳產業股權投資基金有限公司       | 聯營企業  |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 62 關聯方交易 (續)

本集團於有關期間與關聯方的重大交易如下：

|                               | 截至6月30日止六個月期間  |                |
|-------------------------------|----------------|----------------|
|                               | 2022<br>(未經審計) | 2021<br>(未經審計) |
| 佣金及手續費收入                      |                |                |
| — 富國基金管理有限公司                  | 85,353         | 80,261         |
| — 央視融媒體產業投資基金(有限合夥)           | 34,382         | —              |
| — 遼寧海通新動能股權投資基金合夥企業(有限合夥)     | 12,736         | 12,736         |
| — 遼寧中德產業股權投資基金合夥企業(有限合夥)      | 8,491          | 8,491          |
| — 上海併購股權投資基金二期合夥企業(有限合夥)      | 7,095          | 7,438          |
| — 吉林省現代農業和新興產業投資基金有限公司        | 4,261          | 12,405         |
| — 西安航天新能源產業基金投資有限公司           | 3,420          | 4,754          |
| — 西安軍融電子衛星基金投資有限公司            | 2,465          | 4,505          |
| — 廣東南方媒體融合發展投資基金(有限合夥)        | 2,127          | 2,088          |
| — 安徽省皖能海通雙碳產業併購投資基金合夥企業(有限合夥) | 1,940          | —              |
| — 許昌海通創新股權投資基金合夥企業(有限合夥)      | 1,415          | 94             |
| — 海通(吉林)股權投資基金合夥企業(有限合夥)      | 575            | 1,104          |
| — 上海電氣控股集團有限公司                | 197            | 281            |
| — 上海國盛(集團)有限公司                | 86             | 625            |
| — 上海併購股權投資基金合夥企業(有限合夥)        | 21             | 12,939         |
| — 嘉興海通旭初股權投資基金合夥企業(有限合夥)      | 11             | 2,442          |
| — 海通興泰(安徽)新興產業投資基金(有限合夥)      | —              | 14,209         |
| — 其他(註i)                      | 48             | 942            |
| 利息淨收入                         |                |                |
| — 上海國盛(集團)有限公司                | 535            | 87             |
| — 上海電氣控股集團有限公司                | 193            | 135            |
| — 其他(註ii)                     | 401            | 47             |
| 投資收入及收益(淨額)                   |                |                |
| — 上海國盛(集團)有限公司                | 2,402          | (1,511)        |

註：

- (i) 「其他」包含西安航天海通創新新材料股權投資合夥企業(有限合夥)、上海文化產業股權投資基金合夥企業(有限合夥)、海通(吉林)現代服務業創業投資基金合夥企業(有限合夥)。
- (ii) 「其他」包含西安航天新能源產業基金投資有限公司、上海併購股權投資基金二期合夥企業(有限合夥)、西安航天海通創新新材料股權投資合夥企業(有限合夥)、富國基金管理有限公司、上海併購股權投資基金合夥企業(有限合夥)、吉林省現代農業和新興產業投資基金有限公司、嘉興海通旭初股權投資基金合夥企業(有限合夥)、光明食品(集團)有限公司、廣東南方媒體融合發展投資基金(有限合夥)、上海文化產業股權投資基金合夥企業(有限合夥)、上海彤關投資管理合夥企業(有限合夥)、遼寧海通新能源低碳產業股權投資基金有限公司。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 62 關聯方交易 (續)

|                               | 2022年<br>6月30日<br>(未經審計) | 2021年<br>12月31日<br>(經審計) |
|-------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 應收賬款                          |                          |                          |
| — 遼寧海通新動能股權投資基金合夥企業(有限合夥)     | 13,520                   | 20                       |
| — 上海併購股權投資基金二期合夥企業(有限合夥)      | 7,500                    | —                        |
| — 安徽省皖能海通雙碳產業併購投資基金合夥企業(有限合夥) | 2,056                    | —                        |
| — 吉林省現代農業和新興產業投資基金有限公司        | 760                      | —                        |
| — 上海國盛(集團)有限公司                | 405                      | 585                      |
| — 上海文化產業股權投資基金合夥企業(有限合夥)      | —                        | 17,080                   |
| — 其他(註i)                      | 70                       | 20                       |
| 代理買賣證券款                       |                          |                          |
| — 西安航天海通創新新材料股權投資合夥企業(有限合夥)   | (45,959)                 | —                        |
| — 上海併購股權投資基金二期合夥企業(有限合夥)      | (36,442)                 | (31)                     |
| — 上海電氣控股集團有限公司                | (31,643)                 | (7,762)                  |
| — 嘉興海通旭初股權投資基金合夥企業(有限合夥)      | (8,846)                  | (304)                    |
| — 西安航天新能源產業基金投資有限公司           | (825)                    | (150,000)                |
| — 上海國盛(集團)有限公司                | —                        | (174,699)                |
| — 其他(註ii)                     | (49)                     | (1,096)                  |
| 應付款項                          |                          |                          |
| — 上海國盛(集團)有限公司                | (58,511)                 | (91,600)                 |
| — 西安軍融電子衛星基金投資有限公司            | (2,700)                  | —                        |
| 衍生金融負債                        |                          |                          |
| — 上海國盛(集團)有限公司                | (1,554)                  | —                        |
| 衍生金融資產                        |                          |                          |
| — 上海國盛(集團)有限公司                | —                        | 949                      |

註：

- (i) 「其他」包含許昌海通創新股權投資基金合夥企業(有限合夥)、遼寧中德產業股權投資基金合夥企業(有限合夥)。
- (ii) 「其他」包含吉林省現代農業和新興產業投資基金有限公司、光明食品(集團)有限公司、廣東南方媒體融合發展投資基金(有限合夥)、上海併購股權投資基金合夥企業(有限合夥)、富國基金管理有限公司、上海文化產業股權投資基金合夥企業(有限合夥)、西安軍融電子衛星基金投資有限公司、遼寧海通新能源低碳產業股權投資基金有限公司。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間

（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

### 62 關聯方交易（續）

本集團主要管理人員的薪酬如下：

|                   | 截至6月30日止六個月期間  |                |
|-------------------|----------------|----------------|
|                   | 2022<br>(未經審計) | 2021<br>(未經審計) |
| 短期福利：             |                |                |
| — 袍金、薪金、佣金及花紅     | 17,625         | 18,017         |
| 退休後福利：            |                |                |
| — 僱主向退休金計劃／年金計劃供款 | 417            | 377            |

### 63 金融風險管理

本集團的主要金融工具包括以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具及債務工具、以公允價值計量且其變動計入損益的金融工具、衍生金融工具、買入返售金融資產、其他貸款及應收款項、客戶貸款、孖展融資客戶墊款、應收賬款、拆出資金、交易所儲備及保證金、結算備付金、受限制銀行存款、應付債券、銀行結餘及現金、售後回租安排的應收款、借款、賣出回購金融資產款、應付經紀業務客戶賬款及其他應付款項及預計費用等。有關金融工具的詳情已於各附註中披露。與此類金融工具和應收融資租賃款相關的風險包括市場風險（價格風險、貨幣風險及利率風險）、信用風險及流動性風險。管理層管理及監察風險，以確保及時有效地採取適當的措施。

截至2022年6月30日的六個月期間內，風險管理政策並無重大修改。簡明綜合財務資料並未包含所有金融風險管理資訊與披露，需要與截至2021年12月31日之綜合財務報告聯繫起來閱讀。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 64 金融資產及負債的公允價值

本集團部分金融資產和金融負債是以公允價值計量的。本集團董事建立了相關過程來確定公允價值計量中合適的估值技術和輸入值。本集團董事定期複核相關過程以及公允價值確定的合適性。

#### 64.1 不按照公允價值計量的金融工具

下表概述了在本集團中期簡明綜合財務資料中未以公允價值列示、且賬面價值與預期公允價值有所偏差金融資產和負債。

|              | 2022年6月30日<br>(未經審計) |             | 2021年12月31日<br>(經審計) |             |
|--------------|----------------------|-------------|----------------------|-------------|
|              | 賬面價值                 | 公允價值        | 賬面價值                 | 公允價值        |
| <b>金融資產</b>  |                      |             |                      |             |
| 以攤餘成本計量的債務工具 | 5,291,160            | 5,075,003   | 4,725,209            | 4,310,574   |
| <b>金融負債</b>  |                      |             |                      |             |
| 非可轉換債券       | 173,470,981          | 174,386,228 | 163,586,070          | 170,269,519 |

除了以上列出的金融工具以外，本集團董事認為本集團財務狀況表內按照攤餘成本列賬的金融資產及負債賬面價值與其公允價值相若。

#### 64.2 持續按照公允價值計量的金融工具

下表提供了在初步按公允價值確認後計量的金融工具分析，按照公允價值的可觀察程度分為第一至三層。

第一層金融工具：公允價值是相同資產或負債在活躍市場上未經調整的報價。

第二層金融工具：估值通常基於底層投資（投資組合中的債務證券或公開交易的權益工具）的公允價值計算得出，或由第三方（如中央結算公司）基於現金流貼現模型、近期交易價格或其他估值技術提供估值。所有重大輸入值均為市場中直接或間接可觀察的輸入值。

第三層金融工具：管理層自對手方處獲取估值報價，或使用估值技術確定其公允價值，包括現金流貼現分析、淨資產價值、市場可比法和期權定價模型等。這些金融工具的公允價值可能基於對估值有重大影響的不可觀測輸入值，因此本集團將其分為第三層。不可觀測輸入值包括加權平均資本成本、流動性貼現、市淨率等。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

### 64 金融資產及負債的公允價值（續）

#### 64.2 持續按照公允價值計量的金融工具（續）

下表呈列於2022年6月30日及2021年12月31日，按公允價值計量的金融資產和負債。

|                    | 第一層               | 第二層                | 第三層               | 合計                 |
|--------------------|-------------------|--------------------|-------------------|--------------------|
| （未經審計）             |                   |                    |                   |                    |
| <b>於2022年6月30日</b> |                   |                    |                   |                    |
| 以公允價值計量且其變動計入      |                   |                    |                   |                    |
| 損益的金融資產            |                   |                    |                   |                    |
| — 債券投資             | 1,107,479         | 85,726,049         | 6,240,754         | 93,074,282         |
| — 權益投資             | 13,082,212        | 2,500,861          | 18,138,480        | 33,721,553         |
| — 基金               | 3,312,989         | 49,510,939         | 3,386,273         | 56,210,201         |
| — 其他               | —                 | 15,010,850         | 3,849,351         | 18,860,201         |
| 以公允價值計量且其變動計入      |                   |                    |                   |                    |
| 其他全面收益的債務工具        |                   |                    |                   |                    |
|                    | 746,766           | 40,263,704         | 1,044,757         | 42,055,227         |
| 以公允價值計量且其變動計入      |                   |                    |                   |                    |
| 其他全面收益的權益工具        |                   |                    |                   |                    |
|                    | 5,539,522         | —                  | 1,072,934         | 6,612,456          |
| 衍生金融資產             |                   |                    |                   |                    |
|                    | 67,957            | 758,679            | 1,450,850         | 2,277,486          |
|                    | <b>23,856,925</b> | <b>193,771,082</b> | <b>35,183,399</b> | <b>252,811,406</b> |
| 以公允價值計量且其變動計入      |                   |                    |                   |                    |
| 損益的金融負債            |                   |                    |                   |                    |
|                    | 371,142           | 602,738            | —                 | 973,880            |
| 指定為以公允價值計量且其變      |                   |                    |                   |                    |
| 動計入損益的金融負債         |                   |                    |                   |                    |
|                    | —                 | 5,423,650          | 12,013,858        | 17,437,508         |
| 衍生金融負債             |                   |                    |                   |                    |
|                    | 28,794            | 653,607            | 592,751           | 1,275,152          |
|                    | <b>399,936</b>    | <b>6,679,995</b>   | <b>12,606,609</b> | <b>19,686,540</b>  |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 64 金融資產及負債的公允價值 (續)

#### 64.2 持續按照公允價值計量的金融工具 (續)

|                         | 第一層        | 第二層         | 第三層        | 合計          |
|-------------------------|------------|-------------|------------|-------------|
| (經審計)                   |            |             |            |             |
| 於2021年12月31日            |            |             |            |             |
| 以公允價值計量且其變動計入           |            |             |            |             |
| 損益的金融資產                 |            |             |            |             |
| — 債券投資                  | 698,881    | 110,654,910 | 5,731,526  | 117,085,317 |
| — 權益投資                  | 15,103,142 | 579,055     | 19,272,727 | 34,954,924  |
| — 基金                    | 3,261,745  | 42,982,623  | 2,381,450  | 48,625,818  |
| — 其他                    | —          | 16,473,762  | 3,269,928  | 19,743,690  |
| 以公允價值計量且其變動計入           |            |             |            |             |
| 其他全面收益的債務工具             |            |             |            |             |
|                         | 927,858    | 34,837,660  | 1,287,427  | 37,052,945  |
| 以公允價值計量且其變動計入           |            |             |            |             |
| 其他全面收益的權益工具             |            |             |            |             |
|                         | 9,858,079  | —           | 388,792    | 10,246,871  |
| 衍生金融資產                  |            |             |            |             |
|                         | 59,072     | 735,177     | 290,482    | 1,084,731   |
|                         | 29,908,777 | 206,263,187 | 32,622,332 | 268,794,296 |
| 以公允價值計量且其變動計入           |            |             |            |             |
| 損益的金融負債                 |            |             |            |             |
|                         | 425,338    | 1,957,132   | —          | 2,382,470   |
| 指定為以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債 |            |             |            |             |
|                         | —          | 13,488,046  | 445,701    | 13,933,747  |
| 衍生金融負債                  |            |             |            |             |
|                         | 44,520     | 884,578     | 619,218    | 1,548,316   |
|                         | 469,858    | 16,329,756  | 1,064,919  | 17,864,533  |

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 64 金融資產及負債的公允價值(續)

#### 64.2 持續按照公允價值計量的金融工具(續)

以第三層級公允價值計量的金融資產和金融負債調節。

於2022年6月30日(未經審計)

|                        | 以公允<br>價值計量<br>且其變動<br>計入損益的<br>金融資產 | 以公允<br>價值計量<br>且其變動<br>計入其他<br>綜合收益的<br>權益工具 | 以公允<br>價值計量<br>且其變動<br>計入其他<br>綜合收益的<br>債務工具 | 以公允<br>價值計量<br>且其變動<br>計入損益的<br>金融負債 | 衍生金融工具    |
|------------------------|--------------------------------------|--|--|--------------------------------------|-----------|
| 於2021年12月31日及2022年1月1日 | 30,655,631                           | 388,792                                      | 1,287,427                                    | (445,701)                            | (328,736) |
| 轉入                     | 2,781,685                            | -  | -  | -                                    | 7,638     |
| 購買/(處置)                | 1,235,158                            | 861,660                                      | (99,762)                                     | (10,758,841)                         | 424,521   |
| 轉出                     | (2,821,487)                          | -  | (39,379)                                     | -                                    | -         |
| 損益/其他綜合收益              | (236,129)                            | (177,518)                                    | (103,529)                                    | (809,316)                            | 754,676   |
| 於2022年6月30日            | 31,614,858                           | 1,072,934                                    | 1,044,757                                    | (12,013,858)                         | 858,099   |

於2021年12月31日(經審計)

|                        | 以公允<br>價值計量<br>且其變動<br>計入損益的<br>金融資產 | 以公允<br>價值計量<br>且其變動<br>計入其他<br>綜合收益的<br>權益工具 | 以公允<br>價值計量<br>且其變動<br>計入其他<br>綜合收益的<br>債務工具 | 以公允<br>價值計量<br>且其變動<br>計入損益的<br>金融負債 | 衍生金融工具    |
|------------------------|--------------------------------------|--|--|--------------------------------------|-----------|
| 於2020年12月31日及2021年1月1日 | 26,158,747                           | 267,042                                      | 3,099,639                                    | (331,830)                            | (13,595)  |
| 轉入                     | 3,205,928                            | -  | -  | (956,179)                            | 140       |
| 購買/(處置)                | 2,397,401                            | 490  | (2,322,403)                                  | (31,720)                             | -         |
| 轉出                     | (3,111,053)                          | -  | (27,393)                                     | 324,149                              | -         |
| 損益/其他綜合收益              | 2,004,608                            | 121,260                                      | 537,584                                      | 549,879                              | (315,281) |
| 於2021年12月31日           | 30,655,631                           | 388,792                                      | 1,287,427                                    | (445,701)                            | (328,736) |

於2022年1月1日至6月30日期間及2021年度，以公允價值計量的金融工具在第一層級與第二層級間的轉移並不顯著。

## 中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二二年六月三十日止六個月期間  
(除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示)

### 65 金融資產轉移

#### 資產支持證券

本集團發行了以應收融資租賃款和售後回租安排的應收款為基礎資產的資產支持證券。由於本集團持有全部的次級資產並對該資產支持證券提供差額支付承諾，該等資產支持證券的基礎資產不符合金融資產終止確認條件，本集團未終止確認已轉移的應收融資租賃款和售後回租安排的應收款，並將收到的對價確認為金融負債。

截至2022年6月30日，本集團未予終止確認的已轉移應收融資租賃款和售後回租安排的應收款的賬面價值為人民幣8,316百萬元(2021年12月31日：人民幣9,338百萬元)。

#### 資產支持票據

本集團發行了以應收融資租賃款和售後回租安排的應收款為基礎資產的資產支持票據。由於本集團持有全部的次級資產並對該資產支持票據提供差額支付承諾，該等資產支持票據的基礎資產不符合金融資產終止確認條件，本集團未終止確認已轉移的應收融資租賃款和售後回租安排的應收款，並將收到的對價確認為金融負債。

截至2022年6月30日，本集團未予終止確認的已轉移應收融資租賃款和售後回租安排的應收款的賬面價值為人民幣1,399百萬元(2021年12月31日：人民幣2,276百萬元)。

#### 融出證券

本集團與客戶訂立協定，融出股票及基金予客戶，以客戶的證券或押金為抵押，由於本集團仍保留有關證券的全部風險，因此並未於資產負債表終止確認該等證券。於2022年6月30日，上述轉讓資產的賬面價值為人民幣3,869百萬元(2021年12月31日：人民幣5,062百萬元)。

### 66 報告期後事項

於2022年6月30日後至本報告日期，本集團無其他重大的報告期後事項。