香港交易及結算所有限公司及香港聯合交易所有限公司對本公告的內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示，概不對因本公告全部或任何部份內容而產生或因倚賴該等內容而引致的任何損失承擔任何責任。

海通证券股份有限公司
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）

截至2023年6月30日止六個月之中期業績公告

海通證券股份有限公司（「**本公司**」）董事會（「**董事會**」）謹此宣佈本公司及其附屬公司截至2023年6月30日止六個月之未經審計中期業績。本公告列載本公司2023年中期報告全文，並符合香港聯合交易所有限公司證券上市規則中有關中期業績初步公告附載的資料之要求。

刊登中期業績公告及中期報告

本業績公告將在香港聯合交易所有限公司網站（www.hkexnews.hk）及本公司網站（www.htsec.com）上刊發。

本公司將於適當時候向H股股東寄發2023年中期報告，並在本公司及香港聯合交易所有限公司網站刊載。

承董事會命
海通證券股份有限公司
董事長
周杰

中國•上海
2023年8月30日

於本公告日期，本公司執行董事為周杰先生及李軍先生；本公司非執行董事為屠旋旋先生、周東輝先生、肖荷花女士及許建國先生；本公司獨立非執行董事為張鳴先生、林家禮先生、朱洪超先生及周宇先生。

* *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	16
第四節	公司治理	67
第五節	環境與社會責任	81
第六節	重要事項	88
第七節	股份變動及股東情況	111
第八節	優先股相關情況	118
第九節	債券相關情況	119
第十節	財務報告	129
第十一節	證券公司信息披露	130

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四十一次會議、第七屆監事會第二十四次會議審議通過。非執行董事許建國先生因公出差未出席本次董事會，其他董事均出席董事會會議，全體監事出席監事會會議。未有董事、監事對本報告提出異議。

本集團按照國際財務報告準則編製的2023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、主管會計工作負責人張信軍及會計機構負責人（會計主管人員）馬中聲明：保證本報告中財務報告的真實、準確及完整。除特別説明外，本報告所列數據以人民幣為單位。

本公司2023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。本報告中所涉及的未來計劃、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及其他關聯方非經營性佔用資金情況。

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	海通證券的公司章程
董事會	指	海通證券董事會
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》
本公司或海通證券	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
上海證監局	指	中國證券監督管理委員會上海監管局
董事	指	海通證券董事
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

第一節 釋義及重大風險提示

海通銀行	指	海通銀行（Haitong Bank, S.A.）
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
恒信金融集團	指	海通恒信金融集團有限公司
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
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》

第一節 釋義及重大風險提示

新三板	指	全國中小企業股份轉讓系統
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	2023年1月1日至2023年6月30日
人民幣	指	中國法定貨幣
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
上交所上市規則	指	上海證券交易所股票上市規則
上海惟泰置業	指	上海惟泰置業管理有限公司
上海澤春	指	上海澤春投資發展有限公司
上交所	指	上海證券交易所
監事	指	海通證券監事
監事會	指	海通證券監事會
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「可能面對的風險及風險應對措施」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、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、裴長江
聯席公司秘書	裴長江、黃慧玲
合規總監	趙慧文

第二節 本公司簡介和主要財務指標

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	90,601,656,274.77	93,818,677,554.29

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】

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. 上證基金通業務(2005.07)
9. 報價轉讓業務資格（中證協函[2006]3號）
10. 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）
11. 中國銀行間市場交易商協會資格(2007.08)
12. 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）
13. 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）

第二節 本公司簡介和主要財務指標

14. 為期貨公司提供中間介紹業務資格（滬證監機構字[2010]122號）
15. 開展直接投資業務試點資格（機構部部函[2008]421號）
16. 實施經紀人制度資格（滬證監機構字[2009]302號）
17. 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）
18. 融資融券業務資格（證監許可[2010]315號）
19. 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）
20. 基金評價業務資格（中證協發[2010]070號）
21. 全國社保基金理事會簽約券商資格(2011.08)
22. 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）
23. 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）
24. 發行境外上市外資股資格（證監許可[2011]1821號）（H股）
25. 債券質押式報價回購業務試點（機構部部函[2011]585號）
26. 合夥企業獨立託管業務試點（機構部部函[2012]686號）
27. 櫃台市場交易業務（中證協函[2012]825號）
28. 轉融通業務試點資格（中證金函[2012]113號）
29. 中小企業私募債券承銷業務試點資格（中證協函[2012]561號）
30. 證券業務外匯經營(SC201307)
31. 新三板推薦業務和經紀業務（股轉系統函[2013]61號）
32. 代銷金融產品業務資格（滬證監機構字[2013]180號）
33. 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）
34. 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）
35. 2013年第十一批保險兼業代理人資格（滬保監許可[2013]204號）
36. 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）
37. 證券投資基金託管資格（證監許可[2013]1643號）
38. 代理證券質押登記業務資格(2014.02)
39. 互聯網證券業務試點（中證協函[2014]358號）
40. 黃金交易所會員資格（證書編號：T004）
41. 上市公司股權激勵行權融資業務試點（深圳函[2014]321號）
42. 股票期權做市業務資格（證監許可[2015]153號）
43. 上證50ETF期權合約品種的主做市商（上證函[2015]214號）

第二節 本公司簡介和主要財務指標

44. 期權結算業務資格（中國結算函字[2015]20號）
45. 期貨會員證書（證書編號：NO.G02008）
46. 中國證券投資基金業協會會員證書（證書編號：00000147）
47. 境外自營業務資格（機構部函[2015]1204號）
48. 單向視頻開戶創新方案的無異議函（中國結算辦字[2015]461號）
49. 銀行間黃金詢價業務資格（上金交發[2015]120號）
50. 非金融企業債務融資工具主承銷業務資質(2016.08)
51. 票據交易資質（2016年11月）
52. 信用風險緩釋工具相關業務資格(2017.01)
53. 場外期權業務二級交易商資格（中證協發[2018]386號）
54. 信用衍生品業務資質（機構部函[2019]469號）
55. 軍工涉密業務諮詢服務安全保密條件備案證書(2019.10)
56. 股指期權做市業務（機構部函[2019]3073號）
57. 利率互換實時承接業務資格（中國外匯交易中心公告）
58. 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）
59. 商品互換業務一級交易商(2022.07)
60. 個人養老金基金銷售資格(2022.11)
61. 上交所基金通做市業務資格(2022.12)
62. 北交所融資融券業務資格(2023.2)
63. 深交所基金通做市業務資格(2023.3)

本公司具備上交所、深交所和北交所的會員資格，上海清算所B類普通清算會員，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	中國上海市黃浦區中山南路888號海通外灘金融廣場（郵政編碼：200011）	中國上海市黃浦區中山南路888號海通外灘金融廣場（郵政編碼：200011）
電話	8621-23180000	8621-23180000
傳真	8621-63410627	8621-63410627
電子信箱	dshbgs@haitong.com	dshbgs@haitong.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） 中國上海市四川中路480號（1990年） 中國上海市北海寧路30號（1994年） 中國上海市唐山路218號（1998年） 中國上海市淮海中路98號（2001年） 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	中國上海市黃浦區中山南路888號海通外灘金融廣場
本公司辦公地址的郵政編碼	200011
本公司網址	http://www.htsec.com
電子信箱	haitong@haitong.com
報告期內變更情況查詢索引	http://www.sse.com.cn
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

第二節 本公司簡介和主要財務指標

四、 信息披露及備置地點變更情況簡介

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
登載中期報告的上交所網站地址	http://www.sse.com.cn
登載中期報告的香港聯交所指定的網址	http://www.hkexnews.hk
本公司中期報告備置地點	中國上海市黃浦區中山南路888號海通外灘金融廣場
報告期內變更情況查詢索引	http://www.sse.com.cn http://www.hkexnews.hk

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	／	中國證券登記結算有限責任公司上海分公司
H股	香港聯交所	海通證券	6837	／	香港中央證券登記有限公司

第二節 本公司簡介和主要財務指標

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

如無特別說明，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。

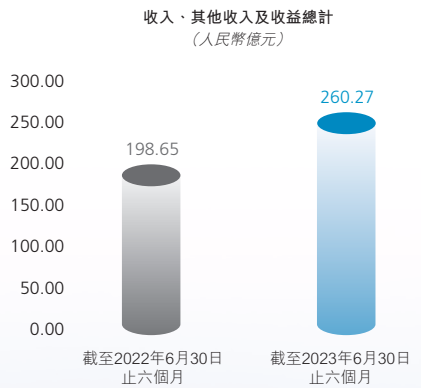
（一） 主要會計數據和財務指標

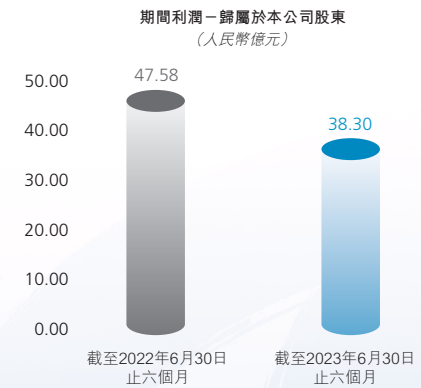
項目	截至2023年6月30日止六個月	截至2022年6月30日止六個月	本期比上期
經營業績（*人民幣千元*）			*增減*
收入、其他收益及收益總計	**26,027,428**	19,864,831	31.02%
所得稅前利潤	**5,251,724**	5,886,065	-10.78%
期間利潤－歸屬於本公司股東	**3,829,635**	4,757,725	-19.51%
（用於）／來自經營活動的現金淨額	**-13,306,411**	10,928,558	-221.76%
其他綜合收益	**795,560**	58,198	1,266.99%
每股計（*人民幣元／股*）			
基本每股收益	**0.29**	0.36	-19.44%
稀釋每股收益	**0.29**	0.36	-19.44%
盈利能力指標			
加權平均淨資產收益率(%)	**2.29**	2.88	下降0.59個百分點

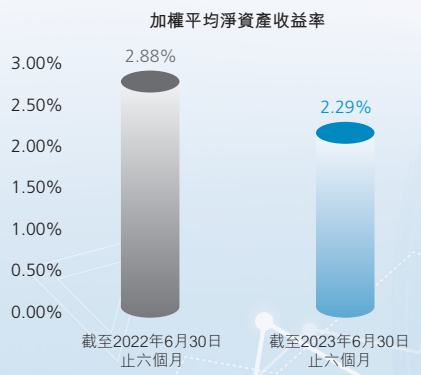
第二節　本公司簡介和主要財務指標

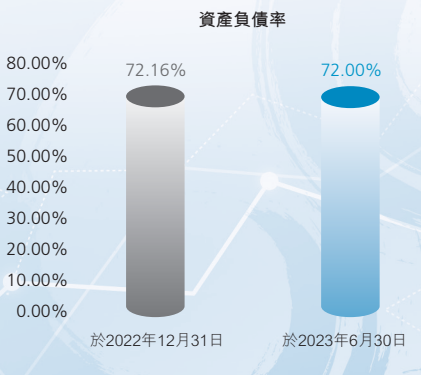
項目	於2023年6月30日	於2022年12月31日	本期比上期
規模指標（*人民幣千元*）			*增減*
資產總額	**762,391,665**	753,609,305	1.17%
負債總額	**582,523,133**	575,987,247	1.13%
應付經紀業務客戶賬款	**119,909,488**	115,513,463	3.81%
歸屬於本公司股東權益	**167,019,635**	164,591,957	1.47%
總股本（*千股*）	**13,064,200**	13,064,200	0.00%
歸屬於本公司股東			
每股淨資產（*人民幣元／股*）	**12.78**	12.60	1.43%
資產負債率(%)[1]	**72.00**	72.16	下降0.16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）

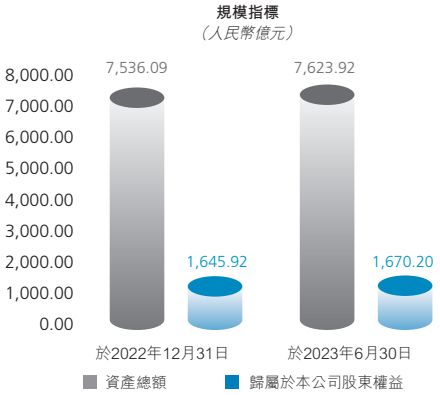








第二節 本公司簡介和主要財務指標



（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2023年1月至6月及2022年1月至6月的淨利潤、截至2023年6月30日及2022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2023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906.02億元，較上年末（人民幣938.19億元）減少人民幣32.17億元。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2023年6月30日	於2022年12月31日
淨資本（人民幣元）	**90,601,656,274.77**	93,818,677,554.29
淨資產（人民幣元）	**149,870,774,715.70**	149,045,782,898.20
風險覆蓋率(%)	**235.37**	241.25
資本槓桿率(%)	**21.60**	21.12
流動性覆蓋率(%)	**352.58**	293.75
淨穩定資金率(%)	**161.68**	162.85
淨資本／淨資產(%)	**60.45**	62.95
淨資本／負債(%)	**36.59**	36.97
淨資產／負債(%)	**60.53**	58.74
自營權益類證券及其衍生品／淨資本(%)	**14.53**	16.59
自營非權益類證券及其衍生品／淨資本(%)	**164.01**	193.66

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260.27億元、歸屬於母公司股東的淨利潤人民幣38.30億元、總資產人民幣7,623.92億元、歸屬於母公司股東的淨資產人民幣1,670.20億元，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。2023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、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。本集團財富管理業務客戶基礎雄厚；投資銀行業務以服務國家發展戰略、助力實體經濟發展為核心指導思想，在科創板業務領域積極佈局、重點開拓，緊抓「硬科技」的市場定位，堅持創新驅動，在集成電路及生物醫藥等重點領域成功打造了「海通品牌」，完成了多個具有較大市場影響力的項目，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；海外業務通過境內外業務聯動，持續發揮本集團海外市場橋頭堡的功能；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。本集團深入踐行「一個海通」理念，深化「投、融、保、研」及財富管理業務線的協同聯動，加強整體協同，有效推進業務落地。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、新、港、滬、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340家證券及期貨營業部（其中證券營業部306家，期貨營業部34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5大洲15個國家和地區設有分行、子公司或代表處。憑藉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2,300萬名客戶。

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。

海通國際與海通銀行是本集團踐行國家「一帶一路」戰略及粵港澳大灣區戰略的重要承載平台。在港股IPO市場，海通國際按保薦項目數量位居前列，並不斷加強項目執行能力及品牌影響力；同時，海通國際積極參與綠色及可持續發展債券發行，踐行ESG理念，並進一步開拓債務管理業務，在中資境外債務管理市場名列前茅。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。2023年上半年，海通銀行完成退歐後倫敦分行的牌照升級，是海通銀行在倫敦這一歐洲最大的金融中心保留並拓展其銀行業務的重要一步。

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。2023年上半年，自貿區分公司圍繞自貿區離岸債券等重點領域，持續推動FTU業務拓展和本集團內跨境業務聯動。

業內領先、全方位多地區的國際業務平台有利於本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. 領先的金融科技創新能力

本公司始終秉承「科技引領」發展戰略。以建設「敏捷化、平台化、智能化、生態化」為核心特徵的「數字海通2.0」為目標，堅持關鍵技術自主可控，深入推進金融科技創新應用，已成為行業數字化轉型的探索者、先行者。一是全面賦能財富管理轉型。一站式互聯網金融平台「e海通財」全面煥新升級，打造集團生態、行業生態、用戶生態於一體的綜合服務入口，APP月度活躍數超550萬，繼續保持行業第一梯隊；「e海通財」PC端與APP互聯互通，強化對客品牌聯動，構建產品差異化服務優勢。二是機構綜合交易服務全面提升。一體化智能交易平台「e海方舟」整合極速交易和極速行情，算法交易不斷完善，單日規模突破人民幣10億元；場外衍生品業務平台「e海通衍」打通南北向交易通道，為境內外投資者提供多樣化、專業化的跨境投資交易及對沖工具。融券服務業務系統「e海通券」日均撮合成交超億元，通過智能撮合算法，充分滿足券源供需雙方融券意向，打造融券開放式服務新生態。三是日趨完善的風險預警體系。借助輿情異動監測、財務舞弊識別、違約預警等五大量化預警模型，

第三節 董事會報告

實現多維風險預警信號在本集團內的全流程閉環管理，為前瞻性風險管理提供新動能。四是科技創新不斷深化。累計獲得17項國家專利和82項軟件著作權，本公司科技品牌影響力進一步提升。報告期內，本公司參加各類創新課題21項，先後榮獲人民銀行金融科技發展獎二等獎、證券期貨業金融科技研究發展中心（深圳）優秀課題一、二等獎等多項金融科技獎項。

三、 管理層討論與分析

（一） 總體經營情況

2023年上半年，本公司緊抓服務國家戰略和實體經濟主線，充分發揮金融服務實體經濟作用，在「一個海通」理念下，通過「投、融、保、研」和財富管理協同聯動，保持良好經營態勢，尤其在融入區域發展、優化網點佈局、深化機構改革、加強集團化管理等方面取得積極成效。

（二） 主營業務分析

1. 財富管理業務

市場環境：

2023年上半年，市場交投小幅回暖，根據滬深交易所數據，兩市股票、基金交易量達人民幣249.40萬億元，同比增長0.11%；截至2023年6月末，市場融資融券餘額達人民幣1.59萬億元，較上年末增長3.12%。伴隨全面註冊制的落地，更靈活的轉融通政策和更豐富的兩融標的為投資策略提供了更多交易空間，股票質押式回購業務持續回歸服務實體經濟本源。金融產品銷售市場持續承壓，根據WIND數據，2023年上半年新成立基金發行份額5,286.30億份，同比減少21.84%。自個人養老金制度實施以來，參與人數不斷增加，個人養老金產品持續擴容，截至2023年6月末，全國36個先行城市（地區）開立個人養老金賬戶人數4,030萬人，個人養老金基金數量151隻。

經營舉措及業績：

本公司堅持「以客戶為中心」，圍繞客戶財富管理和投融資需求，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。報告期內，圍繞「做增量、有特色、強協同、建機制」，積極推動綜合創新網點建設，從服務社區的

第三節 董事會報告

傳統經紀業務網點向紮根園區服務企業發展的綜合金融平台轉型；構建金融產品全生命週期平台系統，金融產品銷量及保有規模穩步增長；強化數字金融平台建設，提升服務質量、拓寬服務邊界。截至2023年6月末，本公司財富管理客戶數量1,777萬戶，較上年末增長4.3%，託管客戶資產規模人民幣3.16萬億元，較上年末增長5.8%。2023年上半年，本公司新開客戶數量同比增長29.3%，新開客戶資產同比增長193.4%。

2023年上半年本公司代理交易額變化

	本報告期	上年同期
股票交易量（*人民幣億元*）	**66,514**	70,940
基金交易量（*人民幣億元*）	**15,971**	10,227
合計（*人民幣億元*）	**82,485**	81,167

(1) 零售業務

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，以「e海通財」和「e海方舟」兩大平台為基礎，面向財富、機構客群提供綜合金融解決方案。

2023年上半年，本公司持續推進財富管理機構化轉型，零售業務實現高質量發展。**本公司加快推動分支機構改革**，加強國家重大發展戰略區域網點覆蓋，努力打造具有特色業務屬性的綜合金融平台，上海臨港分公司等6家綜合網點已正式開業。**本公司搭建區域合作平台生態，初步建立戰略客戶服務體系**，充分整合本公司資源，為戰略客戶提供多元化、一攬子綜合金融服務，試點「1+N」戰略客戶服務模式，與60餘家政府、園區、高校、股權投資等機構簽署戰略合作協議。**本公司着力塑造私行服務品牌**，聚焦高淨值客戶，圍繞家族信託、股權管理、綜合證券、企業家活動，逐步構建私行客戶生態圈。截至2023年

第三節　董事會報告

6月末，本公司日均淨資產在人民幣600萬以上的私行客戶數量超1.5萬戶，較上年末增長6.01%；資產規模近人民幣7,900億元，較上年末增長3.59%。**本公司深化數字金融平台建設**，以「e海通財」APP為線上綜合服務陣地，新增服務功能和場景，打造超級服務入口，推動五大服務專區建設，構建多元化數字生態。截至2023年6月末，「e海通財」APP月度活躍數超550萬人，位列行業第四；以機構、高淨值及量化投資者為主要服務對象的「e海方舟」股基交易量同比增長11%，活躍客戶數同比增長40%，用戶資產同比增長92%；構建綜合機構交易服務體系，算法交易單日規模突破人民幣10億元，融券服務業務系統「e海通券」日均撮合成交超億元人民幣。**本公司積極推動投顧業務佈局和轉型**，全面優化「盈投顧」服務，覆蓋策略、專題、簡訊、直播、ETF直擊、陪伴服務等六大系列內容，面向高淨值客戶推出「匠心100」專戶定制服務，面向普通投資者持續開展ETF和可轉債策略服務；提升投顧團隊專業化服務能力，做好客戶投資全流程的陪伴服務，幫助客戶實現資產的保值增值。

第三節 董事會報告

海通國際私人財富管理團隊推出「逐浪資本 — 航海傢俱樂部」系列活動，為高淨值客戶提供定制化的宏觀分析和投資策略建議。積極拓展新客戶資源，豐富產品選擇，協同專業機構，舉辦更多專業性強的主題活動。同時，通過市場化的定價和快速高效的抵押、託管服務為客戶提供有競爭力的孖展融資服務，增強客戶黏性並達成更多交易。2023年上半年，海通國際私人財富管理新加坡團隊根據最新市場環境和客戶需求，靈活調整業務方向，積極推進外部資產管理業務，以此為契機，開拓客戶資源，推動業務長遠發展。

(2) 金融產品銷售

本公司以優化客戶體驗為抓手提升產品保有量，通過強化銷售組織、理順溝通機制、優化系統平台、完善銷售制度，不斷加強與外部優質基金公司深度合作，並建立以產品細分為基礎的專業化評估跟蹤機制，覆蓋公募、私募、資管等各類產品以及產品售前、售中和售後全生命週期。在複雜的市場環境下，金融產品銷售規模仍保持增長勢頭。截至2023年6月末，本公司產品日均保有規模人民幣1,259.18億元，較上年末增長3.72%，其中，公募非貨產品日均保有量人民幣434億元；私募產品日均保有量人民幣481億元；ETF產品日均保有量人民幣219億元。同時，本公司以券結公募產品及量化私募產品為主要銷售抓手，持續提升客戶對本公司推薦的金融產品的認可度，不斷擴大本公司金融產品服務品牌的影響力。

第三節 董事會報告

2023年以來，本公司致力於為機構投資者提供場外基金全方位創新型綜合解決方案，精準定位機構投資者對於場外基金的投資需求，針對銀行、保險、公募等金融機構以及大型企業客戶，打造推出了場外基金綜合服務系統－「e海通合」，支持客戶端和直連兩種模式，為客戶提供高效的交易運營支持。同時，「e海通合」依託本公司強大的金融產品全生命周期管理系統和深厚的研究實力，為客戶提供金融產品長期跟蹤陪伴和精準投研支持。

(3) 融資類業務

2023年上半年，本公司融資類業務緊跟全面註冊制落地市場機遇，業務發展穩中有進。本公司融資業務加強重點業務模式推進和核心客戶群體覆蓋，推進優質客戶拓展及規模落地。本公司融券業務多途徑拓寬券源籌集渠道，強化自營券源管理，滿足客戶多元化用券需求，截至2023年6月末，本公司融券市場份額由年初4.1%提升至6.1%。本公司股票質押業務持續發掘優質項目，支持實體企業發展，同時強化項目審核和標的券評估能力，資產質量有效提升。截至2023年6月末，本公司融資類業務規模人民幣906億元，其中融資融券業務規模人民幣636億元，股票質押業務規模人民幣267億元。

第三節 董事會報告

2023年上半年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*）	**636.07**	611.64
股票質押餘額（*人民幣億元*）[1]	**267.27**	273.68
約定購回餘額（*人民幣億元*）	**2.45**	2.44
合計（*人民幣億元*）	**905.79**	887.76

(4) 期貨業務

2023年上半年，海通期貨各項業務穩步推進，市場地位持續鞏固。實現代理交易額人民幣15.6萬億元（單邊計算），市場佔比6%。期貨資管業務規模人民幣154億元，較年初增長52%；基金銷售新增銷量突破人民幣10億元，同比實現翻倍。

2. 投資銀行業務

市場環境：

2023年上半年，我國資本市場各項改革穩步推進，全面實行股票發行註冊製成功落地，企業債券職責劃轉平穩過渡，資本市場功能有效發揮，A股市場407單股權融資項目實現募集資金總額人民幣6,627億元，同比減少10.17%。IPO繼續保持常態化，2023年上半年新增掛牌173家，融資金額人民幣2,097億元，同比減少32.78%。其中，以科技、創新為特色的「雙創」板塊已成為A股IPO的主要陣地，2023年上半年新增掛牌93家，合計融資金額人民幣1,525億元，佔我國IPO市場融資總額的72.74%；北交所新股發行提速，2023年上半年新增掛牌42家，募集資金總額人民幣81億元，

[1] 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33.52億元

第三節 董事會報告

同比增長183.72%。再融資規模穩中有升，2023年上半年222家上市公司通過增發、可轉債、配股等再融資方式募集資金總額人民幣4,320億元，同比增長8.52%。

2023年上半年，我國內地債券發行穩步增長，各類債券發行合計人民幣34.58萬億元，同比增長9.74%。利率債發行達人民幣12.43萬億元，同比增長7.61%，其中國債同比增長30.59%，地方政府債同比下降16.80%，政策性銀行債同比增長24.83%。信用債發行達人民幣9.36萬億元，同比增長2.88%。同業存單累計發行人民幣12.77萬億元，同比增長17.79%。

經營舉措及業績：

(1) 股權融資

境內股權融資方面，本公司着力推動大投行組織架構優化，以服務國家戰略為綱，以全面註冊制為契機，深入貫徹「行業化」「區域化」戰略部署，繼續鞏固科創板、創業板等領域業務優勢，業績排名位居前列。2023年上半年，本公司共完成股權融資項目18單，融資金額人民幣330億元。完成IPO項目11單，融資金額人民幣263億元，掛牌數量和融資規模均位列市場第三；其中，完成科創板IPO項目6單，市場排名第二，融資金額人民幣230億元，市場排名第一。完成再融資項目7單，包括5單向特定對象發行股票及2單可轉債，共融資人民幣66億元。隨着大投行組織架構優化和「專業化」戰略深入，本公司在集成電路、生物醫藥等重點領域鞏固優勢、取得新突破。2023年上半年完成中芯集成、裕太微等4家集成電路領域IPO，其中中芯集成募資總額人民幣110億元，為全市場規模最大的項目；在新能源領域積極突破，潤陽股份順利提交註冊，並儲備覆蓋全產業鏈的多家市場知名企業。本公司大力推進申報工作，股權項目儲備豐富。截至2023年6月末，本公司保薦的IPO在審及待發項目數量67家，市場排名第三。

第三節 董事會報告

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）*	**263.37**	246.60
	承銷家數	**11**	14
再融資發行	承銷金額*（人民幣億元）*	**66.31**	71.93
	承銷家數	**7**	5
在審及待發項目數量	首次公開發行	**67**	68
	再融資發行	**23**	13

數據來源：WIND、中國證監會、上海證券交易所、深圳證券交易所、北京證券交易所

境外股權融資方面，海通國際投行團隊致力於提供全方位的投資銀行服務，在拓展費類收入來源的同時，進一步發揮「一個海通」的業務協同效應。報告期內，海通國際投行團隊完成了7單股權融資項目（包含IPO、二級市場配售及供股）。信貸資本市場團隊和併購團隊合作，探索上市前融資的業務機會，為客戶提供更廣泛的金融服務，實現了投資銀行業務的內部協同和交叉銷售，進一步提升海通國際的財務諮詢收入。投行團隊亦與母公司緊密配合，開拓全球存託憑證(GDR)項目儲備，挖掘「互聯互通」業務機會。

(2) 債券融資

境內債券融資方面，本公司持續夯實執業質量，各項指標有所回升。2023年上半年，本公司承銷各類債券533隻，承銷金額人民幣2,097億元。本公司聚焦國家戰略，堅持創新驅動，主承銷各品種綠色債券23期，融資規模合計人民幣1,032億元，成功發行多個「市場首單」產品，包括粵港澳大灣區首單綠色車貸資產支持證券、全國首單「綠色+低碳轉型掛鈎」資產證券化產品、地方國企首單「粵港澳大灣區+科技創新」公司債券等。

第三節 董事會報告

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*）	**47.75**	159.40
	承銷只數	**13**	28
公司債	承銷金額（*人民幣億元*）	**543.43**	619.89
	承銷只數	**145**	161
其他	承銷金額（*人民幣億元*）	**1,505.57**	1,138.40
	承銷只數	**375**	384

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

數據來源：WIND

境外債券融資方面，截至2023年6月末，根據彭博中國風險（G3+人民幣）債券排行榜，海通國際共完成48筆債券發行項目，包括華發集團深合債、中航租賃自貿區綠色人民幣債等。債券資本市場團隊深入踐行ESG和可持續金融理念，報告期內完成3筆綠色及可持續債券的承銷，融資規模達5.7億美元，蟬聯中資美元債年度機構評選「年度ESG獎」。根據市場需求，團隊進一步拓展債務管理及重組業務，報告期內共完成6筆債務管理項目，在彭博亞太負債管理債券排行榜中排名第一。海通銀行澳門分行抓住自貿債的戰略機遇和發行窗口，累計參與21筆境外債券發行；完成3個信貸業務項目，合計放款7,400萬美元，另有3個儲備項目，規模合計1.6億美元。

第三節 董事會報告

3. 資產管理業務

市場環境：

在中國經濟和居民財富持續增長的背景下，隨着資管新規的全面實施以及養老金體系的逐步完善，以公募基金為代表的標準化、淨值型資產管理行業成為金融市場中極具活力和增長潛力的板塊，回歸資管行業本源、提升主動管理能力成為券商資管業務發展的關鍵。在「一參一控一牌」的政策東風之下，券商積極籌設資管子公司，加速佈局公募賽道。截至2023年6月末，證券行業資管子公司數量已增至26家。中國證監會於2023年1月13日發佈《證券期貨經營機構私募資產管理業務管理辦法》及其配套規範性文件《證券期貨經營機構私募資產管理計劃運作管理規定》，進一步提升私募資管產品投資運作靈活度，促進私募資管業務充分發揮服務實體經濟功能。2023年以來，券商資管業務整體仍處於降通道、轉集合的轉型期，據中國基金業協會統計，截至2023年6月末，公募基金管理機構管理資產規模人民幣27.69萬億元，較上年末增長6.37%；證券公司及其子公司私募資產管理業務規模人民幣5.66萬億元，較上年末減少9.98%。

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，着力打造客戶類型、投資市場以及投資策略全覆蓋的私募資管產品體系，推進資產管理業務高質量發展。截至2023年6月末，全集團資產管理業務總規模近人民幣2.0萬億元。

(1) 基金管理公司

富國基金業務發展保持良好勢頭，截至2023年6月末，資產管理規模超人民幣1.4萬億元，較上年末增長人民幣600億元。公募基金規模超人民幣9,000億元，位列市場前八；其中非貨類規模超人民幣6,000億元，位列市場前五；公募固收類規模實現大幅提升，累計增長超人民幣500億元；非貨類ETF期末總規模已突破人民幣500億元，創歷史新高。各類養老金業務保持良好發展態勢，組合總數及管理規模均位於市場領先地位。

截至2023年6月末，海富通基金資產管理規模人民幣4,403億元，其中公募基金規模人民幣1,650億元，較年初增長17%；養老金業務規模人民幣2,336億元，較年初增長4.3%。海富通中證短融ETF規模持續增長至人民幣194億元；主動權益、「固收+」等特色基金投資業績均位於市場前列。

第三節 董事會報告

(2) 海通資管公司

海通資管公司以公募、私募雙輪產品戰略驅動公司發展，致力於打造全能資產管理機構。一方面積極謀劃資管業務轉型並佈局公募市場，以參公改造的十余只公募產品為抓手，在維持產品流動性和安全性的前提下，為投資者提供較好的收益，樹立公司的公募業務品牌。2023年上半年，海通資管通過參公改造完成的17隻參公大集合產品初步形成了產品風險等級由低到高、持有期限差異化的公募產品矩陣線，投資業績位列市場同類產品前列。另一方面持續提升主動管理能力，致力於打造客戶類型全覆蓋、投資市場全覆蓋以及投資策略全覆蓋的私募資管產品體系。2023年上半年，海通資管新發行私募資管產品26隻，發行規模合計人民幣23.75億元；海通資管集合產品投資業績在市場同策略產品中排名位於37.05%。

海通資管公司業務規模及淨收入變化

	本報告期		上年同期	
	資產管理規模（人民幣億元）	**淨收入（人民幣萬元）**	資產管理規模（人民幣億元）	淨收入（人民幣萬元）
集合資產管理	**233**	**7,840**	353	15,162
定向資產管理	**187**	**2,084**	261	2,573
專項資產管理	**405**	**473**	349	544
合計	**825**	**10,397**	963	18,279

第三節 董事會報告

(3) 私募投資基金

本公司私募股權投資基金圍繞國家戰略和發展趨勢，深耕國家重點領域，深挖細分行業龍頭，截至2023年6月末，基金總規模人民幣308億元，完成上海海通引領區產業引導母基金合夥企業（有限合夥）和安徽海螺海通工業互聯網母基金合夥企業（有限合夥）二支母基金及上海海通伊泰一期私募基金合夥企業（有限合夥）等綜合類基金募集、合夥協議簽署工作。2023年上半年，本公司私募股權投資業務在投、退兩端發力，業務發展正向循環，新增投資項目29個，實現上市項目10個，過會待發項目4個，實現淨利潤人民幣0.51億元。

2023年上半年，海通開元榮獲「2022年度最佳私募股權投資機構第18名」、「2022年度中國最佳券商私募基金子公司TOP10」、「2022-2023年度中國集成電路與半導體領域最佳投資機構」等獎項。

私募投資基金業務規模變化

	於本報告期末	上年度末
管理基金數量	**57**	55
管理規模餘額*（人民幣億元）*	**308**	300
累計投資項目數量	**29**	42
累計投資項目金額*（人民幣億元）*	**15**	35
項目退出（含部份退出）數量	**34**	65

第三節 董事會報告

(4) 境外資產管理

海通國際資產管理強調客戶導向，明確自身定位，優化資產結構，聚焦重點產品，深度挖掘和服務客戶在境內外市場的投資及配置需求，幫助海外機構客戶投資中國市場。面對宏觀經濟分化、證券市場波動、投資情緒低迷等壓力，海通國際進一步深化投研體系能力建設，加強海外業務拓展，投資表現和基金排名逐漸提升，海外客戶資產管理規模穩步增長。在高息環境中，資產管理團隊有針對性地優化和推廣靈活收益基金、ESG ETF等配置型產品，努力為客戶創造收益。2023年上半年，海通國際資產管理旗下的基金產品榮獲「理柏基金香港年獎」、「投資洞見與委託－專業投資大獎」等多項基金中長期表現大獎。2023年上半年，海通銀行下屬資管子公司獲牌後的第一支基金－中國債券基金獲葡萄牙證監會批准。

4. 交易與機構服務業務

市場環境：

2023年以來，A股市場窄幅震盪、漲跌分化，上半年上證指數、深證成指分別收漲3.65%、0.10%，創業板指收跌5.61%。2023年上半年，國際大宗商品價格普遍下跌，美國居民消費價格指數繼續上漲，受國際環境以及國內經濟發展需要影響，我國央行貨幣政策相對寬鬆，債券市場表現相對平穩。2023年上半年，中債國債總淨價指數、中債企業債總淨價指數、中債總財富指數分別收漲1.22%、1.57%、2.55%。

第三節 董事會報告

經營舉措及業績：

(1) 交易業務

2023年上半年，本公司境內權益及衍生品與交易業務面對市場不利行情，積極優化持倉結構，多措並舉控制風險。權益投資業務立足自身資源稟賦，設立價值投資組合，通過專業化、精細化研究，發掘一批可以經受短期市場波動且兼備長期投資價值的品種，實現長期穩健投資收益。基金做市業務主做市品種超400隻，實現頭部基金公司全覆蓋，期權做市業務獲得中金所2022年度「股指期權優秀做市商金獎」和「股指期權做市商新品種上市突出貢獻獎」。本公司提供多資產、跨品種、全球化的機構衍生品交易服務，通過場外衍生品工具提供豐富的表內非標準化衍生產品。2023年上半年，本公司聯合中證指數公司正式發佈「中證海通證券ESG股債聯動策略指數」，為踐行綠色金融理念提供良好投資工具；為財富管理業務提供豐富的衍生產品工具箱，為高質量服務持牌金融機構、企業及高淨值個人三類客戶提供有力抓手；一站式場外衍生品業務平台「e海通衍」系統持續建設疊代，多空互換交易功能不斷優化，對接客戶數逐步提升，為客戶提供了多樣化的算法交易策略。截至2023年6月末，本公司場外衍生品存續規模合計人民幣1,649億元。

2023年上半年，固定收益業務強化費類業務開展，穩住自營債券投資基本盤的同時，推動報價回購業務、衍生品業務及客需業務發展，進一步優化負債結構，促進融資成本平穩下降。本公司踐行金融服務實體經濟戰略，聚焦國家政策支持項目和戰略目標，積極參與公募REITS，服務實體經濟，盤活基礎設施資產，新增社會責任投資人民幣253億元。落地公司首單銀行間信用聯結票據；落地公司首單交易所固收平台線上信用保護合約。

2023年上半年，海通創新證券貫徹落實國家創新發展戰略，精選直接股權投資項目，重點聚焦國家大力支持的新一代信息技術、新能源、新材料、高端裝備製造、生物醫藥等行業的優質企業，股權投資新增投資項目4個，新增科創板跟投項目6個。

第三節 董事會報告

2023年上半年，宏觀經濟、地緣政治和市場環境持續多變，香港證券市場日均成交額同比下降16%。在客戶全球分散投資的需求日益增加的基礎上，海通國際堅持以客戶為導向，固定收益銷售及交易團隊根據市場情況，持續鞏固一、二級市場銷售及交易固收類產品的業務地位。在嚴控風險的前提下，積極提高在投資級債券市場的參與度，佣金收入保持穩步提升，同時依託與母公司在跨境總收益互換(TRS)業務方面的合作，進一步拓展機構客戶以固收類產品為目標的跨境業務。同時，持續關注人民幣進一步國際化帶來的市場機遇，在債券、利率互聯互通方面探索新的業務機會。

(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，持續夯實組織架構調整，加快提升面向機構客戶的綜合服務能力。機構銷售團隊協同公司其他產品條線，向公募基金、社保、銀行、銀行理財子公司、保險及保險資產管理公司、私募基金、QFII、WFOE等境內外金融機構提供專業化綜合服務，包括研究銷售、產品銷售、投行項目、證券金融、衍生品、跨境業務、證券交易等一攬子綜合金融解決方案，為境內外頭部機構提供「一站式」服務，為成長期客戶提供「陪伴式」服務。

2023年上半年，本公司保持在外資機構客戶服務的市場領先地位，繼續與境內外資產管理公司加强合作的廣度和深度，挖掘產品線，在服務品牌、系列產品打造、公募券結基金合作、ETF產品生態圈建設、綜合金融服務提升等方面持續發力。本公司持續強化持牌機構服務能力，鞏固機構客戶各項業務的市場佔有率，構建綜合銷售服務體系，提高在機構客戶中的影響力和滲透率。

第三節 董事會報告

本公司堅持打造業內一流的研究品牌，以研究驅動機構業務發展及投行業務拓展；強化集團內部協同，加強對分支機構、營業部客戶服務支持力度；通過網絡直播、電話會議、線下論壇等多種形式精準服務機構客戶，品牌優勢得到進一步鞏固和發揮。本公司積極發揮產業研究專業優勢，在長沙、上海、合肥等地與地方政府和產業園區共同舉辦行業論壇，通過研究產業發展趨勢和政策動態跟蹤，為政府、園區、戰略客戶等提供產業信息支持、專業智囊服務，提升公司影響力。海通國際股票研究團隊不斷鞏固在中國及跨國研究領域的能力，截至2023年6月末，團隊已覆蓋全球1,748隻股票。

5. 融資租賃業務

市場環境：

2023年上半年，融資租賃行業監管政策持續健全，整體展業環境得到進一步優化。目前，中國融資租賃行業正處於統一監管、統一登記、加速出清、轉型優化的關鍵時期，挑戰與機遇並存。截至2023年6月末，全國融資租賃企業總數為9,540家，較2022年末減少300家；全國融資租賃合同餘額約人民幣57,660億元，較2022年末下降1.44%，融資租賃行業整體依然處於收縮態勢，但降幅較去年有所減少。同時，多地地方監管部門相繼制定或更新融資租賃行業監管規定、細則，強化融資租賃公司風險防範，監管架構愈發清晰、監管機制愈發完善，融資租賃行業的監管環境持續向好。另外，多個地方政府也陸續出台措施，將融資租賃業務納入金融市場主體高質量發展實施方案中，鼓勵融資租賃企業加大與地方企業的合作，促進實體經濟健康有序發展，為融資租賃行業蓬勃發展提供了有利的政策條件及良好的外部環境。

第三節 董事會報告

經營舉措及業績：

2023年上半年，海通恒信以「一個海通」理念為指引，秉持「務實、開拓、穩健、卓越」的經營理念，緊跟國家產業政策導向，把握大勢，順勢而為，推動經營業績穩健提升。2023年上半年，海通恒信實現期間溢利8.08億元，同比增長5.6%；實現收入總額人民幣42.86億元，同比增長4.7%；生息資產平均收益率為6.71%，加權平均淨資產回報率為8.85%。截至2023年6月30日，海通恒信資產總額達到人民幣1,287.99億元，較2022年末增長3.4%；權益總額達到人民幣194.63億元，較2022年末增長3.4%；不良資產率1.09%，不良資產撥備覆蓋率253.37%。

報告期內公司經營情況的重大變化，以及報告期內發生的對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2023年6月30日，本集團總資產人民幣7,623.92億元，歸屬於母公司淨資產人民幣1,670.20億元。截至2023年6月30日止六個月，本集團實現收入人民幣260.27億元，歸屬於母公司淨利潤人民幣38.30億元；加權平均淨資產收益率2.29%。其中，子公司實現收入人民幣149.25億元，佔比56%；境外業務實現收入人民幣73.62億元，佔比28%。

（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2023年6月30日止六個月 金額	截至2022年6月30日止六個月 金額	增減情況 金額	增減情況 比例
佣金及手續費收入	**6,462,063**	7,699,311	-1,237,248	-16.07%
利息收入	**9,320,529**	8,258,455	1,062,074	12.86%
融資租賃利息收入	**781,925**	1,280,942	-499,017	-38.96%
投資收入及收益（淨額）	**3,286,842**	692,435	2,594,407	374.68%
其他收入及收益	**6,176,069**	1,933,688	4,242,381	219.39%
收入、其他收入及收益合計	**26,027,428**	19,864,831	6,162,597	31.02%

2023年上半年，本集團實現收入、其他收入及其他收益人民幣260.27億元，同比增加人民幣61.63億元，增幅31.02%，主要是子公司銷售收入增加。

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2023年6月30日止六個月	截至2022年6月30日止六個月	增減金額	增減比例
證券及期貨經紀業務收入	**3,438,879**	3,984,888	-546,009	-13.70%
承銷費及保薦費收入	**1,827,800**	2,347,204	-519,404	-22.13%
資產管理費收入（含基金管理費收入）	**959,640**	1,108,055	-148,415	-13.39%
財務諮詢顧問費收入	**188,618**	203,137	-14,519	-7.15%
其他	**47,126**	56,027	-8,901	-15.89%
佣金及手續費收入合計	**6,462,063**	7,699,311	-1,237,248	-16.07%

佣金及手續費收入為人民幣64.62億元，較去年同期減少人民幣12.37億元，減幅16.07%，主要是證券及期貨經紀業務收入，承銷費及保薦費收入減少。

b. 利息收入

利息收入人民幣93.21億元，較去年同期增加人民幣10.62億元，增幅12.86%，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32.87億元，較去年同期增加人民幣25.94億元，增幅374.68%，主要由於金融工具投資收益增加。

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	7,081,638	5,345,088	24.52%	-8.85%	24.00%	-20.00%
投資銀行業務	2,514,379	1,606,156	36.12%	-4.05%	-1.10%	-1.91%
資產管理業務	1,181,971	854,274	27.72%	-16.80%	14.61%	-19.81%
交易及機構服務	6,040,405	5,127,930	15.11%	80.25%	39.62%	24.70%
融資租賃業務	4,620,352	3,693,041	20.07%	10.20%	9.36%	0.61%
其他	4,588,683	4,628,986	-0.88%	799.04%	737.49%	7.41%

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	18,665,887	14,065,620	24.65%	23.44%	58.91%	-16.82%
境外業務	7,361,541	7,189,855	2.33%	55.21%	32.39%	16.84%
小計	26,027,428	21,255,475	18.33%	31.02%	48.82%	-9.77%

第三節 董事會報告

財富管理業務營業收入人民幣70.82億元，同比（人民幣77.69億元）減少人民幣6.87億元，減幅8.85%，主要是證券經紀業務收入同比減少；公司持續推進財富管理機構化轉型，加快打造全能型分公司，搭建區域合作平台生態，構建產融結合新高地。投資銀行業務營業收入人民幣25.14億元，同比（人民幣26.21億元）減少人民幣1.07億元，減幅4.05%，主要是上半年全市場IPO承銷規模同比下降，公司股權承銷收入減少；公司着力推動大投行組織架構優化，以服務國家戰略為綱，深入貫徹「行業化」、「區域化」戰略部署，繼續鞏固科創板、創業板等領域業務優勢，業績排名位居前列。資產管理業務營業收入人民幣11.82億元，同比（人民幣14.21億元）減少人民幣2.39億元，減幅16.80%，主要是資管子公司管理規模下降，管理費收入同比減少。交易及機構業務營業收入人民幣60.40億元，同比（人民幣33.51億元）增加人民幣26.89億元，增幅80.25%，主要是公司把握市場結構性機會，積極優化持倉結構，多措並舉控制風險，實現長期穩健投資收益。融資租賃業務營業收入人民幣46.20億元，同比（人民幣41.93億元）增加人民幣4.27億元，增幅10.20%，主要是公司立足租賃本源，聚焦服務國家戰略，大力拓展高端裝備製造、數字經濟、能源環保等國家產業政策鼓勵領域業務，加大綠色租賃投放力度，不斷提升服務實體經濟能力。

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2023年6月30日止六個月	截至2022年6月30日止六個月	增減情況 金額	增減情況 比例
折舊和攤銷費用	**839,209**	754,583	84,626	11.21%
僱員成本	**3,651,013**	3,488,369	162,644	4.66%
佣金及手續費支出	**1,521,494**	1,558,630	-37,136	-2.38%
利息支出	**7,918,051**	6,451,309	1,466,742	22.74%
預期信用減值損失	**1,203,824**	178,663	1,025,161	573.80%
其他資產減值損失	**9,878**	25,911	-16,033	-61.88%
其他支出	**6,112,006**	1,824,893	4,287,113	234.92%
合計	**21,255,475**	14,282,358	6,973,117	48.82%

2023年上半年，本集團支出總額人民幣212.55億元，較去年同期增加人民幣69.73億元，增幅48.82%，主要是子公司銷售成本增加。

2023年上半年，本集團實現歸屬於本公司股東的淨利潤人民幣38.30億元，同比下降19.51%；實現基本每股收益人民幣0.29元／股，同比下降19.44%；加權平均淨資產收益率2.29%，同比減少0.59個百分點。

第三節 董事會報告

3 公益投入

2023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684千元。

2023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	684
合計	684

4 現金流

2023年上半年，本集團現金及現金等價物淨增加至人民幣713.20億元，其中：

用於經營活動的現金淨額人民幣133.06億元，主要是賣出回購金融資產款減少，導致現金流出人民幣186.28億元；買入返售金融資產增加，導致現金流出人民幣85.14億元；應付經紀業務客戶款項及其他應付款項及預計費用增加，導致現金流入人民幣43.58億元。

來自投資活動的現金淨額人民幣53.99億元，主要是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，導致現金流入人民幣175.15億元；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99.93億元。

來自籌資活動的現金淨額人民幣109.24億元，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688.78億元；籌集借款所得款項，導致現金流入人民幣425.27億元；償還借款、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948.11億元。

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

	2023年6月30日	構成	2022年12月31日	構成	增減情況 金額	增減情況 比例
非流動資產	**185,499,989**		187,513,724		-2,013,735	-1.07%
其中： 應收融資租賃款	**8,478,964**	**1.11%**	7,102,583	0.94%	1,376,381	19.38%
售後回租安排的應收款	**47,157,535**	**6.19%**	47,847,820	6.35%	-690,285	-1.44%
以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具	**40,563,105**	**5.32%**	45,975,346	6.10%	-5,412,241	-11.77%
以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具	**7,468,696**	**0.98%**	6,096,319	0.81%	1,372,377	22.51%
以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產	**25,237,727**	**3.31%**	25,043,377	3.32%	194,350	0.78%
其他貸款及應收款項	**957,248**	**0.13%**	2,518,564	0.33%	-1,561,316	-61.99%
權益法項下投資	**7,298,898**	**0.96%**	7,013,714	0.93%	285,184	4.07%
買入返售金融資產	**1,010,702**	**0.13%**	50,071	0.01%	960,631	1,918.54%
物業及設備	**16,915,180**	**2.22%**	17,016,634	2.26%	-101,454	-0.60%
客戶貸款	**6,165,616**	**0.81%**	5,031,733	0.67%	1,133,883	22.53%
商譽	**3,794,197**	**0.50%**	3,676,231	0.49%	117,966	3.21%

第三節 董事會報告

	2023年6月30日	構成	2022年12月31日	構成	增減情況 金額	比例
流動資產	**576,891,676**		566,095,581		10,796,095	1.91%
其中：銀行結餘及現金	**163,620,481**	**21.46%**	153,392,719	20.35%	10,227,762	6.67%
結算備付金	**18,566,287**	**2.44%**	21,380,695	2.84%	-2,814,408	-13.16%
以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產	**183,699,683**	**24.10%**	184,555,352	24.49%	-855,669	-0.46%
客戶墊款	**66,419,988**	**8.71%**	67,843,871	9.00%	-1,423,883	-2.10%
應收賬款	**9,988,638**	**1.31%**	10,394,515	1.38%	-405,877	-3.90%
買入返售金融資產	**40,093,887**	**5.26%**	32,595,078	4.33%	7,498,809	23.01%
應收融資租賃款	**9,518,249**	**1.25%**	12,355,870	1.64%	-2,837,621	-22.97%
售後回租安排的應收款	**40,012,579**	**5.25%**	36,702,132	4.87%	3,310,447	9.02%
以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具	**5,489,647**	**0.72%**	6,876,553	0.91%	-1,386,906	-20.17%
交易所儲備及保證金	**21,496,741**	**2.82%**	22,664,637	3.01%	-1,167,896	-5.15%
衍生金融資產	**1,932,425**	**0.25%**	1,477,167	0.20%	455,258	30.82%
其他貸款及應收款項	**5,195,743**	**0.68%**	4,209,604	0.56%	986,139	23.43%
資產總額	**762,391,665**		753,609,305		8,782,360	1.17%

第三節 董事會報告

	2023年6月30日	構成	2022年12月31日	構成	增減情況 金額	增減情況 比例
流動負債	**389,723,669**		389,397,820		325,849	0.08%
其中： 應付經紀業務客戶賬款	**119,909,488**	**20.58%**	115,513,463	20.05%	4,396,025	3.81%
賣出回購金融資產款	**82,423,177**	**14.15%**	101,694,357	17.66%	-19,271,180	-18.95%
借款	**60,362,034**	**10.36%**	56,864,912	9.87%	3,497,122	6.15%
拆入資金	**6,957,129**	**1.19%**	3,218,363	0.56%	3,738,766	116.17%
以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債	**11,543,496**	**1.98%**	5,478,358	0.95%	6,065,138	110.71%
衍生金融負債	**1,305,591**	**0.22%**	898,419	0.16%	407,172	45.32%
其他應付及預計費用	**25,637,420**	**4.40%**	21,262,810	3.69%	4,374,610	20.57%
應付短期融資款	**12,985,280**	**2.23%**	16,159,094	2.81%	-3,173,814	-19.64%
客戶存款	**4,282,383**	**0.74%**	3,784,565	0.66%	497,818	13.15%
所得稅負債	**700,305**	**0.12%**	1,729,485	0.30%	-1,029,180	-59.51%
應付債券	**62,423,349**	**10.72%**	60,153,220	10.44%	2,270,129	3.77%
流動資產淨值	**187,168,007**		176,697,761		10,470,246	5.93%
非流動負債	**192,799,464**		186,589,427		6,210,037	3.33%
其中： 應付債券	**142,781,097**	**24.51%**	121,677,698	21.13%	21,103,399	17.34%
長期借款	**26,509,829**	**4.55%**	33,951,333	5.89%	-7,441,504	-21.92%
賣出回購金融資產款	**643,468**	**0.11%**	–	0.00%	643,468	不適用
以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債	**10,977,761**	**1.88%**	17,410,122	3.02%	-6,432,361	-36.95%
拆入資金	**2,065,763**	**0.35%**	3,057,738	0.53%	-991,975	-32.44%
負債總額	**582,523,133**		575,987,247		6,535,886	1.13%
權益總額	**179,868,532**		177,622,058		2,246,474	1.26%

* 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2023年6月30日，本集團資產總額為人民幣7,623.92億元，較2022年末增加人民幣87.82億元，增幅1.17%；負債總額為人民幣5,825.23億元，較2022年末增加人民幣65.36億元，增幅1.13%。

第三節 董事會報告

截至2023年6月30日，非流動資產為人民幣1,855.00億元，較2022年末減少1.07%，主要是由於以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具減少；流動資產為人民幣5,768.92億元，較2022年末增加1.91%，主要是銀行結餘及現金增加。流動負債為人民幣3,897.24億元，較2022年末增加0.08%；流動資產淨值為人民幣1,871.68億元，較2022年末增加5.93%；非流動負債為人民幣1,927.99億元，較2022年末增加3.33%，主要是由於應付債券增加。

截至2023年6月30日，本集團歸屬於本公司擁有人的權益為人民幣1,670.20億元，較2022年末增加人民幣24.28億元，增幅1.47%；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72.00%，較2022年末資產負債率72.16%，下降了0.16個百分點，本集團資產負債結構保持相對穩定。

借款及債券融資

截至2023年6月30日，本集團的借款及債券融資額為人民幣305,062百萬元，下表載列於2023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

	2023年6月30日	2022年12月31日
應付債券	**205,204,446**	181,830,918
借款	**86,871,863**	90,816,245
應付短期融資款	**12,985,280**	16,159,094
合計	**305,061,589**	288,806,257

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

截至2023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1,357.71億元，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1,871.68億元，因此，本集團面臨的流動性風險並不重大。

除在本報告中已披露外，於2023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、承兑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。

第三節 董事會報告

（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72.99億元，較上年末（人民幣70.14億元）增加人民幣2.85億元，增幅4.07%。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). 以公允價值計量的金融資產

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變動計入損益的金融資產人民幣2,089.37億元，以公允價值計量且變動計入損益的金融負債人民幣-225.21億元，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74.69億元，以公允價值價值計量且變動計入其他綜合收益的債務工具人民幣460.53億元及衍生金融工具人民幣6.27億元。

（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。於2023年6月30日，海通創新證券總資產為人民幣210.43億元，淨資產人民幣203.25億元；截至2023年上半年，實現營業收入人民幣8.29億元，淨利潤人民幣6.44億元。

2. 海通國際控股，註冊資本港幣111.80億元，海通證券持有100%的股權。於2023年6月30日，海通國際控股總資產為港幣2,695.22億元，淨資產港幣310.83億元；截至2023年上半年，實現收入港幣33.53億元，淨虧損港幣2.72億元。

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。於2023年6月30日，海通開元總資產為人民幣127.44億元，淨資產人民幣111.67億元；截至2023年上半年，實現營業收入人民幣0.97億元，淨虧損人民幣0.14億元。

4. 海通資管公司，註冊資本22億元人民幣，海通證券持有100%的股權。於2023年6月30日，海通資管公司的總資產為人民幣69.92億元，淨資產人民幣55.30億元；截至2023年上半年，實現營業收入人民幣2.09億元，淨利潤人民幣0.63億元。

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。於2023年6月30日，上海澤春的總資產為人民幣4.96億元，淨資產人民幣2.41億元；截至2023年上半年，實現營業收人民幣入0.32億元，淨利潤人民幣0.17億元。

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。於2023年6月30日，上海惟泰置業的總資產為人民幣2.45億元，淨資產人民幣0.15億元；截至2023年上半年，實現營業收入人民幣0.20億元，淨利潤人民幣13.14萬元。

7. 海通期貨，註冊資本人民幣13.015億元，海通證券持有83.22%的股權。於2023年6月30日，海通期貨總資產為人民幣583.07億元，淨資產人民幣36.18億元；截至2023年上半年，實現營業收入人民幣50.85億元，淨利潤人民幣1.52億元。

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。於2023年6月30日，海富通基金總資產為人民幣37.47億元，淨資產人民幣24.45億元；截至2023年上半年，實現營業收入人民幣6.32億元，淨利潤人民幣1.92億元。

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。於2023年6月30日，富國基金總資產為人民幣136.24億元，淨資產人民幣77.81億元；截至2023年上半年，實現營業收入人民幣36.48億元，淨利潤人民幣10.65億元。

（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本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60個結構化主體納入合併報表範圍。

第三節 董事會報告

五、 其他披露事項

（一） 可能面對的風險及風險應對措施

1. 風險管理概述

本集團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。

本集團根據《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，強化風控指標並表管理，健全集團T+1風險數據集市，賦能子公司風險管理，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、各單位（即總部部門、分支機構及子公司），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、風險容忍度及限額指標、業務風控指標的三層風控指標體系，通過系統實現動態監控和自動預警，主動開展壓力測試來審慎評估極端風險影響，加強同一客戶、同一業務風險集中統一管理，建立、完善集團風險限額體系並向部門、子公司進行拆解，並建成集團智能預警平台，提升風險預判預警能力；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、半年報及年報，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，本集團從文化建設、制度建設、數據和系統建設、人才隊伍建設、加強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（「**首席風險官**」）、風險管理部門、業務及管理部門、分支機構及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，本公司合規管理部負責管理公司合規風險、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公司聲譽風險，本公司信息技術管理部門負責管理公司信息技術風險。

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。本公司將子公司風險管理納入全面風險管理體系，對其風險管理工作實行垂直管理，每日開展風控指標並表管理，建立了本集團T+1風險數據集市，並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、風險數據對接、風控指標並表、風險督導檢查、風險考核評價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

本集團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，並結合公本司的實際情況，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，為有效防範本公司合規風險，推動本公司合規管理有效運行，促進本公司持續、健康、合規發展，本公司進一步夯實合規審查、合規檢查、合規監測等合規管理基礎職能，進一步優化集團合規管理機制，提升本集團合規管理科技化水平。本公司確定2023年為「合規內控文化鞏固年」，在本集團範圍內全面鞏固合規內控文化建設工作，聚焦「提升合規文化宣傳培育的融合性」「提升合規內控隊伍的專業履職能力」「加大對重點領域的執行保障力度」「落實反洗錢檢查整改，推動一道防線履職」等四大重點工作，推動本公司建立健全合規內控長效機制，合規內控管理效能持續提升。

(2) 洗錢及恐怖融資風險

本公司根據《法人金融機構洗錢和恐怖融資風險管理指引（試行）》（銀反洗發[2018]19號）制定了《海通證券股份有限公司洗錢和恐怖融資風險管理辦法》，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，制定以「風險為本」的洗錢和恐怖融資風險管理策略，針對本公司各業務條線面臨的不同風險狀況採取相應的風險管控措施，並通過培訓和宣傳促進洗錢風險管理文化傳導，營造良好的洗錢風險管理文化氛圍，積極防範洗錢和恐怖融資風險。

第三節 董事會報告

報告期內，本公司將「落實反洗錢檢查整改，推動一道防線履職」工作納入公司「合規內控文化鞏固年」重點建設工作，全面推動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。一是推動一道防線反洗錢履職，督導業務部門和分支機構加強反洗錢履職。二是完善反洗錢系統建設，探索和嘗試利用大數據基礎、通過人工智能隨機森林等算法，構建可疑交易監測的人工智能模型，提高監測模型有效性。三是加強洗錢風險管理文化建設，繼續做好洗錢風險管理系列培訓，分享反洗錢學習與工作經驗。四是積極履行反洗錢宣導義務，編寫發佈《合規內控文化建設年動態－反洗錢專刊》，開展反洗錢優秀宣傳作品評比，倡導積極的洗錢風險管理文化氛圍，提高投資者洗錢和恐怖融資風險防範意識。

(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。

第三節 董事會報告

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。

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。

第三節 董事會報告

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。一是推動集團智能預警中心的推廣應用，建立針對各類風險信號的監測、預警及排查工作機制，賦能業務條線增強風險預警預判能力；二是以集團T+1風險數據集市為依託，對信用風險管理信息系統進行持續升級，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；三是持續強化統一評級與集中授信管理機制，發佈項目融資類客戶信用風險評級與授信管理實施細則，並對信用評級和授信限額進行動態優化；四是繼續推進高風險客戶名單管理工作落實，修訂高風險客戶名單管理辦法並持續開展相關信息系統的集團化部署；五是積極落實客戶ESG盡職調查和ESG風險評估等工作，開展了集團ESG風險管理專題培訓。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，強化存續項目的跟蹤、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270.67%，約定購回式證券交易客戶的平均履約保障比例為258.06%，股票質押式回購業務客戶的平均履約保障比例為256.20%，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。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。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。本集團國際化佈局不斷完善，面對複雜多變的境外市場，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。集團注重外幣資產和負債的匹配，以控制外匯風險的敞口。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集團的整體損益帶來影響。報告期內，根據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0.2%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公司造成損失的風險。操作風險貫穿於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。本集團以操作風險管理辦法等制度為依據，利用風險與控制自我評估、關鍵風險指標、損失數據收集等風險管理工具開展操作風險識別、評估、監測、報告等工作。本集團每年開展年度風險與控制自我評估，並根據監管要求及新業務、新產品開展情況等進行專項風險與控制自我評估。建立了覆蓋集團主要部門及子公司的關鍵風險指標體系，對關鍵風險指標開展監測工作。在本集團範圍內開展操作風險事件收集工作，監控風險事件發生情況及進展，並針對風險事件揭示的問題及時排查分析並制定相應的整改措施。此外，本集團通過完善規章制度、規範操作流程、加強風險檢查、強化考核及問責等方式持續完善內部控制管理機制，降低操作風險發生的可能性，積極應對並妥善處理其不利影響。報告期內，本集團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，未發生重大操作風險事件。

信息技術風險指在借助信息技術手段從事證券基金業務活動中，由於自然因素、人為因素、技術漏洞和管理缺陷產生的風險。本集團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。本集團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。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，維系良好信譽，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和子公司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，基本實現本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，以流動性風險並表指標為基礎，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，本公司持續完善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。本公司核心流動性監管指標流動性覆蓋率日均267.71%，淨穩定資金率日均157.84%，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、媒體等對公司形成負面評價，從而損害公司品牌價值，不利於公司正常經營，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，圍繞經營亮點強化主動宣傳，為本公司發展營造良好的輿論環境。針對少數負面輿情，本公司科學研判、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，維護公司品牌形象。本公司圍繞《海通證券股份有限公司聲譽風險管理辦法》，通過上線專題課程、組織集中學習、解析典型案例、開展應急演練等手段，進行全員宣傳和貫徹，不斷提升全體員工聲譽風險管理意識、防範水平和應對能力。報告期內，本公司總體輿論環境良好。

（二） 其他披露事項

經營計劃進展說明

2023年上半年，經濟社會全面恢復常態化運行。在總體戰略的指引下，本公司深入踐行「一個海通」理念，堅持圍繞中心、服務大局，促進「科技－產業－金融」良性循環，助力現代產業體系建設，持續深化區域服務，推動分支機構轉型升級，深化機構改革，強化集團管理，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。

第三節 董事會報告

在投資銀行業務線，本公司主動適應全面註冊制，着力推動大投行組織架構優化；公司股權融資業務積極佈局，大力開拓科創板、創業板、北交所項目，市場排名保持行業前列；債券融資業務各項指標排名回升，聚焦國家戰略，堅持創新驅動，成功發行多個「市場首單」產品。在財富管理業務線，本公司經紀業務加快打造全能型分公司，推進財富管理機構化轉型，提升投顧服務能力，加強投資者權益保護，初步建立戰略客戶服務體系，搭建區域合作平台生態；金融產品業務穩步提升產品保有規模；融資融券業務穩中求進，股票質押業務穩步開展，融券業務市佔率提升，紓困基金穩健運行；私人銀行業務聚焦高淨值客戶，逐步構建私行客戶生態圈；期貨業務代理交易額市場份額穩步增長。在交易及機構業務線，本公司衍生品業務規模不斷擴大；權益投資交易業務面對市場不利行情，積極求變；固定收益投資重啟投顧業務，新增多項社會責任投資；自貿區分公司持續推進以自貿區離岸債券為標的的自營投資和客需服務；研究服務創新工作方法，加強「業務賦能」，強化持牌機構服務能力，構建綜合銷售服務體系。在資產管理業務線，海通資管參公大集合量化產品、中短債產品投資業績在市場同類產品中排名前列；富國基金公募基金管理規模排名行業前列，各類養老金業務保持良好發展態勢；海富通基金公募基金規模、養老金業務規模、海富通中證短融ETF規模實現增長。在私募股權投資及直投業務線，私募股權投資基金堅持服務實體經濟，高效支持科技創新；創新證券穩健發展股權投資，積極開展戰略基金投資。在海外業務與融資租賃業務線，海通國際勇於逆勢尋突破，不斷強化境內外業務聯動；海通銀行妥善應對地緣政治緊張局勢及全球加息浪潮，在多項工作中取得重要進展；海通恒信加速推進產業化轉型，深入佈局綠色租賃細分領域，持續優化資產結構。報告期內，本公司各個業務條線均取

第三節 董事會報告

得穩健業績的同時，在管理工作方面，持續強化合規風控能力，優化財資管理能力，深化數字化轉型，整合資源，推進業務協同，實現駐京機構集中辦公，通過管理賦能持續強化精耕細作助力公司在「一個海通」理念下的健康發展。

2023年下半年，本公司將進一步整合公司資源，發揮本公司綜合金融服務優勢，全方位、多層次推動企業對接資本市場，咬定目標不動搖，打好打贏「四場大仗」，具體的業務重點包括：(1)投資銀行業務線將強化高端產業引領功能，發揮高質量發展的示範作用，進一步深化改革，優化內外部協同機制，並探索研究境內外聯動機制；(2)財富管理業務線將多渠道強化銷售體系，加快優化傳統網點佈局，持續建立戰略客戶生態圈，加大分支機構轉型力度；(3)交易及機構業務線將加快提升投資管理能力，打造PB業務綜合平台，優化持牌金融機構服務；(4)資產管理業務線，將持續完善合規風控體系，着力打造行業良好發展生態，全面強化專業能力建設；(5)私募股權投資及直投業務線將緊抓服務國家戰略和實體經濟的主線，加強基礎研究與各類基金間的協同聯動，並繼續鞏固股權投資業務優勢；(6)海外業務線將統籌資源、優化流程、完善考核，堅決打好境外業務品牌保衛戰，更好發揮「一個海通」協同實效；及(7)融資租賃業務線將加快產業化轉型發展，培育戰略新興資產，持續優化資產結構。與此同時，本公司下半年還將圍繞高質量的合規內控、科技運營、財資管理、集團化管理等體系建設，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查詢索引	決議刊登的披露日期	會議決議
2022年度股東大會	2023年6月16日	http://www.sse.com.cn https://www.hkexnews.hk/	2023年6月17日 2023年6月16日	詳見下文「股東週年大會情況說明」

註： 上述會議決議公告請參閱會議當日的香港聯交所網站及本公司網站，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》。

表決權恢復的優先股股東請求召開臨時股東大會

✓不適用

股東大會情況說明

本報告期內，本公司於2023年6月16日在海通外灘金融廣場召開了2022年度股東大會，審議並通過11項議案，分別是普通決議案1.審議及批准本公司2022年度董事會工作報告；2.審議及批准本公司2022年度監事會工作報告；3.審議及批准本公司2022年度獨立董事述職報告；4.審議及批准本公司2022年年度報告；5.審議及批准本公司2022年度財務決算報告；6.審議及批准本公司2022年度利潤分配預案；7.審議及批准本公司關於續聘會計師事務所的議案；8.審議及批准本公司關於預計公司2023年度自營投資業務配置規模的議案；9.審議及批准本公司關於預計公司2023年度日常關聯／連交易的議案；10.審議及批准本公司關於提名肖荷花女士為本公司非執行董事的議案；及特別決議案1.審議及批准本公司關於提請股東大會給予董事會認可、分配或發行A股及／或H股股份的一般性授權的議案。相關決議公告於會議當日刊登在香港聯交所網站（http://www.hkexnews.hk）及本公司網站，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、董事、監事及本公司高級管理人員變動情況

姓名	擔任的職務	變動情形
任澎	執行董事、副總經理	離任
余莉萍	非執行董事	離任
侍旭	職工代表監事	離任
李建國	總經理助理	離任
林涌	總經理助理	離任
杜洪波	首席風險官	離任
李海超	合規總監	離任
肖荷花	非執行董事	選舉
曹志剛	職工代表監事	選舉
趙慧文	合規總監	聘任
侍旭	首席風險官	聘任

註： 除上述表格所列事宜，本公司部分高級管理人員任職情況發生了調整，具體如下：李海超先生不再擔任本公司合規總監，仍擔任本公司副總經理；姜誠君先生不再擔任本公司總經理助理，擔任本公司副總經理；張信軍先生擔任本公司副總經理，原財務總監職務仍保持不變；潘光韜先生不再擔任本公司總經理助理，擔任本公司副總經理；裴長江先生不再擔任本公司副總經理，擬任本公司董事會秘書，在取得上海證券交易所頒發的董事會秘書任前培訓證明後正式履職，在此之前由姜誠君先生繼續履行本公司董事會秘書職責。

第四節 公司治理

董事、監事及本公司高級管理人員變動的情況說明

1. 董事變更情況

2023年1月30日，董事會收到任澎先生提交的書面辭職報告，任澎先生因年齡原因提出辭去執行董事、董事會發展戰略與ESG管理委員會（「**發展戰略與ESG管理委員會**」）委員和副總經理的職務，根據《公司法》《公司章程》的相關規定，任澎先生的辭職申請自辭職報告自送達董事會之日起生效。詳見本公司2023年1月30日於香港聯交所披露易網站披露的《執行董事辭任》公告。

2023年5月31日，董事會收到余莉萍女士提交的書面辭職報告，余莉萍女士因個人原因（退休）申請辭去第七屆董事會董事職務，同時一併辭去第七屆董事會提名與薪酬考核委員會（「**提名與薪酬考核委員會**」）委員、審計委員會（「**審計委員會**」）委員職務。余莉萍女士的辭職申請自辭職報告送達董事會時生效。詳見本公司2023年5月31日於香港聯交所披露易網站披露的《非執行董事辭任》公告。

2023年6月16日，本公司召開的2022股東週年大會審議通過了《關於提名肖荷花女士為本公司非執行董事的議案》，同意肖荷花女士任第七屆董事會非執行董事。肖荷花女士自本次股東週年大會決議生效之日起履行非執行董事職責。詳見本公司於2023年6月16日於香港聯交所披露易網站披露的《於二零二三年六月十六日舉行之股東週年大會之投票結果》公告。

2. 監事變更情況

2023年6月20日，監事會收到侍旭先生提交的書面辭職報告，侍旭先生因本公司相關工作安排申請辭去第七屆監事會職工代表監事職務。根據《公司法》和《公司章程》的相關規定，侍旭先生在新的職工代表監事選舉產生履職前仍繼續履行公司職工代表監事的職責。詳見本公司2023年6月20日於香港聯交所網站披露的《監事辭任》的公告。

第四節 公司治理

2023年6月28日，本公司以通訊方式召開了第四屆職工代表大會第十七次會議，選舉曹志剛先生為第七屆監事會職工代表監事。曹志剛先生的監事任職自2023年6月28日生效，任期與第七屆監事會任期一致。同日，侍旭先生不再履行職工代表監事的職責。詳見本公司於2023年6月28日於香港聯交所網站披露的《關於選舉職工代表監事的公告》。

3. 高級管理人員變更情況

2023年3月16日，董事會收到本公司總經理助理林涌先生提交的書面辭職報告。林涌先生因相關工作安排辭去本公司總經理助理的職務。林涌先生的辭任自辭職報告送達董事會之日起生效。詳見本公司2023年3月17日於香港聯交所網站披露的《海外監管公告》。

2023年4月12日，董事會收到本公司總經理助理李建國先生提交的書面辭職報告。李建國先生因年齡原因辭去本公司總經理助理的職務。李建國先生的辭任自辭職報告送達董事會之日起生效。詳見本公司2023年4月12日於香港聯交所網站披露的《海外監管公告》。

2023年6月30日，董事會收到本公司首席風險官杜洪波先生的辭職報告。杜洪波先生因年齡原因，不再擔任本公司首席風險官職務。杜洪波先生的辭任自辭職報告送達董事會之日起生效。詳見本公司2023年6月30日於香港聯交所網站披露的《海外監管公告》。

第四節 公司治理

2023年6月30日，本公司召開了第七屆董事會第三十九次會議（臨時會議），該次董事會審議通過了如下事宜：

(1) 審議通過了《關於聘任副總經理的議案》。董事會聘任姜誠君先生、潘光韜先生和張信軍先生為本公司副總經理。姜誠君先生不再擔任本公司總經理助理職務；並於同日向董事會提交了辭呈，申請辭去本公司董事會秘書、本公司聯席公司秘書、授權代表的職務，待本公司新任董事會秘書、本公司聯席公司秘書、授權代表正式履職後卸任。潘光韜先生不再擔任本公司總經理助理職務。張信軍先生仍擔任本公司財務總監職務。姜誠君先生、潘光韜先生和張信軍先生作為本公司副總經理的任期自董事會決議通過之日起。

(2) 審議通過了《關於聘任首席風險官的議案》，董事會同意聘任侍旭先生為本公司首席風險官，其任期董事會決議通過之日起。

(3) 審議通過了《關於聘任合規總監的議案》，聘任趙慧文女士為本公司合規總監，並在取得中國證監會相關派出機構認可後正式履職。

2023年7月31日，趙慧文女士擔任本公司合規總監事宜已獲中國證監會相關派出機構認可，即日起正式任職本公司合規總監。李海超先生不再擔任本公司合規總監。詳見本公司2023年7月31日於香港聯交所網站披露的《海外監管公告》。

第四節 公司治理

(4) 審議通過了《關於聘任董事會秘書和聯席公司秘書的議案》，本公司董事會秘書姜誠君先生由於工作變動原因於該次董事會召開日向董事會提交了辭呈，辭去本公司董事會秘書、本公司聯席公司秘書、本公司授權代表（就香港上市規則第3.05條而言）及本公司香港聯交所電子呈交系統之授權人士之職務（「**電子呈交系統獲授權人士**」）。董事會聘任裴長江先生為董事會秘書、本公司聯席公司秘書、本公司授權代表及電子呈交系統獲授權人士。

裴長江先生在取得上海證券交易所頒發的董事會秘書任前培訓證明後正式履職。在此之前，由姜誠君先生繼續履行本公司董事會秘書職責。因委任裴長江先生為聯席公司秘書需取得香港聯交所批准授予豁免（「**該豁免**」）嚴格遵守香港上市規則第3.28條及第8.17條規定，裴長江先生須自取得香港聯交所對該豁免的批准之日正式擔任聯席本公司秘書及本公司授權代表（就香港上市規則第3.05條而言）職責。在此之前，由姜誠君先生繼續履行聯席公司秘書及本公司授權代表（就香港上市規則第3.05條而言）職責（詳見本公司於2023年6月30日於香港聯交所網站披露的《建議更換聯席公司秘書、董事會秘書及授權代表》公告）。香港聯交所已於2023年7月6日批准該豁免。於取得該豁免後，裴先生獲委任為聯席公司秘書及授權代表，於2023年7月6日生效。（詳見本公司於2023年7月7日於香港聯交所網站披露的《委任聯席公司秘書及授權代表之進展公告》）

第四節 公司治理

三、 董事、監事、本公司高級管理人員及員工其他情況説明

（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2023年1月1日起至2023年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。

（二） 董事、監事相關信息的重大變更

非執行董事周東輝先生自2023年1月起，不再擔任上海煙草機械有限公司副董事長、董事，不再擔任上海高揚國際煙草有限公司、上海海煙投資管理有限公司、中國煙草上海進出口有限責任公司、上海煙草集團黃浦煙草糖酒有限公司、上海煙草集團徐匯煙草糖酒有限公司、上海煙草集團虹口煙草糖酒有限公司、上海煙草集團楊浦煙草糖酒有限公司、上海煙草集團閔行煙草糖酒有限公司、上海煙草集團寶山煙草糖酒有限公司、上海煙草集團浦東煙草糖酒有限公司、上海煙草集團松江煙草糖酒有限公司、上海煙草集團青浦煙草糖酒有限公司、上海煙草集團崇明煙草糖酒有限公司、上海白玉蘭煙草材料有限公司、上海王寶和大酒店有限公司、上海煙草集團房地產開發經營有限公司、上海海煙煙草糖酒有限公司、上海煙草集團蘇州中華園大飯店有限責任公司、深圳新型煙草製品有限公司董事，不再擔任中維資本控股股份有限公司監事。

非執行董事許建國先生自2023年2月起不再擔任上海海立（集團）股份有限公司（該公司於上交所上市，股票代碼為600619）監事長、天津鋼管集團股份有限公司董事、上海電氣集團恒聯企業發展有限公司董事。

第四節 公司治理

獨立非執行董事張鳴先生自2023年6月起擔任上工申貝（集團）股份有限公司（該公司於上交所上市，股票代碼為600843）獨立董事。

獨立非執行董事林家禮先生自2023年4月起擔任新火科技控股有限公司（股份代號：1611）獨立非執行董事，自2023年4月起不再擔任新加坡交易所上市Beverly JCG Investment Holdings Limited（股份代號：VFP）獨立非執行董事及自2023年5月起不再擔任馬來西亞交易所(Bursa Malaysia)上市TMC生命科學（股份代號：0101）獨立非執行董事。

獨立非執行董事朱洪超先生自2023年5月起不再擔任財通基金管理有限公司獨立董事。

監事戴麗自2023年5月起擔任上海東方網股份有限公司董事，2023年7月起擔任上海東方報業有限公司董事。

監事董小春自2023年6月起不再擔任上海百聯集團股份有限公司財務總監、董秘。

監事曹志剛自2023年6月起由本公司稽核部副總經理改任總經理。

監事侍旭（已離任）自2023年6月起不再擔任公司稽核部總經理，並自2023年6月起擔任公司首席風險官。

除上述披露者外，概無其他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。

第四節 公司治理

（三） 董事、監事服務合約的説明

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）。

（四） 員工及薪酬政策

截至報告期末，本集團僱員人數12,262人。其中本公司僱員人數6,865人，子公司僱員人數5,397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，持續完善薪酬遞延支付、追索扣回等機制。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。

第四節 公司治理

（五） 員工培訓

2023年上半年，培訓工作堅持統籌規劃、分類開展，堅持資源整合、賦能發展，堅持共建共享、智慧運營，依託本公司黨委黨校和海通財富研修院，聚焦內容創新、項目精細、功能完善，助力公司人才發展及梯隊建設。豐富黨校辦學形式，上線「海通黨校」專欄，加強新形勢下廣大幹部員工思想政治工作，提高廣大黨員教育培訓工作質量；持續推進內容創新，以「五大分院一個中心」為基礎，整合集團資源，完善課程體系，滿足員工定制學習、個性學習、隨需隨學的需求；持續升級重點項目，分類分層搭建公司人才發展體系，「海豚計劃」着眼應屆生資源儲備，「海星計劃」突出新員工文化融合，「海燕計劃」聚焦國際化人才儲備，「蒲公英計劃」強調業務交流和協同；持續完善平台功能，有效支持線上業務培訓的開展，定制推出創新項目案例、分公司專欄等知識專欄，助力員工專業素質能力的持續提升。

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2023年6月16日召開2022股東週年大會，審議通過了本公司2022年度利潤分配預案：以截至2022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0.21元（含稅），共計派發現金紅利人民幣2,743,482,000.00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2,027,472,547.80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785,837,421.63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、香港聯交所網站及本公司網站刊登了2022年度利潤分配實施的有關公告，並於2023年7月28日實施完畢。

第四節 公司治理

（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。

六、 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5次，監事會2次，審計委員會4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1次，合規與風險管理委員會1次，共計17次會議。

（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。

第四節 公司治理

（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。於2023年6月30日，本公司董事會由十名董事組成，其中執行董事兩名，分別為周杰先生和李軍先生；非執行董事四名，分別為屠旋旋先生，周東輝先生，肖荷花女士及許建國先生；獨立非執行董事四名，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、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管理委員會主任委員由董事長周杰擔任，合規與風險管理委員會主任委員由執行董事李軍擔任，另兩個委員會的主任委員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的規定，成員有五名，包括張鳴先生（主任委員）、肖荷花女士、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2023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2023年6月30日，監事會由九名監事組成，其中監事會主席一名，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。

（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。

第四節 公司治理

（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。

本公司注重維護投資者關係，通過開展各類投資者關係活動，持續加強與投資者的信息溝通，切實保護投資者的合法權益，有效增進投資者對公司的了解和認同。為保障投資者關係管理工作規範化、制度化、流程化開展，本公司已制定《投資者關係管理辦法》等相關制度，通過本公司官網、投資者熱線、電子郵箱、投資者説明會、路演、分析師會議、接待來訪及上證e互動平台等多種載體與投資者進行溝通交流，並建立健全投資者關係管理檔案。

2023年上半年，本公司順利召開2022年度業績發佈會，管理層全面推介公司發展戰略和經營亮點，並就市場熱點問題與投資者及分析師交換意見，在回應市場關注的同時，正確引導市場預期。本公司定期維護公司官網投資者關係欄目和上證e互動平台內容，幫助投資者快速、全面地了解公司信息。及時處理投資者問詢和建議，接聽投資者熱線133起，回答上證e互動問題69個。本公司注重在市場交流中加強主動性和戰略性溝通，多次以現場或電話方式接待境內外機構投資者及分析師調研，並多次受邀參加境內外賣方機構投資策略會。同時，針對投資者及分析師的關注重點，本公司積極組織相關部門參與調研，並將市場聲音傳達至管理層，反哺公司業務發展及治理提升，充分發揮投資者關係管理的雙向傳導作用。

第四節 公司治理

（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2023年為「合規內控文化鞏固年」，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，聚焦「提升合規文化宣傳培育的融合性」「提升合規內控隊伍的專業履職能力」「加大對重點領域的執行保障力度」「落實反洗錢檢查整改，推動一道防線履職」等四大重點工作，推動本公司建立健全合規內控長效機制，合規內控管理效能持續提升。

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布的重點排污單位的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布的重點排污單位。

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

圍繞國家「雙碳」和高質量發展目標，通過ESG風險管理、負責任投資等將ESG理念全面融入發展戰略和日常經營。為推進ESG管理系統化建設，本公司搭建發展戰略與ESG管理委員會、ESG建設領導小組及ESG工作小組三層管理架構，實現本公司ESG管理工作的規範、有效推進。報告期內，本公司不斷完善ESG管理工作機制，根據實際工作需要，對ESG工作小組的責任部門及分工進行動態調整，提升ESG管理架構與實際工作開展的匹配性。

第五節　環境與社會責任

本公司堅持綠色低碳循環發展，從自身運營及綠色金融兩方面自覺履行企業環境責任。自身運營層面，本公司大力倡導環保辦公理念，通過倡導無紙化辦公、空調限溫、綠色出行、綠色會議等方式減少辦公過程中的資源浪費。綠色金融層面，持續為節能環保、清潔能源、清潔交通等綠色產業提供多渠道、多品種的綠色投融資工具，引導和激勵更多社會資本投入綠色產業，並積極開展綠色研究諮詢、綠色金融行業交流，以實際行動踐行ESG理念。

1.　自身運營

綠色運營方面，本公司積極落實節約能源和提高能源利用率的責任，鼓勵員工合理限定冬夏兩季空調溫度，自覺做到人走燈滅；本公司提倡「綠色出行，低碳生活」的理念，加強公務用車管理，倡導員工選擇公共交通辦理業務；本公司優先採購節水器具，對用水設備定期檢修，避免水資源浪費，並採用智能水表開展節水管理。

2022年12月，海通外灘金融廣場通過美國綠色建築委員會LEED金級認證，2023年3月，又獲WELL健康建築標準（源自美國的健康建築標準）鉑金級認證，充分彰顯本公司新總部大樓環境友好、綠色節能、舒適健康的建設理念。海通外灘金融廣場全部使用小於WELL標準VOC／甲醛值要求的建築材料，設計完全封閉的集中打印室，採購優於LEED標準40%的節水型器具，使用符合要求的節能型設備和LED節能燈具，配備自動化樓宇控制及電梯系統，有效減少能源損耗。園區還設置符合WELL V2水質要求的直飲水機、顯色指數超過90且符合照明要求的辦公燈光、聲學性能達到STC-30的隔聲門等，打造舒適、健康、環保的辦公環境。

第五節 環境與社會責任

綠色宣傳方面，本公司在官網、官微等線上陣地開展專題宣傳，圍繞「雙碳」理論研究、綠色投融資、碳金融市場、綠色金融創新等方面的有益實踐選題策劃，積極展示本公司在ESG領域的工作成果。本公司融合珍惜紙張、節約糧食、節能減排、用房管理等主題，在新總部園區、張江科技園開展「以儉修身」主題宣傳活動，倡導綠色辦公、綠色生活新風尚；開發設計海通家園環保文創產品，弘揚綠色理念，發揚環保之光。

綠色辦公方面，本公司借助協同辦公系統、RPA智能流程自動化機器人、智能審核系統等搭建信息化、無紙化辦公模式，大量減少廢紙張和其他廢棄物的產生。

2. 綠色金融

綠色融資方面，報告期內，本公司承銷發行綠色債券23支，融資規模合計人民幣1,032億元；通過綠色股權融資服務錦浪能源、晶科科技、新日股份、能輝科技等綠色企業，募集資金人民幣73億元。

綠色投資方面，報告期內，本公司正式發佈「中證海通證券ESG股債聯動策略指數」，為踐行綠色金融理念提供良好投資工具，該指數作為行業首條ESG策略指數，是場外衍生品市場和ESG理念有機結合的代表性成果，更是資本市場服務「雙碳」目標、推動可持續投資實踐的重要工具和載體；本公司通過二級市場認購中國華電、華夏銀行、武漢地鐵、中廣核風電等企業的綠色中期票據、綠色債券，用於支持綠色產業項目。截至報告期末，海富通碳中和主題基金總規模達8.3億元，富國中證上海環交所碳中和ETF規模達人民幣12億元。

第五節 環境與社會責任

綠色研究諮詢方面，報告期內，本公司向中國人民銀行上海總部申報的《發展碳金融，完善碳交易市場風險管理功能》課題榮獲「2022年度上海經濟金融調研機制優秀調研成果綜合獎」三等獎。該課題針對國內碳市場定價機制、產品體系、金融屬性、市場功能等進行分析，提出多項發展建議；本公司參與上海財經大學國際金融中心研究院關於「構建基於ESG的中小企業低碳轉型投融資多方協同平台的對策研究」課題徵集活動，目前已完成開題計劃。

綠色金融行業交流方面，2023年3月，為深化海通綠色「雙碳」與新經濟產融生態圈，子公司海通恒信在西安舉辦綠色「雙碳」暨新經濟合作夥伴發展研討會；2023年6月，本公司參加首屆上海國際碳中和博覽會，分享本公司在綠色金融創新及「雙碳」方面做出的探索與實踐。本公司《服務「雙碳」戰略創新綠色發展路徑》案例入選上海市國有資產監督管理委員會系統社會責任工作「十佳案例」。

（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，本公司通過綠色辦公、低碳數據中心運營、低碳出行等方式持續開展節能工作，以減少運營過程中的碳排放。

本公司秉承綠色發展理念，推進綠色數據中心建設，成為業內首家使用光伏能源並順利投產的證券公司。海通證券張江科技園光伏項目（一期）於2022年12月投產，本公司自有資金投資人民幣41.5萬元，實施64.3kW裝機容量的光伏系統安裝，應用於張江科技園DTE機房精密空調及機房走道照明、空調系統，建成至今，根據電表測試，已發電2.79萬千瓦時，年節能實物量2.79萬度電，折合年節能量11.16噸標準煤。

第五節 環境與社會責任

二、 鞏固拓展脱貧攻堅成果、鄉村振興等工作具體情況

2023年上半年，在中國證監會、上海市委、市政府的正確領導下，海通證券持續開展「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、新疆葉城等五個脱貧縣鞏固脱貧攻堅成果，積極開展援疆援藏援青工作，努力解決幫扶地區群眾實際問題，助力幫扶地區發展振興。

（一） 堅持項目導向，深入開展結對幫扶支援工作

本公司以項目建設為導向，依託分支機構，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，投入專項資金助力結對幫扶縣經濟發展。2023年上半年，本公司與雲南西疇縣人民政府開展結對幫扶座談交流會，深入了解幫扶項目開展情況，精準對接需求，進一步細化幫扶舉措；面向新疆葉城開展「愛在海通•助力成長」推普及學前教師賦能提升公益項目，覆蓋全縣600餘名幼兒園園長、幼師，助力當地提升教學水平。安徽分公司召開結對幫扶工作交流座談會，立足金融幫扶、智力幫扶、產業幫扶、公益幫扶等方面，與利辛縣進一步深化合作；舉辦「強化精準服務助推企業發展」資本市場公益投教活動，組織海通專家為舒城縣相關領導、全縣規模以上工業企業負責人及高新技術企業人員共計150餘人詳細介紹多層次資本市場體系，深刻解讀資本市場的新形勢、新政策以及全面實行股票發行註冊制下創業板股票的上市規則等，為當地經濟發展提供智力支持。

第五節 環境與社會責任

（二） 發揮專業優勢，賦能幫扶地區經濟發展

2023年3月，本公司在去年助力江西省寧都縣城市發展投資有限公司發行第一期公司債的基礎上，成功發行第二期寧都縣城市發展投資有限公司公司債券，募集資金人民幣4億元，用於現代農業重點項目建設，持續助力寧都縣三農產業結構升級。此外，本公司還投入人民幣30萬元，依託子公司海通期貨業務優勢，在貴州印江開展「愛在海通共期美好」生豬「保險+期貨」項目，幫助農戶規避生豬價格波動風險、保障收益。

（三） 消費助力，將幫扶工作融入企業文化建設

本公司通過上海市消費幫扶渠道採購雲南省特色滇紅茶、咖啡以及手工藝品雲南斑銅祥瑞牛等作為公司禮品，傳遞「愛在海通」公益品牌理念。子公司海通期貨充分發揮工會優勢，採購結對幫扶地區黑龍江樺川縣、新疆葉城縣等地農副產品，助力當地農戶增收。

（四） 構建公益體系，傳遞「愛在海通」公益力量

本公司堅持以「愛在海通」黨建公益品牌為引領，廣泛凝聚愛心力量，以慈善公益助力鄉村振興。一是加強幫扶公益體系建設。持續推進設立「上海愛在海通公益基金會」（以下簡稱「基金會」），召開基金會第一屆理事會、監事會第一次會議，進一步健全基金會辦事機構。二是認真落實「愛在海通」公益清單。持續推進「愛在海通•美麗新疆」「愛在海通•美麗西藏」助學公益項目；結合習近平總書記給《共產黨宣言》展示館黨員志願者回信三周年，支持開展《望道》電影全國公益展映項目，激勵廣大黨員幹部在學思踐悟中堅定理想信念、在奮發有為中踐行初心使命；攜手嘉定區委區政府面向青海省果洛藏族自治州久治縣開展文化幫扶，打造「海通久音三交活動服務中心」項目，進一步彰顯公司主動服務國家鄉村振興戰

第五節 環境與社會責任

略、參與上海對口支援幫扶工作的使命擔當；參與開展「同圓中國夢平安校園行」安全防護包捐贈項目，助力培養青少年公共安全意識和自護自救應變能力。本公司還應邀參加第二屆中國資本市場公益論壇，分享展示公司幫扶公益工作成果，參加上海市合作交流辦、上海人民廣播電台長三角之聲《情義東方》欄目合作推出的《公益半月談》專題節目，分享「海通•愛朗讀」第四季——「童聲無界」活動組織情況，號召更多社會力量投身公益工作，助力鄉村振興。此外，各子公司、分支機構結合「學習二十大志願新徵程」主題活動，圍繞公益投教、低碳環保、社區服務等方面開展志願公益和捐贈幫扶行動，展現了「愛在海通」公益合力。

下一步，本公司將繼續深入貫徹黨中央關於鞏固脱貧攻堅成果和全面推進鄉村振興的重要指示精神，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。**一是**進一步深化結對幫扶工作機制，不斷完善「五位一體」幫扶模式，立足新發展階段，以更精準的幫扶措施，繼續助力幫扶地區實現可持續發展。**二是**持續發揮專業優勢，精準對接幫扶地區企業融資需求，為幫扶地區提供多渠道、多品種的金融服務。**三是**以設立「上海愛在海通公益基金會」為契機，進一步加強志願者隊伍建設，豐富拓展「海通•愛」系列公益項目，重點關注結對幫扶地區、革命老區和雲南、新疆、西藏等邊疆民族地區，持續在慈善公益領域發力，傳遞海通溫度，擦亮「愛在海通」公益品牌。

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	是否有履行期限	是否及時嚴格履行	如未能及時履行應說明未完成履行的具體原因	如未能及時履行應說明下一步計劃
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48個月	是	是	-	-
	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本公司利益；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鈎；5.若本公司後續推出本公司重要交易和事項政策，承諾擬公布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鈎	作為本公司董事、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、 中期報告審計情況

✓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（簡稱南一農公司）拒絕依約履行股票質押購回義務，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（簡稱紅太陽集團）、南京世界村汽車動力有限公司（簡稱南京世界村）承擔保證責任。2020年5月，上海金融法院受理本案，於2020年11月12日開庭審理。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，南一農公司被南京市高淳區人民法院裁定破產重整，本公司向南一農破產重整項目管理人申報債權。2022年6月1日，南京市高淳區人民法院出具《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（以下稱南一農公司等四家公司）進行實質合併重整。2022年11月7日，南京市中級人民法院決定對ST紅太陽啟動預重整程序。2023年6月30日，南一農公司等四家公司實質合併重整管理人向南京市高淳區人民法院提交重整計劃草案，並計劃安排召開債權人大會表決。2023年7月28日，南京市高淳區人民法院裁定同意延期表決。

第六節 重要事項

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，要求債務人南一農公司支付本金人民幣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，上海金融法院受理本案，於2020年8月7日開庭審理。2020年12月31日，上海金融法院作出一審判決，支持海通資管的訴訟請求。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於2021年6月23日作出終審判決，維持原判。2021年6月，南一農公司被南京市高淳區人民法院裁定破產重整，海通資管已代表資管計劃向南一農破產重整項目管理人申報債權。2022年6月1日，南京市高淳區人民法院出具《民事裁定書》，裁定對南一農公司等四家公司進行實質合併重整。2022年11月7日，南京市中級人民法院決定對ST紅太陽啟動預重整程序。2023年6月30日，南一農公司等四家公司實質合併重整管理人向南京市高淳區人民法院提交重整計劃草案，並計劃安排召開債權人大會表決。2023年7月28日，南京市高淳區人民法院裁定同意延期表決。

四川信託與海通資管、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（簡稱四川信託）向四川省成都市中級人民法院起訴，要求海通資管、公司等被告返還或賠償原告四川信託委託財產51,455萬元及相應利息。2021年9月，四川省成都市中級人民法院受理本案，於2022年11月10日、2023年7月10日開庭審理。目前法院尚未作出一審判決。

第六節 重要事項

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（簡稱郵儲銀行）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（簡稱富誠海富通）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，上海金融法院受理本案。2023年4月14日，上海金融法院作出一審判決。目前，原告郵儲銀行及富誠海富通等被告已向上海市高級人民法院提起上訴。

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，中國國際經濟貿易仲裁委員會受理本案，於2023年8月3日開庭審理。

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。

本公司境外上市子公司、海通銀行的重大訴訟、仲裁事宜由其按照所在地的監管規則和相關上市規則（如涉及）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：

2023年5月，本公司收到上海證監局出具的《關於對海通證券股份有限公司採取出具警示函措施的決定》（滬證監決[2023]95號），被採取出具警示函的行政監管措施。該監管函件認定公司未嚴格規範有關從業人員的執業行為等。本公司收到該監管函件後，高度重視，及時進行整改，完善制度建設，健全內控機制，加強合規培訓及合規檢查力度，提升員工合規意識及執業水平。

2023年6月，本公司收到上海證券交易所出具的《關於對海通證券股份有限公司予以監管警示的決定》（[2023]26號），被予以監管警示。該書面函件認定公司在保薦工作中，核查工作履職盡責不到位、內部質量控制存在薄弱環節。本公司收到該監管函件後，高度重視，及時進行整改，加強項目內控審核及跟蹤管理，定期組織開展專項培訓，督導員工勤勉盡責，夯實工作底稿，切實提高執業水平。

第六節 重要事項

九、 報告期內公司及其控股股東、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

1、 已在臨時公告披露且後續實施無進展或變化的事項

✓不適用

2、 已在臨時公告披露，但有後續實施的進展或變化的事項

✓不適用

3、 臨時公告未披露的事項

✓不適用

4、 日常關聯／連交易

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。

第六節 重要事項

報告期內，本公司嚴格按照2022年股東周年大會審議通過的《關於預計公司2023年度日常關聯／連交易的議案》，開展日常關聯／連交易。

本章節所載關聯／連交易的披露係依據《上交所上市規則》與香港上市規則規定，與財務報表附註中的關聯交易數額（依據企業會計準則編制）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，唯本公司與上海国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2022年12月30日的持續關連交易公告。除上述關連交易及本報告披露外，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性關連交易*

  茲提述本公司日期為2022年12月30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，國盛集團及其連絡人直接及間接持有本公司10.38%權益。依據香港上市規則14A.07條，國盛集團及其連絡人構成本公司於香港上市規則下之關連人士。本公司與上海國盛集團於2022年12月30日訂立持續關連交易框架協議，期限為自2023年1月1日起至2026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連絡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	2023年度預計交易上限	截至2023年6月30日止六個月實際發生金額
證券及金融產品交易		
流入(1)	250,000.00	4,363.60
流出(2)	210,000.00	–
證券及金融服務		
本集團向國盛集團及其聯繫人提供證券和金融服務收取的收入總額	10,000.00	366.16
本集團接受國盛集團及其聯繫人提供證券和金融服務產生的支出總額	3,000.00	147.22

(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2023年6月30日止六個月發生金額	佔同類交易金額的比例	備註
手續費及佣金淨收入	83.14	0.02%	向關聯方收取的資產管理業務收入
手續費及佣金淨收入	30.62	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	34.49	0.02%	關聯人保證金產生的利息淨收入
衍生金融工具交易淨損益（註）	-265.94	-0.22%	報告期內，名義本金發生金額人民幣0.57億元，期末名義本金餘額人民幣0.45億元。

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，虧損以負值列示。

單位：萬元 幣種：人民幣

往來項目	於2023年6月30日餘額	佔同類交易金額的比例	備註
應收款項	66.01	0.01%	應向關聯人收取的各項服務手續費餘額
代理買賣證券款	0.02	0.00%	關聯人存放本公司的客戶保證金餘額
應付款項	5,824.03	0.43%	本公司應付關聯人衍生金融工具保證金餘額
衍生金融資產	83.96	0.04%	與關聯人開展衍生品交易產生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	2023年6月30日止六個月發生金額	佔同類交易金額的比例	備註
手續費及佣金淨收入	9,041.77	1.83%	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	895.62	0.18%	向關聯人收取的證券交易手續費及佣金收入
利息淨收入	24.09	0.01%	關聯人保證金產生的利息淨收入
衍生金融工具交易淨損益（註）	316.34	0.27%	報告期內，名義本金發生金額人民幣526.61億元，期末名義本金餘額人民幣177.72億元。

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，虧損以負值列示。

第六節 重要事項

單位：萬元 幣種：人民幣

往來項目	於2023年6月30日餘額	佔同類交易金額的比例	備註
應收款項	964.13	0.10%	應收關聯人業務報酬及預付業務保證金餘額等
應付款項	0.45	0.00%	應付關聯人業務服務費及待付業務保證金餘額
代理買賣證券款	5,482.42	0.05%	關聯人存放本公司的客戶保證金餘額
衍生金融資產	981.65	0.51%	與關聯人開展衍生品交易產生的衍生金融資產餘額
衍生金融負債	585.67	0.45%	與關聯人開展衍生品交易產生的衍生金融負債餘額
交易性金融負債	8.70	0.00%	與關聯人開展衍生品交易產生的交易性金融負債餘額

另外，部分證券公司等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142.37億元。

（二） 資產收購或股權收購、出售發生的關聯交易

1、 已在臨時公告披露且後續實施無進展或變化的事項

✓不適用

2、 已在臨時公告披露，但有後續實施的進展或變化的事項

✓不適用

3、 臨時公告未披露的事項

✓不適用

第六節 重要事項

4、 涉及業績約定的，應當披露報告期內的業績實現情況

✓不適用

（三） 共同對外投資的重大關聯交易

1、 已在臨時公告披露且後續實施無進展或變化的事項

✓不適用

2、 已在臨時公告披露，但有後續實施的進展或變化的事項

✓不適用

3、 臨時公告未披露的事項

✓不適用

（四） 關聯債權債務往來

1、 已在臨時公告披露且後續實施無進展或變化的事項

✓不適用

2、 已在臨時公告披露，但有後續實施的進展或變化的事項

✓不適用

3、 臨時公告未披露的事項

✓不適用

（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

✓不適用

（六） 其他重大關聯交易

✓不適用

第六節 重要事項

（七） 其他

1. 《香港上市規則》項下的關連交易

茲提述本公司日期為2023年6月21日關於成立合夥企業的關連交易公告。海通開元投資有限公司（「**海通開元**」，本公司之全資附屬公司）與上海國盛（集團）有限公司（「**國盛集團**」）及其他獨立第三方簽訂合夥協議，共同發起成立上海海通引領區產業引導母基金合夥企業（有限合夥）（「**合夥企業**」）。合夥企業將以有限合夥企業的形式成立。根據合夥協議，海通開元（作為普通合夥人）、國盛集團（作為有限合夥人）及其他獨立第三方（作為有限合夥人）各自應分別認繳出資人民幣1,300百萬元、人民幣800百萬元及人民幣1,900百萬元。根據合夥協議，海通開元擔任基金管理人，為合夥企業提供投資管理及其他服務，而合夥企業應向海通開元支付基金管理費。合夥企業將主要投資於集成電路、生物醫藥、人工智能、先進製造、金融科技等領域及其他浦東新區主導的戰略新興產業。合夥企業將不會作為本公司附屬公司入賬，其財務業績亦不會併入本公司。

於本報告日期，國盛集團為本公司之主要股東，直接或間接持有本公司全部已發行股本約10.38%。國盛資本由國盛集團持有約30%股權及上海國有資本運營研究院由國盛集團持有約37%股權。因此，國盛資本及上海國有資本運營研究院為國盛集團之聯繫人，且彼等均為上市規則第14A章項下本公司之關連人士。因此，根據上市規則第14A章，合夥協議項下擬進行之交易構成本公司之關連交易。

由於本次交易之最高適用百分比率高於0.1%但低於5%，本次交易須遵守上市規則第14A章項下申報及公告之規定，惟獲豁免遵守通函（包括獨立財務意見）及獨立股東批准之規定。

第六節 重要事項

十一、重大合同及其履行情況

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	6,800,000,000
報告期末對子公司擔保餘額合計(B)	21,587,773,400
本公司擔保總額情況（包括對子公司的擔保）	
擔保總額(A+B)	21,587,773,400
擔保總額佔本公司淨資產的比例(%)	12.00
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)	18,587,773,400
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)	18,587,773,400
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. 2022年10月28日，本公司召開第七屆董事會第三十三次會議，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國際控股有限公司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10億美元債務融資本金（含10億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7年（含7年）。

   本公司於2023年4月20日簽署《擔保協議》，為公司境外全資附屬公司Haitong International Finance Holdings Limited發行金額為40億元人民幣、於2026年到期的債券提供連帶責任保證擔保。

   本公司於2023年5月18日簽署《擔保協議》，為本公司境外全資附屬公司Haitong International Finance Holdings Limited發行金額為28億元人民幣、於2026年到期的債券提供連帶責任保證擔保。

第六節　重要事項

2. 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。

第六節 重要事項

3. 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。截止2023年6月30日，本公司的該項擔保責任餘額為2.25億歐元。

第六節 重要事項

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》，同意本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》，為本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。

第六節 重要事項

5. 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人民幣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）。

第六節 重要事項

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）。截至2023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52,001,841歐元，按2023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7.8771元換算，合計為人民幣409,623,702元。報告期末對外擔保餘額合計（不包括對子公司的擔保）為171,629,284歐元，按2023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7.8771元換算，合計為人民幣1,351,941,035元。

報告期內子公司海通國際對內提供債務融資擔保，擔保限額按2023年6月30日中國外匯交易中心公布的人民幣匯率中間價公告1港元對人民幣0.92198元、1美元對人民幣7.2258元、1新加坡元對人民幣5.3442元換算，合計為人民幣9,087,969,120元，截至報告期末，實際提貸的擔保餘額合計為人民幣503,516,000元。

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。

第六節 重要事項

十二、其他重大事項的說明

1. 海通國際控股參與海通國際供股計劃

2023年3月28日，本公司第七屆董事會第三十五次會議（臨時會議）審議通過了《關於海通國際控股有限公司參與海通國際證券集團有限公司供股的議案》，同意海通國際控股參與海通國際供股計劃，供股比例為每10股供3股。海通國際此次供股新發股份數量為1,796,460,483股，供股價為0.65港元／股，已發行股份總數由供股前的6,641,563,594股增加至8,438,024,077股，供股所得款項總額約為11.68億港元，供股所得款項淨額（經扣除供股的所有相關開支後）預期約為11.60億港元。海通國際控股在此次供股中的認購股份數目為1,683,199,833股，參與供股金額約為10.94億港元，持有股份數目由供股前的4,510,666,113股增加至6,193,865,946股，持股比例由供股前的67.92%增加至73.40%。

2. 為境外子公司境外債務融資提供維好支持額度

2023年3月30日，本公司第七屆董事會第三十六次會議審議通過了《關於為境外子公司境外債務融資提供維好支持額度的議案》，同意公司為境外全資子公司海通國際控股、境外控股子公司海通國際及上述兩個主體的全資附屬公司境外債務融資提供不超過160億（含）港幣（或等值幣種）的維好支持額度，維好期限不超過5年（含）。

3. 向海通期貨及其全資子公司提供借款

2023年4月28日，本公司第七屆董事會第三十七次會議審議通過了《關於向子公司提供借款的議案》，同意本公司向海通期貨及其全資子公司提供借款。

第六節 重要事項

4. 完成恒信金融集團股權架構調整

2021年11月30日，本公司第七屆董事會第二十一次會議審議通過了《關於調整海通恒信金融集團有限公司股權架構的議案》，擬將恒信金融集團由全資二級子公司變更為全資一級子公司。2023年8月17日，股權轉讓事項經香港稅務局審核後正式生效，恒信金融集團於當日同步完成股東名冊變更，恒信金融集團已由公司直接全資持有。

十三、報告期後事項

除本報告之合併財務報表附註66所載者外，於2023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2023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、 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	報告期解除限售股數	報告期增加限售股數	報告期末限售股數	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
合計	781,250,000	0	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） 263,998（其中A股263,851；H股147）

（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

前十名股東持股情況

股東名稱（全稱）	報告期內增減	期末持股數量	比例(%)	持有有限售條件股份數量	質押、標記或凍結情況 股份狀態	數量	股東性質
香港中央結算（代理人）有限公司	-16,000	3,408,714,695	26.09	0	未知	–	境外法人
上海國盛（集團）有限公司	–	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	–	635,084,623	4.86	0	無	0	國有法人
光明食品（集團）有限公司	5,560,000	480,275,000	3.68	0	無	0	國有法人
上海電氣控股集團有限公司	-260,000	344,236,418	2.63	0	無	0	國家
申能（集團）有限公司	–	322,162,086	2.47	0	無	0	國有法人
中國證券金融股份有限公司	–	258,104,024	1.98	0	無	0	其他
上海國盛集團資產有限公司	–	238,382,008	1.82	0	無	0	國有法人
上海久事（集團）有限公司	–	235,247,280	1.80	0	無	0	國有法人
中國建設銀行股份有限公司－國泰中證全指證券公司交易型開放式指數證券投資基金	15,852,069	216,632,400	1.66	0	無	0	其他

第七節 股份變動及股東情況

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	3,408,714,695	境外上市外資股	3,408,714,695
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	344,236,418	人民幣普通股	344,236,418
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
中國建設銀行股份有限公司－國泰中證全指證券公司交易型開放式指數證券投資基金	216,632,400	人民幣普通股	216,632,400
上海百聯集團股份有限公司	214,471,652	人民幣普通股	214,471,652
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、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）有限公司的全資子公司，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。

第七節 股份變動及股東情況

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。

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，佔本公司總股本的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64,689.88萬股，佔本公司總股本的4.95%。

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

			有限售條件股份可上市交易情況		限售條件
序號	有限售條件股東名稱	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		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、2022年2月7日限售期屆滿並解禁，具體內容詳見2021年1月29日、2022年1月21日本公司於上交所網站披露的《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股，有限售條件的流通股為781,250,000股。			無

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2023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	持有的股份數目（股）	佔本公司已發行股份總數的比例(%)	佔本公司已發行A股／H股總數的比例(%)	好倉*(註3)*／淡倉*(註4)*／可供借出的股份
1.	Maunakai Capital Partners (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 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*(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法團的權益*(註2)*	307,409,200	2.35	9.02	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。

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。

第七節 股份變動及股東情況

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2023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2023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） 其他説明

✓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%，本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	投資者適當性安排(如有)	交易機制	是否存在終止上市交易的風險
2013年公司債券(第一期)(10年期)	13海通03	122282	2013/11/25	2013/11/25	2023/11/25	23.9	6.18	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)(10年期)	13海通06	122313	2014/7/14	2014/7/14	2024/7/14	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
面向專業投公開發行2020年公司債券(第一期)(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2020年公司債券(第三期)	20海通08	163903	2020/8/10	2020/8/11	2023/8/11	-	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
面向專業投資者公開發行2021年公司債券(第一期)	21海通01	175630	2021/1/12	2021/1/13	2024/1/13	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

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	投資者適當性安排(如有)	交易機制	是否存在終止上市交易的風險
面向專業投資者公開發行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
面向專業投資者公開發行2021年公司債券(第五期)	21海通05	188202	2021/6/9	2021/6/10	2024/6/10	21	3.40	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2021年公司債券(第六期)(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、詢價和協議交易	否
面向專業投資者公開發行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、詢價和協議交易	否
面向專業投資者公開發行2021年公司債券(第八期)(品種一)	21海通08	188663	2021/8/27	2021/8/30	2024/8/30	20	3.10	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2021年公司債券(第八期)(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、詢價和協議交易	否
面向專業投資者公開發行2021年公司債券(第九期)	21海通10	188962	2021/11/9	2021/11/10	2024/11/10	50	3.10	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、詢價和協議交易	否
2022年面向專業投資者公開發行次級債券(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	投資者適當性安排(如有)	交易機制	是否存在終止上市交易的風險
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	2.90	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
2022年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第五期)	22海通05	137799	2022/9/8	2022/9/9	2025/9/9	50	2.53	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
2022年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第六期)	22海通06	137904	2022/10/13	2022/10/14	2025/10/14	47	2.60	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年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第七期)	22海通07	138571	2022/11/9	2022/11/10	2025/11/10	30	2.61	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年面向專業機構投資者公開發行綠色公司債券(專項用於碳中和)(第一期)	GC海通01	138623	2022/12/12	2022/12/13	2023/12/20	27	2.90	到期一次還本付息	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	交易場所	投資者適當性安排(如有)	交易機制	是否存在終止上市交易的風險
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第一期)(品種一)	23海通01	138869	2023/2/7	2023/2/8	2025/2/8	25	2.95	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
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第一期)(品種二)	23海通02	138870	2023/2/7	2023/2/8	2026/2/8	30	3.23	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
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第二期)(品種一)	23海通03	115003	2023/3/3	2023/3/6	2025/3/6	25	3.11	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
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第二期)(品種二)	23海通04	115004	2023/3/3	2023/3/6	2026/3/6	17	3.26	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
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第三期)(品種一)	23海通05	115104	2023/3/21	2023/3/22	2025/3/22	33	2.97	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
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第三期)(品種二)	23海通06	115105	2023/3/21	2023/3/22	2026/3/22	27	3.10	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
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第四期)(品種一)	23海通07	115272	2023/4/21	2023/4/24	2025/4/24	20	2.89	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
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第四期)(品種二)	23海通08	115273	2023/4/21	2023/4/24	2026/4/24	40	3.05	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	交易場所	投資者適當性安排(如有)	交易機制	是否存在終止上市交易的風險
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第五期)(品種一)	23海通09	115362	2023/5/17	2023/5/18	2026/5/18	36	2.94	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
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第五期)(品種二)	23海通10	115363	2023/5/17	2023/5/18	2028/5/18	14	3.10	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
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第六期)(品種一)	23海通11	115487	2023/6/14	2023/6/15	2026/6/15	30	2.73	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
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第六期)(品種二)	23海通12	115488	2023/6/14	2023/6/15	2028/6/15	20	3.07	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
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第七期)(品種一)	23海通13	115618	2023/7/24	2023/7/25	2026/7/25	20	2.72	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
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第七期)(品種二)	23海通14	115619	2023/7/24	2023/7/25	2028/7/25	27	3.05	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
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券(第八期)	23海通15	155828	2023/8/17	2023/8/18	2026/8/18	32	2.67	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

報出日前，20海通08已兑付。

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。

逾期未償還債券

本公司不存在逾期未償還債券。

第九節 債券相關情況

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

其他說明

無。

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

✓適用 □不適用

現狀	執行情況	是否發生變更	變更後情況	變更原因	變更是否已取得有權機構批准	變更對債券投資者權益的影響
存續的本公司債券均為無擔保債券。	正常	否	–	–	–	–
嚴格按照債券募集説明書中有關償債計劃的約定履行兑付兑息職責。	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	–	–	–	–

其他說明

未發生變更。

第九節 債券相關情況

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
中信証券股份有限公司	北京市朝陽區亮馬橋路48號中信証券大廈22、23層	–	聶磊、祁繼華	010-60838888
中信建投証券股份有限公司	北京市東城區朝內大街2號凱恒中心B座2層	–	耿華	010-65608396
國信證券股份有限公司	北京市西城區金融大街興盛街6號國信證券大廈四層	–	郭睿、何俊賢	010-88005384
申萬宏源證券有限公司	上海市徐匯區長樂路989號45層	–	段亞平	021-33389706
普華永道中天會計師事務所（特殊普通合夥）	上海市黃埔區湖濱路202號領展企業廣場二座普華永道中心11樓	許康瑋、劉偉	許康瑋	021-23238888
德勤華永會計師事務所（特殊普通合夥）	上海市延安東路222號外灘中心21樓	胡小駿、宮明亮	胡小駿	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號上海中心大廈11、12層	–	肖文艷	021-20511000
中誠信國際信用評級有限責任公司	北京市東城區南竹杆胡同2號1幢60101	–	喬爽	010-66428877

上述中介機構發生變更的情況：

因債券到期兑付，中介機構比上年末減少兩家，係「主承銷商」興業證券股份有限公司和民生證券股份有限公司。

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	募集資金總金額	已使用金額	未使用金額	募集資金專項賬戶運作情況（如有）	募集資金違規使用的整改情況（如有）	是否與募集說明書承諾的用途、使用計劃及其他約定一致
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券（第一期）（品種一）	25	25	0	無	無	是
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券（第一期）（品種二）	30	30	0	無	無	是
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券（第二期）（品種一）	25	25	0	無	無	是
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券（第二期）（品種二）	17	17	0	無	無	是
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券（第三期）（品種一）	33	33	0	無	無	是
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券（第三期）（品種二）	27	27	0	無	無	是
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券（第四期）（品種一）	20	20	0	無	無	是
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券（第四期）（品種二）	40	40	0	無	無	是
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券（第五期）（品種一）	36	36	0	無	無	是
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券（第五期）（品種二）	14	14	0	無	無	是
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券（第六期）（品種一）	30	30	0	無	無	是
2023年面向專業機構投資者公開發行公司債券（第六期）（品種二）	20	20	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	兑付日期	還本付息方式	交易場所
金融債(境外)	海通證券4.5% 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 B2023	5483	2.3億歐元	3M EURIBOR +1.65	2018/12/13	2023/12/13	單利按季計息	香港聯交所

（四） 銀行間債券市場非金融企業債務融資工具

✓不適用

（五） 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

✓適用

單位：億元 幣種：人民幣

主要指標	本報告期末	上年度末	本報告期末比上年度末增減(%)	變動原因
流動比率	2.17	1.94	11.86	–
速動比率	2.17	1.94	11.86	–
資產負債率(%)	72.00	72.16	-0.22	–

	本報告期（1-6月）	上年同期	本報告期比上年同期增減(%)	變動原因
扣除非經常性損益後淨利潤	32.12	42.35	-24.14	–
EBITDA全部債務比	0.03	0.03	–	–
利息保障倍數	1.69	1.97	-14.21	–
現金利息保障倍數	-0.10	4.44	-102.25	經營活動產生的現金流量淨額減少
EBITDA利息保障倍數	1.80	2.09	-13.87	–
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2023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
2023年7月14日	關於同意海通證券股份有限公司向專業投資者公開發行短期公司債券註冊的批覆	中國證監會	證監許可[2023]1536號

二、監管部門對公司的分類結果

✓不適用

備查文件目錄

載有本公司法定代表人簽名的半年度報告文本

載有本公司法定代表人、主管會計工作負責人及會計機構負責人簽名蓋章的財務報告文本

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所有本公司文件的正本及公告原稿

其他有關資料

承董事會命
海通證券股份有限公司
董事長
周杰

中國上海
2023年8月30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132至212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」）於二零二三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，以及選定的解釋附註。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，二零二三年八月三十日

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

截至二零二三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 2023（未經審計）	2022（未經審計）
收入			
— 佣金及手續費收入	4	**6,462,063**	7,699,311
— 利息收入	5	**9,320,529**	8,258,455
— 融資租賃收入	5	**781,925**	1,280,942
— 投資收入及收益（淨額）	6	**3,286,842**	692,435
		19,851,359	17,931,143
其他收入及收益	7	**6,176,069**	1,933,688
收入、其他收入及收益總計		**26,027,428**	19,864,831
佣金及手續費支出	8	**(1,521,494)**	(1,558,630)
利息支出	9	**(7,918,051)**	(6,451,309)
折舊和攤銷費用	10	**(839,209)**	(754,583)
僱員成本		**(3,651,013)**	(3,488,369)
預期信用損失模式下的減值損失	11	**(1,203,824)**	(178,663)
其他資產減值損失		**(9,878)**	(25,911)
其他支出	12	**(6,112,006)**	(1,824,893)
支出總額		**(21,255,475)**	(14,282,358)
攤分聯營及合營企業業績		**479,771**	303,592
所得稅前利潤		**5,251,724**	5,886,065
所得稅費用	13	**(1,326,992)**	(1,420,704)
期間利潤		**3,924,732**	4,465,361
歸屬於：			
本公司股東		**3,829,635**	4,757,725
非控制性權益		**95,097**	(292,364)
		3,924,732	4,465,361
每股收益（以每股人民幣元列示）			
— 基本	14	**0.29**	0.36
— 稀釋	14	**0.29**	0.36

相應附註係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

截至二零二三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	
	2023（未經審計）	2022（未經審計）
本期間利潤	**3,924,732**	4,465,361
其他全面收益／（損失）：		
後續不能重分類至損益的項目：		
設定受益計劃的精算（損失）／收益	**(2,266)**	55,466
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公允價值變動收益／（損失）	**84,353**	(1,035,114)
所得稅影響	**(13,950)**	238,928
小計	**68,137**	(740,720)
後續或重分類至損益的項目：		
外幣折算產生的匯兑差額	**452,773**	760,242
指定為現金流量套期的套期工具公允價值變動收益	**54,803**	39,527
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公允價值變動收益／（損失）		
－期間公允價值變動淨額	**416,681**	62,933
－出售損益的重分類調整	**(86,912)**	(16,263)
－減值損失的重分類調整	**(40,469)**	(54,550)
－有關其他全面收益部分的所得稅	**(72,439)**	2,664
攤分聯營及合營企業的其他全面收益（稅後）	**2,986**	4,365
小計	**727,423**	798,918
本期其他全面收益（稅後）	**795,560**	58,198
本期全面收益總額	**4,720,292**	4,523,559
歸屬於：		
本公司股東	**4,381,613**	3,875,350
非控制性權益	**338,679**	648,209
	4,720,292	4,523,559
歸屬於股東的本期全面收益總額來自於：		
持續經營	**4,720,292**	4,523,559
終止經營	**–**	–
	4,720,292	4,523,559

相應附註係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

於二零二三年六月三十日

（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

	附註	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
非流動資產			
物業及設備	15	**16,915,180**	17,016,634
使用權資產	16	**1,732,299**	1,710,529
投資物業	17	**2,718,466**	2,641,590
商譽	18	**3,794,197**	3,676,231
其他無形資產	19	**584,410**	570,006
權益法項下投資	20	**7,298,898**	7,013,714
應收融資租賃款	21	**8,478,964**	7,102,583
售後回租安排的應收款	22	**47,157,535**	47,847,820
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	**7,468,696**	6,096,319
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	**40,563,105**	45,975,346
以攤餘成本計量的債務工具	25	**5,846,189**	5,437,086
以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產	26	**25,237,727**	25,043,377
買入返售金融資產	27	**1,010,702**	50,071
其他貸款及應收款項	28	**957,248**	2,518,564
客戶貸款	29	**6,165,616**	5,031,733
遞延稅項資產	30	**4,553,891**	4,711,680
交易所儲備及保證金	31	**170,743**	199,937
受限制銀行存款	32	**1,845,186**	1,769,482
其他非流動資產	34	**3,000,937**	3,101,022
非流動資產總額		**185,499,989**	187,513,724

中期簡明綜合財務狀況表

於二零二三年六月三十日

（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

	附註	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
流動資產			
孖展融資客戶墊款	35	**66,419,988**	67,843,871
應收賬款	36	**9,988,638**	10,394,515
應收融資租賃款	21	**9,518,249**	12,355,870
售後回租安排的應收款	22	**40,012,579**	36,702,132
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	**5,489,647**	6,876,553
以攤餘成本計量的債務工具	25	**1,724,723**	369,071
以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產	26	**183,699,683**	184,555,352
衍生金融資產	37	**1,932,425**	1,477,167
買入返售金融資產	27	**40,093,887**	32,595,078
其他貸款及應收款項	28	**5,195,743**	4,209,604
客戶貸款	29	**734,510**	837,281
其他流動資產	38	**6,148,343**	6,748,623
拆出資金		**65,128**	274,445
交易所儲備及保證金	31	**21,496,741**	22,664,637
結算備付金	39	**18,566,287**	21,380,695
存放中央銀行款項	40	**2,049,935**	3,245,096
存放同業	40	**134,689**	172,872
銀行結餘及現金	32	**163,620,481**	153,392,719
流動資產總額		**576,891,676**	566,095,581
資產總額		**762,391,665**	753,609,305

中期簡明綜合財務狀況表

於二零二三年六月三十日
（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

	附註	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
流動負債			
借款	*41*	**60,362,034**	56,864,912
應付短期融資款	*42*	**12,985,280**	16,159,094
應付債券	*43*	**62,423,349**	60,153,220
應付經紀業務客戶賬款	*44*	**119,909,488**	115,513,463
客戶存款	*45*	**4,282,383**	3,784,565
合同負債		**107,696**	25,969
其他應付款項及預計費用	*46*	**25,637,420**	21,262,810
租賃負債	*16*	**293,723**	279,881
預計負債	*47*	**209,498**	201,705
所得稅負債		**700,305**	1,729,485
以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債	*48*	**11,543,496**	5,478,358
衍生金融負債	*37*	**1,305,591**	898,419
賣出回購金融資產款	*49*	**82,423,177**	101,694,357
拆入資金	*50*	**6,957,129**	3,218,363
向中央銀行借款		**583,100**	2,133,219
流動負債總額		**389,723,669**	389,397,820
流動資產淨額		**187,168,007**	176,697,761
資產總額減流動負債		**372,667,996**	364,211,485

中期簡明綜合財務狀況表

於二零二三年六月三十日
（除另有標明外，所有金額均以人民幣千元列示）

	附註	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
非流動負債			
長期應付款	51	**5,282,205**	5,508,164
遞延稅項負債	30	**1,016,601**	909,459
客戶存款	45	**1,179,980**	1,533,910
長期借款	41	**26,509,829**	33,951,333
應付債券	43	**142,781,097**	121,677,698
向中央銀行借款		**88,090**	81,911
其他應付款項及預計費用	46	**1,498,885**	1,723,273
賣出回購金融資產款	49	**643,468**	–
以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債	48	**10,977,761**	17,410,122
租賃負債	16	**755,785**	735,819
拆入資金	50	**2,065,763**	3,057,738
非流動負債總額		**192,799,464**	186,589,427
負債總額		**582,523,133**	575,987,247
權益			
股本	52	**13,064,200**	13,064,200
資本公積		**75,809,659**	75,007,559
投資重估儲備	53	**(265,194)**	(624,143)
外幣報表折算儲備		**(765,906)**	(993,170)
一般儲備	54	**31,491,332**	31,438,374
未分配利潤	54	**47,685,544**	46,699,137
歸屬於本公司股東權益		**167,019,635**	164,591,957
非控制性權益		**12,848,897**	13,030,101
權益總額		**179,868,532**	177,622,058
權益及負債總額		**762,391,665**	753,609,305

相應附註係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2023年8月30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	李軍	張信軍
董事長	*執行董事及總經理*	*首席財務官*

中期簡明綜合權益變動表

截至二零二三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（附註）	投資重估儲備	外幣報表折算儲備	一般儲備	未分配利潤	合計	非控制性權益	權益總額
（未經審計）									
於2022年12月31日	13,064,200	75,007,559	(624,143)	(993,170)	31,438,374	46,699,137	164,591,957	13,030,101	177,622,058
本期間利潤	-	-	-	-	-	3,829,635	3,829,635	95,097	3,924,732
本期間其他全面收益	-	-	324,714	227,264	-	-	551,978	243,582	795,560
本期間全面收益總額	-	-	324,714	227,264	-	3,829,635	4,381,613	338,679	4,720,292
子公司供股配發的股份	-	801,557	-	-	-	-	801,557	(738,821)	62,736
子公司發行的其他權益工具	-	-	-	-	-	-	-	480,000	480,000
劃撥至一般儲備	-	-	-	-	52,958	(52,958)	-	-	-
確認為分派的現金股利（附註58）	-	-	-	-	-	(2,743,482)	(2,743,482)	-	(2,743,482)
向非控制性權益方和其他權益工具持有者分派股利	-	-	-	-	-	-	-	(278,200)	(278,200)
子公司股份支付	-	543	-	-	-	-	543	4,755	5,298
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	-	-	34,235	-	-	(34,235)	-	-	-
非控制性權益變動	-	-	-	-	-	-	-	1,566	1,566
其他	-	-	-	-	-	(12,553)	(12,553)	10,817	(1,736)
於2023年6月30日	13,064,200	75,809,659	(265,194)	(765,906)	31,491,332	47,685,544	167,019,635	12,848,897	179,868,532

中期簡明綜合權益變動表

截至二零二三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（附註）	投資重估儲備	外幣報表折算儲備	一般儲備	未分配利潤	合計	非控制性權益	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
本期間全面收益／(損失)總額	–	–	(640,411)	(241,964)	–	4,757,725	3,875,350	648,209	4,523,559
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

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。

相應附註係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

截至二零二三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	
	2023	2022
	（未經審計）	（未經審計）
經營活動		
所得稅前利潤	**5,251,724**	5,886,065
就下列各項作出調整：		
利息支出	**7,918,051**	6,451,309
攤分聯營合營企業業績	**(479,771)**	(303,592)
折舊及攤銷費用	**839,209**	754,583
預期信用損失模式下的減值損失	**1,203,824**	178,663
其他資產減值損失計提	**9,878**	25,911
子公司權益結算的股份支付確認的費用	**5,298**	(32,903)
處置物業、設備及其它無形資產的損失	**7,677**	652
匯兑損失淨額	**205,420**	297,910
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	**(871,432)**	(665,732)
以攤餘成本計量的債務工具的利息收入	**(115,835)**	(50,015)
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	**(67,285)**	(68,037)
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已實現收益淨額	**(135,550)**	(33,523)
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收益淨額	**(69,281)**	(220,143)
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	**(48,517)**	(1,358,310)
營運資金變動前的營運現金流量	**13,653,410**	10,862,838

中期簡明綜合現金流量表

截至二零二三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	
	2023	2022
	（未經審計）	（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	**(1,764,185)**	(5,767,145)
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	**1,898,180**	18,449,870
買入返售金融資產增加	**(8,513,832)**	(2,734,982)
其他貸款及應收款減少	**295,092**	7,662,084
客戶貸款增加	**(1,041,152)**	(635,682)
客戶墊款減少	**1,094,424**	5,210,668
應收賬款及其他流動資產減少	**732,451**	3,523,309
拆出資金減少	**209,258**	272,229
交易所保證金減少／(增加)	**1,197,090**	(2,387,543)
存放中央銀行款項(增加)／減少	**(957)**	5,650
受限制的銀行存款減少	**142,643**	85,588
代客戶持有的現金增加	**(2,564,217)**	(6,395,573)
應付經紀業務客戶款項及其他應付款項及預計費用增加	**4,357,816**	420,289
客戶存款增加	**143,888**	433,583
合同負債增加／(減少)	**81,727**	(130,777)
預計負債增加／(減少)	**7,792**	(17,702)
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(減少)／增加	**(1,333,813)**	2,820,403
賣出回購金融資產款減少	**(18,627,712)**	(10,344,468)
拆入資金增加／(減少)	**2,746,791**	(5,009,274)
向中央銀行借款減少	**(1,543,939)**	(71,159)
同業存款增加／(減少)	**34,911**	(57,279)
來自經營業務的現金	**(8,794,334)**	16,194,927
已付所得稅淨額	**(2,219,039)**	(3,274,447)
已付利息	**(2,293,038)**	(1,991,922)
(用於)／來自經營活動的現金淨額	**(13,306,411)**	10,928,558

中期簡明綜合現金流量表

截至二零二三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	
	2023	2022
	（未經審計）	（未經審計）
投資活動		
從聯營企業和其他投資收到的股利	**1,462**	403,573
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	**67,285**	68,037
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	**991,078**	564,267
購買物業、設備及其他無形資產	**(344,626)**	(1,852,868)
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	**2,850**	1,204
注資聯營企業和合營企業	**(135,000)**	(72,373)
部分處置聯營企業的所得款項	**42,251**	103,168
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	**(1,722,347)**	(1,511,170)
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	**(9,992,525)**	(14,360,041)
購買以攤餘成本計量的債務工具的現金流出	**(1,770,546)**	(1,133,406)
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	**(1,059,768)**	(1,220,454)
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	**516,237**	4,534,861
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	**17,514,961**	9,635,835
處置收回以攤餘成本計量的債務工具款項	**355,999**	318,535
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	**931,613**	1,943,205
來自／(用於)投資活動的現金淨額	**5,398,924**	(2,445,574)

中期簡明綜合現金流量表

截至二零二三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	
	2023	2022
	（未經審計）	（未經審計）
籌資活動		
借款、債券支付的利息及已付股利	**(5,400,176)**	(4,283,454)
吸收少數股東投資	**64,302**	–
少數股東收回投資款項	**–**	(406,543)
籌集借款所得款項	**42,526,736**	43,467,339
永續債支付的利息	**(60,279)**	(77,424)
短期融資券及非可轉換債券等發行費用	**(90,033)**	(92,731)
償還租賃負債的款項	**(183,106)**	(211,224)
償還借款、短期融資券及非可轉換債券等支付的款項	**(94,810,967)**	(87,529,796)
發行短期融資券及非可轉換債券等所得款項	**68,877,961**	56,850,897
為股權激勵計劃回購股份	**–**	(14,679)
來自籌資活動的現金淨額	**10,924,438**	7,702,385
現金及現金等價物增加淨額	**3,016,951**	16,185,369
外匯變動影響	**772,762**	405,189
期初的現金及現金等價物	**67,530,100**	57,705,067
期末的現金及現金等價物（附註33）	**71,319,813**	74,295,625

相應附註係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

截至二零二三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。

本公司註冊地址：中國上海市廣東路689號海通證券大廈，總部地址：中國上海市黃浦區中山南路888號海通外灘金融廣場。

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 編製基礎及會計政策

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製。

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，編製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製的2022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2022年度綜合財務報表和2022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

截至二零二三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 編製基礎及會計政策（續）

2.1 集團採用的新增及修訂標準

自2023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) 國際財務報告準則第17號：保險合同；
(b) 國際會計準則第1號和國際財務報告準則實務說明第2號（修訂）：會計政策的披露；
(c) 國際會計準則第8號（修訂）：會計估計的定義；
(d) 國際會計準則第12號（修訂）：與單一交易產生的資產和負債有關的遞延稅款

(a) 國際財務報告準則第17號：保險合同

替代國際財務報告準則第4號，國際財務報告準則第17號保險合同於2017年5月發行，要求採用當前計量模型，即每個報告期對估計進行重新計量。保險合同的計量採用以下模組：經折現的概率加權現金流量，顯性的風險調整，以及代表將在保險期內平均確認的合同未實現利潤的合同服務邊際。新的準則將會對發行具有自由參與性質的保險合同或者投資合同的主體的財務報表和關鍵績效指標產生影響。上述準則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1號和國際財務報告準則實務說明第2號（修訂）：會計政策的披露

國際會計準則理事會修訂了國際會計準則第1號，要求實體披露重要的而不是重大的會計政策。該修訂定義了什麼是「重要的會計政策信息」，並解釋了如何識別會計政策信息的重要性。他們進一步澄清不重要的會計政策信息不需要被披露。如果被披露，它不應該掩蓋重要的會計信息。

為了支持這一修訂，國際會計準則理事會還修訂了國際財務報告準則實務公告2－就重要性作出判斷，為如何將重要性概念應用於會計政策披露提供指導。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) 國際會計準則第8號（修訂）：會計估計的定義

對國際會計準則第8條會計政策、會計估計的變更和錯誤的修訂，澄清了公司應如何區分會計政策的變更和會計估計的變更。這種區分是很重要的，因為會計估計的變更是對未來的交易和其他未來的事件進行前瞻性的應用，而會計政策的變更一般是對過去的交易和其他過去的事件以及本期進行追溯性的應用。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

截至二零二三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 編製基礎及會計政策（續）

2.1 集團採用的新增及修訂標準（續）

(d) 國際會計準則第12號（修訂）：與單一交易產生的資產和負債有關的遞延稅款

國際會計準則第12號所得稅修正案要求公司確認那些在初始確認時產生等額的應稅和可扣減臨時性差異的交易的遞延稅款。它們通常適用於承租人的租賃和退役義務等交易，並要求確認額外的遞延稅款資產和負債。該修正案應適用於在最早呈現的比較期開始時或之後發生的交易。此外，實體應在最早的比較期開始時，確認與使用權資產和租賃負債以及退役、恢復和類似負債有關的所有可扣減和可徵稅的暫時性差異的遞延稅款資產（以其可能被利用為限）和遞延稅款負債，以及確認為相關資產成本一部分的相應金額。確認這些調整的累積影響在留存收益或權益的另一個組成部分中確認（如適用）。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

截至二零二三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 編製基礎及會計政策（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／之後的年度內生效
(a)	國際會計準則第1號（修訂）	帶有契約的非流動負債	2024年1月1日
(b)	國際財務報告準則第16號（修訂）	售後租回的租賃負債	2024年1月1日
(c)	國際會計準則第7號和國際財務報告準則第7號(修訂)	供應商融資安排	2024年1月1日
(d)	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，與編製截至2022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

截至二零二三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，這些標準與編製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

截至二零二三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2023年6月30日止六個月期間（未經審計）

	財富管理分部	投資銀行分部	資產管理分部	交易及機構分部	融資租賃分部	其他分部	合計
分部收益及業績							
收入	6,931,239	2,359,570	987,420	5,927,118	3,637,584	8,428	19,851,359
其他收入及收益	150,399	154,809	194,551	113,287	982,768	4,580,255	6,176,069
分部收入	7,081,638	2,514,379	1,181,971	6,040,405	4,620,352	4,588,683	26,027,428
分部支出	(5,345,088)	(1,606,156)	(854,274)	(5,127,930)	(3,693,041)	(4,628,986)	(21,255,475)
分部業績	1,736,550	908,223	327,697	912,475	927,311	(40,303)	4,771,953
應佔聯營企業業績	–	–	295,915	183,856	–	–	479,771
所得稅前利潤	1,736,550	908,223	623,612	1,096,331	927,311	(40,303)	5,251,724

截至2022年6月30日止六個月期間（未經審計）

	財富管理分部	投資銀行分部	資產管理分部	交易及機構分部	融資租賃分部	其他分部	合計
分部收益及業績							
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

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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2023年6月30日（未經審計）

	財富管理分部	投資銀行分部	資產管理分部	交易及機構分部	融資租賃分部	其他分部	合計
分部資產及負債							
分部資產	226,521,137	15,419,158	19,073,228	354,821,448	130,984,330	3,719,575	750,538,876
權益法項下投資	–	–	2,161,293	5,137,605	–	–	7,298,898
遞延税項資產							4,553,891
集團資產總額							762,391,665
分部負債	183,736,684	13,368,939	12,092,813	254,612,558	116,809,229	886,309	581,506,532
遞延税項負債	–	–	–	–	–	–	1,016,601
集團負債總額							582,523,133

於2022年12月31日（經審計）

	財富管理分部	投資銀行分部	資產管理分部	交易及機構分部	融資租賃分部	其他分部	合計
分部資產及負債							
分部資產	240,892,803	12,623,014	19,228,728	338,812,314	127,115,674	3,211,378	741,883,911
權益法項下投資	–	–	2,151,252	4,862,462	–	–	7,013,714
遞延税項資產							4,711,680
集團資產總額							753,609,305
分部負債	174,524,635	11,665,090	14,673,609	260,136,584	113,871,144	206,726	575,077,788
遞延税項負債							909,459
集團負債總額							575,987,247

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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	
	2023（未經審計）	2022（未經審計）
證券及期貨經紀業務收入	**3,438,879**	3,984,888
承銷費及保薦費收入	**1,827,800**	2,347,204
資產管理費收入（含基金管理費收入）	**959,640**	1,108,055
財務諮詢顧問費收入	**188,618**	203,137
其他	**47,126**	56,027
	6,462,063	7,699,311

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2023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

截至二零二三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	
	2023（未經審計）	2022（未經審計）
售後回租安排的應收款利息收入	**2,831,408**	1,937,065
客戶墊款的利息收入	**2,116,168**	2,321,896
銀行利息收入	**1,977,917**	1,774,838
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以攤餘成本計量的債務工具利息收入	**987,267**	715,747
買入返售金融資產利息收入	**931,069**	1,016,331
貸款及應收款項利息收入	**469,824**	487,593
其他利息收入	**6,876**	4,985
	9,320,529	8,258,455
融資租賃收入	**781,925**	1,280,942

6 投資收入及收益（淨額）

	截至6月30日止六個月期間	
	2023（未經審計）	2022（未經審計）
以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產／負債產生的已實現收益／（損失）淨額	**3,031,855**	(742,738)
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已實現收益淨額	**135,550**	33,523
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	**67,285**	68,037
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	**48,517**	1,358,310
其他	**3,635**	(24,697)
	3,286,842	692,435

7 其他收入及收益

	截至6月30日止六個月期間	
	2023（未經審計）	2022（未經審計）
大宗商品貿易收入	**4,577,360**	479,252
政府補助	**729,330**	676,499
服務收入	**383,249**	488,559
經營租賃的租金收入	**281,513**	262,553
投資物業的租金收入	**33,190**	5,003
匯兑損失	**(205,420)**	(297,910)
其他	**376,847**	319,732
	6,176,069	1,933,688

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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	
	2023（未經審計）	2022（未經審計）
證券及期貨買賣及經紀業務費用	**1,378,266**	1,386,710
經紀人佣金支出	**88,687**	124,170
證券承銷、財務顧問等服務支出	**54,541**	47,750
	1,521,494	1,558,630

9 利息支出

	截至6月30日止六個月期間	
	2023（未經審計）	2022（未經審計）
利息支出源自：		
— 借款	**2,088,013**	1,217,834
— 銀行及其他金融機構拆入資金	**92,575**	57,745
— 賣出回購金融資產款	**1,406,250**	981,576
— 應付經紀業務客戶款項	**305,090**	377,406
— 轉融通支付於中國證券金融股份有限公司（「證金公司」）	**172,695**	188,062
— 應付債券和應付短期融資款	**3,513,367**	3,220,642
— 租賃負債	**23,633**	20,912
— 其他	**316,428**	387,132
	7,918,051	6,451,309

10 折舊和攤銷費用

	截至6月30日止六個月期間	
	2023（未經審計）	2022（未經審計）
物業及設備折舊	**489,477**	437,732
使用權資產折舊	**208,855**	221,589
投資物業折舊	**29,791**	1,514
其他無形資產攤銷	**111,086**	93,748
	839,209	754,583

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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	
	2023（未經審計）	2022（未經審計）
預期信用損失源自：		
— 應收融資租賃款	**145,668**	639,862
— 售後回租安排的應收款	**459,552**	145,587
— 孖展融資客戶墊款	**287,492**	312,635
— 買入返售金融資產	**54,392**	(822,810)
— 其他貸款及應收款項	**235,336**	(82,843)
— 以攤餘成本計量的債務工具	**7,283**	1,238
— 以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具	**(40,469)**	(54,550)
— 客戶貸款	**(362)**	(2,562)
— 其他金融資產及其他項目	**54,932**	42,106
	1,203,824	178,663

12 其他支出

	截至6月30日止六個月期間	
	2023（未經審計）	2022（未經審計）
大宗商品貿易成本	**4,565,500**	474,761
管理費用	**1,368,570**	1,138,973
税金及附加	**129,064**	156,695
其他	**48,872**	54,464
	6,112,006	1,824,893

13 所得税費用

	截至6月30日止六個月期間	
	2023（未經審計）	2022（未經審計）
當期税項	**1,084,606**	838,021
調整以前年度	**17,131**	45,612
遞延税項	**225,255**	537,071
	1,326,992	1,420,704

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

本集團在香港經營的子公司適用香港利得税。香港利得税是就在香港產生的估計應課税溢利按税率16.5%計算。

其他司法權區的税項是根據有關司法權區的現行税率計算。

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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	
	2023（未經審計）	2022（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	**3,829,635**	4,757,725
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	**–**	–
子公司的認股權／股份獎勵	**–**	–
用以計算每股稀釋收益的收益	**3,829,635**	4,757,725
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）	**0.29**	0.36
稀釋每股收益（以每股人民幣元列示）	**0.29**	0.36

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

截至二零二三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

	土地及建築物	租賃物改良	電子設備	交通運輸設備	傢俱、裝置及設備	在建工程	總計
（未經審計）							
成本							
於2023年1月1日	11,313,385	992,179	1,976,527	6,768,471	343,873	440,564	21,834,999
增加	–	43,789	102,613	3,936	9,314	40,554	200,206
處置	–	(46,186)	(146,933)	(7,493)	(10,187)	–	(210,799)
轉移	260,888	21,604	1,610	–	2,872	(286,974)	–
匯兑差額	19,510	9,726	13,597	248,035	6,033	–	296,901
於2023年6月30日	11,593,783	1,021,112	1,947,414	7,012,949	351,905	194,144	22,121,307
累計折舊							
於2023年1月1日	1,234,106	724,374	1,365,632	1,192,413	215,800	–	4,732,325
增加	152,159	58,555	126,666	136,472	15,625	–	489,477
處置	–	(20,718)	(139,557)	(6,506)	(9,425)	–	(176,206)
匯兑差額	2,260	8,249	12,258	44,643	5,022	–	72,432
於2023年6月30日	1,388,525	770,460	1,364,999	1,367,022	227,022	–	5,118,028
減值損失備抵							
於2023年1月1日	30,382	–	4,426	50,534	698	–	86,040
匯兑差額	–	–	142	1,895	22	–	2,059
於2023年6月30日	30,382	–	4,568	52,429	720	–	88,099
賬面價值							
於2023年6月30日（未經審計）	10,174,876	250,652	577,847	5,593,498	124,163	194,144	16,915,180
於2022年12月31日（經審計）	10,048,897	267,805	606,469	5,525,524	127,375	440,564	17,016,634

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2023年6月30日，其原值為人民幣6,405,126千元（2022年12月31日：人民幣6,173,592千元）；累計折舊為人民幣976,327千元（2022年12月31日：人民幣829,587千元）；減值損失備抵為人民幣52,429千元（2022年12月31日：人民幣50,534千元）；淨值為人民幣5,376,370千元（2022年12月31日：人民幣5,293,471千元）。

截止2023年6月30日，本集團建築物中金額為人民幣27,659千元的房產產權證有待取得（2022年12月31日：人民幣28,259千元）。

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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

	租賃土地及房屋	電子設備	交通運輸設備	其他	總計
（未經審計）					
成本					
於2023年1月1日	**2,695,504**	**626**	**2,617**	**2,357**	**2,701,104**
期內添置	**220,975**	**–**	**–**	**305**	**221,280**
期內處置	**(154,820)**	**–**	**(485)**	**(485)**	**(155,790)**
匯兑差額	**27,067**	**65**	**195**	**–**	**27,327**
於2023年6月30日	**2,788,726**	**691**	**2,327**	**2,177**	**2,793,921**
累計折舊					
於2023年1月1日	**987,094**	**295**	**1,473**	**1,713**	**990,575**
期內折舊	**208,158**	**89**	**274**	**334**	**208,855**
處置抵銷	**(150,475)**	**–**	**(467)**	**(482)**	**(151,424)**
匯兑差額	**13,505**	**23**	**88**	**–**	**13,616**
於2023年6月30日	**1,058,282**	**407**	**1,368**	**1,565**	**1,061,622**
賬面價值					
於2023年6月30日（未經審計）	**1,730,444**	**284**	**959**	**612**	**1,732,299**
於2022年12月31日（經審計）	**1,708,410**	**331**	**1,144**	**644**	**1,710,529**

租賃負債

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
1年以內	**293,723**	279,881
1年至2年	**223,435**	204,320
2年至5年	**320,203**	300,301
5年以上	**212,147**	231,198
	1,049,508	1,015,700
於流動負債項下顯示的12個月內到期結算的金額	**293,723**	279,881
於非流動負債項下顯示的12個月以後到期結算的金額	**755,785**	735,819

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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，交通運輸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2023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227,310千元（截至2022年6月30日止六個月期間：人民幣227,340千元）。

截至2023年6月30日止六個月期間，租賃負債的利息支出為人民幣23,633千元（截至2022年6月30日止六個月期間：人民幣20,912千元）。

於2023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2023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2023年1月1日	2,710,766
本期增加	11,564
匯兑差額	99,123
於2023年6月30日	2,821,453
累積折舊	
於2023年1月1日	69,176
期內折舊	29,791
匯兑差額	2,196
於2023年6月30日	101,163
減值損失備抵	
於2023年1月1日	–
本期計提	1,824
於2023年6月30日	1,824
賬面價值	
於2023年6月30日（未經審計）	2,718,466
於2022年12月31日（經審計）	2,641,590

於2023年6月30日，本集團投資物業的公允價值為人民幣3,515,028千元（2022年12月31日：人民幣3,385,023千元），係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

截至二零二三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	2022年12月31日（經審計）	匯兑調整	2023年6月30日（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	701,200	22,537	**723,737**
海通恆信金融集團有限公司	2,236,907	71,895	**2,308,802**
Haitong International Holdings (UK) Limited	132,064	4,245	**136,309**
Haitong Bank, S.A.	1,041,864	33,485	**1,075,349**
Haitong International Financial Services (Singapore) Pte. Ltd.	4,936	158	**5,094**
	4,122,867	132,320	**4,255,187**
減：減值準備			
Haitong Bank, S.A.	(446,636)	(14,354)	**(460,990)**
	3,676,231	117,966	**3,794,197**

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）					
成本					
於2023年1月1日	**224,619**	**2,007,925**	**110,849**	**25,141**	**2,368,534**
期內添置	**–**	**121,229**	**–**	**3,562**	**124,791**
期內處置	**(1,400)**	**(25,869)**	**(50)**	**(66)**	**(27,385)**
期內轉移	**–**	**4,137**	**–**	**(4,137)**	**–**
匯兑差額	**218**	**32,073**	**1,817**	**300**	**34,408**
於2023年6月30日	**223,437**	**2,139,495**	**112,616**	**24,800**	**2,500,348**
累積攤銷					
於2023年1月1日	**116,601**	**1,592,711**	**89,216**	**–**	**1,798,528**
期內攤銷	**–**	**107,821**	**3,265**	**–**	**111,086**
處置抵銷	**–**	**(25,867)**	**(50)**	**–**	**(25,917)**
匯兑差額	**–**	**30,500**	**1,741**	**–**	**32,241**
於2023年6月30日	**116,601**	**1,705,165**	**94,172**	**–**	**1,915,938**
賬面價值					
於2023年6月30日（未經審計）	**106,836**	**434,330**	**18,444**	**24,800**	**584,410**
於2022年12月31日（經審計）	**108,018**	**415,214**	**21,633**	**25,141**	**570,006**

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。

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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）

20 權益法項下投資

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
於聯營公司及合營企業的非上市投資成本	**4,405,515**	4,312,766
攤分收購後利潤及其他全面收益，並扣除已收的股利	**2,893,383**	2,700,948
總計	**7,298,898**	7,013,714

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，主要從事基金管理和基金銷售服務，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：

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
資產總額	**13,623,841**	13,070,529
負債總額	**5,842,497**	5,325,337
資產淨值	**7,781,344**	7,745,192

	截至2023年6月30日止六個月期間（未經審計）	截至2022年6月30日止六個月期間（未經審計）
營業收入	**3,648,084**	3,772,562
淨利潤	**1,065,400**	1,122,213
綜合全面收益	**1,076,152**	1,137,929

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
最低租賃收款額		
– 1年以內	**11,504,985**	14,822,054
– 1年至2年	**4,436,747**	4,761,042
– 2年至3年	**2,255,528**	1,324,033
– 3年至4年	**1,083,678**	565,995
– 4年至5年	**693,747**	446,252
– 5年以上	**1,852,560**	1,586,042
應收融資租賃款總額	**21,827,245**	23,505,418
減：未實現融資收益	**(2,708,871)**	(2,457,073)
應收融資租賃款現值	**19,118,374**	21,048,345
減：預期信用損失	**(1,121,161)**	(1,589,892)
應收融資租賃款賬面價值	**17,997,213**	19,458,453
最低租賃收款額的現值		
– 1年以內	**10,121,505**	13,305,964
– 1年至2年	**3,838,903**	4,249,047
– 2年至3年	**1,942,176**	1,167,355
– 3年至4年	**937,316**	501,794
– 4年至5年	**612,977**	398,372
– 5年以上	**1,665,497**	1,425,813
合計	**19,118,374**	21,048,345
就報告目的分析如下：		
流動資產	**9,518,249**	12,355,870
非流動資產	**8,478,964**	7,102,583
總計	**17,997,213**	19,458,453

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。

2023年6月30日，本集團應收融資租賃款淨額計人民幣388,511千元（2022年12月31日：人民幣426,016千元）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

截至二零二三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個月的預期信用損失階段1	整個存續期內預期信用損失（未發生信用減值）階段2	整個存續期內預期信用損失（發生信用減值）階段3	總計
（未經審計）				
於2023年1月1日	**439,314**	**531,299**	**619,279**	**1,589,892**
預期信用損失的變動：				
— 預期信用損失（轉回）／確認	**(115,631)**	**140,338**	**120,961**	**145,668**
— 本期核銷	**–**	**–**	**(314,668)**	**(314,668)**
— 階段間的轉換	**18,937**	**(256,156)**	**237,219**	**–**
— 收回以前年度核銷款項	**–**	**–**	**51,929**	**51,929**
— 其他終止確認情況	**–**	**–**	**(351,660)**	**(351,660)**
於2023年6月30日	**342,620**	**415,481**	**363,060**	**1,121,161**

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個月的預期信用損失階段1	整個存續期內預期信用損失（未發生信用減值）階段2	整個存續期內預期信用損失（發生信用減值）階段3	總計
於2023年6月30日（未經審計）	**17,001,427**	**1,547,687**	**569,260**	**19,118,374**
於2022年12月31日（經審計）	18,404,093	1,623,102	1,021,150	21,048,345

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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：

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
– 1年以內	**44,657,553**	41,038,253
– 1年至2年	**28,845,939**	27,141,407
– 2年至3年	**14,494,914**	15,714,479
– 3年至4年	**6,291,065**	6,709,395
– 4年至5年	**2,059,066**	3,069,131
– 5年以上	**1,138,654**	837,855
售後回租安排的應收款總額	**97,487,191**	94,510,520
減：利息調整	**(8,684,840)**	(8,775,539)
售後回租安排的應收款現值	**88,802,351**	85,734,981
減：預期信用損失	**(1,632,237)**	(1,185,029)
售後回租安排的應收款賬面價值	**87,170,114**	84,549,952
售後回租安排的應收款現值		
– 1年以內	**40,695,365**	37,226,971
– 1年至2年	**26,276,126**	24,655,189
– 2年至3年	**13,195,007**	14,237,955
– 3年至4年	**5,725,571**	6,076,049
– 4年至5年	**1,873,980**	2,779,039
– 5年以上	**1,036,302**	759,778
總計	**88,802,351**	85,734,981
就報告目的分析如下：		
流動資產	**40,012,579**	36,702,132
非流動資產	**47,157,535**	47,847,820
	87,170,114	84,549,952

於2023年6月30日，本集團售後回租安排的應收款淨額計人民幣2,374,691千元（2022年12月31日：人民幣5,005,702千元）質押用於借款。

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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個月的預期信用損失階段1	整個存續期內預期信用損失（未發生信用減值）階段2	整個存續期內預期信用損失（發生信用減值）階段3	總計
（未經審計）				
於2023年1月1日	**952,361**	**159,715**	**72,953**	**1,185,029**
預期信用損失的變動：				
— 預期信用損失確認	**41,106**	**257,993**	**160,453**	**459,552**
— 本期核銷	**–**	**–**	**(8,035)**	**(8,035)**
— 階段間的轉換	**(56,098)**	**(19,467)**	**75,565**	**–**
— 收回以前年度核銷款項	**–**	**–**	**187**	**187**
— 其他終止確認情況	**–**	**–**	**(4,539)**	**(4,539)**
— 外匯變動及其他	**43**	**–**	**–**	**43**
於2023年6月30日	**937,412**	**398,241**	**296,584**	**1,632,237**

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個月的預期信用損失階段1	整個存續期內預期信用損失（未發生信用減值）階段2	整個存續期內預期信用損失（發生信用減值）階段3	總計
於2023年6月30日（未經審計）	**86,411,253**	**1,775,817**	**615,281**	**88,802,351**
於2022年12月31日（經審計）	84,955,975	634,235	144,771	85,734,981

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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
其他權益投資（附註i）	**7,468,696**	6,096,319
分析如下：		
上市股權證券	**6,457,172**	5,102,310
非上市股權證券	**1,011,524**	994,009
	7,468,696	6,096,319

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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2023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34,235千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) 2023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中有承諾條件的金融資產，係用於融出證券業務，其公允價值為人民幣788,388千元（2022年12月31日：1,866,595千元）。

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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
未上市債券投資	**22,822,768**	23,497,708
上市債券投資	**23,229,984**	29,354,191
	46,052,752	52,851,899
就報告目的分析如下：		
流動資產	**5,489,647**	6,876,553
非流動資產	**40,563,105**	45,975,346
	46,052,752	52,851,899
預期信用損失	**166,009**	204,409

於2023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中有承諾條件的金融資產，係用於賣出回購業務、債券借貸業務、轉融通業務、衍生業務質押和向葡萄牙央行融資等，其公允價值為人民幣36,027百萬元（2022年12月31日：人民幣35,447百萬元）。

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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個月的預期信用損失 階段1	整個存續期內預期信用損失（未發生信用減值） 階段2	整個存續期內預期信用損失（發生信用減值） 階段3	總計
（未經審計）				
於2023年1月1日	**86,989**	**117,420**	**–**	**204,409**
預期信用損失的變動：				
– 預期信用損失（轉回）／確認	**(55,559)**	**5,629**	**9,461**	**(40,469)**
– 階段間的轉換	**14,036**	**(14,179)**	**143**	**–**
– 外匯變動及其他	**754**	**97**	**1,218**	**2,069**
於2023年6月30日	**46,220**	**108,967**	**10,822**	**166,009**

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個月的預期信用損失 階段1	整個存續期內預期信用損失（未發生信用減值） 階段2	整個存續期內預期信用損失（發生信用減值） 階段3	總計
於2023年6月30日（未經審計）	**41,665,405**	**4,137,235**	**40,428**	**45,843,068**
於2022年12月31日（經審計）	48,696,364	4,265,842	–	52,962,206

25 以攤餘成本計量的債務工具

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
債務證券	**7,598,808**	5,825,147
減：預期信用損失	**(27,896)**	(18,990)
	7,570,912	5,806,157
就報告目的分析如下：		
流動資產	**1,724,723**	369,071
非流動資產	**5,846,189**	5,437,086
	7,570,912	5,806,157

附註：

於2023年6月30日，以攤餘成本計量的債務工具中有承諾條件的金融資產，係用於賣出回購、向葡萄牙央行融資等，其賬面價值為人民幣5,620百萬元（2022年12月31日：人民幣4,004百萬元）。

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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個月的預期信用損失階段1	整個存續期內預期信用損失（未發生信用減值）階段2	整個存續期內預期信用損失（發生信用減值）階段3	總計
（未經審計）				
於2023年1月1日	**18,990**	**–**	**–**	**18,990**
預期信用損失的變動：				
– 預期信用損失確認	**3,978**	**3,305**	**–**	**7,283**
– 階段間的轉換	**(1,107)**	**1,107**	**–**	**–**
– 外匯變動及其他	**1,314**	**309**	**–**	**1,623**
於2023年6月30日	**23,175**	**4,721**	**–**	**27,896**

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個月的預期信用損失階段1	整個存續期內預期信用損失（未發生信用減值）階段2	整個存續期內預期信用損失（發生信用減值）階段3	總計
於2023年6月30日（未經審計）	**7,511,383**	**87,425**	**–**	**7,598,808**
於2022年12月31日（經審計）	5,825,147	–	–	5,825,147

26 以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
債務證券	**93,203,938**	101,634,305
股權證券	**30,670,781**	30,343,977
基金	**66,203,922**	58,853,951
其他	**18,858,769**	18,766,496
	208,937,410	209,598,729
就報告目的分析如下：		
流動資產	**183,699,683**	184,555,352
非流動資產	**25,237,727**	25,043,377
	208,937,410	209,598,729

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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2023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48,824百萬元（2022年12月31日：人民幣63,261百萬元），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482百萬元（2022年12月31日：人民幣487百萬元）。

(ii) 於2023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5,400百萬元（2022年12月31日：人民幣4,257百萬元）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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
按抵押品種類劃分：		
股票（註）	**27,152,364**	27,795,962
債券	**14,571,175**	5,413,745
減：預期信用損失	**(618,950)**	(564,558)
	41,104,589	32,645,149
按市場劃分：		
交易所	**36,404,315**	32,015,828
銀行間市場	**5,319,224**	1,193,879
減：預期信用損失	**(618,950)**	(564,558)
	41,104,589	32,645,149
就報告目的分析如下：		
流動資產	**40,093,887**	32,595,078
非流動資產	**1,010,702**	50,071
	41,104,589	32,645,149

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2023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26,140,881千元（2022年12月31日：人民幣27,745,853千元），期限為1年以上為人民幣1,011,483千元（2022年12月31日：人民幣50,109千元）。

截至2023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96,095,048千元（截至2022年12月31日：人民幣89,186,204千元）。

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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個月的預期信用損失階段1	整個存續期內預期信用損失（未發生信用減值）階段2	整個存續期內預期信用損失（發生信用減值）階段3	總計
（未經審計）				
於2023年1月1日	**13,572**	**1,693**	**549,293**	**564,558**
預期信用損失的變動：				
－預期信用損失（轉回）／確認	**(1,022)**	**1,757**	**53,657**	**54,392**
－階段間的轉換	**1,663**	**(1,663)**	**–**	**–**
於2023年6月30日	**14,213**	**1,787**	**602,950**	**618,950**

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個月的預期信用損失階段1	整個存續期內預期信用損失（未發生信用減值）階段2	整個存續期內預期信用損失（發生信用減值）階段3	總計
於2023年6月30日（未經審計）	**39,781,583**	**457,607**	**1,484,349**	**41,723,539**
於2022年12月31日（經審計）	31,146,703	330,638	1,732,366	33,209,707

28 其他貸款及應收款項

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
委託貸款及其他	**515,327**	514,159
其他貸款及應收款項	**6,758,986**	7,055,246
賬面總額	**7,274,313**	7,569,405
減：預期信用損失	**(1,121,322)**	(841,237)
	6,152,991	6,728,168
就報告目的分析如下：		
流動資產	**5,195,743**	4,209,604
非流動資產	**957,248**	2,518,564
	6,152,991	6,728,168

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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個月的預期信用損失階段1	整個存續期內預期信用損失（未發生信用減值）階段2	整個存續期內預期信用損失（發生信用減值）階段3	總計
（未經審計）				
於2023年1月1日	**26,939**	**160,167**	**654,131**	**841,237**
預期信用損失的變動：				
— 預期信用損失（轉回）／確認	**(15,426)**	**83,802**	**166,960**	**235,336**
— 階段間的轉換	**(6,980)**	**404**	**6,576**	**–**
— 外匯變動及其他	**67**	**5**	**44,677**	**44,749**
於2023年6月30日	**4,600**	**244,378**	**872,344**	**1,121,322**

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個月的預期信用損失階段1	整個存續期內預期信用損失（未發生信用減值）階段2	整個存續期內預期信用損失（發生信用減值）階段3	總計
於2023年6月30日（未經審計）	**1,455,665**	**596,119**	**5,222,529**	**7,274,313**
於2022年12月31日（經審計）	2,460,819	378,612	4,729,974	7,569,405

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
客戶貸款	**7,012,152**	5,978,815
減：預期信用損失	**(112,026)**	(109,801)
	6,900,126	5,869,014
就報告目的分析如下：		
流動資產	**734,510**	837,281
非流動資產	**6,165,616**	5,031,733
	6,900,126	5,869,014

預期信用損失的本期變動：

	12個月的預期信用損失階段1	整個存續期內預期信用損失（未發生信用減值）階段2	整個存續期內預期信用損失（發生信用減值）階段3	總計
（未經審計）				
於2023年1月1日	**22,711**	**40,253**	**46,837**	**109,801**
預期信用損失的變動：				
– 預期信用損失確認／（轉回）	**1,793**	**(3,155)**	**1,000**	**(362)**
– 本期核銷	**–**	**–**	**(7,815)**	**(7,815)**
– 外匯變動及其他	**1,731**	**4,415**	**4,256**	**10,402**
於2023年6月30日	**26,235**	**41,513**	**44,278**	**112,026**

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個月的預期信用損失階段1	整個存續期內預期信用損失（未發生信用減值）階段2	整個存續期內預期信用損失（發生信用減值）階段3	總計
於2023年6月30日				
（未經審計）	**6,135,542**	**806,392**	**70,218**	**7,012,152**
於2022年12月31日				
（經審計）	5,153,647	752,825	72,343	5,978,815

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：

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
遞延稅項資產	**4,553,891**	4,711,680
遞延稅項負債	**(1,016,601)**	(909,459)
	3,537,290	3,802,221

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：

	以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產／（負債）	加速折舊	衍生金融工具	應計但未繳付支出	以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具	以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具	減值損失	稅務損失及其他	合計
（經審計）									
於2022年1月1日	(1,205,852)	(68,090)	82,219	1,373,613	(28,497)	(32,587)	3,216,707	510,926	3,848,439
於損益中計入／（扣減）	165,406	(16,879)	95,753	(310,391)	(14,647)	–	(187,676)	(188,189)	(456,623)
於其他全面收益中計入	–	–	29,780	–	43,913	320,322	–	–	394,015
匯率影響及其他	–	(1,678)	3,337	3,223	29,554	(100,042)	23,462	58,534	16,390
於2022年12月31日	(1,040,446)	(86,647)	211,089	1,066,445	30,323	187,693	3,052,493	381,271	3,802,221
（未經審計）									
於損益中（扣減）／計入	**(6,249)**	**(458)**	**(261,360)**	**(41,456)**	**–**	**–**	**(10,017)**	**106,560**	**(212,980)**
於其他全面收益中計入	**–**	**–**	**(17,601)**	**–**	**(84,713)**	**(13,950)**	**–**	**–**	**(116,264)**
匯率影響及其他	**347**	**(3,157)**	**2,516**	**1,317**	**1,823**	**(13,388)**	**9,199**	**65,656**	**64,313**
於2023年6月30日	**(1,046,348)**	**(90,262)**	**(65,356)**	**1,026,306**	**(52,567)**	**160,355**	**3,051,675**	**553,487**	**3,537,290**

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

截至二零二三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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
交易所儲備及保證金		
－上交所	**454,433**	458,959
－深交所	**272,261**	234,925
－全國中小企業股份轉讓系統	**2,451**	2,672
－香港聯合交易所有限公司	**1,744**	1,340
小計	**730,889**	697,896
期貨衍生及商品交易所保證金		
－中國金融期貨交易所	**12,270,344**	12,743,745
－上海期貨交易所	**2,903,804**	3,230,204
－大連商品交易所	**2,566,536**	2,580,037
－鄭州商品交易所	**1,726,272**	1,342,274
－上海黃金交易所	**36,829**	63,451
－香港期貨結算有限公司	**10,854**	2,250
－付予其他地區的保證金	**522,748**	415,849
小計	**20,037,387**	20,377,810
交易席位費及其他保證金		
－存於證金公司的保證金	**557,205**	1,415,591
－存於上海清算所的保證金	**143,228**	131,853
－付予香港中央結算有限公司的保證金	**143,170**	182,324
－付予上交所的保證金	**20,307**	21,046
－付予深交所的保證金	**20,124**	23,832
－付予香港聯合交易所期權結算所有限公司的保證金	**4,144**	3,228
－付予北交所的保證金	**200**	–
－其他	**10,830**	10,994
小計	**899,208**	1,788,868
合計	**21,667,484**	22,864,574
就報告目的分析如下：		
流動資產	**21,496,741**	22,664,637
非流動資產	**170,743**	199,937
	21,667,484	22,864,574

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
自有賬戶	**65,571,825**	56,191,722
代客戶持有的現金（附註i）	**99,893,842**	98,970,479
	165,465,667	155,162,201
減：非流動受限制銀行存款（附註ii）	**(1,845,186)**	(1,769,482)
	163,620,481	153,392,719

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：

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
銀行結餘及現金－自有（除應計利息）	**65,467,602**	56,102,251
減：受限制銀行存款(i)	**(2,744,412)**	(2,887,055)
存放同業款項（除應計利息）	**141,905**	179,809
存放央行超額準備金	**2,035,284**	3,231,241
結算備付金－自有	**6,419,434**	10,903,854
	71,319,813	67,530,100

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

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
長期應收政府與社會資本合作項目款	**1,301,372**	1,174,762
收回融資租賃資產	**78,517**	85,385
抵債資產	**63,390**	86,701
其他	**1,557,658**	1,754,174
	3,000,937	3,101,022

35 孖展融資客戶墊款

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
孖展客戶的貸款（附註）	**68,932,188**	70,026,612
減：預期信用損失	**(2,512,200)**	(2,182,741)
	66,419,988	67,843,871
就報告目的分析如下		
流動資產	**66,419,988**	67,843,871

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2023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222,700,597千元（2022年12月31日：人民幣208,287,447千元）的證券作為抵押品而擔保。

於2023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8,122,962千元（2022年12月31日：人民幣7,634,836千元）。

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

截至二零二三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個月的預期信用損失階段1	整個存續期預期信用損失（未發生信用減值）階段2	整個存續期預期信用損失（發生信用減值）階段3	總計
（未經審計）				
於2023年1月1日	**52,121**	**31,984**	**2,098,636**	**2,182,741**
預期信用損失的變動：				
— 預期信用損失（轉回）／確認	**(36,810)**	**(23,063)**	**347,365**	**287,492**
— 階段間的轉換	**25,318**	**(2,807)**	**(22,511)**	**–**
— 外匯變動及其他	**267**	**123**	**41,577**	**41,967**
於2023年6月30日	**40,896**	**6,237**	**2,465,067**	**2,512,200**

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個月的預期信用損失階段1	整個存續期預期信用損失（未發生信用減值）階段2	整個存續期預期信用損失（發生信用減值）階段3	總計
於2023年6月30日（未經審計）	**62,073,348**	**1,899,328**	**4,959,512**	**68,932,188**
於2022年12月31日（經審計）	60,787,569	2,212,707	7,026,336	70,026,612

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
應收賬款來自：		
－經紀、交易商及結算所	**4,068,039**	4,509,006
－現金客戶	**1,949,781**	3,508,600
－資產及基金管理	**582,040**	560,359
－顧問及財務規劃	**144,794**	151,312
－認購新股客戶	**–**	965
－其他	**3,607,588**	1,986,304
	10,352,242	10,716,546
減：預期信用損失	**(363,604)**	(322,031)
	9,988,638	10,394,515

賬齡分析如下：

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
3個月以內	**7,390,446**	8,872,138
3-6個月	**913,329**	704,621
6-12個月	**1,236,099**	369,720
超過1年	**448,764**	448,036
	9,988,638	10,394,515

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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

	2023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	**1,735,436**	**86,984**	**–**
外匯互換	**593,303**	**33,848**	**–**
遠期合同	**859,308**	**56,214**	**6,189**
持作交易的衍生投資：			
股指期貨合約（附註i）	**25,599,151**	**–**	**–**
國債期貨合約（附註ii）	**31,678,009**	**–**	**–**
商品期貨合約（附註iii）	**17,407,715**	**–**	**–**
利率互換合約（附註iv）	**123,979,826**	**331,750**	**275,496**
權益互換	**37,795,945**	**953,188**	**673,907**
遠期合同	**17,852,779**	**96,045**	**43,095**
期權（附註v）	**118,260,032**	**371,985**	**281,983**
嵌入式權益工具	**2,566,806**	**1,116**	**21,344**
外匯互換	**627,776**	**5**	**3,313**
信用違約互換	**526,000**	**1,290**	**264**
合計	**379,482,086**	**1,932,425**	**1,305,591**

	2022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	2,437,841	87,005	18,745
外匯互換	1,256,077	6,363	16,800
遠期合同	1,443,475	19,988	40,626
持作交易的衍生投資：			
股指期貨合約（附註i）	28,451,306	–	–
國債期貨合約（附註ii）	21,995,571	–	–
商品期貨合約（附註iii）	13,735,363	–	–
利率互換合約（附註iv）	139,385,340	331,091	296,080
權益互換	22,043,716	590,554	314,327
遠期合同	22,680,325	46,007	71,642
期權（附註v）	85,370,924	387,993	127,716
嵌入式權益工具	1,110,869	–	7,986
外匯互換	8,875,332	8,166	4,133
信用違約互換	152,000	–	364
合計	348,938,139	1,477,167	898,419

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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2023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。2023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25,599,151千元（2022年12月31日：人民幣28,451,306千元），結算前確認衍生負債淨額為人民幣17,939千元（2022年12月31日：衍生負債淨額為人民幣572,114千元）。

(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2023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（2022年12月31日：人民幣零元）。

	2023年6月30日（未經審計）	
	合約價值	**公允價值**
T2309	**8,750,636**	**2,138**
T2312	**109,701**	**237**
TF2309	**10,389,159**	**(16,489)**
TF2312	**50,940**	**68**
TS2309	**12,338,349**	**(10,761)**
TL2309	**39,224**	**(180)**
合計	**31,678,009**	**(24,987)**
加：結算		**24,987**
國債期貨合約淨額		**–**

	2022年12月31日（經審計）	
	合約價值	公允價值
T2303	520,168	(499)
TF2303	9,603,257	(22,545)
TS2303	11,872,146	(23,637)
合計	21,995,571	(46,681)
加：結算		46,681
國債期貨合約淨額		–

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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2023年6月30日所有的商品期貨合約產生的持倉損益金額。於2023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（2022年12月31日：人民幣零元）。

	2023年6月30日（未經審計）		2022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	**17,407,715**	**8,532**	13,735,363	(5,874)
加：結算		**(8,532)**		5,874
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2023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。

	2023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	**114,910,000**	**462,616**	**413,069**
利率互換－非集中清算	**9,069,826**	**331,750**	**275,496**
合計	**123,979,826**	**794,366**	**688,565**
加：結算		**(462,616)**	**(413,069)**
利率互換合約淨值		**331,750**	**275,496**

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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）

	2022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	83,500,000	234,892	188,180
利率互換－非集中清算	55,885,340	331,091	296,080
合計	139,385,340	565,983	484,260
加：結算		(234,892)	(188,180)
利率互換合約淨值		331,091	296,080

(v) 期權

於2023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117,044,748千元（2022年12月31日：人民幣75,370,059千元）。本集團在境外投資的期權名義本金約為人民幣1,215,284千元（2022年12月31日：人民幣10,000,865千元）。

38 其他流動資產

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
預付款項	**1,394,154**	1,349,583
應收股利	**291,694**	618
存貨	**262,850**	104,379
其他應收（附註i）	**4,774,215**	5,853,376
	6,722,913	7,307,956
減：預期信用損失（附註ii）	**(574,570)**	(559,333)
	6,148,343	6,748,623

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

截至二零二三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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
為下列人士於結算所持有的結算備付金：		
自有	**6,419,434**	10,903,854
客戶	**12,146,853**	10,476,841
	18,566,287	21,380,695

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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
存放中央銀行除法定存款準備金以外款項	**2,035,480**	3,231,599
法定存款準備金	**14,455**	13,497
	2,049,935	3,245,096
存放同業款項	**134,689**	172,872
合計	**2,184,624**	3,417,968

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

截至二零二三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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
短期借款：		
有抵押（附註）	**1,191,687**	291,097
無抵押	**33,859,381**	34,566,945
	35,051,068	34,858,042
長期借款：		
有抵押（附註）	**16,738,314**	18,399,853
無抵押	**35,082,481**	37,558,350
	51,820,795	55,958,203
合計	**86,871,863**	90,816,245
流動負債：		
短期借款	**35,051,068**	34,858,042
一年內到期的長期借款	**25,310,966**	22,006,870
	60,362,034	56,864,912
非流動負債：		
長期借款	**26,509,829**	33,951,333
	86,871,863	90,816,245
到期日分析如下：		
1年以內	**60,362,034**	56,864,912
1-2年	**13,515,472**	11,911,122
2-5年	**11,997,161**	21,147,505
5年以上	**997,196**	892,706
	86,871,863	90,816,245

附註：

截至2023年6月30日，約有人民幣104.82億元的銀行貸款（2022年12月31日：人民幣103.72億元）以本集團下屬子公司海通國際證券集團有限公司百分之七十的股權、海通恒信金融集團有限公司和海通銀行的股權作為質押。

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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）

截至2023年6月30日，本集團下屬子公司海通國際證券集團有限公司的銀行質押借款餘額合計港幣3.88億元（折合人民幣3.58億元）（2022年12月31日：港幣1.85億元，折合人民幣1.65億元），該款項係海通國際證券集團有限公司在客戶同意下，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2023年6月30日，該質押品期末市值為港幣20.99億元（折合人民幣19.35億元）（2022年12月31日：港幣19.79億元，折合人民幣17.68億元）。

截至2023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70.91億元（2022年12月31日：人民幣81.54億元），以應收融資租賃款、售後回租安排的應收款、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2023年6月30日，質押的應收融資租賃款賬面價值為人民幣3.89億元（2022年12月31日：人民幣4.26億元），質押的售後回租安排的應收款賬面價值為人民幣23.75億元（2022年12月31日：人民幣50.06億元），抵押的飛機租賃及物業及設備計入固定資產的賬面價值為人民幣65.26億元（2022年12月31日：人民幣48.32億元）。

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，海通國際控股有限公司已於本財務報表批准報出前就其截至2023年6月30日賬面價值為港幣31.80億元（折合人民幣29.32億元）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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
超短期融資券	**5,041,826**	5,035,289
中期票據	**1,329,558**	2,909,046
短期收益憑證	**4,582,226**	2,647,746
短期融資券	**2,031,670**	1,003,520
短期公司債券	**–**	4,563,493
	12,985,280	16,159,094

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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	幣種	起息日期	到期日期	票面利率	期初餘額	本期增加	本期減少	期末餘額
海通證券股份有限公司	短期公司債券	人民幣	09/06/2022	09/06/2023	2.50%	4,563,493	49,007	4,612,500	–
海通證券股份有限公司	短期收益憑證	人民幣	04/07/2022-30/06/2023	02/07/2023-30/06/2024	0.00%-2.92%	2,647,746	6,321,061	4,386,581	4,582,226
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	超短期融資券	人民幣	25/05/2022	17/02/2023	2.05%	1,012,129	2,639	1,014,768	–
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	超短期融資券	人民幣	15/06/2022	10/03/2023	2.06%	505,443	1,918	507,361	–
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	超短期融資券	人民幣	09/08/2022	21/04/2023	2.03%	1,007,493	6,118	1,013,611	–
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	超短期融資券	人民幣	23/08/2022	28/04/2023	1.86%	1,006,090	5,962	1,012,052	–
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	超短期融資券	人民幣	26/10/2022	10/03/2023	1.86%	501,435	1,733	503,168	–
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	短期融資券	人民幣	25/10/2022	25/10/2023	2.45%	1,003,520	12,793	–	1,016,313
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	超短期融資券	人民幣	16/11/2022	11/08/2023	2.51%	1,002,700	12,799	–	1,015,499
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	短期融資券	人民幣	10/01/2023	10/01/2024	3.41%	–	1,015,357	–	1,015,357
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	超短期融資券	人民幣	15/02/2023	25/08/2023	2.63%	–	1,009,626	–	1,009,626
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	超短期融資券	人民幣	08/03/2023	22/09/2023	2.73%	–	1,008,399	–	1,008,399

42 應付短期融資款（續）

發債主體	債券名稱	幣種	起息日期	到期日期	票面利率	期初餘額	本期增加	本期減少	期末餘額
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	超短期融資券	人民幣	19/04/2023	24/11/2023	2.48%	–	1,004,535	–	1,004,535
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	超短期融資券	人民幣	26/04/2023	19/01/2024	2.56%	–	1,003,767	–	1,003,767
海通國際證券集團有限公司	中期票據	港幣	17/02/2022	16/02/2023	1.00%	923,319	29,676	952,995	–
海通國際證券集團有限公司	中期票據	港幣	08/06/2022	09/01/2023	2.10%	1,536,733	49,391	1,586,124	–
海通國際證券集團有限公司	中期票據	港幣	09/06/2022	10/01/2023	2.00%	90,338	2,904	93,242	–
海通國際證券集團有限公司	中期票據	美元	26/08/2022	24/08/2023	4.10%	358,655	22,096	–	380,751
海通國際證券集團有限公司	中期票據	港幣	27/01/2023	27/07/2023	5.00%	–	376,491	–	376,491
海通國際證券集團有限公司	中期票據	港幣	09/02/2023	08/02/2024	4.70%	–	283,694	–	283,694
海通國際證券集團有限公司	中期票據	美元	16/02/2023	16/11/2023	5.15%	–	288,622	–	288,622
合計						16,159,094	12,508,588	15,682,402	12,985,280

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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

發債主體	債券類型	幣種	面值（原幣千元）	起息日期	到期日期	票面利率	期初餘額	本期增加	本期減少	期末餘額
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,390,000	25/11/2013	25/11/2023	6.18%	2,402,796	73,466	–	2,476,262
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	800,000	14/07/2014	14/07/2024	5.85%	821,694	23,280	–	844,974
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	5,500,000	22/09/2017	22/09/2027	4.99%	5,565,490	136,559	–	5,702,049
海通證券股份有限公司	公司債券	美元	300,000	13/12/2018	13/12/2023	4.50%	2,091,001	222,356	142,439	2,170,918
海通證券股份有限公司	公司債券	歐元	230,000	13/12/2018	13/12/2023	Euribor+165bps	1,704,749	176,830	70,546	1,811,033
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	5,000,000	27/02/2020	27/02/2023	3.01%	5,126,498	24,002	5,150,500	–
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	3,500,000	19/03/2020	19/03/2023	2.99%	3,582,103	22,547	3,604,650	–
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	5,600,000	30/04/2020	30/04/2023	2.38%	5,688,670	44,610	5,733,280	–
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	700,000	30/04/2020	30/04/2025	2.88%	712,972	10,115	20,160	702,927
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	6,700,000	25/05/2020	25/05/2023	2.70%	6,807,859	73,041	6,880,900	–
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	6,000,000	11/08/2020	11/08/2023	3.53%	6,080,676	106,904	–	6,187,580
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	6,000,000	13/01/2021	13/01/2024	3.58%	6,203,834	108,373	214,800	6,097,407
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	5,400,000	08/02/2021	08/02/2024	3.79%	5,579,597	103,156	204,660	5,478,093
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	5,000,000	23/04/2021	23/04/2024	3.45%	5,115,449	86,991	172,500	5,029,940
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,800,000	27/05/2021	27/05/2024	3.35%	2,853,809	47,352	93,800	2,807,361
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,100,000	10/06/2021	10/06/2024	3.40%	2,138,198	36,041	71,400	2,102,839
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,000,000	29/07/2021	29/07/2024	3.14%	2,024,859	31,756	–	2,056,615
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	3,000,000	20/08/2021	20/08/2024	3.04%	3,030,396	46,146	–	3,076,542
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,000,000	30/08/2021	30/08/2024	3.10%	2,018,972	31,358	–	2,050,330
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,000,000	30/08/2021	30/08/2026	3.43%	2,020,542	34,372	–	2,054,914
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	5,000,000	10/11/2021	10/11/2024	3.10%	5,016,234	78,391	–	5,094,625
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	5,000,000	22/11/2021	22/11/2024	3.09%	5,010,980	78,142	–	5,089,122
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	5,000,000	20/01/2022	25/12/2024	2.84%	5,128,222	71,925	142,000	5,058,147
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,900,000	21/02/2022	21/02/2025	2.90%	2,968,444	42,587	84,100	2,926,931
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	500,000	07/03/2022	07/03/2025	3.03%	511,767	7,651	15,150	504,268
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	5,000,000	26/07/2022	26/07/2025	2.75%	5,051,831	69,699	–	5,121,530
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	5,000,000	09/09/2022	09/09/2025	2.53%	5,031,056	64,246	–	5,095,302
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	4,700,000	14/10/2022	14/10/2025	2.60%	4,718,219	62,020	–	4,780,239
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	3,000,000	10/11/2022	10/11/2025	2.61%	3,005,763	39,735	–	3,045,498
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,700,000	13/12/2022	20/12/2023	2.90%	2,699,241	41,179	–	2,740,420
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,500,000	08/02/2023	08/02/2025	2.95%	–	2,525,073	–	2,525,073
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	3,000,000	08/02/2023	08/02/2026	3.23%	–	3,033,007	–	3,033,007
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,500,000	06/03/2023	06/03/2025	3.11%	–	2,520,866	–	2,520,866
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	1,700,000	06/03/2023	06/03/2026	3.26%	–	1,714,833	–	1,714,833
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	3,300,000	22/03/2023	22/03/2025	2.97%	–	3,321,649	–	3,321,649

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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（原幣千元）	起息日期	到期日期	票面利率	期初餘額	本期增加	本期減少	期末餘額
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,700,000	22/03/2023	22/03/2026	3.10%	–	2,718,448	–	2,718,448
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,000,000	24/04/2023	24/04/2025	2.89%	–	2,007,302	–	2,007,302
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	4,000,000	24/04/2023	24/04/2026	3.05%	–	4,015,561	–	4,015,561
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	3,600,000	18/05/2023	18/05/2026	2.94%	–	3,606,186	–	3,606,186
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	1,400,000	18/05/2023	18/05/2028	3.10%	–	1,402,633	–	1,402,633
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	3,000,000	15/06/2023	15/06/2026	2.73%	–	2,997,994	–	2,997,994
海通證券股份有限公司	公司債券	人民幣	2,000,000	15/06/2023	15/06/2028	3.07%	–	1,998,939	–	1,998,939
海通證券股份有限公司	次級債券	人民幣	5,000,000	12/01/2022	12/01/2025	3.18%	5,147,819	80,368	159,000	5,069,187
海通證券股份有限公司	次級債券	人民幣	2,000,000	25/02/2022	25/02/2025	3.15%	2,050,800	31,848	63,000	2,019,648
海通證券股份有限公司	次級債券	人民幣	2,480,000	09/03/2022	09/03/2025	3.29%	2,543,207	41,142	81,592	2,502,757
海通證券股份有限公司	收益憑證	人民幣	753,297	05/07/2021至30/06/2023	30/06/2023至25/06/2025	0.00%-3.50%	595,787	447,757	281,567	761,977
上海海通證券資產管理有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	04/11/2020	04/11/2025	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	04/04/2018	04/04/2023	5.00%	103,726	1,274	105,000	–
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	11/05/2020	11/05/2023	3.50%	1,021,767	12,466	1,034,233	–
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,200,000	28/07/2020	28/07/2023	4.00%	1,219,165	25,070	–	1,244,235
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	17/09/2020	17/09/2023	4.20%	1,010,667	21,842	–	1,032,509
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	800,000	30/10/2020	30/10/2023	4.15%	804,369	17,274	–	821,643
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	26/04/2021	26/04/2025	3.65%	1,027,186	697,473	1,037,957	686,702
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	800,000	18/06/2021	15/06/2023	3.85%	815,698	14,176	829,874	–
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	600,000	12/08/2021	12/08/2024	3.90%	607,367	12,113	–	619,480
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	25/10/2021	25/10/2023	3.80%	1,005,095	20,066	–	1,025,161
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	24/12/2021	24/12/2024	3.70%	997,951	19,145	–	1,017,096

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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（原幣千元）	起息日期	到期日期	票面利率	期初餘額	本期增加	本期減少	期末餘額
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,500,000	21/04/2022	21/04/2024	3.48%	1,531,627	25,885	50,193	1,507,319
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	500,000	05/05/2022	05/05/2025	3.57%	509,827	8,852	17,347	501,332
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	21/06/2022	21/06/2024	3.16%	1,013,123	15,670	30,484	998,309
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	600,000	07/07/2022	07/07/2025	3.44%	607,330	10,905	–	618,235
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	21/10/2022	21/10/2025	3.13%	1,001,299	16,360	–	1,017,659
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	17/04/2023	17/04/2026	3.90%	–	1,004,363	–	1,004,363
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	公司債券	人民幣	1,000,000	26/06/2023	26/06/2028	3.80%	–	997,240	–	997,240
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	中期票據	人民幣	500,000	31/08/2020	31/08/2023	4.20%	506,525	10,826	–	517,351
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	中期票據	人民幣	500,000	20/01/2021	20/01/2023	4.00%	518,890	1,041	519,931	–
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	中期票據	人民幣	1,000,000	09/12/2021	09/12/2024	3.70%	999,074	19,175	–	1,018,249
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	中期票據	人民幣	800,000	13/01/2022	13/01/2025	3.64%	825,379	14,440	28,418	811,401
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	中期票據	人民幣	1,000,000	27/05/2022	27/05/2025	3.42%	1,016,579	16,960	33,381	1,000,158
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	中期票據	人民幣	1,200,000	10/08/2022	10/08/2025	3.25%	1,210,215	20,329	–	1,230,544
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	中期票據	人民幣	1,000,000	14/12/2022	14/12/2025	4.13%	998,271	21,133	–	1,019,404
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	中期票據	人民幣	1,000,000	23/02/2023	23/02/2026	4.20%	–	1,011,871	–	1,011,871
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	中期票據	人民幣	1,000,000	06/06/2023	06/06/2026	3.81%	–	999,291	–	999,291
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支援票據	人民幣	950,000	29/11/2021	26/05/2023	3.95%	186,327	1,198	187,525	–

43 應付債券（續）

發債主體	債券類型	幣種	面值（原幣千元）	起息日期	到期日期	票面利率	期初餘額	本期增加	本期減少	期末餘額
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支援票據	人民幣	950,000	10/03/2022	26/08/2024	3.30%、3.50%	453,066	5,824	227,084	231,806
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支援票據	人民幣	855,000	22/07/2022	18/01/2023	2.30%	863,411	916	864,327	–
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支援票據	人民幣	950,000	21/09/2022	20/03/2023	2.10%	954,137	4,263	958,400	–
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支援票據	人民幣	955,000	18/01/2023	19/07/2023	2.98%	–	967,447	–	967,447
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支援票據	人民幣	950,000	20/03/2023	15/09/2023	2.96%	–	956,868	–	956,868
海通恒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	07/04/2020	13/02/2023	5.00%	191,107	1,119	192,226	–
海通恒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	22/10/2020	26/06/2023	4.30%	7,030	71	7,101	–
海通恒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	09/12/2020	30/01/2023	4.30%	40,604	138	40,742	–
海通恒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	02/02/2021	27/02/2023	4.55%	44,799	318	45,117	–
海通恒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	25/03/2021	27/02/2023	4.50%	49,387	346	49,733	–
海通恒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	29/04/2021	26/06/2023	4.00%、4.50%	88,165	1,205	89,370	–
海通恒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	31/05/2021	26/01/2023	4.35%	39,331	135	39,466	–
海通恒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	17/06/2021	26/05/2023	3.80%、4.40%	84,519	669	85,188	–
海通恒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	05/08/2021	26/06/2023	3.50%、4.20%	113,787	1,390	115,177	–
海通恒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	24/09/2021	26/04/2023	3.83%、3.99%	139,085	488	139,573	–
海通恒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	19/11/2021	26/05/2023	3.80%、3.95%	231,733	2,418	234,151	–
海通恒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	08/12/2021	28/08/2023	4.00%	179,704	1,834	176,310	5,228

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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（原幣千元）	起息日期	到期日期	票面利率	期初餘額	本期增加	本期減少	期末餘額
海通恒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	26/01/2022	26/05/2023	3.30%、3.40%	140,866	733	141,599	–
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	935,000	28/04/2022	27/12/2024	3.60%、4.40%	463,661	4,234	187,904	279,991
海通恒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	29/06/2022	26/02/2025	3.19%、3.60%	698,906	8,902	288,128	419,680
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	943,000	07/07/2022	15/09/2025	3.50%、4.30%	650,115	10,043	213,805	446,353
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,425,000	16/09/2022	25/12/2025	4.10%	1,395,619	28,972	24,304	1,400,287
海通恒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	21/09/2022	26/08/2025	2.25%-3.40%	817,694	9,843	258,505	569,032
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	984,000	28/10/2022	15/08/2025	3.03%-4.00%	1,007,144	5,083	484,608	527,619
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,425,000	23/12/2022	25/12/2025	4.48%	1,401,010	31,657	28,316	1,404,351
海通恒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	23/12/2022	22/11/2023	4.30%	630,297	335,257	13,907	951,647
海通恒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	13/01/2023	26/08/2025	3.96%-4.70%	–	961,478	264,331	697,147
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	737,000	10/03/2023	23/10/2025	3.58%-4.80%	–	765,249	–	765,249
海通恒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	16/03/2023	28/07/2025	3.20%-4.00%	–	953,741	217,023	736,718
海通恒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	24/05/2023	26/12/2025	2.68%-3.62%	–	947,339	–	947,339
海通恒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	07/06/2023	26/03/2026	2.70%-3.58%	–	943,869	–	943,869
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	非公開定向債務融資工具	人民幣	1,000,000	04/06/2021	04/06/2023	3.95%	1,022,001	16,666	1,038,667	–
海通恒信國際融資租賃股份有限公司	非公開定向債務融資工具	人民幣	1,000,000	11/11/2021	11/11/2024	4.19%	1,002,893	21,559	–	1,024,452

43 應付債券（續）

發債主體	債券類型	幣種	面值（原幣千元）	起息日期	到期日期	票面利率	期初餘額	本期增加	本期減少	期末餘額
海通恒信國際融資租賃股份有限公司／海通恒信小微融資租賃（上海）有限公司	資產支援票據	人民幣	950,000	10/04/2023	26/05/2024	2.90%、3.29%	–	952,329	–	952,329
海通恒信國際融資租賃股份有限公司／海通恒信小微融資租賃（上海）有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	760,000	29/12/2021	15/08/2023	3.95%	235,533	2,632	200,528	37,637
海通恒信國際融資租賃股份有限公司／海通恒信小微融資租賃（上海）有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,140,000	13/04/2022	26/12/2023	3.24%、3.40%	418,334	5,437	301,940	121,831
海通恒信國際融資租賃股份有限公司／海通恒信小微融資租賃（上海）有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,140,000	18/05/2022	26/03/2024	2.95%、3.20%	567,140	6,993	328,264	245,869
海通恒信國際融資租賃股份有限公司／海通恒信小微融資租賃（上海）有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,140,000	12/07/2022	27/05/2024	3.00%、3.03%	790,671	8,994	381,299	418,366
海通恒信國際融資租賃股份有限公司／海通恒信小微融資租賃（上海）有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,140,000	08/09/2022	26/08/2024	2.30%-2.80%	958,318	10,265	379,529	589,054
海通恒信國際融資租賃股份有限公司／海通恒信小微融資租賃（上海）有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,140,000	25/11/2022	26/11/2024	3.18%-3.60%	1,136,240	16,191	416,716	735,715
海通恒信國際融資租賃股份有限公司／海通恒信小微融資租賃（上海）有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,140,000	08/03/2023	26/01/2025	3.15%-3.70%	–	1,145,801	279,790	866,011
海通恒信國際融資租賃股份有限公司／海通恒信小微融資租賃（上海）有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,140,000	16/05/2023	26/03/2025	2.69%-3.43%	–	1,138,100	–	1,138,100

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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（原幣千元）	起息日期	到期日期	票面利率	期初餘額	本期增加	本期減少	期末餘額
海通恒信國際融資租賃股份有限公司／海通恒信小微融資租賃（上海）有限公司	資產支持專項計劃	人民幣	1,140,000	27/06/2023	26/06/2025	2.69%-3.41%	–	1,133,742	–	1,133,742
Haitong UT Brilliant Limited	中期票據	美元	100,000	03/06/2021	03/06/2024	3.00%	672,836	36,454	3,002	706,288
Haitong UT Brilliant Limited	中期票據	美元	200,000	27/04/2022	27/04/2025	4.20%	1,398,585	82,301	28,777	1,452,109
海通國際證券集團有限公司	公司債券	美元	700,000	19/07/2019	19/07/2024	3.38%	4,940,162	184,466	–	5,124,628
海通國際證券集團有限公司	公司債券	美元	400,000	18/11/2019	18/05/2025	3.13%	2,784,763	104,669	–	2,889,432
海通國際證券集團有限公司	公司債券	美元	400,000	02/07/2020	02/07/2023	2.13%	2,812,755	105,758	–	2,918,513
海通國際證券集團有限公司	公司債券	美元	300,000	20/05/2021	20/05/2026	2.13%	2,088,114	77,625	–	2,165,739
Haitong International Finance Holdings 2015 Limited	公司債券	美元	670,000	12/03/2020	11/03/2025	2.11%	4,690,174	185,798	8,539	4,867,433
Haitong International Finance Holdings Limited	公司債券	人民幣	4,000,000	20/04/2023	20/04/2026	3.40%	–	4,026,739	–	4,026,739
Haitong International Finance Holdings Limited	公司債券	人民幣	2,800,000	18/05/2023	18/05/2026	3.20%	–	2,810,739	–	2,810,739
Haitong Investment Ireland PLC	中期票據	美元	350	15/02/2018	23/01/2026	1.71%	1,664	459	–	2,123
Haitong Investment Ireland PLC	中期票據	歐元	1,300	23/07/2018	24/07/2023	1.15%	8,842	761	–	9,603
Haitong Banco de Investimento do Brasil S.A.	金融債券	巴西雷亞爾	1,088,052	21/05/2018至30/06/2023	30/01/2023至30/03/2026	5.00%-15.68%	1,270,918	594,861	102,231	1,763,548
Haitong Bank, S.A.	金融債券	歐元	230,000	08/02/2022	08/02/2025	4.73%	1,707,877	110,591	–	1,818,468
Haitong Bank, S.A.	金融債券	美元	150,000	23/05/2022	29/05/2027	4.00%	1,044,918	43,847	–	1,088,765
合計							181,830,918	59,289,592	35,916,064	205,204,446

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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）

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
就報告目的分析如下：		
流動負債	**62,423,349**	60,153,220
非流動負債	**142,781,097**	121,677,698
	205,204,446	181,830,918

44 應付經紀業務客戶賬款

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
應付經紀業務客戶賬款	**119,909,488**	115,513,463

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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
公司活期存款	**268,190**	341,188
公司定期存款	**2,560,442**	3,074,505
個人活期存款	**10,165**	9,070
個人定期存款	**2,623,566**	1,893,712
	5,462,363	5,318,475
分析如下：		
流動負債	**4,282,383**	3,784,565
非流動負債	**1,179,980**	1,533,910
	5,462,363	5,318,475

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
應付僱員成本（附註i）	**4,179,651**	4,485,011
應付股利	**2,962,134**	7,536
短期融資租賃保證金	**2,017,359**	2,706,970
應付客戶清算款	**1,834,427**	2,222,899
應付票據	**1,589,146**	2,047,521
應付經紀商款項	**1,387,957**	473,659
風險準備金	**761,332**	744,368
其他稅費	**479,440**	468,323
應付手續費及佣金	**148,995**	9,632
應付結算所款項	**14,160**	203,157
其他（附註ii）	**11,761,704**	9,617,007
	27,136,305	22,986,083
分析如下：		
流動負債	**25,637,420**	21,262,810
非流動負債（附註i）	**1,498,885**	1,723,273
	27,136,305	22,986,083

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372,767千元將於一年後償付（2022年12月31日：人民幣373,068千元），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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
未決訴訟及其它	**189,624**	189,288
對外提供擔保	**19,874**	12,417
	209,498	201,705

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
交易性金融負債	**2,619,515**	286,697
合併結構化主體形成的金融負債	**1,211,517**	702,488
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	**11,803,022**	16,122,780
— 黃金期權	**890,945**	279,483
— 收益憑證	**5,996,258**	5,497,032
	22,521,257	22,888,480
就報告目的分析如下：		
流動負債	**11,543,496**	5,478,358
非流動負債	**10,977,761**	17,410,122
	22,521,257	22,888,480

附註：

於2023年6月30日及2022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2023年6月30日止六個月期間和2022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2023年6月30日及2022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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
按抵押品分類劃分：		
股票	**2,393,548**	3,025,125
債券	**70,214,887**	87,906,636
黃金	**10,458,210**	10,762,596
	83,066,645	101,694,357
按市場所分類劃分：		
交易所	**22,945,554**	42,830,883
銀行間市場	**49,371,411**	48,100,878
場外交易市場	**10,749,680**	10,762,596
	83,066,645	101,694,357
就報告目的分析如下：		
流動負債	**82,423,177**	101,694,357
非流動負債	**643,468**	–
	83,066,645	101,694,357

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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2023年6月30日

	以公允價值計量且變動計入損益的金融資產	以公允價值計量且變動計入其他綜合收益的債務工具	以攤餘成本計量的債務工具	買入返售金融資產	其他	合計
已轉移資產的賬面價值	41,404,583	30,047,038	3,248,529	668,669	20,359,084	95,727,903
相關負債的賬面價值	38,146,206	21,762,364	3,034,866	576,354	19,546,855	83,066,645
淨頭寸	3,258,377	8,284,674	213,663	92,315	812,229	12,661,258

於2022年12月31日

	以公允價值計量且變動計入損益的金融資產	以公允價值計量且變動計入其他綜合收益的債務工具	以攤餘成本計量的債務工具	買入返售金融資產	其他	合計
已轉移資產的賬面價值	53,182,215	31,378,291	1,133,028	470,972	23,631,866	109,796,372
相關負債的賬面價值	48,926,215	28,968,402	1,103,113	352,793	22,343,834	101,694,357
淨頭寸	4,256,000	2,409,889	29,915	118,179	1,288,032	8,102,015

50 拆入資金

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
銀行拆入資金	2,965,842	3,244,643
從證金公司融入資金	6,057,050	3,031,458
	9,022,892	6,276,101
就報告目的分析如下：		
流動負債	6,957,129	3,218,363
非流動負債	2,065,763	3,057,738
	9,022,892	6,276,101

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
融資租賃保證金	**4,255,698**	4,303,758
遞延收益	**400,308**	422,792
其它	**626,199**	781,614
	5,282,205	5,508,164

長期應付款主要係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（千股）	金額	股份數目（千股）	金額	股份數目（千股）	金額
按每股人民幣1.00元註冊、發行及繳足：						
於2022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2023年6月30日（未經審計）	**9,654,631**	**9,654,631**	**3,409,569**	**3,409,569**	**13,064,200**	**13,064,200**

於2023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2022年12月31日：有限售條件的股份為781,250千股）。

53 投資重估儲備

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
於期／年初	**(624,143)**	305,179
其他債權投資		
— 於期內公允價值變動淨額	**416,719**	(111,392)
— 處置重分類調整對損益的影響	**(86,912)**	(83,883)
— 預期信用損失重分類調整對損益的影響	**(40,469)**	(63,908)
— 所得稅影響	**(72,483)**	44,121
其他權益工具投資		
— 於期內公允價值變動淨額	**74,507**	(1,462,092)
— 轉至未分配利潤	**47,624**	400,167
— 所得稅影響	**(27,339)**	220,280
所佔聯營企業及合營企業的投資重估損失份額	**2,986**	8,336
設定受益計劃的精算（損失）／收益	**(2,266)**	80,357
指定為現金流量套期的套期工具公允價值變動收益	**46,582**	38,692
於期／年末	**(265,194)**	(624,143)

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
或有負債：		
一 保函和備用信用證	**1,317,784**	1,070,625
承諾：		
一 不可撤銷信貸承諾	**971,059**	1,220,027

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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：

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
1年內	**586,741**	574,682
第1至第2年	**556,183**	556,922
第2至第3年	**480,675**	514,570
第3至第4年	**471,865**	474,325
第4至第5年	**287,568**	348,531
超過5年	**734,262**	829,418
	3,117,294	3,298,448

57 資本承擔

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
有關收購物業及設備的資本開支：		
一 已訂約但未計提	**880,592**	806,385

58 股利

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
確認為分派的股利	**2,743,482**	3,919,260

根據海通證券2023年6月16日召開的2022年度股東週年大會審議批准向全體股東宣派2022年度現金股利每10股人民幣2.10元（含稅），宣派總額為人民幣2,743百萬元（含稅）。於2023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

截至二零二三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法人實體類型	註冊成立／成立地點	本集團持有的股本權益		註冊資本（元）	主要業務
			於2023年6月30日（未經審計）	於2022年12月31日（經審計）		
海富通基金管理有限公司HFT Investment Management Co., Ltd. *	有限責任公司(中外合資) Limited liability company (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Haitong Capital Investment Co., Ltd.*	有限責任公司(法人獨資) Limited liability company (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Haitong International Holdings Limited	不適用 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Haitong Futures Co., Ltd.*	股份有限公司(新三板上市) Joint stock limited company (listed on NEEQ)	上海	83%	83%	人民幣1,301,500,000	期貨代理
海通國際證券集團有限公司Haitong International Securities Group Limited	不適用 N/A	百慕達	73%	68%	港幣843,802,408	投資控股
海通創新證券投資有限公司 Haitong Innovation Securities Investment Company Limited*	有限責任公司(法人獨資) Limited liability company (wholly owned)	上海	100%	100%	人民幣11,500,000,000	金融產品投資、股權投資及證券投資
上海海通證券資產管理有限公司 Shanghai Haitong Securities Asset Management Company Limited*	有限責任公司(法人獨資) Limited liability company (wholly owned)	上海	100%	100%	人民幣2,200,000,000	證券資產管理
海通恒信金融集團有限公司 Haitong UT Capital Group Co., Limited	不適用 N/A	香港	100%	100%	港幣4,146,162,881	投資控股
海通恒信國際融資租賃股份有限公司Haitong UniTrust International Financial Leasing Co., Ltd.*	股份有限公司(上市) Joint stock limited company (listed)	上海	85%	85%	人民幣8,235,300,000	租賃
海通銀行Haitong Bank, S.A.	不適用 N/A	葡萄牙	100%	100%	歐元863,278,725	銀行
上海惟泰置業管理有限公司 Shanghai Weitai Properties Management Co., Ltd.*	有限責任公司(法人獨資) Limited liability company (wholly owned)	上海	100%	100%	人民幣10,000,000	物業管理、房地產開發經營、餐飲企業管理
上海澤春投資發展有限公司 Shanghai Zechun Investment & Development Co., Ltd.*	有限責任公司(法人獨資) Limited liability company (wholly owned)	上海	100%	100%	人民幣100,000,000	實業投資、房地產開發經營、投資管理

附註：

* 英語翻譯名稱僅供參考。

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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

本集團合併了部分結構性主體，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2023年6月30日及2022年12月31日的財務狀況及截至2023年6月30日止六個月期間及2022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2023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34,003,573千元（2022年12月31日：人民幣31,422,817千元）。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2023年6月30日，本集團未持有上述風險級產品（2022年12月31日：人民幣10,497千元）。

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2023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15,258,209千元（2022年12月31日：人民幣15,463,801千元），本集團所面臨風險敞口與賬面價值相若。截至2023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799,614千元（截至2022年6月30日止六個月期間：人民幣964,123千元）。

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2023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
一 上海國盛（集團）有限公司	持股5%以上的股東
一 光明食品（集團）有限公司	重大影響
一 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

截至二零二三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
— 富國基金管理有限公司	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
— 上海併購股權投資基金合夥企業（有限合夥）	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
— 西安軍融電子衛星基金投資有限公司	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
— 遼寧中德產業股權投資基金合夥企業（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
— 許昌海通創新股權投資基金合夥企業（有限合夥）	聯營企業
— 央視融媒體產業投資基金（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
— 上海海通煥新私募投資基金合夥企業（有限合夥）	聯營企業
— 中小企業發展基金海通（合肥）合夥企業（有限合夥）	聯營企業
— 吉林海創長新投資中心（有限合夥）	聯營企業
— 金華市海通重點產業發展招商併購投資合夥企業（有限合夥）	聯營企業
— 吉林海通創新衛星投資中心（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
— 西安航天新能源產業基金投資有限公司	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
— 上海文化產業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
— 嘉興海通旭初股權投資基金合夥企業（有限合夥）	聯營企業

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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	
	2023（未經審計）	2022（未經審計）
佣金及手續費收入		
— 富國基金管理有限公司	**71,699**	85,353
— 央視融媒體產業投資基金（有限合夥）	**40,305**	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）	**8,526**	8,491
— 上海海通煥新私募投資基金合夥企業（有限合夥）	**8,416**	–
— 上海併購股權投資基金二期合夥企業（有限合夥）	**7,500**	7,095
— 中小企業發展基金海通（合肥）合夥企業（有限合夥）	**5,868**	–
— 西安軍融電子衛星基金投資有限公司	**3,774**	2,465
— 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）	**2,423**	1,940
— 廣東南方媒體融合發展投資基金（有限合夥）	**1,960**	2,127
— 吉林省現代農業和新興產業投資基金有限公司	**1,925**	4,261
— 許昌海通創新股權投資基金合夥企業（有限合夥）	**1,509**	1,415
— 光明食品（集團）有限公司	**1,415**	–
— 吉林海創長新投資中心（有限合夥）	**1,403**	–
— 上海國盛（集團）有限公司	**1,138**	86
— 金華市海通重點產業發展招商併購投資合夥企業（有限合夥）	**824**	–
— 吉林海通創新衛星投資中心（有限合夥）	**702**	–
— 海通（吉林）股權投資基金合夥企業（有限合夥）	**306**	575
— 西安航天新能源產業基金投資有限公司	**2**	3,420
— 其他	**40**	277
利息淨收入		
— 上海國盛（集團）有限公司	**345**	535
— 上海電氣控股集團有限公司	**98**	193
— 西安航天新能源產業基金投資有限公司	**89**	232
— 其他	**581**	169
投資收入及收益（淨額）		
— 上海國盛（集團）有限公司	**(2,659)**	2,402

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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）

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
應收賬款		
－西安航天新能源產業基金投資有限公司	**33,055**	33,055
－遼寧海通新動能股權投資基金合夥企業（有限合夥）	**13,540**	20
－上海海通煥新私募投資基金合夥企業（有限合夥）	**8,921**	–
－上海併購股權投資基金二期合夥企業（有限合夥）	**7,950**	–
－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）	**2,568**	–
－金華市海通重點產業發展招商併購投資合夥企業（有限合夥）	**873**	–
－上海國盛（集團）有限公司	**660**	684
－海通興泰（安徽）新興產業投資基金（有限合夥）	**–**	32,881
－上海文化產業股權投資基金合夥企業（有限合夥）	**–**	31,758
－西安航天海通創新新材料股權投資合夥企業（有限合夥）	**–**	8,369
－其他	**40**	120

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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）

	2023年6月30日（未經審計）	2022年12月31日（經審計）
代理買賣證券款		
— 遼寧中德產業股權投資基金合夥企業（有限合夥）	**(248,687)**	–
— 嘉興海通旭初股權投資基金合夥企業（有限合夥）	**(67,241)**	(2,414)
— 上海電氣控股集團有限公司	**(31,216)**	(15,398)
— 西安航天新能源產業基金投資有限公司	**(27,147)**	(826)
— 光明食品（集團）有限公司	**(23,506)**	(23,476)
— 上海併購股權投資基金二期合夥企業（有限合夥）	**(52)**	(50,065)
— 上海併購股權投資基金合夥企業（有限合夥）	**(38)**	(57,192)
— 其他	**(32)**	(42)
應付款項		
— 上海國盛（集團）有限公司	**(58,240)**	(56,980)
— 西安軍融電子衛星基金投資有限公司	**(2,292)**	–
— 吉林省現代農業和新興產業投資基金有限公司	**(1,710)**	–
衍生金融資產		
— 上海國盛（集團）有限公司	**840**	2,310

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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	
	2023（未經審計）	2022（未經審計）
短期福利：		
一 袍金、薪金、佣金及花紅	**12,475**	17,625
退休後福利：		
一 僱主向退休金計劃／年金計劃供款	**432**	417

上述集團主要管理人員在告期內從公司獲得的稅前報酬總額未包含在2023年度遞延發放的、歸屬於過往年度的薪酬，共計8.33百萬元。

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2023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2022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

截至二零二三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。

	2023年6月30日（未經審計）		2022年12月31日（經審計）	
	賬面價值	公允價值	賬面價值	公允價值
金融資產				
以攤餘成本計量的債務工具	**7,570,912**	**7,366,807**	5,806,157	5,546,901
金融負債				
非可轉換債券	**205,204,446**	**205,906,783**	181,830,918	182,341,774

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

截至二零二三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

下表呈列於2023年6月30日及2022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）				
於2023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				
－債券投資	1,259,580	84,653,891	7,290,467	93,203,938
－權益投資	10,103,360	591,764	19,975,657	30,670,781
－基金	6,526,252	43,477,122	16,200,548	66,203,922
－其他	–	11,990,192	6,868,577	18,858,769
以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具	1,112,675	44,216,128	723,949	46,052,752
以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具	6,457,172	–	1,011,524	7,468,696
衍生金融資產	117,997	748,304	1,066,124	1,932,425
	25,577,036	185,677,401	53,136,846	264,391,283
以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債				
－交易性金融負債	682,858	1,936,657	–	2,619,515
－指定為以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債	443,866	5,306,556	14,151,320	19,901,742
衍生金融負債	658	422,216	882,717	1,305,591
	1,127,382	7,665,429	15,034,037	23,826,848

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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

	第一層	第二層	第三層	合計
（經審計）				
於2022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	1,357,059	92,234,054	8,043,192	101,634,305
－權益投資	11,227,920	640,956	18,475,101	30,343,977
－基金	3,480,911	41,501,759	13,871,281	58,853,951
－其他	–	12,983,497	5,782,999	18,766,496
以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的債務工具	901,956	51,107,051	842,892	52,851,899
以公允價值計量且其變動計入其他全面收益的權益工具	5,101,492	–	994,827	6,096,319
衍生金融資產	44,366	646,636	786,165	1,477,167
	22,113,704	199,113,953	48,796,457	270,024,114
以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債				
－交易性金融負債	164,914	121,783	–	286,697
－指定為以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債	601,363	3,136,206	18,864,214	22,601,783
衍生金融負債	–	535,107	363,312	898,419
	766,277	3,793,096	19,227,526	23,786,899

中期簡明綜合財務資料附註

截至二零二三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

以第三層級公允價值計量的金融資產和金融負債調節。

於2023年6月30日（未經審計）

	以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產	以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的權益工具	以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的債務工具	以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債	衍生金融工具
於2022年12月31日及2023年1月1日	**46,172,573**	**994,827**	**842,892**	**18,864,214**	**422,853**
轉入	**1,777,371**	**1,400**	**28,300**	**–**	**45,198**
購買／（處置）	**3,343,839**	**–**	**(237,279)**	**(6,904,390)**	**(14,366)**
轉出	**(2,214,753)**	**–**	**–**	**–**	**661**
其他損益	**1,256,219**	**15,297**	**90,036**	**2,191,496**	**(270,939)**
於2023年6月30日	**50,335,249**	**1,011,524**	**723,949**	**14,151,320**	**183,407**

於2022年12月31日（經審計）

	以公允價值計量且其變動計入損益的金融資產	以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的權益工具	以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的債務工具	以公允價值計量且其變動計入損益的金融負債	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	17,740,117	–	–	437,844	538
購買／（處置）	4,503,120	894,031	(522,110)	17,465,797	(1,114,928)
轉出	(6,394,652)	–	(6,200)	–	–
其他損益	(331,643)	(287,996)	83,775	514,872	1,865,979
於2022年12月31日	46,172,573	994,827	842,892	18,864,214	422,853

於2023年1月1日至6月30日期間及2022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

截至二零二三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應付債券。

截至2023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13,154百萬元（2022年12月31日：人民幣10,149百萬元）。

資產支持票據

本集團於日常業務過程中進行證券化交易，即本集團向結構化主體轉讓應收融資租賃款及售後回租安排的應收款，而結構化主體在中國銀行間市場向投資者發行資產支持票據。由於本集團持有所有次級資產支持票據，保留已轉移資產的絕大部分風險及報酬，因此繼續確認全部已轉移資產並就已收代價確認應付債券。

截至2023年6月30日，本集團已轉移但未予終止確認的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2,241百萬元（2022年12月31日：人民幣1,887百萬元）。

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2023年6月30日，上述轉讓資產的賬面價值為人民幣2,125百萬元（2022年12月31日：人民幣2,821百萬元）。

66 報告期後事項

本公司第七屆董事會第二十一次會議審議通過了《關於調整海通恒信金融集團有限公司股權架構的議案》，擬將海通恆信金融集團有限公司由全資二級子公司變更為全資一級子公司。2023年8月17日，股權轉讓事項經香港稅務局審核後正式生效，海通恆信金融集團有限公司於當日同步完成股東名冊變更，海通恆信金融集團有限公司已由本公司直接全資持有。

本公司於2023年8月25日發佈《海通證券股份有限公司關於籌劃回購公司A股股份的提示性公告》，擬通過集中競價交易方式回購A股股份，回購資金額預計為3-6億元人民幣，預計本次回購A股股份價格不超過本公司董事會通過回購股份決議前30個交易日公司A股股票交易均價的150%，且不超過人民幣12.8元／股（含）。本次回購股份實施期限為自董事會審議通過回購方案之日起3個月內。擬回購股份將在符合所有適用的法律、法規及本公司股票上市地證券監督管理機構的相關規則的前提下進行。

本集團無其他重大的報告期後事項。