

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。



海通證券股份有限公司  
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)

## 關於計提資產減值準備的公告

本公告乃由海通證券股份有限公司（「本公司」）根據香港法例第571章證券及期貨條例第XIVA部項下內幕消息條文（定義見香港聯合交易所有限公司證券上市規則（「上市規則」））及上市規則第13.09(2)條與第13.10B條而作出。

### 一、計提資產減值準備情況概述

根據《企業會計準則》和本公司會計政策的相關規定，為真實、公允地反映本公司截至2020年12月31日的財務狀況及2020年的經營成果，本公司及下屬子公司對截至2020年12月31日的各項需要計提減值的資產進行了預期信用損失評估，在2020年上半年已計提資產減值準備的基礎上（詳見本公司日期為2020年8月28日的《關於計提資產減值準備的公告》），本公司2020年7-12月共計提信用減值損失人民幣156,564.09萬元，對淨利潤的影響超過本公司2019年經審計的淨利潤的10%，具體如下：

單位：人民幣萬元

項目	2020年7-12月 計提金額
融出資金	35,994.69
買入返售金融資產	15,595.19
應收融資租賃款	64,291.83
其他債權投資	25,575.79
其他	15,106.59
合計	<u>156,564.09</u>

## 二、計提資產減值準備對本公司的影響

2020年7-12月，本公司合併報表計提資產減值準備156,564.09萬元，減少利潤總額156,564.09萬元，減少淨利潤117,996.24萬元。

## 三、計提資產減值準備的具體說明

### 1、融出資金

2020年7-12月計提融出資金減值準備3.60億元。

對於融出資金業務，根據融資主體特徵和擔保證券預期處置變現狀況，綜合評估融資主體的預期可回收現金流量，採用違約概率／違約損失率法或單項測試計算其預期信用損失，計提減值準備。

### 2、買入返售金融資產

2020年7-12月計提買入返售金融資產減值準備1.56億元。

對於股票質押和約定購回業務，採用違約概率／違約損失率法或單項測試計算其預期信用損失，依據擔保證券的預期處置變現價值，綜合評估融資主體的預期可回收現金流量，折現後預期仍不足以覆蓋其風險敞口的部分，計提減值準備。

### 3、應收融資租賃款

2020年7-12月計提應收融資租賃款減值準備6.43億元。

對於融資租賃業務，根據應收融資租賃款的信用風險變化評估預期信用損失並確定相應的信用損失準備，在個別檢查的基礎上，採用違約概率／違約損失率法或單項測試計算預期信用損失。

### 4、其他債權投資

2020年7-12月計提其他債權投資減值準備2.56億元。

對於其他債權投資業務，綜合考慮債務人信用評級和信用風險變化情況，採用違約概率／違約損失率法或單項測試計算預期信用損失。

## 5、其他

除上述融出資金、買入返售金融資產、應收融資租賃款、其他債權投資等資產減值損失外，依據其他各類業務的性質，對面臨的其他各類信用風險進行識別、評估，根據《企業會計準則》和本公司相關會計政策及管理辦法，2020年7-12月計提售後回租業務形成的長期應收款減值準備等其他減值準備合計1.51億元。

## 四、其他相關說明

上述事項為本公司對資產減值準備的初步評估，最終計提情況以經審計的年度報告為準。目前，本公司經營管理情況正常，財務狀況穩健，流動性充足，本次計提後能夠更加真實地反映本公司的財務狀況。

本公司於同日披露的2020年度業績快報公告中的相關數據已包含本次計提的資產減值準備。本公司將根據相關法律法規要求和評估情況及時履行信息披露義務。敬請廣大投資者注意投資風險。

承董事會命  
海通證券股份有限公司  
董事長  
周杰

中國上海  
2021年2月26日

於本公告刊發日期，本公司執行董事為周杰先生、瞿秋平先生及任澎先生；本公司非執行董事為屠旋旋先生、周東輝先生、余莉萍女士及許建國先生；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