

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分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。



(於中華人民共和國註冊成立的股份有限公司，  
中文公司名稱為華泰證券股份有限公司，在香港以HTSC名義開展業務)  
(股份代號：6886)

## 截至2022年6月30日止六個月之中期業績公告

董事會謹此宣佈，本公司及其附屬公司截至2022年6月30日止六個月之未經審計中期業績。本中期業績公告符合《香港上市規則》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

本中期業績公告將分別在香港交易及結算所有限公司披露易網站([www.hkexnews.hk](http://www.hkexnews.hk))及本公司網站([www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn))刊載。

本公司2022年中期報告將於適當時候寄發予H股股東，並在香港交易及結算所有限公司披露易網站及本公司網站刊載。

### 釋義

除文義另有所指外，本公告所用詞彙應與本公告列載的本公司2022年中期報告「釋義」章節所界定者具有相同涵義。

承本公司董事會命  
聯席公司秘書  
張輝

中國江蘇，2022年8月30日

於本公告日期，董事會成員包括執行董事張偉先生、周易先生及尹立鴻女士；非執行董事丁鋒先生、陳仲揚先生、柯翔先生及胡曉女士；以及獨立非執行董事劉艷女士、陳志斌先生、王建文先生、區璟智女士及王全勝先生。

## 目錄

|                  |     |
|------------------|-----|
| 重要提示.....        | 3   |
| 釋義 .....         | 5   |
| 公司簡介和主要財務指標..... | 10  |
| 管理層討論與分析 .....   | 18  |
| 公司治理.....        | 80  |
| 環境與社會責任 .....    | 91  |
| 重要事項.....        | 96  |
| 股份變動及股東情況 .....  | 112 |
| 債券相關情況 .....     | 117 |
| 備查文件目錄 .....     | 124 |
| 證券公司信息披露 .....   | 124 |
| 附錄： 信息披露索引 ..... | 125 |
| 中期財務報告           |     |

## 重要提示

一、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內容的真實、準確、完整，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。

## 二、未出席董事情況

| 未出席董事職務 | 未出席董事姓名 | 未出席董事的原因說明 | 被委託人姓名 |
|---------|---------|------------|--------|
| 董事      | 陳仲揚     | 公務原因       | 柯翔     |
| 董事      | 胡曉      | 公務原因       | 張偉     |
| 董事      | 尹立鴻     | 公務原因       | 張偉     |
| 獨立董事    | 區璟智     | 公務原因       | 陳志斌    |

三、本中期報告未經審計。

四、公司負責人張偉、主管會計工作負責人焦曉寧及會計機構負責人（會計主管人員）費雷聲明：保證中期報告中財務報告的真實、準確、完整。

五、董事會決議通過的本報告期利潤分配預案或公積金轉增股本預案。

公司董事會在審議中期報告時，未擬定利潤分配預案、資本公積金轉增股本預案。

## 六、前瞻性陳述的風險聲明

本中期報告涉及的未來計劃、發展戰略等前瞻性陳述不構成公司對投資者的實質承諾，請投資者注意投資風險。

七、本公司不存在被控股股東及其關聯方非經營性佔用資金情況。

八、本公司不存在違反規定決策程序對外提供擔保的情況。

九、本公司不存在半數以上董事無法保證公司所披露中期報告的真實性、準確性和完整性。

十、本公司以中英文兩種語言編製本中期報告。在對本報告的中英文版本理解上發生歧義時，以中文為準。

## 十一、重大風險提示

宏觀經濟及貨幣政策、影響金融及證券行業的法律法規、商業及金融行業的漲跌趨勢、通脹、匯率波動、長短期市場資金來源的可用性、融資成本與利率水平及波動等整體經濟及政治狀況因素，均可能會對公司的業務產生影響。另一方面，與證券行業其他公司一樣，市場波動、交易量等證券市場固有風險因素也可能會對公司的業務產生影響。公司無法保證有利的政治經濟及市場狀況會持續。

公司經營中面臨的風險主要包括：因國家宏觀調控措施，與證券行業相關的法律法規、監管政策及交易規則等變動，從而對證券公司經營產生不利影響的政策性風險；因經營管理或執業行為違反法律、法規或準則而使公司受到法律制裁、被採取監管措施、遭受財產損失或聲譽損失的合規風險；因未能遵循法律法規規定及要求，致使公司面臨訴訟糾紛、賠償、罰款，導致公司受損失的法律風險；因市場價格（利率、匯率、股票價格和商品價格等）的波動而引起的公司資產發生損失的市場風險；因產品或債券發行人違約、交易對手（客戶）違約導致公司資產受損失的信用風險；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的資金需求的流動性風險；內外部原因造成公司信息系統發生各類技術故障或數據洩露，導致信息系統在業務實現、響應速度、處理能力、數據加密等方面不能保障交易與業務管理穩定、高效、安全地進行，從而造成損失的信息技術風險；因不完善或有問題的內部程序、人員、系統或外部事件所造成公司損失的操作風險；公司經營、管理及其他行為或外部事件導致有關媒體對公司負面評價的聲譽風險；公司的產品或服務被不法分子利用從事洗錢活動，進而對公司在法律、聲譽、合規、經營等方面造成不利影響的洗錢風險；此外，隨著公司國際化戰略的推進，公司業務進入到美國、英國、香港等其他國家和地區，公司面臨的市場環境和監管要求更加複雜。

## 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：

### 常用詞語釋義

|           |   |  |
|-----------|---|--|
| A股        | 指 | 公司每股面值人民幣1.00元的內資股，於上交所上市並以人民幣買賣             |
| AoP       | 指 | Assets on Platform，平台資產規模                    |
| APP       | 指 | Application，應用程序                             |
| 公司章程      | 指 | 本公司的公司章程（經不時修訂、補充或以其他方式修改）                   |
| AssetMark | 指 | AssetMark Financial Holdings, Inc.           |
| 江蘇銀行      | 指 | 江蘇銀行股份有限公司                                   |
| 董事會       | 指 | 本公司董事會                                       |
| 北交所       | 指 | 北京證券交易所                                      |
| CAGR      | 指 | 複合年增長率                                       |
| 中國企業會計準則  | 指 | 中國企業會計準則                                     |
| 中國        | 指 | 中華人民共和國                                      |
| 南方基金      | 指 | 南方基金管理股份有限公司                                 |
| 交通控股      | 指 | 江蘇交通控股有限公司                                   |
| 公司法       | 指 | 《中華人民共和國公司法》（經不時修訂）                          |
| 滬深300指數   | 指 | 上交所與深交所聯合以規模和流動性作為根本標準，挑選最具代表性的300支股票組成指數樣本股 |
| 中國證監會     | 指 | 中國證券監督管理委員會                                  |
| 董事        | 指 | 本公司董事  |

|                     |   |  |
|---------------------|---|--|
| FICC                | 指 | 固定收益、貨幣及商品   |
| Fintech             | 指 | 金融科技   |
| 期貨IB業務              | 指 | 證券公司接受期貨公司委託，為期貨公司介紹客戶參與期貨交易並提供其他相關服務的業務活動   |
| GDR                 | 指 | 全球存託憑證   |
| 江蘇高投                | 指 | 江蘇高科技投資集團有限公司  |
| 本集團、集團              | 指 | 本公司及下屬控股公司，以及彼等各自的前身公司   |
| 國信集團                | 指 | 江蘇省國信集團有限公司（前稱江蘇省國信資產管理集團有限公司）   |
| H股                  | 指 | 公司每股面值人民幣1.00元的外資股，於香港聯交所上市並以港元買賣  |
| 香港交易所               | 指 | 香港交易及結算所有限公司   |
| 港元                  | 指 | 香港法定貨幣   |
| 香港                  | 指 | 中國香港特別行政區  |
| 香港聯交所               | 指 | 香港聯合交易所有限公司  |
| 華泰證券、本公司、<br>公司、母公司 | 指 | 於中國以華泰證券股份有限公司的公司名稱註冊成立的股份有限公司，於2007年12月7日由前身華泰證券有限責任公司改制而成，在香港以「HTSC」名義開展業務，根據公司條例第16部以中文獲准名稱「華泰六八八六股份有限公司」及英文公司名稱「Huatai Securities Co., Ltd.」註冊為註冊非香港公司，其H股於2015年6月1日在香港聯交所主板上市（股票代碼：6886），其A股於2010年2月26日在上交所上市（股票代碼：601688），其全球存託憑證於2019年6月在倫交所上市（證券代碼：HTSC），除文義另有所指外，亦包括其前身 |
| 華泰資管公司              | 指 | 華泰證券全資子公司華泰證券（上海）資產管理有限公司  |
| 華泰金控（香港）            | 指 | 華泰國際全資子公司華泰金融控股（香港）有限公司  |
| 華泰公益基金會             | 指 | 江蘇省華泰公益基金會   |

|                     |   |  |
|---------------------|---|--|
| 華泰期貨                | 指 | 華泰證券控股子公司華泰期貨有限公司，報告期後變更為華泰證券全資子公司                   |
| 華泰創新投資              | 指 | 華泰證券全資子公司華泰創新投資有限公司                                  |
| 華泰國際                | 指 | 華泰證券全資子公司華泰國際金融控股有限公司                                |
| 華泰柏瑞                | 指 | 華泰柏瑞基金管理有限公司   |
| 華泰紫金投資              | 指 | 華泰證券全資子公司華泰紫金投資有限責任公司                                |
| 華泰證券(美國)            | 指 | 華泰國際全資子公司華泰證券(美國)有限公司(Huatai Securities (USA), Inc.) |
| 華泰聯合證券              | 指 | 華泰證券控股子公司華泰聯合證券有限責任公司                                |
| 國際財務報告準則            | 指 | 國際財務報告準則   |
| IPO                 | 指 | 首次公開發售   |
| IT                  | 指 | 信息技術   |
| 江蘇股權交易中心            | 指 | 華泰證券控股子公司江蘇股權交易中心有限責任公司                              |
| 江蘇省國資委              | 指 | 江蘇省政府國有資產監督管理委員會                                     |
| 江蘇證監局               | 指 | 中國證監會江蘇監管局   |
| 《上市規則》或<br>《香港上市規則》 | 指 | 《香港聯合交易所有限公司證券上市規則》(經不時修訂、增補或以其他方式修改)                |
| 倫交所                 | 指 | 倫敦證券交易所  |
| 《標準守則》              | 指 | 《香港上市規則》附錄十《上市發行人董事進行證券交易的標準守則》                      |
| MSCI                | 指 | 摩根士丹利國際資本指數  |
| 新三板                 | 指 | 全國中小企業股份轉讓系統   |

|         |   |  |
|---------|---|--|
| 月活數     | 指 | 月度活躍用戶數                                |
| OTC     | 指 | 櫃台交易                                   |
| 中國人民銀行  | 指 | 中國人民銀行                                 |
| QDII    | 指 | 合格境內機構投資者                              |
| QFII    | 指 | 合格境外機構投資者                              |
| 報告期     | 指 | 2022年1月1日至2022年6月30日止六個月期間             |
| 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)     |
| 香港證監會   | 指 | 香港證券及期貨事務監察委員會                         |
| 上海新世紀   | 指 | 上海新世紀資信評估投資服務有限公司                      |
| 上海清算所   | 指 | 銀行間市場清算所股份有限公司                         |
| 上交所     | 指 | 上海證券交易所                                |
| 深交所     | 指 | 深圳證券交易所                                |
| 上證50指數  | 指 | 上交所挑選上海證券市場規模大、流動性好的最具代表性的50支股票組成指數樣本股 |
| 社保基金會   | 指 | 全國社會保障基金理事會                            |
| 科創板     | 指 | 上交所科技創新板                               |
| 監事      | 指 | 本公司監事                                  |
| 監事會     | 指 | 本公司監事會                                 |



|        |   |   |
|--------|---|---|
| TAMP   | 指 | Turn-key Asset Management Platform，統包資產管理平台，提供投資產品及策略、資產組合管理、客戶關係管理、資產託管、企業運營等服務的技術平台 |
| 美元     | 指 | 美利堅合眾國法定貨幣美元  |
| VAR    | 指 | 風險價值  |
| Wind資訊 | 指 | 萬得信息技術股份有限公司，一家中國大陸金融資料、信息和軟件服務企業   |
| %      | 指 | 百分比   |

2022年中期報告中，部分合計數與各加總數直接相加之和在尾數上可能略有差異，這些差異是由於四捨五入造成的；同一科目變動比例在尾數上可能略有差異，這些差異是由於科目金額單位不同造成的。

## 公司簡介和主要財務指標

### 一、公司信息

|                 |                             |
|-----------------|-----------------------------|
| 公司的中文名稱         | 华泰證券股份有限公司                  |
| 公司的中文簡稱         | 華泰證券                        |
| 公司的外文名稱         | HUATAI SECURITIES CO., LTD. |
| 公司的外文名稱縮寫       | HTSC                        |
| 公司的法定代表人        | 張偉                          |
| 公司首席執行官、執行委員會主任 | 周易                          |
| 公司的授權代表         | 周易、張輝                       |

### 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 | 9,076,650,000.00  | 9,076,650,000.00  |
| 淨資本  | 86,190,064,482.77 | 82,314,070,326.70 |

### 公司的各單項業務資格情況

根據江蘇省市場監督管理局核發的營業執照，公司經營範圍包括：證券經紀業務，證券自營，證券承銷業務（限承銷國債、非金融企業債務融資工具、金融債（含政策性金融債）），證券投資諮詢，為期貨公司提供中間介紹業務，融資融券業務，代銷金融產品業務，證券投資基金代銷，證券投資基金託管，黃金等貴金屬現貨合約代理和黃金現貨合約自營業務，股票期權做市業務，中國證監會批准的其他業務。（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）

## 二、董事會及專門委員會名單

### 董事會名單

#### 執行董事

張偉先生(董事長)  
周易先生(首席執行官、執行委員會主任)  
尹立鴻女士

#### 非執行董事

丁鋒先生  
陳仲揚先生  
柯翔先生  
胡曉女士

#### 獨立非執行董事

劉艷女士  
陳志斌先生  
王建文先生  
區璟智女士  
王全勝先生

### 專門委員會名單

#### 發展戰略委員會

張偉先生(主席)  
周易先生  
陳仲揚先生  
胡曉女士

#### 合規與風險管理委員會

周易先生(主席)  
柯翔先生  
王建文先生

#### 審計委員會

陳志斌先生(主席)  
丁鋒先生  
區璟智女士

#### 提名委員會

劉艷女士(主席)  
尹立鴻女士  
王全勝先生

#### 薪酬與考核委員會

陳志斌先生(主席)  
劉艷女士  
王全勝先生

### 三、聯繫人和聯繫方式

#### 董事會秘書

姓名 張輝  
聯繫地址 中國江蘇省南京市江東中路228號1號樓11樓  
電話 025-83387272、83387780、83389157  
傳真 025-83387784  
電子信箱 zhanghui@htsc.com

#### 聯席公司秘書

姓名 張輝  
聯繫地址 中國江蘇省南京市  
江東中路228號1號樓11樓

#### 聯席公司秘書

鄺燕萍  
中國香港灣仔皇后大道東248號  
大新金融中心40樓

### 四、基本情況變更簡介

|               |  |
|---------------|--|
| 公司註冊地址        | 中國江蘇省南京市江東中路228號   |
| 公司註冊地址的歷史變更情況 | 2015年7月，本公司辦理了工商登記變更手續，註冊地址由「中國江蘇省南京市中山東路90號」變更為「中國江蘇省南京市江東中路228號」 |
| 公司辦公地址        | 中國江蘇省南京市江東中路228號   |
| 公司辦公地址的郵政編碼   | 210019   |
| 香港主要營業地址      | 中國香港皇后大道中99號中環中心42樓4201室   |
| 公司網址          | <a href="http://www.htsc.com.cn">http://www.htsc.com.cn</a>        |
| 電子信箱          | boardoffice@htsc.com   |
| 公司總機          | 025-83389999   |
| 客服熱線          | 95597或4008895597   |
| 公司傳真          | 025-83387784   |
| 營業執照統一社會信用代碼  | 91320000704041011J   |
| 指數納入情況簡要      | 上證50指數、滬深300指數、MSCI中國股指數   |
| 報告期內變更情況查詢索引  | 報告期內無變更  |

## 五、信息披露及備置地點變更情況簡介

|                     |   |
|---------------------|---|
| 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   |
| 登載中期報告的中國證監會指定網站的網址 | <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>                             |
| 登載中期報告的香港聯交所指定網站的網址 | <a href="http://www.hkexnews.hk">http://www.hkexnews.hk</a>                           |
| 登載中期報告的倫交所指定網站的網址   | <a href="https://www.londonstockexchange.com">https://www.londonstockexchange.com</a> |
| 公司中期報告備置地點 (A股)     | 中國江蘇省南京市江東中路228號；上交所  |
| 公司中期報告備置地點 (H股)     | 中國江蘇省南京市江東中路228號；<br>中國香港皇后大道中99號中環中心42樓4201室   |
| 報告期內變更情況查詢索引        | 報告期內無變更   |

## 六、公司通訊語言版本及備索取渠道

本公司現根據H股股東各自選擇的語言版本及獲取方法向H股股東提供公司通訊。H股股東有如下選擇：

- 瀏覽及／或下載於本公司網站 [www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn) 登載之公司通訊，並收取有關登載公司通訊之通知印刷本；或
- 僅收取公司通訊的英文印刷本；或
- 僅收取公司通訊的中文印刷本；或
- 收取公司通訊英文及中文印刷本。

H股股東可隨時選擇及／或更改獲取公司通訊的語言版本及／或公司通訊的收取方式。H股股東可以以下方式通知本公司：

- 書面通知：中國香港灣仔皇后大道東183號合和中心17M樓
- 電郵通知：[huatai.ecom@computershare.com.hk](mailto:huatai.ecom@computershare.com.hk)

有關公司通訊語言版本及備索取渠道的安排，H股股東可隨時致電+852 2862 8688查詢。

## 七、公司股票／存託憑證簡況

| 股票／存託憑證種類 | 上市交易所 | 證券簡稱                        | 證券代碼   |
|-----------|-------|-----------------------------|--------|
| A股        | 上交所   | 華泰證券                        | 601688 |
| H股        | 香港聯交所 | HTSC                        | 6886   |
| GDR       | 倫交所   | Huatai Securities Co., Ltd. | HTSC   |

本公司未變更證券簡稱。

## 八、其他相關資料

### (一) 會計師事務所

|                 |            |   |
|-----------------|------------|---|
| 公司聘請的會計師事務所(境內) | 名稱<br>辦公地址 | 德勤華永會計師事務所(特殊普通合夥)<br>中國上海市黃浦區延安東路222號30樓                       |
| 公司聘請的會計師事務所(香港) | 名稱<br>辦公地址 | 德勤•關黃陳方會計師行<br>於香港《財務匯報局條例》下的註冊公眾利益實體核數師<br>中國香港金鐘道88號太古廣場一期35樓 |
| 公司聘請的會計師事務所(英國) | 名稱<br>辦公地址 | 德勤華永會計師事務所(特殊普通合夥)<br>中國上海市黃浦區延安東路222號30樓                       |

### (二) 法律顧問

|               |            |   |
|---------------|------------|---|
| 公司聘請的法律顧問(境內) | 名稱<br>辦公地址 | 北京市金杜律師事務所<br>中國北京市朝陽區東三環中路1號<br>環球金融中心辦公室東樓18層 |
| 公司聘請的法律顧問(境外) | 名稱<br>辦公地址 | 高偉紳律師行<br>中國香港中環康樂廣場1號怡和大廈27樓                   |

### (三) 股份登記處

|         |      |                                       |
|---------|------|---------------------------------------|
| A股股份登記處 | 名稱   | 中國證券登記結算有限責任公司上海分公司                   |
|         | 辦公地址 | 中國上海市浦東新區楊高南路188號                     |
| H股股份登記處 | 名稱   | 香港中央證券登記有限公司                          |
|         | 辦公地址 | 中國香港灣仔皇后大道東183號<br>合和中心17樓1712-1716號舖 |

## 九、公司主要會計數據和財務指標

(本報告所載會計數據和財務指標按照國際財務報告準則編製)

### (一) 主要會計數據

單位：千元 幣種：人民幣

| 項目              | 本報告期       | 上年同期         | 本報告期<br>比上年同期<br>增減(%) |
|-----------------|------------|--------------|------------------------|
| 收入、其他收入及收益總計    | 23,479,022 | 24,615,529   | (4.62)                 |
| 所得稅前利潤          | 6,773,996  | 10,036,901   | (32.51)                |
| 本期利潤－歸屬於本公司股東   | 5,375,208  | 7,770,308    | (30.82)                |
| 經營活動所得／(所用)現金淨額 | 26,018,313 | (30,531,020) | 不適用                    |
| 本期稅後其他綜合收益總額    | 515,614    | (463,027)    | 不適用                    |

單位：千元 幣種：人民幣

| 項目         | 本報告期末         | 上年度末          | 本報告期末<br>比上年度末<br>增減(%) |
|------------|---------------|---------------|-------------------------|
| 資產總額       | 849,322,705   | 806,650,833   | 5.29                    |
| 負債總額       | 692,930,157   | 654,615,049   | 5.85                    |
| 本公司股東應佔總權益 | 152,469,597   | 148,422,810   | 2.73                    |
| 股東權益合計     | 156,392,548   | 152,035,784   | 2.87                    |
| 總股本(股)     | 9,076,650,000 | 9,076,650,000 | -                       |

## (二) 主要財務指標

| 主要財務指標                    | 本報告期  | 上年同期  | 本報告期<br>比上年同期<br>增減(%) |
|---------------------------|-------|-------|------------------------|
| 基本每股收益(人民幣元/股)            | 0.58  | 0.86  | (32.56)                |
| 稀釋每股收益(人民幣元/股)            | 0.56  | 0.86  | (34.88)                |
| 加權平均淨資產收益率(%)             | 3.69  | 5.73  | 減少2.04個百分點             |
| 資產負債率(%)                  | 77.35 | 78.75 | 減少1.40個百分點             |
| 歸屬於本公司股東每股淨資產<br>(人民幣元/股) | 15.40 | 14.63 | 5.26                   |

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



### (三) 母公司的淨資本及風險控制指標

單位：元 幣種：人民幣

| 項目                   | 本報告期末              | 上年度末               |
|----------------------|--------------------|--------------------|
| 淨資本                  | 86,190,064,482.77  | 82,314,070,326.70  |
| 淨資產                  | 128,816,353,549.35 | 126,702,081,824.87 |
| 風險覆蓋率(%)             | 248.30             | 246.45             |
| 淨資本／淨資產(%)           | 66.91              | 64.97              |
| 淨資本／負債(%)            | 20.98              | 21.42              |
| 淨資產／負債(%)            | 31.36              | 32.97              |
| 自營權益類證券及其衍生品／淨資本(%)  | 49.91              | 49.80              |
| 自營非權益類證券及其衍生品／淨資本(%) | 366.60             | 291.29             |
| 核心淨資本                | 59,490,064,482.77  | 58,314,070,326.70  |
| 附屬淨資本                | 26,700,000,000.00  | 24,000,000,000.00  |
| 各項風險資本準備之和           | 34,712,190,294.21  | 33,399,876,683.34  |
| 表內外資產總額              | 451,972,317,208.81 | 422,846,924,915.98 |
| 資本槓桿率(%)             | 15.21              | 15.99              |
| 流動性覆蓋率(%)            | 142.18             | 169.68             |
| 淨穩定資金率(%)            | 131.44             | 126.98             |

### 十、境內外會計準則下會計數據差異

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

## 管理層討論與分析

### 一、報告期內公司所屬行業及主營業務情況說明

本集團所屬行業是證券行業。證券行業的營業收入和利潤水平對證券市場變化趨勢的依賴程度較高，具有較強的週期性與波動性特點。本集團的證券業務也依賴並受益於我國的經濟增長及我國資本市場的發展及表現，受經濟環境、監管環境、投資者情緒以及國際市場等多方面因素影響。

本集團是一家國內領先的科技驅動型證券集團，擁有高度協同的業務模式、先進的數字化平台以及廣泛且緊密的客戶資源。本集團從事的主要業務包括財富管理業務、機構服務業務、投資管理業務和國際業務。本集團搭建了客戶導向的組織架構及機制，通過線上線下有機結合的方式，為個人和機構客戶提供全方位的證券及金融服務，並致力於成為兼具本土優勢和全球影響力的一流投資銀行。

#### 1、**財富管理業務**

依託移動APP與PC端專業平台、分公司與證券期貨營業部、華泰國際及其下屬境外子公司，以線上線下和境內境外聯動模式，向各類客戶提供多元化財富管理服務，包括證券期貨期權經紀、金融產品銷售、基金投資顧問、資本中介等業務。證券期貨期權經紀業務方面，主要代理客戶買賣股票、基金、債券、期貨及期權等，提供交易服務。金融產品銷售業務方面，主要向客戶提供各種金融產品銷售服務和資產配置服務，相關金融產品由本集團及其他金融機構管理。基金投資顧問業務方面，主要是接受客戶委託，在客戶授權的範圍內，按照協議約定為客戶做出投資基金的具體品種、數量和買賣時機的選擇，並代替客戶進行基金產品申購、贖回、轉換等交易申請。資本中介業務方面，向客戶提供融資融券、股票質押式回購等多樣化融資服務。財富管理業務主要業績驅動因素包括手續費及佣金收入、利息收入等。

## 2、機構服務業務

以機構銷售為紐帶，整合投資銀行、機構投資者服務和投資交易業務資源，為各類企業及金融機構客戶提供全方位的綜合金融服務，主要包括投資銀行業務、主經紀商業務、研究與機構銷售業務和投資交易業務。

- (1) 投資銀行業務主要包括股權承銷、債券承銷、財務顧問和場外業務等。股權承銷業務方面，為客戶提供首次公開發行及股權再融資服務。債券承銷業務方面，為客戶提供各類債券融資服務。財務顧問業務方面，從產業佈局和策略角度為客戶提供以併購為主的財務顧問服務。場外業務方面，為客戶提供新三板掛牌及後續融資服務，以及江蘇股權交易中心從事的相關場外業務。投資銀行業務主要業績驅動因素包括承銷及保薦費、顧問費等。
- (2) 主經紀商業務主要包括為私募基金、公募基金等各類資管機構提供資產託管和基金服務，包括結算、清算、報告和估值等。此外，亦向主經紀商客戶提供融資融券、金融產品銷售和其他增值服務。主經紀商業務主要業績驅動因素包括基金託管費及服務業務費。
- (3) 研究與機構銷售業務主要包括研究業務和機構銷售業務。研究業務方面，為客戶提供各種專業化研究諮詢服務。機構銷售業務方面，向客戶推廣和銷售證券產品及服務。研究與機構銷售業務主要業績驅動因素包括各類研究和金融產品的服務收入等。
- (4) 投資交易業務主要包括權益交易、FICC交易及場外衍生品交易。本集團以自有資金開展權益類、FICC類及其他金融工具交易，通過各類交易策略和交易技術降低投資風險並提高回報。同時，為滿足客戶投融資與風險管理需求，亦從事做市業務和場外衍生品業務。權益交易方面，開展股票、ETF和衍生工具的投資與交易，並從事金融產品做市服務等。FICC交易方面，開展銀行間及交易所債券市場各類FICC和衍生工具的投資與交易，並從事銀行間債券市場、債券通做市服務等。場外衍生品交易方面，為客戶創設及交易OTC金融產品，主要包括權益類收益互換、場外期權和收益憑證等。投資交易業務主要業績驅動因素包括權益、FICC產品和衍生產品等各類投資收益等。

### 3、投資管理業務

接受客戶資金委託，依託專業化的投資研究平台和龐大的客戶基礎，創設和提供各類金融產品並管理客戶資產，有效滿足客戶投融資需求，主要包括：證券公司資產管理、私募股權基金管理及基金公司資產管理業務等。證券公司資產管理業務方面，通過全資子公司華泰資管公司參與經營證券公司資產管理業務，包括集合資產管理業務、單一資產管理業務、專項資產管理業務和公募基金管理業務（與本集團旗下基金公司公募基金管理業務差異化經營）。私募股權基金管理業務方面，通過全資子公司華泰紫金投資開展私募股權基金業務，包括私募股權基金的投資與管理。基金公司資產管理業務方面，本集團持有兩家公募基金管理公司（南方基金和華泰柏瑞）的非控股權益，通過其參與經營基金公司資產管理業務。資產管理業務主要業績驅動因素包括管理費、業績表現費及投資收益等。

### 4、國際業務

本集團通過全資子公司華泰國際及其持有的華泰金控（香港）、AssetMark、華泰證券（美國）等經營國際業務，業務範圍覆蓋香港和美國等國家和地區。

本集團香港業務主要由華泰國際全資子公司華泰金控（香港）經營，主要包括股權業務平台、固收業務平台、個人金融平台、基金平台和旗艦投行業務。股權業務平台方面，開展跨境股票衍生品交易、設計以及銷售業務，為客戶提供各類權益類資本中介服務；為全球機構客戶提供境內外一體化、覆蓋各行業的綜合金融服務。固收業務平台方面，開展各類FICC和衍生工具的投資與交易，並為各類機構客戶提供銷售、交易和做市服務等FICC全產品品類的解決方案。個人金融平台方面，為客戶提供涉及全球不同資產類別的客戶經紀、孖展和財富管理服務，滿足客戶多層次全方位理財需求。基金平台方面，所管理的大灣區基金為客戶提供槓桿收購、戰略併購、上市前融資、業務擴張等定制化解決方案；中概股回歸基金關注具有行業成長潛力的中後期投資、跨境併

購、分拆和私有化投資機會。旗艦投行業務方面，打造全能跨境投行平台體系，向中國及國際客戶提供股權及債券承銷保薦服務、財務顧問服務。2019年9月，華泰金控(香港)獲得了倫交所會員資格，並完成上交所滬倫通全球存託憑證英國跨境轉換機構備案，能夠為客戶提供GDR發行與交易的全流程服務。2020年12月，華泰金控(香港)成為首家取得倫交所做市商資格的亞洲金融機構。2021年12月，華泰金控(香港)正式成為倫交所集團旗下綠寶石交易平台(Turquoise)會員。

本集團於2016年完成收購AssetMark。AssetMark是美國領先的統包資產管理平台，作為第三方金融服務機構，為投資顧問提供投資策略及資產組合管理、客戶關係管理、資產託管等一系列服務和先進便捷的技術平台。2019年7月，AssetMark在美國紐約證券交易所完成掛牌上市。2021年7月，AssetMark完成對Voyant收購，進一步優化技術平台及運營環境，保持在統包資產管理平台領域的領先地位。

2018年9月，華泰國際於美國特拉華州註冊設立了境外全資下屬公司華泰證券(美國)，推動國際業務發展。2019年6月，華泰證券(美國)經美國金融業監管局核准，獲得美國經紀交易商牌照；2020年，獲取美國自營交易牌照；2021年，獲得在加拿大與機構投資者開展證券交易的業務資格；2022年，獲得歐洲主要證券交易所的市場准入。

國際業務主要業績驅動因素包括經紀佣金、承銷保薦費、顧問費、利息收入及資產管理費等。



## 二、獎項與榮譽

### 財富管理業務

上海證券交易所：  
公司榮獲「2021年度十佳期權經紀商」、  
「2021年度優秀期權做市商」

深圳證券交易所：  
公司榮獲「2021年度優秀股票期權經紀  
商」、「2021年度股票期權市場拓展十佳經  
紀商」、「2021年度優秀股票期權做市商」

香港交易所：  
公司榮獲「2021年港股通卓越券商獎」、  
「2021年港股通投資者教育積極券商獎」

《新華財經》舉辦的「第一屆金諮獎基金投  
顧」評選：

公司榮獲「基金投顧金諮獎」、「顧問服務金  
諮榜第一名」、「系統營運金諮榜第一名」、  
「投資研究金諮榜第三名（券商第一）」等獎  
項

### 機構服務業務

上海證券交易所：  
華泰聯合證券榮獲「2021年度公司債券優秀  
承銷商」、「2021年度信用債高質量發展推  
進獎」、「2021年度優秀受託管理人」

深圳證券交易所：  
華泰聯合證券榮獲「2021年度優秀債券存  
續期管理機構」、「2021年度優秀公司債券  
承銷商」、「2021年度優秀基礎設施公募  
REITs中介機構」等獎項

易觀智庫統計數據：

「漲樂財富通」2022年上半年末月活數量保  
持業內第一

新浪財經舉辦的「第七屆券商APP風雲榜」  
評選：

「漲樂財富通」榮獲「年度十佳APP」、「最佳  
功能創新APP」、「最受用戶喜愛APP」

《財資》雜誌舉辦的「2021-2022年度金融科  
技獎」評選：

「漲樂全球通」榮獲「香港地區最佳手機券  
商APP」

專業財經資訊平台《經濟通》舉辦的「2021  
年金融科技大獎」評選：

「漲樂全球通」榮獲「交易系統－傑出全方  
位財富管理平台」

《新財富》舉辦的「第十五屆最佳投行」評  
選：

華泰聯合證券榮獲「本土最佳投行」、「最  
具創新能力投行」、「最佳股權承銷投行」、  
「最佳債權承銷投行」、「最佳再融資投  
行」、「最佳IPO投行」、「最佳併購投行」、  
「海外市場能力最佳投行」等獎項

## 投資管理業務

上海證券交易所：  
華泰資管公司榮獲「2021年度資產證券化業務優秀管理人」、「2021年度資產證券化創新業務優秀管理人」

深圳證券交易所：  
華泰資管公司榮獲「2021年度優秀資產支持專項計劃管理人」

上海證券交易所：  
南方基金榮獲「2021年度優秀債券投資機構」、「2021年度債券優秀交易商」

## 國際業務

國際知名私募債行業雜誌《PDI(Private Debt Investor)》舉辦的「2021年度獎項」評選：

華泰國際榮獲「最佳私募債投資機構(亞太區)」、「最佳地產私募債投資基金經理(亞太區)」、「最佳項目(亞太區)」、「最佳PE機構融資項目(全球)」

《財資》雜誌舉辦的「2021年度AAA國家獎(中國區)」評選：

華泰國際榮獲「最佳本地企業及機構顧問獎(券商類)」、「最佳私募債券顧問獎」

投資中國舉辦的「投中2021年度榜」評選：

華泰紫金投資榮獲「中國最佳中資私募股權投資機構TOP20」、「中國最佳私募股權投資機構TOP50」、「中國最佳券商私募基金子公司TOP10」、「中國最佳有限合夥人TOP30」、「中國醫療及健康服務產業最佳生物醫藥領域投資機構TOP30」等獎項

深圳證券交易所：  
南方基金榮獲「2021年度優秀ETF基金管理人」、「2021年度基金市場投資者服務獎」

香港主流財經廣播媒體《新城財經台》舉辦的「香港金融科技發展大獎2022」評選：

華泰國際榮獲「投資理財－證券及外匯投資金融大獎」

Cerulli Associates及其他公開信息：

截至2021年年末，AssetMark在美國TAMP行業中的市場佔有率為11.1%，排名第三

### 三、報告期內核心競爭力分析

#### (一) 科技驅動的中國證券行業轉型開拓者

本集團多年來一直保持信息技術的高水位資源投入，圍繞「成就客戶、創新業務、優化運營、賦能員工」的總體目標，全面推進數字化轉型，致力於用數字化思維和平台徹底改造業務及管理模式，著力構建領先的自主掌控的信息技術研發體系，通過全方位科技賦能，實現科技與業務共創，打造數字化牽引下的商業模式創新與平台化支撐下的全業務鏈優勢。同時，以股權投資為紐帶，聚集優秀科技創新公司，加快構建金融科技生態，積極佈局大數據、人工智能、區塊鏈、雲計算、RPA安全、5G等前沿領域。在財富管理領域，不斷迭代升級移動金融戰略，基於「漲樂財富通」全新8.0版本和「聊TA」平台的雙平台聯動發展優勢，構建聚焦客戶全生命週期的內容運營體系，有效提升獲客及服務效能。在機構服務領域，持續以自主研發的機構客戶服務數字化平台「行知」作為牽引，串聯機構服務各個環節。報告期內依託智能投研平台全新升級研究服務，為客戶提供研究視圖、行業數據庫、估值模型等多個功能，創新客戶體驗。依託公司研發的各類先進的數字化中台體系，持續推進融券通平台、FICC交易台等平台建設，加速沉澱核心交易和定價能力。報告期內，融券通平台進一步拓展與外部平台的技術對接，推動融券業務創新發展。FICC交易台雲原生架構演進和極速風控等關鍵能力取得突破。技術和業務融合創新持續深化，報告期內在金融智能、區塊鏈和雲計算等多個領域設立專項實驗室，開展重點課題研究。集團通過多年自主研發積累形成的技術底蘊和人才隊伍，為本集團打造平台化、體系化的核心競爭力奠定了堅實基礎。



## (二) 開放的數字化財富管理平台為大規模客戶提供高效的專業服務

本集團打造了中國證券行業最具活力的財富管理平台之一，擁有2,000多萬客戶。本集團充分藉鑑國內外先進的財富管理服務體系和經驗，從產品、服務、流程和技術平台等方面加快財富管理業務發展。本集團財富管理業務致力打造總部驅動、總分聯動的平台化、一體化發展模式，搭建聚焦客戶全生命週期運營的全新架構體系，積極探索以內容為牽引的全新客戶運營模式，面向客戶的移動服務平台「漲樂財富通」與面向投資顧問的工作雲平台「聊TA」在迭代升級中強化功能、深化貫通，高效、精準賦能一線投資顧問，初步形成了基於數據驅動的客戶需求與投資顧問服務匹配機制。截至報告期末，「漲樂財富通」累計下載量6,770.85萬。根據易觀智庫統計數據，2022年6月底，「漲樂財富通」月活數達952.39萬，位居證券公司類APP第一名。報告期內，本集團作為首批獲得基金投資顧問業務試點資格的證券公司之一，基金投資顧問業務的資產規模保持行業前列，資產配置、產品研究、策略運營、陪伴服務體系日臻完善。根據中國證券投資基金業協會截至2022年第二季度的統計，本公司股票及混合公募基金保有規模行業排名第一、非貨幣市場公募基金保有規模行業排名第二。

## (三) 體系化服務客戶和高質量發展的一流投資銀行業務

本集團充分把握中國經濟轉型升級和全面註冊制為主線的資本市場深化改革機遇，繼續加快行業佈局，積極推進以投行客戶為中心的平台化和生態化戰略，依託全業務鏈大平台，發揮證券化資產流量入口的作用；同時，不斷加強投行業務與其他各項業務的聯動協同，打造「買方+賣方+研究」三位一體的機構客戶服務生態圈。本集團持續為新老客戶提供境內外一體化的專業投行服務，同時堅持行業深耕，在重點行業領域成功開發並落地了一批優質客戶。本集團以專業與產品創新為立身之本，緊抓資本市場趨勢性機會，大力佈局GDR業務，是唯一一家同時具備GDR發行人及承銷經驗、全業務鏈執行經驗的企業，也是目前GDR承銷市場份額最大的券商。本集團併購重組業務重點推進標桿性大型項目、創新項目，並積極拓展客戶的持續服務，始終處於行業前列。報告期內，經中國證監會核准及註冊的併購重組交易家數4家、交易金額人民幣234.19億元，均排名行業第一；自2012年以來，經中國證監會核准及註冊的併購重組交易數量合計達154家，行業排名第一。報告期內，本集團全品種債券主承銷金額人民幣5,015.03億元，行業排名第三。全面實行股票發行註冊制，提高直接融資比重，是2022年資本市場的主旋律，依託於資本市場的股債融資和產業整合活動日益活躍，將為本集團帶來良好的發展機遇。

#### (四) 兼具規模優勢與創新優勢的綜合性資產管理平台

依託集團龐大的客戶基礎和全業務鏈資源優勢，充分發揮投行資產發現、風險定價與產品設計能力，本集團已建立起業內領先的資產管理平台之一。資產管理業務管理資產總規模位居行業前列，主動管理能力與規模持續提升，截至報告期末資產管理規模人民幣5,016.13億元，主動管理規模佔比進一步提高。管理產品覆蓋主要資產大類，已形成規模可觀、覆蓋廣泛的產品體系，打造了顯著的運營優勢和市場影響力。聚焦券商特色，系統化創設「基礎產品+特色化產品」，強化與集團雙向驅動，構建資產端產品輸出模式，做大產品規模，滿足集團及市場上零售客戶和高淨值客戶對產品形式和風險收益的不同需求。同時，通過多資產、多策略定制化服務，為機構客戶提供定制化的一攬子綜合金融服務，通過固收類優勢產品以及FOF、MOM等特色產品滿足客戶對產品形式、流動性以及收益率的需求。本集團是業內ABS交易設計領導者，在基礎資產、交易結構等層面不斷創新，為行業樹立了標桿，在防疫抗疫、綠色金融等領域發行多單支持實體經濟項目，業務規模持續排名行業前列。

#### (五) 加速全球佈局和打造跨境生態邁上高質量發展新台階

本集團始終堅持伴隨客戶國際化發展，不斷拓展國際業務佈局，通過持續深化跨境一體化聯動，優化跨境綜合性金融服務平台體系，為集團客戶嫁接全球資源，更好服務中國客戶的境外拓展和國際投資者的境內投資。報告期內，華泰國際依託集團境內資源，以跨境為抓手，堅持券商本源，持續聚焦資本市場中介業務，通過跨境聯動、業務協同和平台運營，深耕以客戶為中心的一體化、平台化跨境服務生態體系。同時，加強風險管控能力，以多樣化的對沖手段有效降低市場波動帶來的風險，保障各項業務健康發展。報告期內，華泰金控（香港）由股權業務平台、固收業務平台、個人金融平台、基金平台和旗艦投行業務共同搭建的「4+1」業務平台體系持續深化，差異化競爭優勢得以凸顯。截至報告期末，華泰國際資產規模近兩千億港元，綜合實力持續提升，穩居香港中資券商第一梯隊前列。報告期內，華泰國際聚焦頭部客群，通過完善多資產銷售交易能力、持續提升系統平台支持能力，提升客戶體驗，在波動的市場環境下穩住了業務規模，夯實了以主經紀商業務為核心的跨境銷售交易業務體系。個人金融平台充分發揮金融科技賦能財富管理的優勢，線上線下相結合地拓展To B及To C端的產品及服務。自主研發的一站式線上財富管理平台「漲樂全球通」推出樂盈寶，更好滿足投資者在波動市況下的現金管理需求。報告期內，華泰金控（香港）正式取得香港聯交所的特殊目的收購公司（SPAC）交易所參與者資格，是首批取得該資質的在港中資券商，並作為聯席賬簿管理人參與全香港市場第二單SPAC上市項目，在SPAC領域開闢出全新篇章。國際評級機構標準普爾維持了對本公司及子公司華泰國際的長期發行人評級「BBB+」、短期發行人評級「A-2」。此外，AssetMark保持運營獨立性，通過領先的業務模式和先進的技術平台保持管理資產規模穩步增長，穩固行業領先地位，並持續提升本集團的國際業務收入。

## (六) 兼具專業和平台優勢的全面風險管理

本集團具有良好的風險管理文化和清晰的風險管理目標，「穩健」始終是本集團企業核心價值觀的重要組成部分。本集團堅持全員、覆蓋、穿透的核心風險管理理念，圍繞集團化、專業化、平台化思路持續打造境內外一體化全面風險管理體系。本集團積累建立了適應公司業務國際化發展的有效風險管理架構、流程和措施，持續構建以客戶為核心、專業風險職責目標為導向的自適應協作和風險管控體系，深入穿透境內外重點業務及領域，動態監測預警風險和快速應對處置風險。本集團高度重視先進IT技術在風險管理中的應用，報告期內，深入推進境內外一體化風險管理平台框架升級，持續打造風險管理數字化主線基座的一體兩翼，以科技賦能促進風險管理工作模式轉型和效率提升。

## (七) 構建起持續賦能一流專業人才成長的發展平台

堅定打造市場化的體制機制是本集團持續轉型超越的重要推動力。早在2019年，本集團職業經理人制度即已落地實施，構建了契約化、市場化、職業化的經營管理團隊。新的經營管理團隊視野開闊、經驗豐富、業務能力強，正帶領公司發展打開新的局面。本集團深植「科技賦能、創新進取」的企業文化基因，不斷豐富並深化「開放、包容、創新、奮鬥、擔當」的文化內涵，為「雙輪驅動」戰略的深入推進蓄積持久的動力與活力。本集團持續打造基於平台的專業化、高素質、年輕化、國際化的人才發展模式，為優秀年輕人才匹配基於平台的、更為個性的解決方案，構建了一條「職場新人－業務骨幹－複合精英－管理將才」的成長路徑，滿足其職業生涯不同階段的發展需求，推動優秀人才與組織共同成長，將人才優勢轉換為核心競爭優勢。本集團建立完善了以能力和貢獻為導向的人才選拔任用機制，確立了市場化的用人機制和薪酬激勵機制。本集團已落地實施面向中高層管理人員及核心骨幹員工的限制性股票股權激勵計劃，充分體現公司與個人利益共享、風險共擔、共同持續發展理念，進一步激發市場化的組織活力。



## 四、經營情況的討論與分析

單位：千元 幣種：人民幣

| 分行業     | 分部收入、<br>其他收入 |              | 分部業績      | 分部利潤率<br>(%) | 分部收入、<br>其他收入<br>及收益比 |               | 分部利潤率<br>比上年同期增減 |
|---------|---------------|--------------|-----------|--------------|-----------------------|---------------|------------------|
|         | 及收益           | 分部支出         |           |              | 上年同期增減<br>(%)         | 上年同期增減<br>(%) |                  |
| 財富管理業務  | 12,395,626    | (8,007,493)  | 4,388,133 | 35.40        | 8.73                  | 8.36          | 增長0.22個百分點       |
| 機構服務業務  | 3,786,093     | (2,977,089)  | 809,004   | 21.37        | (41.81)               | (13.37)       | 下降25.81個百分點      |
| 投資管理業務  | 893,317       | (549,527)    | (343,373) | (38.44)      | (64.32)               | (7.60)        | 下降138.70個百分點     |
| 國際業務    | 4,184,585     | (2,926,501)  | 1,258,084 | 30.06        | 18.18                 | 17.83         | 增長0.19個百分點       |
| 其他(含抵銷) | 2,219,401     | (2,707,889)  | 662,148   | 29.83        | 234.07                | 19.93         | 增長121.87個百分點     |
| 分部總計    | 23,479,022    | (17,168,499) | 6,773,996 | 28.85        | (4.62)                | 6.22          | 下降11.92個百分點      |

### (一) 財富管理業務

#### 1、 財富管理業務市場環境與行業趨勢

- (1) 我國財富管理市場縱深發展驅動業務轉型升級，財富管理行業發展空間廣闊

隨著我國實體經濟潛能的不斷釋放、多層次資本市場的發展和完善、金融投資產品供給的日益豐富、社會總財富的持續增長及房地產市場調控的繼續延續，我國財富管理市場處於長期變革和快速發展的階段，居民對於優質權益資產及專業投資顧問的需求不斷增強。基於完善的業務鏈條、以客戶為導向的組織架構、綜合服務平台及業務協同機制，構築客戶分層分類的綜合服務體系，將成為證券公司財富管理業務發展的關鍵。根據招商銀行私人財富報告統計數據，截至2021年年末，中國個人持有的可投資資產總體規模約人民幣268萬億元，較2020年年末增長11.20%；個人可投資資產超過人民幣1,000萬元的高淨值人群數量約296萬人，較2020年年末增長12.98%。在雙循環新發展格局構建、全面註冊制改革穩步推進、財富管理行業滲透率提升、專業化業務需求增加等背景下，注重構建創新驅動的財富管理業務生態、打造全業務鏈的財富管理服務能力、強化以客戶為中心的服務理念、深度理解多元化的客戶需求、聚焦客戶全週期全方位全品類綜合金融服務的財富管理機構將獲得廣泛發展空間。

(2) 客戶需求與市場競爭態勢的變化持續推動財富管理轉型，專業財富管理機構將迎來發展機遇

隨著資本市場全面深化改革的持續推進、金融市場雙向開放新格局的不斷擴大、金融科技對證券行業的加速滲透、市場競爭的日趨激烈，財富管理機構面臨客戶多樣化的財富管理需求和更為嚴苛的全流程體驗要求，構建新生態下的財富管理服務模式、持續完善財富管理業務體系、不斷提升財富管理服務能力已成為證券公司戰略轉型的重要方向。報告期內，國內股票市場震盪下行，萬得全A下跌9.53%、上證綜指下跌6.63%、深證成指下跌13.20%；國際主要指數方面，標普500下跌20.58%、納斯達克指數下跌29.51%、道瓊斯工業指數下跌15.31%。在境內外資本市場聯動不斷加強、監管政策和市場機制逐步完善、財富管理工具和產品供給持續擴大等背景下，資產配置服務的複雜性愈發增加，客戶對專業化、個性化、多元化的財富管理服務需求更加迫切，擁有先進的金融服務平台、有競爭力的金融產品體系和專業化人才隊伍的財富管理機構將迎來財富管理業務發展的重要機遇。不斷完善多層次、個性化、全資產的協同協作產品供給，持續搭建標準化、生態化、精細化的全流程客戶運營體系，全面打造移動化、數字化、智能化、一體化的金融科技平台，全方位向財富管理業務高質量發展轉型的金融機構將在未來的競爭中取得優勢。

(3) 金融科技賦能與數字化轉型重塑運營管理模式，引領財富管理行業迭代升級

近年來，全球新一輪科技革命和產業變革正在加速演進，科技前沿技術與傳統金融業務深度融合，應用場景持續豐富，對證券公司業務模式和經營效率帶來全方位影響。證券公司應積極擁抱和踐行數字化轉型戰略，打造金融科技創新生態，不斷增強金融科技應用創新全方位賦能財富管理業務價值鏈各環節的能力，構築數字化、平台化、生態化的財富管理服務新模式，推動引領業務創新和管理創新，助力財富管理行業高質量發展。金融科技和數字化轉型已成為驅動金融生態演化的基本力量和打造證券公司競爭優勢的戰略制高點，將深刻變革證券公司的展業模式、業務架構以及運營體系，也將是證券行業下一個戰略週期的發展核心驅動力，特別是新冠肺炎疫情的防控進一步深化了金融服務線上化需求，金融科技與業務場景的融合也將更為密切。應用金融科技賦能，全面推動數字化轉型，以科技重塑業務發展並努力構建和諧、開放、高效、協同共贏的金融創新生態圈，為客戶提供全方位財富管理服務，正成為國內大型證券公司打造差異化競爭優勢和實現商業模式持續創新的必然選擇。

## 2、 財富管理業務經營舉措及業績

### (1) 證券期貨期權經紀業務

報告期內，本集團深入聚焦客戶財富管理需求，依託數字化賦能與全業務鏈優勢，積極搭建全生命週期客戶交易體系與成長體系，完善線上線下相結合、中心化運營與生態運營相結合的金融服務與營銷平台，全力推進投資顧問一體化運營，持續做深做實財富管理業務轉型。持續打造「漲樂財富通」平台與「聊TA」平台的雙平台聯動發展優勢，推進平台迭代優化，不斷增強平台賦能客戶與投資顧問的能力，提升客戶黏性和平台活躍度。以平台一體化運營為核心，不斷優化內容運營模式，持續建設智能化、體系化、場景化的運營策略，有效提升流量承接轉化和客戶全週期服務運營能力。持續打造專業化投資顧問隊伍，積極構建投資顧問全方位賦能體系，利用平台化運營、內容運營和客戶運營賦能持續提升投資顧問服務效能，不斷擴大客戶服務覆蓋度，優化客戶服務體驗。

本集團持續推進「漲樂財富通」平台產品及服務創新，不斷完善平台功能，積極打造特色化行情交易與理財服務，重點推出以視頻內容為主體的全新內容輸出和運營方式，致力於以更佳的客戶體驗、更全的產品工具、更廣的服務縱深有效提升客戶黏性和活躍度。報告期內，「漲樂財富通」下載量238.92萬，自上線以來累計下載量6,770.85萬；96.18%的交易客戶通過「漲樂財富通」進行交易。根據易觀智庫統計數據，報告期內，「漲樂財富通」平均月活數為932.86萬，截至報告期末月活數為952.39萬，月活數位居證券公司類APP第一名。同時，本集團不斷夯實「漲樂全球通」平台基礎交易服務能力，以專業的平台服務持續增厚用戶黏性，致力於為客戶提供全球資產一站式投資管理服務，「漲樂全球通」自上線以來累計下載量145.47萬，報告期內平均月活數為16.09萬。

本集團進一步強化基於先進平台的交易服務優勢。根據滬深交易所會員統計數據，本集團股票基金交易量合計人民幣19.72萬億元，排名行業第一。截至報告期末，根據內部統計數據，客戶賬戶總資產規模達人民幣5.21萬億元。

## 代理交易金額數據

幣種：人民幣

| 證券品種 | 2022年1-6月                | 證券品種 | 2021年1-6月                |
|------|--------------------------|------|--------------------------|
|      | 代理交易金額(億元)               |      | 代理交易金額(億元)               |
| 股票   | 166,698.49               | 股票   | 166,938.59               |
| 基金   | 30,478.02                | 基金   | 13,501.68                |
| 債券   | <u>204,382.31</u>        | 債券   | <u>177,084.33</u>        |
| 合計   | <u><u>401,558.82</u></u> | 合計   | <u><u>357,524.60</u></u> |

註：2021年1-6月、2022年1-6月代理交易金額數據引自滬深交易所會員統計數據。其中，2021年1-6月基金數據不含上交所場內貨幣基金交易量；鑑於上交所會員統計數據口径調整，2022年1-6月基金數據包含上交所ETF、貨幣ETF、LOF、公募REITs交易量。

報告期內，港股通業務不斷優化運營措施、細化客戶服務，業務運行穩定，滬港通下港股通業務開通權限客戶數1.59萬戶，深港通下港股通業務開通權限客戶數1.66萬戶。股票期權經紀業務持續優化升級交易系統功能，運用科技推進運營管理智能化，深化核心客戶服務，業務繼續保持市場領先優勢。根據上交所統計數據，報告期內，本公司滬市股票期權經紀業務成交量市場份額行業排名第一。

期貨經紀業務方面，華泰期貨持續優化網點佈局，截至報告期末，共有9家分公司、41家期貨營業部，遍及國內4個直轄市和16個省份，代理交易品種94個。報告期內，華泰期貨實現代理成交量24,342.66萬手，成交金額人民幣279,868.74億元。證期業務協同持續深化、平台融合加速推進，截至報告期末，本集團獲准從事期貨IB業務的證券營業部共233家、期貨IB業務總客戶數56,226戶。



## (2) 金融產品銷售與基金投資顧問業務

報告期內，本集團多角度推動以客戶需求為中心的金融產品銷售與基金投資顧問業務開展，以平台化與專業化為牽引，全力打造以資產配置和產品化輸出為核心的買方投研能力，為客戶提供符合其風險與收益需求的策略組合和金融產品，滿足客戶多層次的財富管理需求。根據內部統計數據，報告期內，金融產品保有數量(除現金管理產品「天天發」外) 7,969隻，金融產品銷售規模(除現金管理產品「天天發」外) 人民幣2,594.36億元；截至報告期末，基金投資顧問業務授權資產人民幣151.36億元、參與客戶數量56.33萬戶。根據中國證券投資基金業協會2022年二季度的統計，本公司股票及混合公募基金保有規模人民幣1,266億元，行業排名第一；非貨幣市場公募基金保有規模人民幣1,407億元，行業排名第二。

報告期內，本集團持續完善策略組合，創新性提出功能性策略和賽道型策略，加強資產配置為核心的投研配置能力建設，滿足客戶多層次配置需求。優化投研架構，完善大類資產研究、產品研究、策略投資一體化的投研體系，強化內外部聯動，持續迭代配置模型。加強分層分級的產品和投資服務體系構建，基於資產配置視角，豐富產品和策略類型，升級完善產品標籤體系，滿足不同群體客戶的投資需求。強化市場研究能力、資產研究能力、產品研究能力、策略算法研究能力與資產配置能力的構建，積極打造業務應用場景，增強對投資顧問與客戶的觀點支持與賦能。持續通過數字化與平台化實現客戶與產品的服務全覆蓋，有效提升業務整體效率與能力。

## (3) 資本中介業務

報告期內，本集團圍繞以客戶需求為中心的經營理念，快速響應市場變化和監管要求，深入挖掘客戶需求，不斷豐富客戶服務體系，積極創新業務運營模式，持續完善風險管控建設，依託全業務鏈生態化建設和開放式融券通平台系統優勢，切實增強業務核心競爭力。有效整合內外部資源，持續完善融券業務運營管理體系，不斷增強出借客戶開發能力，夯實券源基礎，拓展券池規模，加快構建以數字化平台為核心、全業務鏈協作為支撐的融券新生態，提升差異化與專業化服務能力。依託「融券通3.0」，進一步推進融券通開放式平台建設，通過實時行情、線上委託、智能撮合等核心功能，高效聯通券源的供給方和需求方，持續優化證券借貸行業數字化運營新模式。根據監管報表數據口徑，截至報告期末，母公司融資融券業務餘額為人民幣1,158.70億元，市場份額達7.23%，整體維持擔保比例為314.08%，其中，融券業務餘額為人民幣169.76億元，市場份額達18.14%；股票質押式回購業務待購回餘額為人民幣451.68億元、平均履約保障比例為271.05%，其中，表內業務待購回餘額為人民幣59.95億元、平均履約保障比例為278.69%，表外業務待購回餘額為人民幣391.73億元。



### 3、 財富管理業務2022年下半年展望

財富管理業務承載著本集團規模化聚集、沉澱客戶資源和客戶資產的戰略職能。2022年下半年，本集團將繼續抓住財富管理市場縱深發展的戰略機遇，依託客戶和投資顧問雙端平台化、生態化運營，通過總部驅動、總分聯動、一體運營，進一步做大客戶與客戶資產規模，推動財富管理業務向客戶全生命週期服務和資產配置服務模式轉型，持續打造面向未來的全新競爭優勢。

財富管理業務將繼續做深做實平台運營和客戶運營，構建新型客戶增長和服務運營體系，積極打造財富管理業務新生態；延續「以內容聚攏流量、以私域沉澱流量、以運營放大流量」的業務思路，不斷豐富內容生態，不斷提升線上線下聯動的運營與交易服務能力，推動陪伴式、高互動、一體化潛客服務轉化模式，有效提升整體留存轉化；優化投資顧問分層分級服務體系，沉澱優秀投資顧問服務模式，強化投資顧問服務精細化運營，有效打通投資顧問運營賦能關鍵鏈路，全面提升投資顧問服務效能；深化數字化發展戰略，全面升級「千人千面」的「漲樂財富通」平台服務能力，鞏固優化「聊TA」平台運營能力，打造精細化、數據化、系統化運營體系，不斷增強用戶黏性和好感度。

金融產品銷售與基金投資顧問業務將持續推動完善投研與交易的數字化建設，不斷提升平台化運營能力，加強內容運營與產品體系建設，強化配置產品供給，豐富策略類型和服務場景，積極探索以賬戶診斷管理為基礎的建議型基金投資顧問轉化路徑，強化C2M服務配置能力，增強客戶多元需求響應和客戶運營能力，不斷提升業務品牌影響力。

資本中介業務將繼續以客戶需求為導向，持續加強營銷服務體系建設，不斷提升業務運營效率，著眼於券源獲取能力、客戶服務能力和金融科技運用的差異化競爭優勢，進一步提升業務發展質量。加大資源投入力度，完善數字化運營平台，深化全業務鏈合作，加強資源型客戶開發以實現高質引流，持續推進「融券通」平台迭代更新，構建境內外、場內外一體化券池，積極打造開放、高效的證券借貸行業生態，不斷增強融通品牌優勢。

## (二) 機構服務業務

### 1、 機構服務業務市場環境與行業趨勢

#### (1) 實體經濟轉型發展和資本市場全面深化改革為機構服務業務發揮一體化優勢打開了更大空間

近年來，隨著以全面註冊制改革為牽引的系列改革舉措的落地實施，市場廣度與深度不斷拓展，市場體系包容性大幅提升，投融資功能顯著增強，資本市場服務經濟高質量發展的戰略地位持續提升，機構服務業務迎來跨越式發展的良好契機，注重發展全鏈條、全產品、全市場、全球化的多元業務，並為機構客戶提供全生命週期高品質的綜合金融服務將成為證券公司核心競爭力的重要體現。在我國實體經濟轉型升級持續推進、資本市場改革全面深化的新發展格局下，證券行業開啟基礎性制度全面優化、市場生態全面重構的改革發展新階段，市場化資源配置體制機制不斷健全，證券公司投資銀行業務面臨高階轉型戰略機遇，業務結構和產品體系優化完善、項目儲備豐富且業務協同發展、具備提供差異化產品和服務能力的證券公司將迎來更多業務增量和收入。未來，隨著多層次資本市場體系錯位發展、有序競爭新格局的構建，機構服務業務對證券公司業務資質、資本實力、規模優勢、產品設計、風控系統、展業渠道等提出更高要求，有能力更好把握宏觀經濟趨勢與資本市場改革發展機遇、全方位提升全業務鏈綜合服務能力、推動業務體系全面轉型升級並為客戶創造長期價值的證券公司將面臨更多業務機會。

(2) 資本市場向專業化、機構化、國際化方向轉型的趨勢對證券公司機構服務能力提出更高要求

近年來，在我國宏觀經濟轉型升級、資本市場改革持續深化及證券業務創新發展等背景下，機構投資者參與度日益提升，機構投資者在資本市場中的話語權不斷增強，機構投資者正成為資本市場主力增量，市場結構的深層次變化將重構資本市場新生態，助力資本市場提升交易活躍度、產品豐富度和國際參與度，為證券公司的業務發展提供了廣闊空間，業務機構化趨勢更加明顯。在推動基金高質量發展的政策導向及資本市場改革紅利的驅動下，居民財富配置加速向金融資產遷移的趨勢持續強化，公募基金數量和管理規模震盪攀升，市場影響力持續提升，資本市場機構化進程進一步加快，這對證券公司一體化、專業化金融服務能力提出更高要求。此外，隨著資本市場高水平雙向開放新格局的加快形成、市場優勢資源向優質機構的加速集聚，證券行業分化更趨明顯，基於平台賦能、高效整合境內外業務資源為客戶提供更加專業、更具洞察、更為便捷的一站式、全生命週期服務將成為證券公司機構服務業務新一輪競爭的關鍵。未來，積極打造平台化、一體化、生態化的機構服務業務體系，以更加開放的視野與一流的服務能力構建專業機構投資者服務生態圈，具備提供全生命週期投融資綜合金融服務的證券公司將取得發展先機。

(3) 證券公司機構服務業務可持續發展需要強有力的風險管理能力作為基礎

在國內宏觀經濟轉型、國際政治衝突頻發、新冠肺炎疫情常態化防控、全球通脹及政策緊縮等複雜環境下，資本市場波動及不確定性大幅增加，證券公司的風險管理面臨全新挑戰。健全與自身發展戰略及業務發展相適應的全面風險管理架構，建立有效的風控前置程序、完備的風險管理系統、強大的風險文化體系，將成為證券公司助力業務發展、打造差異化競爭與發展新格局的關鍵。證券公司需要通過完善的風險管理制度、科學的風險管理模式和方法、先進的風險管理手段準確識別、有效管理並及時化解風險，保證長期穩健發展。有效管理金融風險需要證券公司不斷優化風險管理組織架構和運作流程，持續健全專業化和平台化的全面風險管理機制，實現

風險信息的集中監測分析和全流程管控；及時化解金融風險需要證券公司在具備較強資本實力的同時有效利用金融衍生品市場。在《期貨和衍生品法》正式落地的背景下，基礎金融產品體系的豐富完善了市場風險對沖和風險管理的工具，證券行業對保障金融市場和資本市場平穩運行、健康發展的作用將更為重要，證券公司應積極構建全方位的風險管理體系，強化風險預防、應對、處置制度體系建設，提升風險管理策略和管控措施的專業性、前瞻性和主動性，切實把握機構服務業務高階發展的新機遇。

## 2、機構服務業務經營舉措及業績

### (1) 投資銀行業務

報告期內，本集團牢牢把握資本市場深化改革的重大機遇，持續推進全業務鏈戰略，秉持以客戶為中心的經營理念，以行業聚焦、區域佈局和客戶深耕為方向，加強境內境外、場內場外跨市場協同，全面提升全產品服務能力和綜合服務快速響應能力，投資銀行業務各領域均取得良好業績。

#### 合併數據

幣種：人民幣

| 發行類別 | 主承銷次數(次) |       | 主承銷金額(萬元)     |                | 主承銷收入(萬元)  |              |
|------|----------|-------|---------------|----------------|------------|--------------|
|      | 本期       | 歷年累計  | 本期            | 歷年累計           | 本期         | 歷年累計         |
| 新股發行 | 14       | 241   | 1,477,297.71  | 19,947,367.62  | 80,483.49  | 964,048.64   |
| 增發新股 | 13       | 264   | 1,763,995.68  | 42,631,384.90  | 15,794.07  | 326,132.37   |
| 配股   | 2        | 36    | 48,387.10     | 2,210,547.65   | 141.51     | 22,778.88    |
| 債券發行 | 1,217    | 4,888 | 21,503,572.90 | 219,638,009.37 | 45,254.05  | 586,652.12   |
| 合計   | 1,246    | 5,429 | 24,793,253.39 | 284,427,309.54 | 141,673.12 | 1,899,612.01 |

註：上表數據來源於監管報表，統計口徑為項目發行完成日；增發新股內含優先股；債券發行含國債、企業債、公司債(含可交換債)、可轉債、短期融資券、中期票據等，不含資產證券化項目。

### ① 股權承銷業務

報告期內，股權承銷業務以優質客戶為中心，充分發揮全業務鏈體系和大投行境內外一體化平台優勢，深耕區域，聚焦行業，為客戶提供多產品、全週期、定制化的資本市場服務。根據Wind資訊統計數據，本集團股權主承銷金額(含首次公開發行、增發、配股、優先股、可轉債、可交換債)人民幣437.52億元，行業排名第四。

### ② 債券承銷業務

報告期內，債券承銷業務在嚴格控制風險的基礎上，充分利用全牌照優勢，發揮股債聯動的全能型業務優勢，持續打造具有特色的債券產品，不斷完善客戶分層管理，積極培養核心客戶群體，行業地位穩定。根據Wind資訊統計數據，本集團全品種債券主承銷金額人民幣5,015.03億元，行業排名第三。

### ③ 財務顧問業務

報告期內，併購重組財務顧問業務發揮業務創新優勢，重點推進標桿性大型項目與創新項目，聚焦高價值交易機會發現能力及交易撮合能力，積極拓展客戶持續服務，併購重組業務繼續保持行業領先。經中國證監會核准及註冊的併購重組交易家數4家、交易金額人民幣234.19億元，均排名行業第一。

### ④ 場外業務

報告期內，本集團積極開拓以北交所上市為目標的新三板掛牌項目，充分發揮大投行一體化優勢，為创新型中小企業提供完善的資本市場服務。報告期內，本集團合計為21家掛牌企業提供持續督導服務。控股子公司江蘇股權交易中心積極拓展服務產品與融資渠道，加強特色板塊建設，推進轉板上市工作，深化數字化轉型，完成國家區塊鏈創新應用試點申報並獲得試點資格，不斷提升中小微企業綜合金融服務能力。截至報告期末，掛牌展示企業12,608家，純託管企業140家，會員單位238家，各類投資者78,818戶，報告期內為企業新增融資人民幣30.48億元。



## (2) 主經紀商(PB)業務

報告期內，本集團認真貫徹以客戶運營為核心的服務理念，依託平台化、生態化發展戰略，促進數字化轉型與運營效能提升，繼續踐行全業務鏈服務體系，圍繞客戶全生命週期的綜合金融服務需求，一體化推動主經紀商(PB)業務發展，構築機構服務生態圈，推動業務多元變現。截至報告期末，基金託管業務累計上線產品8,778隻，託管業務規模人民幣4,046.52億元；基金服務業務累計上線產品11,395隻(含資管子產品819隻)，服務業務規模人民幣9,665.12億元(含資管子業務規模人民幣4,005.02億元)。根據中國證券投資基金業協會截至2022年二季度的統計，本集團私募基金託管業務備案存續產品數量行業排名第四。

## (3) 研究與機構銷售業務

報告期內，研究業務堅定推進業務模式轉型，積極踐行全業務鏈，不斷深化業務協同效能，著力打造具備綜合服務能力的專業研究隊伍，持續豐富和深化研究產品及服務，積極打造研究業務競爭優勢。堅持數字化與平台化發展方向，以產品化為抓手，「RIS」平台著力推進與「行知」平台的對接，系統平台服務維度和深度全面拓展。聚焦國內外頭部機構，持續推進跨境研究業務，健全境內外一體化機構客戶服務體系，著力發揮研究業務支撐和牽引作用，不斷提升研究業務服務能力。機構銷售業務以客戶為中心，踐行全業務鏈服務模式，推進「行知」服務平台及機構投資者工作平台建設與優化迭代，做實全面覆蓋、分類分級的機構客戶池，建立協同聯動的平台化、一體化機構客戶服務機制，重塑機構投資者服務體系，深入對接客戶多樣化需求，構建與客戶協同發展的生態圈。本集團積極開展多種形式的研究服務活動，發佈證券研究報告5,327篇，組織分析師路演服務9,547場、上市業績交流及市場熱點電話會議2,006場，通過線上或線上線下相結合方式舉辦策略會2場、專題會議4場。報告期內，公募基金分倉交易量約人民幣5,887.08億元。

#### (4) 投資交易業務

##### ① 權益交易業務

報告期內，本集團繼續堅定推進業務模式全面向交易導向轉型，貫徹去方向化戰略，深化投研模式創新，豐富業務場景，持續拓展權益基礎研究的廣度、深度和力度，不斷完善聯動發展的多市場、多層次、立體式的多元業務體系，全面升級投資交易能力，積極打造具備核心競爭力、可持續發展的權益投資與交易體系。完善宏觀經濟、大類資產配置和行業比較研究體系，挖掘市場運行規律，完善選拔跟蹤機制，提升策略競爭力，積極把握市場交易機會，有效提升投資收益和資金使用效率。本集團高度重視大數據和人工智能等技術手段的研究應用，持續推進平台化建設，積極構建高效智能、風險可控、全生命週期覆蓋的投研一體化平台，聚焦平台性能的提高與拓展，推進業務數字化管理。

##### ② FICC交易業務

報告期內，本集團FICC交易業務以建設跨市場、跨品種、跨境內外、覆蓋FICC產品全生命週期的大交易平台為導向，持續推進業務數字化戰略轉型升級，平台化、體系化提升投資交易能力和風險管理能力，全方位滿足客戶資產配置及風險管理需求。固定收益自營投資業務充分發揮綜合化及多元化運作優勢，不斷打造體系化、自動化、策略化的交易模式及波段、策略、配置多維並重的交易體系，收入結構持續優化。數字化做市業務實現與大交易平台的雙向賦能，現券成交量穩步增長，市場佔有率逆勢提升。大宗商品業務和外匯業務持續推進策略交易研究，繼續完善代客外匯交易系統功能，結售匯業務落地場景不斷豐富，交易品類日益完善，投資交易和定價能力穩步提升，業務多元化發展基礎不斷夯實。

### ③ 場外衍生品交易業務

報告期內，本集團著力構建以客戶為導向的場外衍生品業務體系，持續發揮金融科技優勢，以交易為驅動力不斷提升差異化核心能力，積極打造集主要資產品種與交易類型的一體化賬戶，以平台化建設實現核心業務能力的沉澱、升級與轉化，全面賦能業務發展，不斷提升業務創新能力和交易定價能力，創設並推廣跨市場、多樣化、差異化的金融衍生產品，為客戶提供全方位的衍生品交易服務，提升客戶綜合價值創造能力。根據監管報表SAC協議數據口徑，截至報告期末，收益互換業務存續合約筆數8,087筆，存續規模人民幣1,295.86億元；場外期權業務存續合約筆數1,902筆，存續規模人民幣1,363.77億元。報告期內，本公司通過中證機構間報價系統和櫃台市場發行收益憑證1,615隻，合計規模人民幣162.76億元。

### 3、機構服務業務2022年下半年展望

機構服務業務致力為產業及金融機構客戶提供全業務鏈服務，是驅動本集團邁向高質量發展的重要戰略領域。2022年下半年，本集團將繼續分類聚焦重點客群的金融服務需求，持續推進體系化的服務模式，不斷增強業務協同機制，實施客戶價值綜合運營，打造平台化、產品化及生態化的機構客戶服務新模式，實現與客戶交互賦能、共同成長。

投資銀行業務將繼續聚焦重點區域、重點行業，深度服務產業龍頭客戶，提升跨市場、多產品、一體化的協同服務能力，同時持續推進平台化展業和數字化轉型，構建以優質客戶為核心的大投行、平台化體系，圍繞客戶全生命週期和全業務鏈需求，打造更加高效且富有競爭力的投資銀行生態圈。股權承銷業務將繼續踐行重點區域聚焦和行業深耕，輸送更多優質企業登陸資本市場；債券承銷業務將在保持高速發展勢頭的基礎上，積極推進創新產品服務，深耕區域、聚焦行業、專注產品，不斷提升營銷開發能力和專業服務能力；併購重組財務顧問業務將堅持交易創新引領市場，持續拓展業務類型，積極打造具有市場影響力的併購交易。



主經紀商業務將依託全業務鏈服務體系與金融科技優勢，持續強化以客戶為中心的經營理念，進一步擴大客群規模，不斷推進數字化轉型，以平台賦能打造業務競爭優勢，持續為客戶提供綜合性服務，實現業務價值多元變現。

研究與機構銷售業務將繼續加強重點行業人才的引進和培養力度，穩步推進數字化建設與運營工作，充分發揮業務協同聯動優勢，圍繞機構投資者需求打造全方位、一站式金融服務生態圈，重塑機構客戶服務體系，持續強化品牌聲譽與全新競爭優勢。

投資交易業務將持續打造平台化、體系化的投資交易能力，切實向掌握資產定價權和交易能力產品化的目標升級轉型，積極打造面向未來的核心競爭能力，進一步推動盈利模式多元化。權益交易業務將繼續強化大數據交易業務，持續進化基本面投資交易能力，深入發展創新投資業務，著力打造基於資源平台和IT系統平台的一體化權益投資與交易業務體系，不斷提升專業化投資能力；FICC交易業務將繼續打造智能、高效的交易系統，不斷豐富量化交易模型和策略交易庫，創新業務增長模式，以更精準的定價能力和更全面的交易能力，為客戶提供個性化和專業化的金融服務，持續提升市場影響力；場外衍生品交易業務將憑藉業務的先發優勢、具有市場競爭力的系統優勢及強大的創新能力、交易對沖能力、產品設計與定價能力、風險控制與合規運營能力，不斷創新業務模式與產品結構，打造硬核競爭力。

### (三) 投資管理業務

#### 1、 投資管理業務市場環境與行業趨勢

##### (1) 資產管理業務制度體系不斷健全，行業進入加快推進高質量發展的新階段

在宏觀環境、監管政策、客戶需求、金融科技與數字化變革等多重因素作用下，隨著以資管新規為核心的制度體系不斷健全，我國資產管理行業結構性變革持續深入，大集合公募化改造任務完成，產品創新持續萌生活力，資產管理業務進入回歸本源、規範發展、深度競合的新時代。在資產管理行業步入提質升級新階段的發展格局下，資產管理服務需求日益多元化與綜合化，我國資產管理市場競爭格局面臨重塑，各類資產管理機構應不斷提升主動管理能力，鍛造差異化核心競爭力，積極謀求新的業務發展方向及戰略佈局，持續打造全品類、豐富完善的產品體系以及全球視野的投資策略。根據中國證券投資基金業協會統計數據，截至2022年一季度末，基金管理公司及其子公司、證券公司、期貨公司、私募基金管理機構資產管理業務總規模約人民幣66.24萬億元，其中，證券公司及其子公司私募資產管理業務規模人民幣7.85萬億元。資產管理機構應主動適應監管變化，積極整合內外部優質業務資源，加強資產管理產品的業務創新力度，不斷豐富產品投資策略，持續優化投資管理模式，推動產品和服務的差異化，切實提高資產投資能力、解決方案能力、風險管理能力以及戰略機遇把握能力，致力於為客戶提供多層次全方位高質量的投資產品、資產配置和整體金融解決方案。

(2) 我國股權投資市場整體交易節奏放緩，行業競爭激烈，資金結構呈現分化趨勢

在國際局勢複雜嚴峻、國內疫情散點頻發、行業監管環境日益趨嚴等背景下，我國股權投資市場依然面臨嚴峻考驗，募資市場活躍度呈現走低趨勢，投資市場節奏明顯放緩，市場整體交易總量下降。同時，優質項目競爭激烈，頭部機構優勢明顯，市場資金向具有強大專業能力、資源整合能力的頭部機構聚集，行業生態格局進一步重塑。根據清科研究中心私募通統計數據，2022年上半年，中國股權投資市場新募基金數2,701支，募資總規模人民幣7,724.55億元，較2021年同期減少10.3%；中國股權投資市場投資案例數4,167起，投資總金額人民幣3,149.29億元，較2021年同期減少54.9%。長期來看，隨著市場基礎設施的完善、行業監管體系的健全、差異化監管機制的加強、登記備案流程的優化、數字化轉型的深入，我國股權投資市場將迎來歷史性發展機遇，股權投資業務成長空間依然廣闊。在實體經濟持續恢復發展、資本市場改革全面深化、多層次市場體系逐步完善、市場基础性制度不斷健全、行業生態持續優化，特別是註冊制即將全面實施的背景下，股權投資市場在促進創新資本形成、孕育創新經濟功能、支持企業科技創新方面發揮著日益重要的基础性、戰略性作用。證券公司私募股權投資業務應依託全業務鏈優勢，憑藉專業化、立體化的投資管理體系，持續增強全方位綜合服務能力，積極打造業務核心競爭優勢，切實提升服務實體經濟的效率。

## 2、投資管理業務經營舉措及業績

### (1) 證券公司資產管理業務

報告期內，隨著後資管新規時代的到來，本集團全資子公司華泰資管公司深度把握客戶需求和結構變化，依託全業務鏈協作及一體化專業優勢，著力打造數字化、生態化運營模式，積極推進投研交易體系搭建，持續增強差異化的投資管理能力、精細化的資產定價能力、完善的風險管理能力，為客戶提供全生命週期、全業務鏈條的綜合金融服務解決方案。根據監管報表數據口徑，截至報告期末，華泰資管公司資產管理總規模人民幣5,016.13億元。根據Wind資訊統計數據，報告期內，華泰資管公司企業ABS（資產證券化）發行規模人民幣455.44億元，行業排名第三。

報告期內，證券公司資產管理業務聚焦資產管理總規模質量，繼續向主動管理方向發展，主動投資管理能力持續增強，主動管理規模佔比進一步提高，同時依託自身資產識別能力、產品設計能力和風險定價能力優勢，積極構建規模化、差異化且覆蓋不同風險收益特徵的產品體系。集合資產管理業務有效落實新規轉型，完成重點產品貨幣增強公募基金轉型，合計管理集合資管計劃189隻，合計管理規模人民幣701.96億元。單一資產管理業務加快發展淨值型委外業務，持續推進業務轉型，合計管理單一資管計劃450隻，合計管理規模人民幣1,480.75億元。專項資產管理業務持續推進產品創新，鞏固並提升業務領先優勢，合計管理專項資管計劃180隻，合計管理規模人民幣1,861.06億元。公募基金管理業務積極打造針對投資者不同流動性需求的淨值化理財解決方案，合計管理公募基金產品27隻，合計管理規模人民幣972.36億元。

證券公司資產管理業務規模和收入情況如下表所示：

幣種：人民幣

| 項目       | 2022年1-6月    |             | 2021年1-6月    |             |
|----------|--------------|-------------|--------------|-------------|
|          | 受託規模<br>(億元) | 淨收入<br>(萬元) | 受託規模<br>(億元) | 淨收入<br>(萬元) |
| 集合資產管理業務 | 701.96       | 9,595.17    | 1,187.35     | 49,901.04   |
| 單一資產管理業務 | 1,480.75     | 11,161.15   | 2,485.92     | 12,267.53   |
| 專項資產管理業務 | 1,861.06     | 6,478.05    | 1,367.95     | 6,006.74    |
| 公募基金管理業務 | 972.36       | 37,900.88   | 202.65       | 3,425.65    |

註：上表數據來源於監管報表。

## (2) 私募股權基金管理業務

報告期內，私募股權基金管理業務繼續圍繞自身業務優勢，專注大健康、TMT、先進製造等行業，持續加深行業研究，積極挖掘並投資行業優質項目，通過投後管理服務賦能被投企業，並為企業的申報和上市提供全方面支持，同時積極推進新基金募集，維護與投資機構的基金合作關係，持續做好投資業務項目儲備。截至報告期末，華泰紫金投資及其二級子公司作為管理人在中國證券投資基金業協會備案存續的私募股權投資基金合計23隻，合計認繳規模人民幣526.26億元，合計實繳規模人民幣425.68億元。報告期內，上述私募股權投資基金實施投資項目合計16個，投資金額合計人民幣56,055.31萬元，均為股權投資類項目。根據中國證券投資基金業協會截至2022年第二季度的統計，華泰紫金投資私募基金月均規模行業排名第二。

### (3) 基金公司資產管理業務

報告期內，本集團旗下基金公司堅持合規管理與業務發展並重，持續發力新業務探索與新產品開發，優化調整產品線佈局，加強產品營銷力度，著力完善智能化系統建設，不斷提升市場認知度、美譽度和業務競爭力，資產管理總規模繼續保持增長。南方基金資產管理業務方面，截至報告期末，南方基金管理資產規模合計人民幣16,984.81億元，其中，公募業務管理基金數量合計296個，管理資產規模合計人民幣10,502.11億元；非公募業務管理資產規模合計人民幣6,482.70億元。華泰柏瑞資產管理業務方面，截至報告期末，華泰柏瑞管理資產規模合計人民幣2,936.25億元，其中，公募業務管理基金數量合計117個，管理資產規模合計人民幣2,750.48億元；非公募業務管理資產規模合計人民幣185.76億元。（南方基金以及華泰柏瑞的股權投資損益計入在分部報告中的其他分部中）

### (4) 期貨公司資產管理業務

報告期內，本集團控股子公司華泰期貨不斷強化內部資源整合與業務協同，穩步推進數字化轉型，構建平台化客戶服務體系，持續提升專業化服務水平、智能化管理水平及業務創新能力，積極打造多元業務體系，滿足客戶差異化的風險偏好和資產配置需求。截至報告期末，存續期內資產管理計劃合計23隻，資產管理總規模人民幣192,822.10萬元，期貨端權益規模人民幣30,289.18萬元。

### (5) 另類投資業務

本集團通過全資子公司華泰創新投資開展另類投資業務。報告期內，華泰創新投資持續健全完善內部管理制度和機制，根據監管要求及業務佈局，著力金融科技股權投資和科創板跟投業務，穩步探索創業板跟投業務。截至報告期末，存續投資項目52個，投資規模人民幣241,590.00萬元，投資性質主要包括科創板跟投、股權投資等。



### 3、投資管理業務2022年下半年展望

投資管理業務承載著資產管理者和資產服務者的雙重戰略角色，是本集團金融產品創新和客戶資產管理的重要領域。2022年下半年，本集團將繼續發揮資產發現、風險定價與產品創設的專業能力，充分依託全業務鏈資源優勢，積極打造全品種、規模化與特色化的金融產品體系，對接客戶差異化需求，構建一流的投資管理平台，不斷強化行業領先地位。

證券公司資產管理業務將繼續依託全業務鏈資源，聚焦科技賦能，以數字化轉型牽引業務體系的重塑和管理流程的再造，健全貫穿全業務鏈的風控體系，不斷優化基於戰略導向的產品及業務佈局，以投資研究為引領，打造基本面和科學投研相結合的平台化投研體系。大力拓展內外部渠道，完善客戶分層分級服務體系，不斷優化產品管理機制，豐富多元產品體系，持續鞏固市場影響力和品牌知名度。

私募股權基金管理業務將依託良好的管理能力和歷史業績，積極維護與上市公司、大型國有企業、地方政府平台等機構的基金合作關係，不斷擴大基金管理規模；繼續圍繞優勢業務領域，加深行業研究，積極挖掘行業優質項目，打造重點行業生態圈，不斷增強專業化投資管理能力，進一步鞏固重點領域的行業影響力。

基金公司資產管理業務將不斷完善合規管控體系和人才梯隊建設，積極構建多層次、有特色、差異化的產品線，不斷優化業務結構，持續推動數智化轉型引領業務發展和管理變革，著力增強投資研究專業能力，切實提升整體資產管理規模和投資業績。

期貨公司資產管理業務將貫徹全業務鏈發展戰略，依靠金融科技創新與平台賦能，重點打造以FOF業務為主、以主動管理類業務為備、以投資顧問類業務為輔的業務發展模式，積極構建特色且具備差異化競爭力的產品體系和管理能力。

另類投資業務將持續健全完善制度機制及業務操作流程，加速金融科技生態建設，審慎推進股權投資、科創板跟投和其他新業務的開展，有效管控存量業務風險並妥善處理投後管理事項，穩步提高資金使用效率和資產回報率。



## (四) 國際業務

### 1、 國際業務市場環境與行業趨勢

- (1) 資本市場制度型開放縱深發展加速推進證券行業國際化進程，客戶跨境服務需求推動證券公司國際化服務能力提升

近年來，在我國持續推動資本市場高水平制度型雙向開放的背景之下，資本市場跨境證券雙向投資機制不斷優化，境內外市場互聯互通有效拓展，資本市場雙向開放產品體系持續完善，跨境業務更趨多元化，資本市場開始具備鏈接境內外金融及產業資源、構建雙循環體系樞紐平台的新價值定位，將實現更高層次、更廣範圍、更多方式的雙向開放，證券行業迎來歷史性重大發展機遇，領先證券公司通過在全球範圍內配置資源、服務客戶、管理風險，將更有潛力成長為具有國際競爭力的大型投資銀行。當前，資本市場雙向開放的法律法規和政策指引相繼落地、客戶跨境綜合金融服務需求日益增加、資產全球配置趨勢持續增強、證券行業國際化發展進程步入深水區，國際業務已成為證券公司拓展發展空間、增加新的利潤增長點、促進業務結構升級的前沿領域。大型證券公司應積極把握資本市場雙向開放不斷深化的戰略機遇，深入探索與打造業內前沿的境內外一體化綜合服務平台，持續優化境內外資源良性循環機制，加速國際化佈局並積極打造跨境生態圈，不斷提升國際化運營能力、跨市場服務能力、全球資產配置能力和跨境風險管理能力，更好地為國內及全球客戶提供多市場、全方位、一站式的投融資交易體驗和綜合金融解決方案。

- (2) 美國財富管理行業獨立渠道增長勢頭良好，利好TAMP市場長期發展

從整體行業發展來看，美國財富管理行業目前主要包括獨立渠道（註冊投資顧問、雙重註冊和獨立經紀交易商及保險經紀交易商等）和傳統渠道（全國和區域經紀交易商、銀行經紀交易商和商業銀行顧問等），獨立渠道的財富管理市場份額相比傳統渠道增長更加迅速，且該趨勢仍在持續。根據Cerulli統計數據，從2020年至2025年，獨立渠道的市場規模預計將從10.8萬億美元增長至14.4萬億美元，市場份額將從42%提高至47%。根據PriceMetrix統計數據，2020年投資顧問收入中75%來自管理費，相對佣金收入而言達到歷史新高，從佣金向管理費轉變的收費模式持續推進。從業務發展趨勢來看，投資

者資金呈現向低成本、低費率的投資產品轉移的態勢，TAMP行業通過領先的金融科技水平持續賦能財富管理業務，能夠為客戶帶來規模化的成本優勢，有利於把握當下的發展機遇。根據Cerulli統計數據，2016年至2021年間，TAMP市場年複合增長率為19.6%，顯著高於同期整體投資顧問市場8.5%的年複合增長率。

## 2、國際業務經營舉措及業績

報告期內，作為本集團國際業務的控股平台，華泰國際全方位對接集團全業務鏈體系，深化推進跨境綜合性金融服務平台建設，通過跨境聯動、業務協同、強化風控和平台運營，夯實國際業務前沿平台價值，提升資本市場中介業務能力，業績保持穩定，境外市場影響力持續擴大。截至報告期末，華泰國際資產規模近兩千億港元，綜合實力持續提升，穩居香港中資券商第一梯隊前列。

### (1) 香港業務

本集團香港業務堅持券商本源，以跨境業務為抓手，打造全方位的綜合性跨境金融服務平台體系，在波動的市場環境下憑藉強大的平台實力及出色的風險管控能力，穩住了業務規模及收入，報告期內包括股權業務平台、固收業務平台、個人金融平台、基金平台和旗艦投行業務的業務平台體系持續深化，差異化競爭優勢凸顯。股權衍生品業務充分發揮集團平台優勢，持續強化大類資產配置、大宗商品交易及場內外境內外券池互聯互通；股票銷售交易業務繼續做大做深跨境主經紀商業務，為境內外機構投資者提供「現券+跨境主經紀商+QFII」一站式跨境綜合金融服務；FICC業務強化數字化平台建設，積極承接客戶多樣化需求，實現FICC全品類覆蓋，同時以精準的市場趨勢判斷和合理的對沖手段有效降低風險敞口；零售及網絡金融業務不斷優化「漲樂全球通」平台功能和運營能力，同時開放平台合作，以平台科技實力賦能，豐富引流、加強轉化；私人財富管理業務全方位升級產品功能、交易系統及賬戶管理等模塊，持續完善平台化私行體系，提供全生命週期綜合金融服務；基金業務持續提升主動管理能力，嚴格防控風險，不斷優化資產組合，推動「募投管銷」全流程管理，繼續完善基金平台管理能力，積極把握優質資產並提升管理規模；投資銀行業務關注客戶需求轉變，積極開拓新業務範疇，打造以客戶為中心的全能跨境投行平台，並作為聯席賬簿管理人參與全香港市場第二單SPAC上市項目，開闢全新業務篇章。

報告期內，本集團香港業務保持健康均衡發展，證券交易方面，華泰金控（香港）託管資產總量港幣940.94億元、股票交易總量港幣1,505.21億元；就證券提供意見方面，積極為客戶提供研究報告及諮詢服務；就機構融資提供意見方面，參與完成上市及配售項目5個、債券發行項目63個，總交易發行規模約港幣202.77億元；提供證券保證金融資方面，累計授信金額港幣20.16億元。此外，報告期內，華泰金控（香港）共完成財務顧問項目5個。報告期內，華泰金控（香港）正式取得香港聯交所的特殊目的收購公司（SPAC）交易所參與者資格，是首批取得該資質的在港中資券商，進一步鞏固提升了國際化發展能力以及在主流國際資本市場的參與能力。

## (2) AssetMark

AssetMark的願景是致力於為獨立投資顧問及其服務的投資者的生活帶來改變。AssetMark的核心業務亮點包括：一體化的技術平台、可定制化和規模化的服務，以及先進的投資管理能力。清晰的戰略有助於AssetMark明確短期和長期工作目標，找準服務客戶的關鍵並促使AssetMark在TAMP行業中脫穎而出。截至2021年年末，根據Cerulli Associates及其他公開信息顯示，AssetMark在美國TAMP行業中的市場佔有率為11.1%，排名第三。

報告期內，AssetMark通過領先的業務模式和先進的技術平台保持行業地位持續領先，業務收入不斷提升。截至報告期末，AssetMark平台資產總規模約821.27億美元；AssetMark平台總計服務8,688名獨立投資顧問，其中管理500萬美元以上資產規模的活躍投資顧問2,663名；AssetMark平台總計服務的終端賬戶覆蓋了逾22.0萬個家庭，較2021年年末增長約4.89%。報告期內，新增388名投資顧問與AssetMark簽訂合作協議。

## (3) 華泰證券（美國）

華泰證券（美國）於2019年經美國金融業監管局核准，獲得經紀交易商牌照，可在美國開展經紀交易商業務，包括證券承銷、面向機構投資者的證券經紀、併購財務顧問等業務，於2020年獲得自營牌照，並於2021年獲得在加拿大與機構投資者開展證券交易的業務資格。報告期內，華泰證券（美國）繼續完善系統和平台建設，不斷拓展交易產品種類和市場通道，持續深化與美國主要機構投資者的合作關係，有效平衡合規與風險管理的關鍵需求，業務跨境聯動協同機制不斷優化。報告期內，華泰證券（美國）獲得歐洲主要證券交易所的市場准入，並在美國市場現有High-touch產品中增加Low-touch算法交易平台。



### 3、國際業務2022年下半年展望

國際業務是本集團打造境內外一體化平台的橋樑，也是本集團高階發展和創造盈利的新引擎。2022年下半年，本集團將繼續深化跨境一體化管理機制，不斷強化團隊、平台、資源的有效聯動，著力打造跨市場的資本服務能力，為客戶提供境內外一體化的綜合金融服務，全面提升國際業務競爭力與影響力。

華泰國際將依託規模效應優勢及券商本源業務模式，積極打造一體化、生態化、平台化的綜合性跨境金融服務平台，加強業務協同合作，豐富產品鏈條和對客全流程服務，強化風險前置管控能力，積極打造高質量綜合性跨境平台體系。

香港業務將持續以客戶需求為中心，通過境內境外貫通、股權債權結合、機構零售互補、一級二級聯動的業務策略，夯實跨境資本市場中介定位，為客戶提供一站式金融服務。股權衍生品業務將持續鞏固業務優勢，拓展新業務、新市場，全方位強化對客服務水平；股票銷售交易業務將持續優化頭部客戶服務體系，不斷挖掘產品深度，完善系統建設，形成券池、引流和獲客的良性循環體系；FICC業務將以平台為依託推動規模化、系統化與數字化運營，增強產品創新、跨境聯動、一二級聯動，為客戶提供一站式跨境FICC業務服務；零售及網絡金融業務將優化完善「漲樂全球通」平台的功能及服務，以科技實力賦能，實現ToB及ToC端業務全面發展；私人財富管理業務將專注於以買方投資顧問服務為中心強化平台服務體系和自主產品供應，注重客戶畫像，加大客群覆蓋；基金業務將持續深化一二級聯動、投投聯動，依託全產業鏈資源優勢，聚焦優勢客戶，拓展可投行業，加強與外部基金合作，強化行業口碑和市場影響力；投資銀行業務將深化IPO、再融資與併購並進策略，積極把握業務機會，爭取明星項目並推動存量項目落地。

AssetMark將繼續把握核心業務亮點，打造一體化的技術平台、提升可定制化和規模化的服務、加強先進的投資管理能力，構建靈活且專業的財富管理生態圈。不斷深化與現有投資顧問客戶的合作關係，通過專注客戶需求、提供差異化服務和幫助客戶成長展業以進一步擴大投資顧問客戶基數。不斷升級數字化工具和平台賦能投資顧問，優化交互體驗和協同辦公，助力投資顧問護航客戶財務健康計劃。積極拓展客戶渠道，致力於通過推動業務規模化和推廣上市公司社會責任實踐來提升運營效率和降低經營風險。此外，AssetMark將持續關注優質的戰略併購契機，推動外延式增長。

華泰證券(美國)將持續推進跨區域合作，整合中國內地、香港和美國三地平台資源，以便投資者充分利用集團跨地區覆蓋的資源優勢。通過增加FICC業務及合格境外機構投資者資質，積極拓展產品與業務類型，不斷拓寬市場渠道，為滿足客戶資產配置需求提供全方位服務。

## **(五) 業務創新情況與對公司經營業績和未來發展的影響，以及風險控制情況**

報告期內，公司持續進行業務創新活動，推動新業務、新產品、服務及管理模式創新，不斷提高創新能力。創新業務的開展是對現有產品線和業務範圍的補充，能夠有效釋放業務空間，擴大客戶資源和收入來源，增強盈利能力，也有利於改善客戶結構和業務經營模式，滿足客戶全方位、多元化的業務需求，進一步提升品牌影響力。

報告期內，公司強化集團新業務風險評估管理，優化新業務風險管理機制，強化新業務評估回溯，加強新業務流程執行情況的質量控制，提升新業務評估機制落實有效性。

報告期內，公司新增基金通做市業務，將公募REITs的場內場外份額打通，通過公司的做市能力為市場提供相應流動性，針對此項業務的風險管控，公司將其納入公募REITs做市業務的風險限額體系中，對敞口、持倉限額、集中度等設置對應的限額指標；公司新增轉債大宗交易業務及上交所債券做市業務，為保障該業務風險可控，公司制定了相應的風險限額，對業務規模、集中度等方面進行了嚴格規定；公司獲得鄭州商品交易所、上海期貨交易所部分商品期貨／期權品種的做市資格，積極參與商品期貨／期權做市業務，為商品期貨／期權提供流動性服務，公司進一步完善做市業務配套的系統建設與包括風險敞口、業務規模在內的管控機制，將新增品種納入管理體系，保障業務在風險可測、可控、可承受的前提下平穩運行。

## **(六) 報告期內公司經營情況無重大變化，以及報告期內未發生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**

## 五、報告期內主要經營情況

### (一) 主營業務分析

#### 1、利潤表及現金流量表相關科目變動分析表

單位：千元 幣種：人民幣

| 科目              | 本期數          | 上年同期數        | 變動比例(%) |
|-----------------|--------------|--------------|---------|
| 收入、其他收入及收益總計    | 23,479,022   | 24,615,529   | (4.62)  |
| 支出合計            | (17,168,499) | (16,162,484) | 6.22    |
| 所得稅前利潤          | 6,773,996    | 10,036,901   | (32.51) |
| 歸屬於本公司股東的本期利潤   | 5,375,208    | 7,770,308    | (30.82) |
| 經營活動所得／(所用)現金淨額 | 26,018,313   | (30,531,020) | 不適用     |
| 投資活動(所用)／所得現金淨額 | (3,913,007)  | 2,509,846    | 不適用     |
| 融資活動(所用)／所得現金淨額 | (16,368,358) | 32,932,692   | 不適用     |
| 現金及現金等價物增加淨額    | 5,736,948    | 4,911,518    | 16.81   |

#### 2、收入、其他收入及收益

截至2022年6月30日，本集團實現收入、其他收入及收益總計人民幣234.79億元，同比下降4.62%。其中：

- (1) 佣金及手續費收入人民幣99.31億元，佔42.30%，同比增長0.99%，主要是由於資產管理業務收入增長。
- (2) 利息收入人民幣67.58億元，佔28.79%，同比下降5.46%，主要是由於本集團融資融券業務收入下降。
- (3) 投資收益淨額人民幣37.54億元，佔15.99%，同比下降47.79%，主要是因為本集團投資業務收益下降。
- (4) 其他收入及收益人民幣30.35億元，佔12.92%，同比增長588.05%，主要是大宗商品銷售收入增加。



本集團於報告期內的收入、其他收入及收益結構如下：

單位：千元 幣種：人民幣

| 科目               | 2022年1月1日         |                | 2021年1月1日         |                | 增減情況               |                |
|------------------|-------------------|----------------|-------------------|----------------|--------------------|----------------|
|                  | 至6月30日            |                | 至6月30日            |                | 金額                 | 結構             |
|                  | 金額                | 結構             | 金額                | 結構             |                    |                |
| 佣金及手續費收入         | 9,931,122         | 42.30%         | 9,834,181         | 39.95%         | 96,941             | 0.99%          |
| 利息收入             | 6,758,476         | 28.79%         | 7,148,805         | 29.04%         | (390,329)          | (5.46)%        |
| 投資收益淨額           | 3,754,431         | 15.99%         | 7,191,441         | 29.22%         | (3,437,010)        | (47.79)%       |
| 其他收入及收益          | 3,034,993         | 12.92%         | 441,102           | 1.79%          | 2,593,891          | 588.05%        |
| 收入、其他收入<br>及收益總計 | <u>23,479,022</u> | <u>100.00%</u> | <u>24,615,529</u> | <u>100.00%</u> | <u>(1,136,507)</u> | <u>(4.62)%</u> |

### 3、支出合計

截至2022年6月30日，本集團支出總額人民幣171.68億元，同比增長6.22%，主要原因是利息支出及其他營業支出的增長。其中：

- (1) 佣金及手續費支出人民幣24.02億元，同比下降11.93%，主要是由於經紀業務、承銷與保薦業務支出下降。
- (2) 利息支出人民幣53.73億元，同比增長2.58%，主要是債務融資利息支出增長。
- (3) 僱員成本人民幣46.28億元，同比下降18.59%，主要是由於本集團因收入下降計提的員工成本有所下降。
- (4) 除此之外的支出主要包括折舊和攤銷費用、稅金及附加以及資產減值損失(撥回)/撥備及其他營業支出等。

單位：千元 幣種：人民幣

| 科目       | 2022年1月1日           |                | 2021年1月1日           |                | 增減情況               |              |
|----------|---------------------|----------------|---------------------|----------------|--------------------|--------------|
|          | 至6月30日              |                | 至6月30日              |                | 金額                 | 結構           |
|          | 金額                  | 結構             | 金額                  | 結構             |                    |              |
| 佣金及手續費支出 | (2,402,224)         | 13.99%         | (2,727,742)         | 16.88%         | 325,518            | (11.93)%     |
| 利息支出     | (5,373,126)         | 31.30%         | (5,237,852)         | 32.41%         | (135,274)          | 2.58%        |
| 僱員成本     | (4,628,022)         | 26.96%         | (5,684,559)         | 35.17%         | 1,056,537          | (18.59)%     |
| 折舊和攤銷費用  | (727,809)           | 4.24%          | (705,826)           | 4.37%          | (21,983)           | 3.11%        |
| 税金及附加    | (105,128)           | 0.61%          | (109,880)           | 0.68%          | 4,752              | (4.32)%      |
| 其他營業支出   | (4,269,814)         | 24.87%         | (1,889,652)         | 11.68%         | (2,380,162)        | 125.96%      |
| 金融資產減值損失 | 337,624             | (1.97)%        | 193,027             | (1.19)%        | 144,597            | 74.91%       |
| 支出合計     | <u>(17,168,499)</u> | <u>100.00%</u> | <u>(16,162,484)</u> | <u>100.00%</u> | <u>(1,006,015)</u> | <u>6.22%</u> |

#### 4、分部收入、其他收入及收益和分部支出分析

##### (1) 分部收入、其他收入及收益分析

單位：千元 幣種：人民幣

| 業務分部    | 佔分部收入、                      |                               | 佔分部收入、                        |                               | 佔分部收入、<br>其他收入及<br>收益總計<br>的比例較上年<br>同期增減 |
|---------|-----------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|---|
|         | 分部收入、<br>其他收入<br>及收益<br>本期數 | 其他收入<br>及收益<br>本期數總計<br>比例(%) | 分部收入、<br>其他收入<br>及收益<br>上年同期數 | 其他收入<br>及收益<br>上年同期數<br>比例(%) |   |
| 財富管理業務  | 12,395,626                  | 52.79                         | 11,400,660                    | 46.31                         | 增長6.48個百分點                                |
| 機構服務業務  | 3,786,093                   | 16.13                         | 6,505,920                     | 26.43                         | 下降10.30個百分點                               |
| 投資管理業務  | 893,317                     | 3.80                          | 2,503,732                     | 10.17                         | 下降6.37個百分點                                |
| 國際業務    | 4,184,585                   | 17.82                         | 3,540,859                     | 14.38                         | 增長3.44個百分點                                |
| 其他(含抵銷) | 2,219,401                   | 9.46                          | 664,358                       | 2.71                          | 增長6.75個百分點                                |

報告期內，按合併口徑，本集團實現收入、其他收入及收益總計人民幣234.79億元，同比下降4.62%，主要業務分部中，受市場波動影響，本集團投資交易業務收入及私募股權基金、另類投資項目估值同比下降，機構服務業務和投資管理業務分部收入較上年同期下降人民幣27.20億元、人民幣16.10億元，是本期收入同比下降的主要因素。

## (2) 分部支出分析

單位：千元 幣種：人民幣

| 業務分部    | 分部支出<br>本期數 | 佔分部支出          |               | 佔分部<br>支出上年    |                          |
|---------|-------------|----------------|---------------|----------------|--------------------------|
|         |             | 本期數總計<br>比例(%) | 分部支出<br>上年同期數 | 同期數總計<br>比例(%) | 分部支出<br>佔本期比例較<br>上年同期增減 |
| 財富管理業務  | (8,007,493) | 46.64          | (7,389,581)   | 45.72          | 增長0.92個百分點               |
| 機構服務業務  | (2,977,089) | 17.34          | (3,436,685)   | 21.26          | 下降3.92個百分點               |
| 投資管理業務  | (549,527)   | 3.20           | (594,697)     | 3.68           | 下降0.48個百分點               |
| 國際業務    | (2,926,501) | 17.05          | (2,483,668)   | 15.37          | 增長1.68個百分點               |
| 其他(含抵銷) | (2,707,889) | 15.77          | (2,257,853)   | 13.97          | 增長1.80個百分點               |

從各業務分部支出佔本集團支出總計的比例情況看，財富管理業務和國際業務分部支出佔比分別增長0.92個百分點、1.68個百分點；機構服務業務、投資管理業務分部支出佔比分別下降3.92個百分點、0.48個百分點。

## 5、現金流分析

單位：千元 幣種：人民幣

| 項目              | 本期數          | 上年同期數        | 增減金額         | 增減比例(%) |
|-----------------|--------------|--------------|--------------|---------|
| 經營活動所得／(所用)現金淨額 | 26,018,313   | (30,531,020) | 56,549,333   | 不適用     |
| 投資活動(所用)／所得現金淨額 | (3,913,007)  | 2,509,846    | (6,422,853)  | 不適用     |
| 融資活動(所用)／所得現金淨額 | (16,368,358) | 32,932,692   | (49,301,050) | 不適用     |
| 現金及現金等價物增加淨額    | 5,736,948    | 4,911,518    | 825,430      | 16.81   |

報告期內，本集團現金及現金等價物增加淨額為人民幣57.37億元。其中：

- (1) 經營活動所得現金淨額為人民幣260.18億元，較上年同期增加人民幣565.49億元，主要是本期拆入資金及融出資金現金流入增加所致。
- (2) 投資活動所用現金淨額為人民幣39.13億元，較上年同期減少人民幣64.23億元，主要是收回投資收到的現金減少所致。
- (3) 融資活動所用現金淨額為人民幣163.68億元，較上年同期減少人民幣493.01億元，主要是因為本期發行債券所得款項較少所致。

6、本集團業務類型、利潤構成或利潤來源發生重大變動的詳細說明

單位：千元 幣種：人民幣

| 項目                   | 本期數          | 上年同期數        | 同比變動(%) | 主要影響因素                |
|----------------------|--------------|--------------|---------|-----------------------|
| 收入、其他收入<br>及收益總計     | 23,479,022   | 24,615,529   | (4.62)  | 投資收益淨額下降              |
| 支出合計                 | (17,168,499) | (16,162,484) | 6.22    | 其他營業支出增長              |
| 經營利潤                 | 6,310,523    | 8,453,045    | (25.35) | 收入、其他收入及<br>收益總計下降    |
| 所得稅前利潤               | 6,773,996    | 10,036,901   | (32.51) | 收入、其他收入及<br>收益總計下降    |
| 本期利潤                 | 5,552,139    | 7,886,784    | (29.60) | 收入、其他收入及<br>收益總計下降    |
| 其中：歸屬於本公司<br>股東的本期利潤 | 5,375,208    | 7,770,308    | (30.82) | 收入、其他收入及<br>收益總計下降    |
| 項目                   | 期末餘額         | 期初餘額         | 同比變動(%) | 主要影響因素                |
| 資產總額                 | 849,322,705  | 806,650,833  | 5.29    | 金融資產規模增長              |
| 負債總額                 | 692,930,157  | 654,615,049  | 5.85    | 應付經紀客戶賬款和<br>債務融資規模增長 |
| 股東權益合計               | 156,392,548  | 152,035,784  | 2.87    | 當年利潤實現及<br>發行永續債      |

## (二) 綜合財務狀況表主要項目分析

### 1、綜合財務狀況總體情況表

單位：千元 幣種：人民幣

| 項目                           | 2022年6月30日         |               | 2021年12月31日        |               | 增減情況             |              |
|------------------------------|--------------------|---------------|--------------------|---------------|------------------|--------------|
|                              | 金額                 | 結構            | 金額                 | 結構            | 金額               | 結構           |
| <b>非流動資產</b>                 |                    |               |                    |               |                  |              |
| 物業及設備                        | 6,030,947          | 0.71%         | 5,178,222          | 0.64%         | 852,725          | 16.47%       |
| 投資物業                         | 233,936            | 0.03%         | 294,008            | 0.04%         | (60,072)         | (20.43)%     |
| 商譽                           | 2,984,528          | 0.35%         | 2,836,429          | 0.35%         | 148,099          | 5.22%        |
| 土地使用權和其他無形資產                 | 7,047,773          | 0.83%         | 6,790,673          | 0.84%         | 257,100          | 3.79%        |
| 聯營企業權益                       | 17,667,964         | 2.08%         | 18,269,459         | 2.26%         | (601,495)        | (3.29)%      |
| 合營企業權益                       | 1,833,112          | 0.22%         | 1,749,065          | 0.22%         | 84,047           | 4.81%        |
| 以攤餘成本計量的債權投資                 | 29,127,033         | 3.43%         | 25,299,666         | 3.14%         | 3,827,367        | 15.13%       |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>其他綜合收益的債務工具 | 4,285,003          | 0.50%         | 4,857,284          | 0.60%         | (572,281)        | (11.78)%     |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>其他綜合收益的權益工具 | 123,778            | 0.01%         | 163,138            | 0.02%         | (39,360)         | (24.13)%     |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>當期損益的金融資產   | 9,028,185          | 1.06%         | 9,896,339          | 1.23%         | (868,154)        | (8.77)%      |
| 存出保證金                        | 32,390,559         | 3.81%         | 27,627,129         | 3.42%         | 4,763,430        | 17.24%       |
| 遞延所得稅資產                      | 704,761            | 0.08%         | 654,651            | 0.08%         | 50,110           | 7.65%        |
| 其他非流動資產                      | 242,827            | 0.03%         | 282,227            | 0.03%         | (39,400)         | (13.96)%     |
| <b>非流動資產總額</b>               | <b>111,700,406</b> | <b>13.15%</b> | <b>103,898,290</b> | <b>12.88%</b> | <b>7,802,116</b> | <b>7.51%</b> |

單位：千元 幣種：人民幣

| 項目                           | 2022年6月30日         |                | 2021年12月31日        |                | 增減情況              |              |
|------------------------------|--------------------|----------------|--------------------|----------------|-------------------|--------------|
|                              | 金額                 | 結構             | 金額                 | 結構             | 金額                | 結構           |
| <b>流動資產</b>                  |                    |                |                    |                |                   |              |
| 應收款項                         | 10,141,361         | 1.19%          | 10,287,174         | 1.28%          | (145,813)         | (1.42)%      |
| 其他應收款、預付款項及<br>其他流動資產        | 1,752,325          | 0.21%          | 2,122,246          | 0.26%          | (369,921)         | (17.43)%     |
| 融出資金                         | 103,346,385        | 12.17%         | 116,942,245        | 14.50%         | (13,595,860)      | (11.63)%     |
| 以攤餘成本計量的債權投資                 | 10,500,637         | 1.24%          | 7,121,850          | 0.88%          | 3,378,787         | 47.44%       |
| 買入返售金融資產                     | 13,837,737         | 1.63%          | 11,751,970         | 1.46%          | 2,085,767         | 17.75%       |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>其他綜合收益的債務工具 | 2,695,716          | 0.32%          | 4,457,415          | 0.55%          | (1,761,699)       | (39.52)%     |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>當期損益的金融資產   | 377,388,270        | 44.43%         | 345,362,833        | 42.81%         | 32,025,437        | 9.27%        |
| 衍生金融資產                       | 22,880,610         | 2.69%          | 15,247,805         | 1.89%          | 7,632,805         | 50.06%       |
| 結算備付金                        | 7,884,492          | 0.93%          | 8,580,941          | 1.06%          | (696,449)         | (8.12)%      |
| 代經紀客戶持有的現金                   | 147,177,814        | 17.33%         | 143,640,263        | 17.81%         | 3,537,551         | 2.46%        |
| 現金及銀行結餘                      | 40,016,952         | 4.71%          | 37,237,801         | 4.62%          | 2,779,151         | 7.46%        |
| <b>流動資產總額</b>                | <b>737,622,299</b> | <b>86.85%</b>  | <b>702,752,543</b> | <b>87.12%</b>  | <b>34,869,756</b> | <b>4.96%</b> |
| <b>資產總額</b>                  | <b>849,322,705</b> | <b>100.00%</b> | <b>806,650,833</b> | <b>100.00%</b> | <b>42,671,872</b> | <b>5.29%</b> |



單位：千元 幣種：人民幣

| 項目              | 2022年6月30日         |               | 2021年12月31日        |               | 增減情況                |                |
|-----------------|--------------------|---------------|--------------------|---------------|---------------------|----------------|
|                 | 金額                 | 結構            | 金額                 | 結構            | 金額                  | 結構             |
| <b>流動負債</b>     |                    |               |                    |               |                     |                |
| 短期銀行借款          | 5,668,727          | 0.82%         | 8,492,290          | 1.30%         | (2,823,563)         | (33.25)%       |
| 已發行的短期債務工具      | 48,840,031         | 7.05%         | 53,598,658         | 8.19%         | (4,758,627)         | (8.88)%        |
| 拆入資金            | 43,339,686         | 6.25%         | 14,018,721         | 2.14%         | 29,320,965          | 209.16%        |
| 應付經紀客戶賬款        | 158,777,534        | 22.91%        | 147,501,833        | 22.53%        | 11,275,701          | 7.64%          |
| 應付職工薪酬          | 4,799,480          | 0.69%         | 5,757,598          | 0.88%         | (958,118)           | (16.64)%       |
| 其他應付款項及應計費用     | 109,403,082        | 15.79%        | 106,620,755        | 16.29%        | 2,782,327           | 2.61%          |
| 合同負債            | 350,611            | 0.05%         | 265,637            | 0.04%         | 84,974              | 31.99%         |
| 當期稅項負債          | 926,039            | 0.13%         | 1,245,374          | 0.19%         | (319,335)           | (25.64)%       |
| 賣出回購金融資產款       | 133,289,382        | 19.24%        | 130,710,001        | 19.97%        | 2,579,381           | 1.97%          |
| 以公允價值計量且其變動計入   |                    |               |                    |               |                     |                |
| 當期損益的金融負債       | 38,142,967         | 5.50%         | 28,289,462         | 4.32%         | 9,853,505           | 34.83%         |
| 衍生金融負債          | 11,547,959         | 1.67%         | 10,643,222         | 1.63%         | 904,737             | 8.50%          |
| 一年內到期的長期債券      | 35,106,479         | 5.07%         | 35,372,308         | 5.40%         | (265,829)           | (0.75)%        |
| <b>流動負債總額</b>   | <b>590,191,977</b> | <b>85.17%</b> | <b>542,515,859</b> | <b>82.88%</b> | <b>47,676,118</b>   | <b>8.79%</b>   |
| <b>流動資產淨值</b>   | <b>147,430,322</b> | <b>-</b>      | <b>160,236,684</b> | <b>-</b>      | <b>(12,806,362)</b> | <b>(7.99)%</b> |
| <b>總資產減流動負債</b> | <b>259,130,728</b> | <b>-</b>      | <b>264,134,974</b> | <b>-</b>      | <b>(5,004,246)</b>  | <b>(1.89)%</b> |
| <b>非流動負債</b>    |                    |               |                    |               |                     |                |
| 長期債券            | 89,805,662         | 12.96%        | 97,966,119         | 14.97%        | (8,160,457)         | (8.33)%        |
| 長期銀行借款          | 793,650            | 0.11%         | 722,816            | 0.11%         | 70,834              | 9.80%          |
| 長期應付職工薪酬        | 5,988,858          | 0.86%         | 7,057,339          | 1.08%         | (1,068,481)         | (15.14)%       |
| 遞延所得稅負債         | 2,377,925          | 0.34%         | 2,619,161          | 0.40%         | (241,236)           | (9.21)%        |
| 以公允價值計量且其變動計入   |                    |               |                    |               |                     |                |
| 當期損益的金融負債       | 2,731,642          | 0.39%         | 2,833,456          | 0.43%         | (101,814)           | (3.59)%        |
| 其他應付款項及應計費用     | 1,040,443          | 0.15%         | 900,299            | 0.14%         | 140,144             | 15.57%         |
| <b>非流動負債總額</b>  | <b>102,738,180</b> | <b>14.83%</b> | <b>112,099,190</b> | <b>17.12%</b> | <b>(9,361,010)</b>  | <b>(8.35)%</b> |
| <b>淨資產</b>      | <b>156,392,548</b> | <b>-</b>      | <b>152,035,784</b> | <b>-</b>      | <b>4,356,764</b>    | <b>2.87%</b>   |

單位：千元 幣種：人民幣

| 項目            | 2022年6月30日         |                | 2021年12月31日        |                | 增減情況             |              |
|---------------|--------------------|----------------|--------------------|----------------|------------------|--------------|
|               | 金額                 | 結構             | 金額                 | 結構             | 金額               | 結構           |
| <b>股東權益</b>   |                    |                |                    |                |                  |              |
| 股本            | 9,076,650          | 5.80%          | 9,076,650          | 5.97%          | -                | -            |
| 其他權益工具        | 12,694,871         | 8.12%          | 9,996,425          | 6.58%          | 2,698,446        | 26.99%       |
| 庫存股           | (1,211,555)        | (0.77)%        | (1,231,547)        | (0.81)%        | 19,992           | (1.62)%      |
| 儲備            | 95,566,965         | 61.11%         | 95,021,503         | 62.50%         | 545,462          | 0.57%        |
| 未分配利潤         | 36,342,666         | 23.24%         | 35,559,779         | 23.39%         | 782,887          | 2.20%        |
| 本公司股東應佔總權益    | 152,469,597        | 97.49%         | 148,422,810        | 97.62%         | 4,046,787        | 2.73%        |
| 非控制性權益        | 3,922,951          | 2.51%          | 3,612,974          | 2.38%          | 309,977          | 8.58%        |
| <b>股東權益合計</b> | <b>156,392,548</b> | <b>100.00%</b> | <b>152,035,784</b> | <b>100.00%</b> | <b>4,356,764</b> | <b>2.87%</b> |

截至2022年6月30日，本集團非流動資產總額為人民幣1,117.00億元，較年初增加人民幣78.02億元，主要是由於存出保證金增加人民幣47.63億元。

截至2022年6月30日，本集團非流動負債總額為人民幣1,027.38億元，較年初減少人民幣93.61億元，主要是由於長期債券下降人民幣81.60億元。

截至2022年6月30日，本集團流動資產總額為人民幣7,376.22億元，較年初增加人民幣348.70億元，主要是由於以攤餘成本計量的債權投資、以公允價值計量且其變動計入其它綜合收益的債務工具、以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產合計數較年初增加人民幣336.43億元。

截至2022年6月30日，本集團流動負債總額為人民幣5,901.92億元，較年初增加人民幣476.76億元，主要是由於應付經紀客戶賬款增加人民幣112.76億元，拆入資金增加人民幣293.21億元。

## 2、截至報告期末主要資產受限情況

截至報告期末，本集團主要受限資產包括現金及銀行結餘、以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產、以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的債務工具、以攤餘成本計量的債權投資、聯營企業權益，合計人民幣151,372,172千元。除上述資產外，本集團不存在主要資產被查封、扣押、凍結或者被抵押、質押、必須具備一定條件才能變現、無法變現、無法用於抵償債務的情況；不存在主要資產佔用、使用、受益和處分權益受到限制的情況和安排。

### 3、資產結構和資產質量

截至2022年6月30日，本集團的股東權益合計為人民幣1,563.93億元，較2021年年末增加人民幣43.57億元，提升2.87%，主要是因為報告期內本集團發行永續次級債的影響。

本集團資產結構持續優化，資產質量和流動性保持良好。截至2022年6月30日，本集團資產總額為人民幣8,493.23億元，較年初增加人民幣426.72億元，增幅為5.29%。其中：本集團現金及銀行結餘、代經紀客戶持有的現金以及結算備付金為人民幣1,950.79億元，佔資產總額的比率為22.97%；融出資金為人民幣1,033.46億元，佔資產總額的比率為12.17%；以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產、以攤餘成本計量的債權投資、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其他綜合收益的權益工具為人民幣4,331.49億元，佔資產總額的比率為51.00%；物業及設備、投資物業、土地使用權和其他無形資產佔資產總額的比率為1.57%，大部分資產的變現能力較強，本集團資產流動性強，資產結構合理。

報告期內，本集團資產負債率水平有所下降。截至2022年6月30日，本集團負債為人民幣6,929.30億元，較年初增加人民幣383.15億元，增幅為5.85%，剔除客戶資金後的資產負債率為77.35%，較年初增長0.42個百分點。

截至2022年6月30日，本集團通過借款及債務融資工具等融資手段融入資金。截至報告期末，本集團融入資金總額為人民幣2,235.54億元，具體明細表列示如下：

單位：千元 幣種：人民幣

|                    | 截至2022年<br>6月30日   |
|--------------------|--------------------|
| 借款及債務融資方案          |                    |
| 向中國證券金融股份有限公司的融入資金 | —                  |
| 向金融同業的拆入資金         | 43,339,686         |
| 短期借款               | 5,668,727          |
| 應付短期融資款            | 48,840,031         |
| 長期借款               | 793,650            |
| 應付債券               | 124,912,141        |
| 合計                 | <u>223,554,235</u> |

融資期限在一年以上的為人民幣1,410.05億元，佔比63.07%，其中一年至兩年為人民幣117.48億元，兩年至五年為人民幣817.58億元，五年以上為人民幣474.99億元。融資期限在一年以下的為人民幣825.49億元，佔比36.93%。

截至2022年6月30日，本集團按固定息率所作借款及債券融資為人民幣2,208.67億元，其中短期借款餘額為人民幣56.69億元，長期借款餘額為人民幣7.94億元，拆入資金餘額為人民幣433.40億元，固定息率收益憑證餘額為人民幣168.95億元，金融債餘額為人民幣61.76億元，公司債餘額為人民幣1,078.16億元，次級債餘額為人民幣143.05億元，境外債餘額為人民幣258.72億元。

截至2022年6月30日，本集團現金及現金等價物為人民幣528.61億元，其中人民幣現金及現金等價物佔74.60%。

截至2022年6月30日，本集團短期銀行借款中包含信用借款餘額為人民幣55.41億元，抵押借款餘額為人民幣1.28億元。

截至2022年6月30日，本集團長期銀行借款均為信用借款。

#### 4、 盈利能力情況分析

2022年上半年，本集團堅定踐行財富管理和機構服務「雙輪驅動」的核心戰略，在科技賦能下不斷提升數字化運營能力，綜合實力穩居行業前列。

#### 5、 報表合併範圍變更的說明

##### (1) 收購導致的合併範圍變更

報告期內，本集團收購上海盛鉅資產經營管理有限公司，納入集團合併範圍。

##### (2) 納入合併範圍結構化主體的增加而導致的合併範圍變更

本集團對作為結構化主體的管理人或投資顧問和／或作為投資人，且綜合評估本集團因持有投資份額而享有的回報以及作為結構化主體管理人的管理人報酬將使本集團面臨可變回報的影響重大的結構化主體進行了合併（主要是資產管理計劃）。本集團本期結構化主體納入合併報表範圍較上年新增16個、減少4個。

## 6、 所得稅政策情況分析

報告期內，公司所得稅執行《中華人民共和國企業所得稅法》和《中華人民共和國企業所得稅法實施條例》。所得稅的計算繳納按照國家稅務總局公告[2012]57號《國家稅務總局關於印發〈跨地區經營匯總納稅企業所得稅徵收管理辦法〉的公告》的通知執行。本公司及本公司的境內子公司適用的所得稅率為25%，本公司享受研究開發費用加計扣除優惠政策，本公司的香港子公司適用的利得稅率為16.5%，本公司的其他境外子公司適用於其所在地當地所規定的所得稅稅率。

## 7、 融資渠道和融資能力等情況分析

### 融資渠道

從融資方式來看，公司的融資渠道有股權融資和債權融資兩種方式。從融資期限來看，公司在境內的短期融資渠道包括通過銀行間市場進行信用拆借，通過銀行間市場和交易所市場進行債券回購，發行短期融資券、短期公司債券，通過機構間私募產品報價與服務系統和自建櫃檯市場發行收益憑證，向證金公司、銀行等金融機構進行轉融資、兩融收益權融資等；中長期融資渠道包括發行公司債券、非公開公司債券、金融債券、次級債券、永續次級債券以及股權再融資等融資方式。同時，公司還可以通過發行境外債券、中期票據，銀團貸款等方式，融入外幣資金，支持公司業務發展。通過多年來卓有成效的努力，公司探索並建立了短、中、長相結合的多元化融資渠道，在公司業務的快速發展過程中發揮關鍵作用。



## 流動性管理政策和措施

公司一貫重視流動性管理，資金管理堅持以「全額集中、統一調配、分類計價、及時監控」的原則，在經營發展戰略上注重業務規模與負債相匹配，通過合理的資產配置和多元化的負債融資，確保資產負債的期限、規模的合理配比，確保公司保持適度流動性。

公司按照集中管理、分層防控的管理模式，遵循全面性、審慎性、預見性的總體原則進行流動性風險管理，依託全面風險管理架構建立流動性風險管理組織體系，建立健全與公司戰略相適應的流動性風險管理體系，貫徹實施偏好為「穩健安全」的流動性風險管理政策，即公司確保不發生對持續經營造成重大影響的流動性風險，全力保障公司各項業務穩健、安全發展。

為確保流動性安全，公司採取的主要措施包括：一是不斷完善資金計劃體系，建立流動性日監控體系，並通過平台實現資金頭寸和現金流量日間監控，確保日間流動性安全；二是加強資產負債期限匹配管理，建立優質流動資產儲備，提高融資的多元化和穩定程度；三是升級改造司庫管理平台，實現通過信息系統對流動性風險實施有效的識別、計量、監測和控制，確保流動性風險可測、可控和可承受；四是分析壓力情景下公司的現金流量和流動性風險監管指標，評估公司的流動性風險承受能力，並對壓力測試結果進行分析，不斷提升公司流動性風險應對能力；五是以併表監管為抓手，持續加強了對子公司流動性風險的輔導力度，並對境外子公司實行資金及流動性風險的垂直管理，對核心風險點提出一攬子管控措施，提高子公司的流動性風險應對能力，提升集團流動性風險防控水平；六是組織流動性風險應急計劃的制定、演練和評估，提升公司的流動性風險應急能力；七是完善流動性風險報告體系，確保管理層及時了解集團流動性風險水平及其管理狀況。

## 融資能力及 融資策略分析

公司經營規範，信譽良好，資本實力、盈利能力和償債能力較強，與商業銀行保持良好的合作關係，有充足的銀行授信額度。截至報告期末，公司獲得商業銀行的授信總額度超過人民幣4,800億元，具備較強的短期和中長期融資能力。截至報告期末，經聯合資信評估股份有限公司評定，本公司主體信用等級為AAA，評級展望為穩定；經上海新世紀資信評估投資服務有限公司綜合評定，本公司主體信用等級為AAA，評級展望為穩定。經標準普爾綜合評定，本公司主體長期評級為BBB+，評級展望為穩定；經穆迪綜合評定，本公司主體長期評級為Baa1，評級展望為穩定。作為上市券商，公司也可以通過股權再融資的方式，解決長期發展的資金需求。

就公司而言，為兼顧流動性和收益性，持有一定金額的固定收益產品，利率變動將對公司持有現金所獲利息收入、所持有債券投資的市場價格及投資收益等帶來直接影響；融資融券等資本中介業務、公司債務融資等與利率直接相關，給相應的利息收入和融資利息支出等帶來直接影響；同時，公司的股票投資也受到利率變動的間接影響。此外，因公司有境外註冊的子公司，以外幣投入資本金，公司持有外幣資金和資產，匯率的變動將對公司財務狀況產生一定影響。

為保持公司資產的流動性並兼顧收益率，公司自有資金由資金運營部統一管理，並配以健全的管理制度和相應的業務流程。公司通過及時調整各類資產結構，優化資產負債配置結構，加強對利率和匯率市場的研究，運用相應的利率、匯率等衍生金融工具來規避風險和減輕上述因素的影響。

## 或有事項及其對公司 財務狀況的影響

### (三) 投資狀況分析

#### 1、對外股權投資總體分析

截至報告期末，本集團對聯營企業的投資為人民幣176.68億元，較期初人民幣182.69億元減少人民幣6.01億元，降幅為3.29%；對合營企業的投資為人民幣18.33億元，較期初人民幣17.49億元增加人民幣0.84億元，增幅為4.80%。本集團對外股權投資總體情況請參閱本報告財務報表附註20「聯營企業權益」及附註21「合營企業權益」。

- (1) 本公司無重大的股權投資
- (2) 本公司無重大的非股權投資
- (3) 以公允價值計量的金融資產

單位：千元 幣種：人民幣

| 項目名稱                         | 上期末<br>餘額   | 本期末<br>餘額   | 報告期<br>投資收益 | 報告期          |
|------------------------------|-------------|-------------|-------------|--------------|
|                              |             |             |             | 公允價值<br>變動金額 |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>其他綜合收益的債務工具 | 9,314,699   | 6,980,719   | (139,444)   | (129,991)    |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>其他綜合收益的權益工具 | 163,138     | 123,778     | -           | (35,494)     |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>當期損益的金融資產   | 355,259,172 | 386,416,455 | (5,911,489) | (5,271,065)  |
| 衍生金融工具                       | 4,604,583   | 11,332,651  | 7,139,552   | 7,270,666    |

## 2、 募集資金使用情況

### (1) 募集資金總體使用情況

#### ① A股募集資金總體使用情況

##### (a) A股首次公開發行股票募集資金使用情況

經中國證監會《關於核准华泰證券股份有限公司首次公開發行股票的批覆》(證監許可[2010]138號)核准，本公司於2010年2月9日向社會公眾公開發行人民幣普通股股票784,561,275股，每股面值人民幣1.00元，每股發行價格人民幣20.00元，共募集資金人民幣15,691,225,500.00元。扣除承銷費和保薦費人民幣130,000,000.00元後的募集資金為人民幣15,561,225,500.00元，上述募集資金於2010年2月12日全部到位，並經江蘇天衡會計師事務所有限公司以「天衡驗字(2010)009號」驗資報告驗證。截至2012年12月31日，公司首發募集資金本金已全部使用完畢，累計使用募集資金人民幣156.81億元(含募集資金利息人民幣11,980.82萬元)，公司募集資金專用賬戶已全部辦理銷戶結息手續。

##### (b) A股非公開發行股票募集資金使用情況

經中國證監會《關於核准华泰證券股份有限公司非公開發行股票的批覆》(證監許可[2018]315號)核准，本公司於2018年7月完成非公開發行人民幣普通股(A股)股票發行，共計發行普通股(A股)股票1,088,731,200股，每股面值人民幣1.00元，每股發行價格人民幣13.05元，共募集資金人民幣14,207,942,160.00元。扣除與本次非公開發行相關的發行費用(包括承銷保薦費、律師費、會計師費、信息披露費、發行登記費、印花稅等費用)人民幣74,736,488.79元後募集資金淨額為人民幣14,133,205,671.21元，上述募集資金已於2018年7月31日全部到位，並經畢馬威華振會計師事務所(特殊普通合夥)以「畢馬威華振驗字第1800286號」驗資報告驗證。截至2019年12月31日，公司非公開發行募集資金已全部使用完畢，累計使用募集資金人民幣141.84億元(含募集資金利息)，募集資金專用賬戶已辦理銷戶手續。

## ② H股募集資金總體使用情況

經中國證監會核准，本公司於2015年完成H股股票發行，H股募集資金已經畢馬威華振會計師事務所(特殊普通合夥)驗證，並出具畢馬威華振驗字第1501031號驗資報告。根據畢馬威華振會計師事務所(特殊普通合夥)出具的《驗資報告》，公司2015年首次公開發行H股共募集資金淨額折合人民幣30,587,689,604.94元(扣除相關上市費用)，扣除承銷發行費用後共募集資金折合人民幣30,015,054,696.76元。截至2020年12月31日，本公司H股募集資金已全部使用完畢，累計使用H股募集資金折合人民幣306.66億元(含募集資金產生的利息收入)，相關賬戶已辦理銷戶手續。

## ③ GDR募集資金總體使用情況

經中國證監會《關於核准华泰證券股份有限公司發行全球存託憑證並在倫敦證券交易所上市的批覆》(證監許可[2018]1993號)核准，本公司於2019年6月完成GDR發行，共計發行82,515,000份GDR，每份GDR發行價格為20.50美元，共募集資金美元1,691,557,500.00元，扣除與本次GDR相關的發行費用美元39,961,513.72元後募集資金淨額為美元1,651,595,986.28元，按照募集資金到賬日人民幣兌美元中間價折算為人民幣11,313,036,931.20元。上述募集資金已於2019年6月28日全部到位，並經畢馬威華振會計師事務所(特殊普通合夥)驗證，出具了畢馬威華振驗字第1900393號驗資報告。截至2021年12月31日，本公司GDR募集資金已全部使用完畢，累計使用GDR募集資金折合人民幣115.87億元(含募集資金產生的利息收入)，相關賬戶已辦理銷戶手續。



## 募集資金總體使用情況

單位：萬元 幣種：人民幣

| 募集年份         | 募集方式      | 募集資金<br>總額   | 本報告期          |                 |                |                   |
|--------------|-----------|--------------|---------------|-----------------|----------------|-------------------|
|              |           |              | 已使用募集<br>資金總額 | 已累計使用<br>募集資金總額 | 尚未使用<br>募集資金總額 | 尚未使用募集<br>資金用途及去向 |
| 2019年        | GDR發行     | 1,131,303.69 | -             | 1,158,666.14    | -              | -                 |
| 2018年        | 非公開發行(A股) | 1,420,794.22 | -             | 1,418,421.26    | -              | -                 |
| 2015年        | 首次發行(H股)  | 3,058,768.96 | -             | 3,066,604.63    | -              | -                 |
| 2010年        | 首次發行(A股)  | 1,556,122.55 | -             | 1,568,103.37    | -              | -                 |
| 合計           | -         | 7,166,989.42 | -             | 7,211,795.40    | -              | -                 |
| 募集資金總體使用情況說明 |           | -            |               |                 |                |                   |

(2) 報告期內，本公司不存在募集資金承諾項目情況

(3) 報告期內，本公司不存在募集資金變更項目情況

### 3、非募集資金項目情況

報告期內，公司不存在項目投資總額超過上年度末經審計淨資產10%的非募集資金投資項目。

### 4、報告期內，本公司不存在重大資產和股權出售情況

### 5、報告期內，本公司不存在破產重整，兼併或分立，重大的資產處置、收購、置換、剝離，重組其他公司情況等

## 6、主要控股參股公司分析

單位：萬元 幣種：人民幣

| 名稱   | 公司   | 持股比例                    | 地址         | 設立時間       | 註冊資本         | 總資產          | 淨資產        | 營業收入       | 利潤總額       | 淨利潤 |
|--|------|-------------------------|------------|------------|--------------|--------------|------------|------------|------------|-----|
| 華泰證券(上海)資產管理有限公司   | 100% | 中國(上海)自由貿易試驗區基隆路6號1222室 | 2014/10/16 | 260,000.00 | 1,122,651.12 | 1,010,537.27 | 92,792.42  | 73,142.08  | 55,606.62  |     |
| 主營業務：證券資產管理業務，公開募集證券投資基金管理業務。(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)。                                     |      |                         |            |            |              |              |            |            |            |     |
| 華泰國際金融控股有限公司   | 100% | 中國香港皇后大道中99號中環中心62樓     | 2017/4/5   | 港幣         | 港幣           | 港幣           | 港幣         | 港幣         | 港幣         | 港幣  |
| 主營業務：控股公司。   |      |                         |            |            |              |              |            |            |            |     |
| 華泰紫金投資有限責任公司   | 100% | 中國江蘇省南京市漢中路180號         | 2008/8/12  | 600,000.00 | 1,542,377.70 | 1,110,299.89 | -46,711.52 | -54,141.15 | -39,337.53 |     |
| 主營業務：股權投資，債權投資，投資於與股權投資、債權投資相關的其他投資基金；股權投資、債權投資的投資顧問、投資管理，財務顧問服務。(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)。 |      |                         |            |            |              |              |            |            |            |     |

| 名稱           | 持股比例   | 地址   | 設立時間       | 註冊資本       | 總資產          | 淨資產        | 營業收入       | 利潤總額       | 淨利潤        |
|--------------|--------|--|------------|------------|--------------|------------|------------|------------|------------|
| 華泰創新投資有限公司   | 100%   | 中國北京市西城區豐盛胡同28號樓<br>7層701-8至701-11   | 2013/11/21 | 350,000.00 | 436,296.79   | 366,935.89 | -15,273.10 | -22,547.52 | -16,586.02 |
|              |        | 主營業務：項目投資；投資管理；銷售貴金屬；酒店管理；以下限分支機構經營：住宿；餐飲服務；銷售食品；健身服務；游泳池；洗衣代收；打字、複印；機動車公共停車場服務；會議服務；承辦展覽展示；旅遊信息諮詢；票務代理服务。(1、未經有關部門批准，不得以公開方式募集資金；2、不得公開開展證券類產品和金融衍生品交易活動；3、不得發放貸款；4、不得對所投資企業以外的其他企業提供擔保；不得向投資者承諾投資本金不受損失或者承諾最低收益；企業依法自主選擇經營項目，開展經營活動；依法須經批准的項目，經相關部門批准後依批准的內容開展經營活動；不得從事本市產業政策禁止和限制類項目的經營活動)。 |            |            |              |            |            |            |            |
| 華泰聯合證券有限公司   | 99.92% | 中國深圳市前海深港合作區南山街道桂灣五路128號前海深港基金小鎮B7棟401   | 1997/9/5   | 99,748.00  | 790,995.02   | 521,882.62 | 161,788.47 | 43,613.56  | 32,568.77  |
|              |        | 主營業務：證券承銷與保薦業務(國債、非金融企業債務融資工具、金融債券承銷業務除外)；與證券交易、證券投資活動有關的財務顧問；中國證監會批准的其他業務。  |            |            |              |            |            |            |            |
| 華泰期貨有限公司     | 60%    | 中國廣州市南沙區橫瀝鎮明珠三街1號<br>10層1001-1004、1011-1016房   | 1995/7/10  | 293,900.00 | 5,691,063.29 | 351,967.01 | 262,300.03 | 23,848.65  | 17,648.12  |
|              |        | 主營業務：商品期貨經紀、金融期貨經紀、期貨投資諮詢、資產管理、基金銷售。(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)。  |            |            |              |            |            |            |            |
| 江蘇股權交易中心有限公司 | 52%    | 中國江蘇省南京市建邺區江東中路377號<br>金融城10號樓3層   | 2013/7/4   | 20,000.00  | 49,482.55    | 41,429.75  | 3,544.55   | 1,272.32   | 951.05     |
|              |        | 主營業務：為非上市公司股權、債券、資產和相關金融及其衍生品的批准募集掛牌、登記、託管、交易、融資、結算、過戶、分紅、質押等提供場所、設施和服務，組織和監督交易市場活動，發佈市場信息，代理本交易市場內掛牌產品買賣服務，為市場參與方提供諮詢服務。(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)。   |            |            |              |            |            |            |            |

| 公司 |              | 名稱     | 持股比例                                    | 地址         | 設立時間         | 註冊資本           | 總資產           | 淨資產          | 營業收入         | 利潤總額         | 淨利潤 |
|----|--------------|--------|---|------------|--------------|----------------|---------------|--------------|--------------|--------------|-----|
|    | 南方基金管理股份有限公司 | 41.16% | 中國深圳市福田區蓮花街道益田路5999號<br>基金大廈32-42樓      | 1998/3/6   | 36,172.00    | 1,350,112.39   | 863,845.83    | 327,344.85   | 114,252.34   | 88,641.22    |     |
|    | 華泰柏瑞基金管理有限公司 | 49%    | 中國(上海)自由貿易試驗區民生路1199弄<br>上海證大五道口廣場1號17層 | 2004/11/18 | 20,000.00    | 250,730.86     | 145,516.04    | 68,094.86    | 25,803.35    | 19,599.22    |     |
|    | 江蘇銀行股份有限公司   | 5.63%  | 中國江蘇省南京市中華路26號                          | 2007/1/22  | 1,154,445.00 | 287,058,713.10 | 20,581,398.10 | 3,510,735.20 | 1,721,445.70 | 1,384,923.30 |     |

主營業務：基金募集、基金銷售、資產管理和國務院證券監督管理機構許可的其他業務。

主營業務：基金募集、基金銷售、資產管理和中國證監會許可的其他業務。

主營業務：吸收公眾存款；發放短期、中期和長期貸款；辦理國內結算；辦理票據承兌與貼現；發行金融債券；代理發行、代理兌付、承銷政府債券、承銷短期融資券；買賣政府債券、金融債券、企業債券；從事同業拆借；提供信用證服務及擔保；代理收付款項及代理保險業務、代客理財、代理銷售基金、代理銷售貴金屬、代理收付和保管集合資金信託計劃；提供保險箱業務；辦理委託存款業務；從事銀行卡業務；外匯存款；外匯貸款；外匯匯款；外幣兌換；結售匯、代理遠期結售匯；國際結算；自營及代客外匯買賣；同業外匯拆借；買賣或代理買賣股票以外的外幣有價證券；資信調查、諮詢，見證業務；網上銀行；經銀行業監督管理機構和有關部門批准的其他業務。（依法須經批准的項目，經相關部門批准後方可開展經營活動）。

註：2022年7月，華泰期貨完成股權變更事項的工商變更登記等手續，公司受讓華泰期貨另一股東華麗家族股份有限公司持有的華泰期貨40%股權。目前，公司持有華泰期貨股權比例已變更為100%。

## 7、 報告期內取得和處置子公司的情況

報告期內取得和處置子公司的情況請參閱本報告「重要事項」「其他重大事項的說明」「控股參股公司重大事項說明」。

## 8、 公司控制的結構化主體情況

本集團合併的結構化主體主要是指本集團同時作為管理人或投資顧問及投資者的資產管理計劃。本集團綜合評估本集團因持有的份額而享有的回報以及作為資產管理計劃管理人或投資顧問的報酬是否將使本集團面臨可變回報的影響重大，並據此判斷本集團是否為資產管理計劃的主要責任人。於2022年6月30日，本集團共合併46個結構化主體，合併結構化主體的總資產為人民幣47,273,913,142.02元。本集團在上述合併結構化主體中的持有的權益體現在資產負債表中交易性金融資產的金額為人民幣41,454,615,578.20元。

## 六、 可能面對的風險及風險防範措施

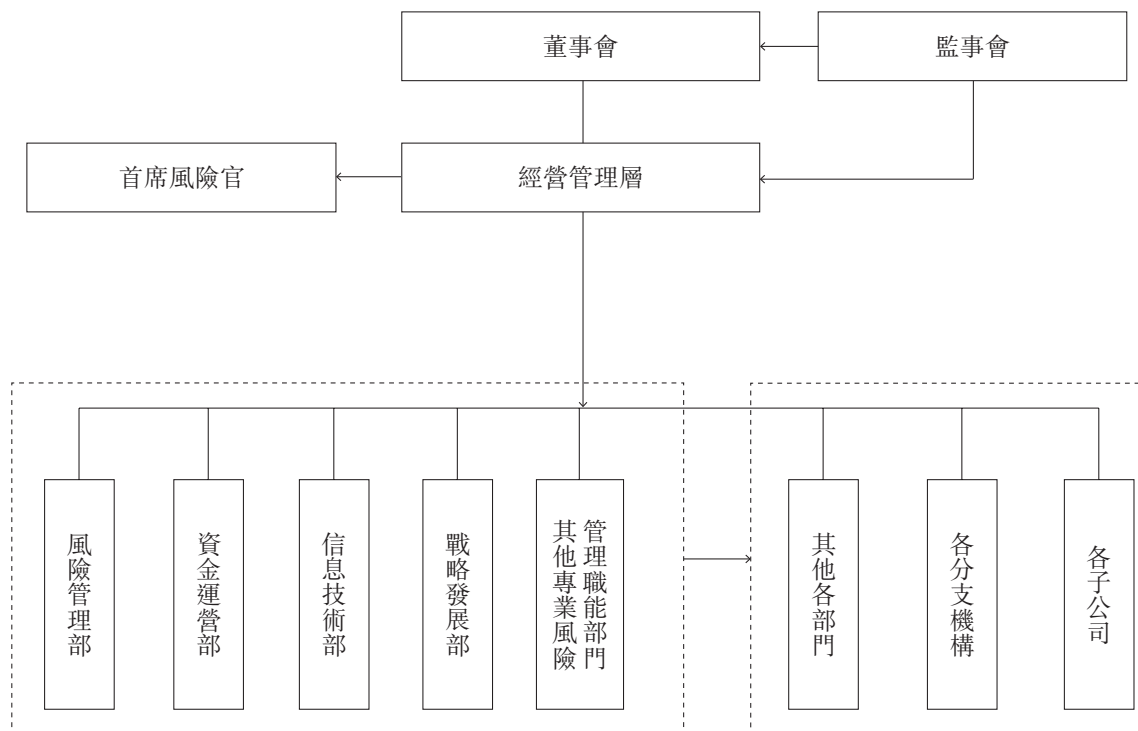
### 1、 風險管理概況

公司高度重視風險管理工作，根據監管要求及業務發展實際情況，以全員、覆蓋、穿透為核心理念，建立了較為完善的全面風險管理體系。公司風險管理組織架構健全有效、職責定位清晰，各層級有效履職；公司制定了風險偏好和容忍度體系，與公司發展戰略有機結合，建立了多層級完備的風險管理制度體系，覆蓋業務經營及管理的各環節；公司大力推進集團化風險管理技術系統的建設，構建集中、時效、量化、穿透的風險管理技術支柱，提升集團風險管理效果，進一步增強集團總體風險識別、量化評估和控制的能力。公司將各子公司納入集團全面風險管理體系，探索構建有效的子公司風險管理模式，大力深化專業風險條線集中統一穿透管理。公司全面風險管理體系運行有效，切實保障了公司各項業務的持續健康發展。

報告期內，公司以深入穿透業務風險管控、夯實跨境一體化風險管理體系、打造風險管理數字化為重心，全面推進各項風險管理工作。公司進一步加強重點業務和領域的風險評估與管控，打造深入業務實質和全生命週期的風險管理能力。公司進一步深入境外子公司穿透風險管控，夯實跨境一體化的風險管理體系建設，為集團國際化提供堅實保障。公司堅持科技賦能，深化集團多維度風險態勢感知，打通管控流程聯動，不斷提升風險管控能力及效率。



## 2、 風險管理架構



公司風險管理組織架構包括五個主要部分：董事會及合規與風險管理委員會，監事會，經營管理層及風險控制委員會，風險管理部及各類專業風險管理部門，其他各部門、分支機構及子公司。

公司董事會承擔公司全面風險管理的最終責任，負責審議批准公司全面風險管理的基本制度，批准公司的風險偏好、風險容忍度及重大風險限額，審議公司定期風險評估報告等。公司董事會設合規與風險管理委員會，對風險管理的總體目標、基本政策進行審議並提出意見；對需董事會審議的重大決策的風險和重大風險的解決方案進行評估並提出意見；對需董事會審議的風險評估報告進行審議並提出意見等。

公司監事會承擔全面風險管理的監督責任，負責監督檢查董事會和經營管理層在風險管理方面的履職盡責情況並督促整改。公司經營管理層根據董事會的授權和批准，結合公司經營目標，具體負責實施風險管理工作，公司經營管理層對全面風險管理承擔主要責任。公司經營管理層下設風險控制委員會，根據經營管理層授權負責經營過程中風險管理事項的決策，並對各業務條線進行風險承擔的授權。公司設首席風險官，負責分管領導公司全面風險管理工作。

公司指定風險管理部履行全面風險管理職責，並牽頭管理公司的市場風險、信用風險和操作風險；指定資金運營部負責牽頭管理公司的流動性風險；指定信息技術部負責牽頭管理公司的信息技術風險；指定戰略發展部負責牽頭管理公司的聲譽風險。公司其他各部門、分支機構及子公司對各自線條的各類風險管理工作負責，負責落實公司及各類專業風險牽頭管理部門制定的各項政策、流程和措施，接受各類風險牽頭管理部門的指導以及對各類風險管理、執行責任的分解。稽查部將全面風險管理納入審計範疇，對全面風險管理的充分性和有效性進行獨立、客觀的審查和評價，並負責牽頭或委託外部專業機構定期對公司全面風險管理體系進行評估。

### 3、市場風險

市場風險是指由於股價、利率、匯率、商品等風險因子波動導致公司資產損失的風險。

報告期內，新冠疫情的持續疊加俄烏衝突對全球大宗商品、供應鏈造成嚴重影響，全球資本市場動盪，公司堅持交易創造價值、對沖控制風險的理念，積極控制風險敞口，通過各項風險管控措施管理持倉資產的市場風險。公司建立統一的風險限額體系，從市場風險價值(VAR)、止損、壓力測試、敏感性等多個維度對各業務進行管控。公司持續完善壓力測試體系，定期計量評估各類極端風險影響。權益類證券投資方面，公司主動通過多種對沖方式管理風險敞口，規避市場大幅波動，同時在控制投資組合下行風險的前提下，積極發掘交易機會，並注重投資標的的市場流動性及持倉資產的高度分散化。固定收益類證券投資方面，公司通過利率衍生品有效對沖市場風險，調整持倉結構以應對期限結構上利率波動對投資組合帶來的衝擊，在控制整體久期、基點價值及VaR值的基礎上，積極尋找定價偏差機會以增厚整體收益。衍生品業務方面，公司的場外衍生品業務採取市場中性的策略，將Delta、Gamma、Vega等希臘值敞口風險控制在可承受範圍內，在風險可控的前提下創造盈利機會。

## 市場風險價值(VAR)情況

幣種：人民幣

前瞻期：1日，置信度95%，歷史模擬法，單位(萬元)

|           | 本公司          |              | 本集團          |              |
|-----------|--------------|--------------|--------------|--------------|
|           | 2022年<br>中期末 | 2021年<br>中期末 | 2022年<br>中期末 | 2021年<br>中期末 |
| 權益敏感性金融工具 | 8,637        | 7,325        | 15,251       | 15,949       |
| 利率敏感性金融工具 | 3,998        | 3,518        | 4,300        | 4,749        |
| 商品敏感性金融工具 | 282          | 42           | 396          | 179          |
| 整體組合風險價值  | 9,308        | 7,743        | 15,994       | 16,465       |

數據來源：公司內部統計。

## 報告期內，市場風險價值(VAR)序列描述性統計量情況

幣種：人民幣

前瞻期：1日，置信度95%，歷史模擬法，單位(萬元)

|     | 期初     | 期末     | 最大值    | 最小值    |
|-----|--------|--------|--------|--------|
| 本集團 | 26,175 | 15,994 | 29,504 | 12,852 |
| 本公司 | 15,803 | 9,308  | 25,146 | 7,361  |

數據來源：公司內部統計。

## 4、信用風險

信用風險是指由於產品或債券發行人違約、交易對手(客戶)違約導致公司資產受損失的風險。

融資類業務方面，公司執行嚴格的風險客戶與風險資產持續監控、及時化解的管理及動態的逆週期調節機制，以控制業務風險、調節業務結構，報告期內在市場震盪行情中，公司融資融券與股票質押業務風險未受到顯著影響。債券投資類業務方面，公司加大對城投地產信用債投資的風險管控，強化了持倉債券監控預警，持續推動風險債券處置工作，鞏固了信用債投資條線信用風險防控機制。交易對手管理方面，報告期內公司進一步推進交易對手統一管理體系及管理系統優化建設，並根據內外部輿情進一步加強交易對手授信管理，嚴控尾部風險。擔保交收類業務方面，持續完善風險指標設計的前端管控並推進系統化建設，強化風險事件處理和風險傳導的管控能力。同時，公司持續推進鞏固信用風險統一管理體系，提升應對外部複雜信用環境的能力，為各類信用業務發展提供強有力的風控保障。

## 5、流動性風險

流動性風險是指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。

公司一貫重視流動性安全，並秉持「穩健安全」的流動性風險偏好，遵循全面性、重要性、適用性、有效性、審慎性和預見性的總體原則，按照集中管理、分層防控的管理模式，持續強化流動性風險的識別、計量、監測和控制機制，提升公司流動性風險管理水平。在掌控整體流動性風險的基礎上，公司通過定期的存量流動性風險梳理和不定期的新業務評估，識別各條業務線潛在的流動性風險，並提出針對性的管控措施。公司搭建了包括現金流在內的流動性指標分析框架，並適當設置風險限額，通過信息技術系統實施每日監控，提升流動性風險的監控頻率和控制水平。同時，公司不斷完善資金計劃體系，強化資金頭寸管理和建立流動性日間監控體系，及時掌握業務用款情況及日間支付進度，進一步將流動性風險防控的陣線前移。公司定期和不定期開展流動性風險專項壓力測試，從現金流量和流動性指標角度評估公司在壓力情境下的流動性風險承受能力，並針對性改進和提升公司流動性風險抗壓能力。為確保在壓力情景下能夠及時滿足流動性需求，公司根據風險偏好建立規模適當的優質流動性資產儲備，同時，多角度拓寬負債融資渠道和額度，以及持續提升公司的應急融資能力。此外，公司以併表監管試點為抓手持續加強對子公司流動性風險管理的輔導力度，尤其是對香港子公司進行垂直管理，加大對其流動性的管理力度，提高子公司的流動性風險應對能力，提升集團整體流動性風險防控水平。報告期內，公司流動性覆蓋率(LCR)和淨穩定資金率(NSFR)持續滿足監管要求，並保有足夠的安全空間。

## 6、操作風險

操作風險是指由不完善或有問題的內部程序、人員、系統或外部事件所造成公司損失的風險。

公司持續推動操作風險識別、評估、監測、應對及報告全流程的有效運作。報告期內，公司以高剩餘風險領域飛行測試為抓手，聚焦重點操作風險領域持續開展深入梳理，提升控制的完整有效性及可靠性並推動管控措施的不斷優化；優化新業務風險管理機制，進一步強化對新業務的操作風險評估深度，加強對新業務流程執行情況的質量控制及新業務後續跟蹤評估機制的落實；開展新冠肺炎疫情應急預案回溯梳理，組織完善應急預案和關鍵資源優化配置。

## 7、合規風險

合規風險是指因證券公司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公司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。

報告期內，公司持續完善合規管理體系，優化合規管理機制，從制度、理念、方式等維度不斷優化。持續推進數字合規建設，強化合規人員能力建設和合規協同；持續完善業務合規管理機制，通過審查評估、監測檢查、培訓宣導等方式加大對重點業務的管控和支持力度；持續鍛造全員合規理念，寓合規管理於服務宣導之中，增進業務部門與合規部門的合規理念共識及合規價值認同，通過合規文化建設增強合規內生動力。



## 8、 信息技術風險

信息技術風險是指公司信息系統因內、外部原因發生技術故障或數據洩露，導致系統在業務實現、響應速度、處理能力、數據安全等方面不能持續保障交易與業務管理穩定、高效、安全運行，從而造成損失的風險。

公司各項業務及中後台管理均高度依賴於信息技術系統，信息系統已成為支撐公司業務運轉的關鍵保障。報告期內，公司持續加大信息科技投入，不斷完善信息技術風險管理制度與流程，加強信息技術風險排查與治理，不斷完善風險控制措施，風險管理成效進一步提升。公司制定信息系統應急技術預案，制定網絡安全事件應急處置流程，定期或不定期開展應急預案評估與應急演練。報告期內，公司信息系統平穩安全運行，未發生重大信息技術風險事件。

## 9、 聲譽風險

聲譽風險主要是指公司經營、管理及其他行為或外部事件等導致有關媒體對公司形成負面評價，從而不利公司正常經營的風險。

報告期內，公司聲譽風險管理機制運行平穩，未發生重大聲譽風險事件。公司圍繞戰略和重點業務，持續加強聲譽風險的防範、監測和處置工作，為公司發展營造平穩的媒體環境。同時，持續強化集團化管理、事前管理和內部宣導，進一步提升聲譽風險防範意識和應對能力。

## 10、 模型風險

模型風險是指錯誤或不適當的模型設計、開發或使用對公司業務造成不良後果或損失的風險。

報告期內，公司針對模型的全生命週期，進行全面和主動管理，通過模型驗證、評估和事中監測等方法與措施，推進模型風險管理。公司不斷建立健全與自身業務發展相適應的模型風險管理體系，完善管理制度和組織架構，完善模型信息數據庫功能。

## 公司治理

### 一、股東大會、董事會、監事會會議情況簡介

#### 1、報告期內召開的股東大會有關情況

| 會議屆次           | 召開日期           | 會議議案   | 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      |
|----------------|----------------|--|--|----------------|-----------|
| 2021年度<br>股東大會 | 2022年<br>6月22日 | 1、審議關於修訂《华泰證券股份有限公司章程》的議案；<br>2、審議關於公司回購註銷部分A股限制性股票的議案；<br>3、審議公司2021年度董事會工作報告；<br>4、審議公司2021年度監事會工作報告；<br>5、審議公司2021年度財務決算報告；<br>6、審議關於公司2021年度報告的議案；<br>7、審議關於公司2021年度利潤分配的議案；<br>8、審議關於預計公司2022年日常關聯交易的議案；<br>9、審議關於預計公司2022年自營投資額度的議案；<br>10、審議關於變更會計師事務所的議案；<br>11、審議關於選舉公司第五屆董事會成員（獨立董事）的議案；<br>12、審議公司獨立董事2021年度履職報告；<br>13、審議關於選舉公司第五屆董事會成員（非獨立董事）的議案； | <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a><br><a href="http://www.hkexnews.hk">http://www.hkexnews.hk</a><br><a href="http://www.londonstockexchange.com">http://www.londonstockexchange.com</a><br><a href="http://www.htsc.com.cn">http://www.htsc.com.cn</a> | 2022年<br>6月23日 | 所有議案均審議通過 |

| 會議屆次                    | 召開日期           | 會議議案  | 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   |
|-------------------------|----------------|---|--|----------------|--------|
|                         |                | 14、聽取關於公司董事2021年度績效考核和薪酬情況的報告；<br>15、聽取關於公司監事2021年度績效考核和薪酬情況的報告；<br>16、聽取關於公司高級管理人員2021年度履行職責、績效考核和薪酬情況的報告。 |  |                |        |
| 2022年第一次<br>A股類別<br>股東會 | 2022年<br>6月22日 | 審議關於公司回購註銷部分A股限制性股票的議案。   | <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a><br><a href="http://www.hkexnews.hk">http://www.hkexnews.hk</a><br><a href="http://www.londonstockexchange.com">http://www.londonstockexchange.com</a><br><a href="http://www.htsc.com.cn">http://www.htsc.com.cn</a> | 2022年<br>6月23日 | 議案審議通過 |
| 2022年第一次<br>H股類別<br>股東會 | 2022年<br>6月22日 | 審議關於公司回購註銷部分A股限制性股票的議案。   | <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a><br><a href="http://www.hkexnews.hk">http://www.hkexnews.hk</a><br><a href="http://www.londonstockexchange.com">http://www.londonstockexchange.com</a><br><a href="http://www.htsc.com.cn">http://www.htsc.com.cn</a> | 2022年<br>6月23日 | 議案審議通過 |

## 2、報告期內召開的董事會有關情況

| 會議屆次              | 召開日期           | 會議形式及地點   | 會議議案  | 會議決議          |
|-------------------|----------------|---|---|---------------|
| 第五屆董事會<br>第二十一次會議 | 2022年<br>3月30日 | 現場及視頻會議方式。<br>地點：南京市江東中路228號華泰證券廣場一號樓十二樓大會議室、北京市西城區豐盛胡同28號太平洋保險大廈A座18層第六會議室、上海市浦東新區東方路18號保利大廈25層華泰證券上海分公司仿真會議室、深圳市益田路5999號基金大廈42樓華泰證券深圳分公司仿真會議室、香港皇后大道中99號中環中心62樓華泰金融控股（香港）有限公司仿真視頻倫敦會議室。 | <ol style="list-style-type: none"> <li>1、審議公司2021年度經營管理層工作報告；</li> <li>2、審議公司2021年度財務決算報告；</li> <li>3、審議公司2022年度財務預算報告；</li> <li>4、審議關於公司回購註銷部分A股限制性股票的議案；</li> <li>5、審議關於公司2021年度利潤分配的預案；</li> <li>6、審議公司2021年度董事會工作報告；</li> <li>7、審議關於公司2021年度報告的議案；</li> <li>8、審議關於公司2021年度合規報告的議案；</li> <li>9、審議關於公司2021年度風險管理報告的議案；</li> <li>10、審議關於公司2021年度內部控制評價報告的議案；</li> <li>11、審議關於公司2021年度信息技術管理專項報告的議案；</li> <li>12、審議關於公司2021年度社會責任報告的議案；</li> <li>13、審議關於預計公司2022年日常關聯交易的預案；</li> <li>14、審議關於預計公司2022年自營投資額度的預案；</li> <li>15、審議公司2022年度內部審計工作計劃；</li> <li>16、審議關於變更會計師事務所的議案；</li> <li>17、審議關於選舉公司第五屆董事會成員（非獨立董事）的預案；</li> <li>18、審議關於選舉公司第五屆董事會成員（獨立董事）的預案；</li> <li>19、審議關於修訂《華泰證券股份有限公司章程》的議案；</li> <li>20、審議關於總部組織架構及相關部門職責調整的議案；</li> </ol> | 所有議案均<br>審議通過 |

| 會議屆次              | 召開日期           | 會議形式及地點   | 會議議案   | 會議決議   |
|-------------------|----------------|---|--|--------|
|                   |                |   | 21、審議關於公司董事2021年度績效考核和薪酬情況的報告；<br>22、審議關於公司高級管理人員2021年度履行職責、績效考核和薪酬情況的報告；<br>23、審議公司獨立董事2021年度履職報告；<br>24、審議關於召開公司2021年度股東大會、2022年第一次A股類別股東大會及2022年第一次H股類別股東大會的議案；<br>25、聽取公司董事會審計委員會2021年度履職情況報告；<br>26、聽取公司2021年度合規總監工作報告；<br>27、聽取公司2021年度反洗錢工作報告；<br>28、聽取關於公司2021年度內部審計工作情況的報告；<br>29、審閱公司洗錢風險自評估報告；<br>30、審查關於公司2021年度淨資本等風險控制指標具體情況的報告。 |        |
| 第五屆董事會<br>第二十二次會議 | 2022年<br>4月8日  | 通訊方式  | 審議關於聘任韓臻聰先生為公司執行委員會委員、首席信息官的議案。  | 議案審議通過 |
| 第五屆董事會<br>第二十三次會議 | 2022年<br>4月29日 | 現場及視頻會議方式。<br>地點：南京市江東中路228號華泰證券廣場一號樓十二樓大會議室、北京市西城區豐盛胡同28號太平洋保險大廈A座18層第六會議室、上海市浦東新區東方路18號保利大廈25層華泰證券上海分公司仿真會議室、深圳市益田路5999號基金大廈42樓華泰證券深圳分公司仿真會議室、香港皇后大道中99號中環中心62樓華泰金融控股(香港)有限公司仿真視頻倫敦會議室。 | 審議關於公司2022年第一季度報告的議案。  | 議案審議通過 |

| 會議屆次              | 召開日期           | 會議形式及地點 | 會議議案  | 會議決議      |
|-------------------|----------------|---------|---|-----------|
| 第五屆董事會<br>第二十四次會議 | 2022年<br>5月31日 | 通訊方式    | 審議關於調增華泰證券研發及培訓中心項目投資金額的議案。   | 議案審議通過    |
| 第五屆董事會<br>第二十五次會議 | 2022年<br>6月22日 | 通訊方式    | <ol style="list-style-type: none"> <li>1、審議關於公司申請開展科創板股票做市交易業務的議案；</li> <li>2、審議關於修訂《華泰證券股份有限公司反洗錢和反恐怖融資基本制度》的議案；</li> <li>3、審議關於終止公司為全資子公司華泰證券(上海)資產管理有限公司提供的淨資本擔保承諾的議案；</li> <li>4、審議關於調整公司第五屆董事會部分專門委員會組成方案的議案。</li> </ol> | 所有議案均審議通過 |

### 3、報告期內召開的監事會有關情況

| 會議屆次             | 召開日期           | 會議形式及地點                               | 會議議案  | 會議決議      |
|------------------|----------------|---------------------------------------|---|-----------|
| 第五屆監事會<br>第十二次會議 | 2022年<br>3月30日 | 現場方式。<br>南京市江東中路228號華泰證券廣場一號樓十二樓小會議室。 | <ol style="list-style-type: none"> <li>1、審議公司2021年度監事會工作報告；</li> <li>2、審議關於公司回購註銷部分A股限制性股票的議案；</li> <li>3、審議關於公司2021年度利潤分配的預案；</li> <li>4、審議關於公司2021年度報告的議案；</li> <li>5、審議關於公司2021年度內部控制評價報告的議案；</li> <li>6、審議關於公司監事2021年度績效考核和薪酬情況的報告；</li> <li>7、聽取關於公司2021年度內部審計工作情況的報告；</li> <li>8、聽取公司2022年度內部審計工作計劃。</li> </ol> | 所有議案均審議通過 |
| 第五屆監事會<br>第十三次會議 | 2022年<br>4月29日 | 現場方式。<br>南京市江東中路228號華泰證券廣場一號樓十二樓小會議室。 | 審議關於公司2022年第一季度報告的議案。   | 議案審議通過    |



## 二、董事會審計委員會及審計事項

公司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聯交所《證券上市規則》的規定。公司第五屆董事會審計委員會由獨立董事與股東單位派駐的董事組成。截至報告期末，公司審計委員會共3人，獨立董事佔多數，成員包括陳志斌先生、丁鋒先生、區璟智女士，其中陳志斌先生為審計委員會主任委員（召集人）。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。

報告期內，公司董事會審計委員會共召開了4次會議。具體情況如下：

- 1、公司第五屆董事會審計委員會2022年第一次會議於2022年1月18日以現場及視頻會議方式召開，會議聽取了畢馬威華振會計師事務所（特殊普通合伙）相關人員關於2021年審計工作進度安排、年審審計重點、預審工作情況的匯報等。
- 2、公司第五屆董事會審計委員會2022年第二次會議於2022年2月25日以通訊方式召開，會議審議通過了《關於公司2021年度審計計劃的議案》。
- 3、公司第五屆董事會審計委員會2022年第三次會議於2022年3月29日以現場及視頻會議方式召開，會議審議通過了《公司2021年度財務決算報告》《公司2022年度財務預算報告》《關於公司2021年度利潤分配的預案》《關於公司2021年度財務報表的議案》《關於公司2021年度報告的預案》《關於公司2021年度內部控制評價報告的議案》《關於預計公司2022年日常關聯交易的預案》《關於變更會計師事務所的預案》《公司董事會審計委員會2021年度履職情況報告》《公司2021年度關聯交易專項審計報告》《公司2022年度內部審計工作計劃》，審閱了公司2021年度審計報告「關鍵審計事項」等涉及的重要事項，並聽取了《關於公司2021年度內部審計工作情況的報告》。
- 4、公司第五屆董事會審計委員會2022年第四次會議於2022年4月28日以通訊方式召開，會議審議通過了《關於公司2022年1-3月份財務報表的議案》。

本公司按照國際財務報告準則編製的2022年中期財務報告已經德勤•關黃陳方會計師行根據國際審閱準則審閱。於2022年8月29日，審計委員會已審閱並確認本集團截至2022年6月30日止六個月的中期業績公告、2022年中期報告以及按照《國際會計準則》第34號《中期財務報告》的規定編製的截至2022年6月30日止六個月的未經審核中期財務報表。

### 三、公司董事、監事、高級管理人員變動情況

| 姓名  | 擔任的職務         | 變動情形 |
|-----|---------------|------|
| 韓臻聰 | 執行委員會委員、首席信息官 | 聘任   |
| 陳仲揚 | 非執行董事         | 選舉   |
| 尹立鴻 | 執行董事          | 選舉   |
| 王全勝 | 獨立非執行董事       | 選舉   |
| 陳泳冰 | 非執行董事         | 離任   |
| 汪濤  | 非執行董事         | 離任   |
| 朱學博 | 執行董事          | 離任   |
| 陳傳明 | 獨立非執行董事       | 離任   |

#### 公司董事、監事、高級管理人員變動的情況說明

2022年4月8日，經公司第五屆董事會第二十二次會議審議通過，聘任韓臻聰先生為公司執行委員會委員、首席信息官。

2022年4月14日，公司董事會收到非執行董事汪濤先生的書面辭職報告。因工作原因，汪濤先生提請辭去公司第五屆董事會非執行董事以及董事會發展戰略委員會委員之職務，辭職後不再擔任公司任何職務。汪濤先生與公司董事會之間並無意見分歧，亦無與其辭任有關的事項需要公司股東垂注。汪濤先生亦確認其並無任何針對公司正在發生或將要發生的訴訟和爭議。2022年6月22日，公司2021年年度股東大會審議通過了《關於選舉公司第五屆董事會成員（獨立董事）的議案》及《關於選舉公司第五屆董事會成員（非獨立董事）的議案》，分別選舉王全勝先生為公司第五屆董事會獨立非執行董事，陳仲揚先生為第五屆董事會非執行董事，尹立鴻女士為第五屆董事會執行董事。自2022年6月22日起，王全勝先生接替陳傳明先生履行公司第五屆董事會獨立非執行董事職責，陳仲揚先生接替陳泳冰先生履行公司第五屆董事會非執行董事職責，尹立鴻女士接替朱學博先生履行公司第五屆董事會執行董事職責，任期均至本屆董事會任期結束。根據公司章程，王全勝先生、陳仲揚先生及尹立鴻女士於任期屆滿後，可獲選連任。

除上述所披露外，報告期內，本公司未發生新聘或解聘董事、監事及高級管理人員情況。同時，根據上市規則第13.51(2)條須予披露有關董事、監事及最高行政人員之任何資料並無變動。

### 四、利潤分配或資本公積金轉增預案

#### 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 |
| 每10股送紅股數(股)    | — |
| 每10股派息數(元)(含稅) | — |
| 每10股轉增數(股)     | — |

利潤分配或資本公積金轉增預案的相關情況說明

公司董事會在審議半年度報告時，未擬定利潤分配預案、資本公積金轉增股本預案。

## 五、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

### (一) 相關股權激勵事項已在臨時公告披露且後續實施無進展或變化的

#### 事項概述

#### 查詢索引

2022年3月30日，公司第五屆董事會第二十一次會議及第五屆監事會第十二次會議分別審議通過了《關於公司回購註銷部分A股限制性股票的議案》，公司將回購並註銷授予的激勵對象中不再具備激勵對象資格的22人所持有的已獲授但尚未解除限售的A股限制性股票，共計1,060,973股，回購價格為人民幣8.70元/股，回購資金總額為人民幣9,230,465.10元。

公告編號：  
臨2022-013

2022年6月22日，公司2021年年度股東大會、2022年第一次A股類別股東會及2022年第一次H股類別股東會審議並通過了《關於公司回購註銷部分A股限制性股票的議案》，同意公司回購註銷上述1,060,973股A股限制性股票。

公告編號：  
臨2022-034

截至本公告日期，公司尚未完成上述1,060,973股A股限制性股票的購回及註銷。

### (二) 臨時公告未披露或有後續進展的激勵情況

#### 其他激勵措施

本集團控股公司AssetMark採用的員工激勵措施請參見本報告「財務報表附註56(b)」及「海外子公司股份支付」。

## 六、員工及薪酬政策

### (一) 薪酬政策

公司貫徹穩健經營理念，將薪酬管理與風險管理緊密結合，注重合規底線要求，充分考慮市場週期波動影響、行業特徵及公司業務發展趨勢，將「合規、誠信、專業、穩健」的文化理念融入薪酬管理，建立著眼長期發展薪酬激勵機制，促進公司和行業高質量可持續發展。

公司注重薪酬激勵的外部競爭性和內部公平性，實行以市場水平為定薪依據、以業績考核結果為分配導向、與合規風險管理匹配銜接的薪酬激勵分配體系。公司薪酬由基本薪酬、績效獎金、股權激勵及福利體系構成。公司根據國家法律法規，制定並實施了A股限制性股票股權激勵計劃，建立健全中長期激勵約束機制，打造市場化的體制機制和發展平台，集聚核心優秀人才。

根據相關法律法規，公司為員工依法足額繳納了各項社會保險和住房公積金。與此同時，公司為員工建立了補充醫療保險計劃和企業年金計劃，提升員工補充醫療保障和退休待遇水平。

## (二) 培訓

為適應行業創新轉型發展趨勢，公司培訓工作圍繞職業能力、管理素質、業務創新、科技賦能、國際視野等方面開展，年度培訓計劃有序實施。公司積極應對疫情，通過線上、線下相結合方式，組織實施針對管理者的BAL星戰營項目、針對潛力員工的HIPO項目、針對新員工的星途項目等職業發展類培訓，聯合業務部門舉辦投資顧問培訓、金融科技培訓、合規培訓等業務類培訓。此外，公司有效利用雲端學習平台，持續優化平台功能，提升員工使用體驗，報告期內組織直播180場，平台年度學習人次58萬人次，學習時長16.3萬學時，人均13.3學時。

報告期內，公司積極開展學習宣傳活動，深入學習掌握各項制度安排內涵，認真領會《期貨和衍生品法》的立法精神，公司組織開展了「合規有你」《期貨和衍生品法》專項宣導活動，通過專題講座、文章解讀、視頻互動等方式，引導員工學習新法新規、切實提升對新法條款和立法精神的理解，促進業務持續健康發展。同時，為迎接國家安全教育日、世界知識產權日，推動全員樹立國家安全、金融安全意識，增強知識產權與商業秘密保護理念，公司組織開展了「倡廉律行·尊創守秘」系列專項宣導活動，通過製作「尊創守秘」知識產權保護專題短片、邀請專家學者開展商業秘密保護專題講座、公眾號推文普及版權保護知識等多項活動，營造「知法守法、廉潔自律」的法治氛圍。

## (三) 員工人數

截至2022年6月末，集團員工人數為15,156人（含勞務派遣、經紀人），其中母公司11,159人（含勞務派遣、經紀人）。

## 七、其他公司治理相關情況說明

作為境內外上市的公眾公司，公司嚴格按照境內外上市地的法律、法規及規範性文件的要求，規範運作，不斷致力於維護和提升公司良好的市場形象。報告期內，公司嚴格依照《公司法》《證券法》《證券公司監督管理條例》《證券公司治理準則》《上市公司治理準則》《香港上市規則》附錄十四《企業管治守則》等相關法律法規以及《公司章程》的規定，按照建立現代企業制度的目標，健全和完善公司法人治理結構、合規風控制度和內控管理體系，形成了股東大會、董事會、監事會和經營管理層相互分離、相互制衡的公司治理結構，使各層次在各自的職責、權限範圍內，各司其職，各負其責，確保了公司的穩健經營和規範運作。

### **(一) 企業管治政策以及就企業管治而言董事會的職責**

公司嚴格遵照《香港上市規則》，以《企業管治守則》中所列的所有原則作為企業管治政策。就企業管治職能而言，董事會的職權範圍至少包括：

- (1) 制定及檢討公司的企業管治政策及常規；
- (2) 檢討及監察董事及高級管理人員的培訓及持續專業發展；
- (3) 檢討及監察公司在遵守法律及監管規定方面的政策及常規；
- (4) 制定、檢討及監察僱員及董事的操守準則及合規手冊（如有）；
- (5) 檢討公司遵守《企業管治守則》的情況及在《企業管治報告》內的披露。



## (二) 符合《香港上市規則》附錄十四《企業管治守則》的要求

報告期內，公司召開股東大會3次(2021年度股東大會、2022年第一次A股類別股東會以及2022年第一次H股類別股東會)，董事會5次，監事會2次，審計委員會4次，合規與風險管理委員會2次，發展戰略委員會1次，薪酬與考核委員會1次，提名委員會2次，共計20次會議，公司股東大會、董事會、監事會的召集、召開及表決程序規範合法有效。報告期內，公司不斷加強投資者關係管理及信息披露工作，公司投資者關係管理工作規範專業，信息披露真實、準確、完整、及時、公平，公司透明度持續提高。

根據《企業管治守則》第C.2.1條的規定，主席及行政總裁之角色應有所區分，而且不應由一人同時兼任。2019年12月16日，公司第五屆董事會第一次會議選舉張偉先生為公司第五屆董事會董事長，繼續聘任周易先生為公司首席執行官、執行委員會主任。董事會認為此管理層架構對本公司營運而言乃屬有效且有足夠的制衡。

公司長期以來致力於公司治理結構和制度建設的不斷完善。公司治理結構不斷規範，公司治理水平不斷提高，公司治理的實際狀況與《公司法》和中國證監會相關規定的要求不存在差異。同時，除以上披露外，公司嚴格遵守《企業管治守則》中的所有守則條文，達到了《企業管治守則》中所列明的絕大多數建議最佳常規條文的要求。

## (三) 董事、監事及有關僱員之證券交易

報告期內，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守則。根據境內監管要求，2014年11月25日，公司第三屆董事會第十三次會議審議通過了《公司董事、監事和高級管理人員所持本公司股份管理制度》，以規範公司董事、監事和高級管理人員持有本公司股份及買賣本公司股份的行為。2015年3月6日，為滿足公司H股掛牌上市相關監管要求，公司對該《管理制度》進行了修訂，並經公司第三屆董事會第十六次會議審議通過。《管理制度》與《標準守則》中的強制性規定相比更加嚴格。根據對公司董事、監事及高級管理人員的專門查詢後，公司所有董事、監事及高級管理人員均已確認其於報告期內嚴格遵守了《管理制度》及《標準守則》的相關規定。公司董事會將不時檢查公司的公司治理及運作，以符合《香港上市規則》有關規定並保障股東的利益。本公司於報告期內概無發現有關僱員違反指引。

## (四) 獨立非執行董事

本公司已根據《香港上市規則》的規定委任足夠人數、並具備適當的專業資格、或具備適當的會計或相關財務管理專長的獨立非執行董事。截至報告期末，本公司共委任五名獨立非執行董事，分別為劉艷女士、陳志斌先生、王建文先生、區璟智女士、王全勝先生。



## **(五) 董事、監事服務合約的說明**

根據《香港上市規則》第19A.54及19A.55條，本公司已與各董事及監事就(其中包括)遵守相關法律及法規和遵從公司章程及仲裁條文訂立合約。除上述披露者外，本公司並無及並不建議與本公司任何董事或監事以其各自作為董事／監事的身份訂立任何服務合約(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)。

## **環境與社會責任**

### **一、環境信息情況**

#### **(一) 公司不屬於環境保護部門公佈的重點排污單位的公司**

#### **(二) 重點排污單位之外的公司的環保情況說明**

公司為金融業企業，不屬於環境保護部門公佈的重點排污單位及其重要子公司。公司每年均委託有資質的第三方機構對總部辦公場所廢水、廢氣、噪聲進行檢測，各項檢測均符合國家的標準。

針對氣候變化可能導致的暴雨、颱風等極端天氣事件，公司及時向各部門及分支機構發佈預警通知，相關人員第一時間做好各項防風、防水浸措施，檢查清理排洪設施，準備沙包、雨衣等應急設備；極端天氣過程中，相關人員對防風、防水浸關鍵區域和部位加強巡視，對發現的設備故障，及時予以解決。

#### **(三) 有利於保護生態、防治污染、履行環境責任的相關信息**

- 1、公司積極響應《南京市生活垃圾管理條例》，總部辦公園區每個樓層均設置垃圾分類投放點，通過在公共場所醒目位置張貼垃圾分類宣傳海報、電梯廳循環播放垃圾分類宣傳視頻等方式，向員工宣貫垃圾分類的理念和做法，營造「垃圾分類，人人參與」的濃厚氛圍，養成主動分類、自覺投放的良好習慣。公司辦公垃圾由物業統一清運，電子垃圾、光管、碳粉盒、硒鼓墨盒等有害廢棄物委託有資質的單位進行回收，由回收方進行處置或再利用。

- 2、公司在車輛管理制度中明確規定，公司實物保障用車及經營業務用車優先考慮購置新能源汽車，踐行低碳環保運營方式。總部辦公園區地下車庫配備有新能源汽車充電樁和電瓶車充電樁，鼓勵員工選擇綠色出行方式，倡導綠色環保理念。
  
- 3、公司在營業用房裝修改造中，通過規定最短裝修週期（除特殊情況外未超過最短裝修週期的不允許實施裝修改造）、提升裝修改造項目質量等措施，延長營業用房裝修使用壽命，減少裝修頻次，降低裝修改造帶來的污染。公司在裝修改造中採用新型建築材料，實現環保和建築一體化。在幕牆、內裝修、景觀等方面，遵循綠色、新穎、環保的理念，辦公空間照明著力普及低能耗的LED照明，較大幅度節約日常辦公照明用電；大幅度降低油漆類裝修材料的使用，使用環保免漆材料代替；辦公家具大量採用板式家具，基本杜絕油漆家具的使用；加大裝修後空氣檢測及治理的力度，提升辦公環境空氣質量，為員工辦公提供安全、舒適的良好環境。

#### (四) 在報告期內為減少其碳排放所採取的措施及效果

##### 1、綠色園區

公司總部園區裝配有光伏發電系統，2022年上半年度通過該系統節約電量達48,770千瓦時，每月功率因數均達到供電部門獎勵標準。在辦公園區運行中，通過日照光誘導照明裝置系統、空調冰蓄冷系統、地送風系統、辦公區智能化照明控制等多種措施減少碳排放，為低碳經濟帶來良好的社會效益。

華泰證券廣場綠化率為27.9%，高於一般商務辦公區綠化水平，圍繞著花園辦公的理念，除了中央綠化，通過多層次的景觀打造，不斷擴大綠植種植面積，減少碳排放，助力碳中和。

##### 2、綠色數據中心

華泰證券廣場數據中心使用面積約3,600平方米，從前期建設到後期運維都以打造綠色數據中心為目標，持續採取多種方式提升能源使用效率。在機房節點設計實施方面，機房區域採用冷通道封閉的高效節能新技術，提高設備散熱效率，加強冷氣流利用效果，並提升冷熱通道隔離效果。同時，對空調間回風百葉進行改造更新，通過減少回風阻力，減少能量損耗，同步配備可溫控的動力送風單元，對熱點區域提供合理必需的冷卻氣流等方式實現精準控溫，提高冷量利用效率，使對應區域的空調壓縮機運行時間縮短。預計全年能夠減少約7.7噸二氧化碳當量的溫室氣體排放。

##### 3、綠色行動倡議

「地球一小時」是由世界自然基金會(WWF)為應對全球氣候變化發起的環保行動。2022年3月26日，公司以「推廣合作夥伴」身份繼續響應「地球一小時」，連續六年加入環保接力，「益心華泰一個長江」環保公益項目聯合HUATECH BAND開展主題為「致自然和你的歌」線上音樂會，引導公眾重新審視人與自然的關係。此外，公司總部大樓熄燈一小時，號召公眾關閉不必要的燈與電子設備，關注氣候和環境變化。

2022年3月，公司發起設立「江蘇省華泰公益基金會」，致力於匯聚在資產管理、金融科技領域的專業優勢，賦能公益慈善行業，為促進社會公平做出應有的貢獻。

2022年6月，在華泰證券的支持下，華泰公益基金會與山水自然保護中心發起「跬步獎學金——一個長江青年行動者支持計劃」，旨在獎勵和支持有志於在生態環境保護公益領域長期發展、並已在一線做出一定實際貢獻的、有潛力的優秀青年人，助力生態環境保護行動者與公益事業的可持續發展。

#### 4、發展綠色金融，推動資本向善

2022年4月，「華泰—吉利曹操出行1-5期資產支持專項計劃（專項用於碳中和）」首期完成發行，華泰聯合證券擔任獨家財務顧問，華泰資管擔任計劃管理人。本項目為網約車出行行業首單碳中和ABS，募集資金主要用於購置、投放純電動新能源汽車，助力綠色出行，對於響應國家碳中和目標，踐行綠色發展理念具有重要積極意義。

2022年5月，華泰聯合證券作為獨家財務顧問助力全國首單綠色新能源電池資產ABS項目「蔚能—華泰—甬興—綠色新能源電池資產支持專項計劃（碳中和）」成功發行。本期產品基礎資產全部對應綠色新能源動力電池，募集資金全部用於電池資產的業務投放，經聯合赤道評級認證，本期產品基礎資產涉及項目屬於綠色產業領域，綠色等級為G1，符合中國證監會關於支持綠色債券發展的指導意見、人民銀行綠色債券支持目錄、國際資本市場協會綠色債券原則等認證標準，並獲得交易所「碳中和」的貼標認證。未來，華泰聯合證券將繼續支持綠色低碳發展，藉助資本之力推動可持續發展和綠色中國建設。

## 二、鞏固拓展脫貧攻堅成果、鄉村振興等工作具體情況

報告期內，華泰證券攜手子公司通過華泰公益基金會設立鄉村振興專項基金、一個長江環境保護專項基金，專項用於鄉村振興和環境保護相關公益項目，以更強的責任感和更高的專業度回報社會，並將依託華泰公益基金會凝聚更多合作夥伴的力量支持公益慈善事業，助力可持續發展，促進社會公平正義。此次設立的鄉村振興專項基金將著力推動鄉村產業振興，支持鄉村教育、醫療事業發展，為鄉村留守兒童、大病兒童等特殊群體提供精準資助；助力欠發達地區社會工作服務機構能力建設，並資助民間救援機構，提升重大自然災害響應能力。報告期內，公司持續深化「一司一縣」結對幫扶，成立縣域經濟發展研究課題組，發揮金融專業人才智力優勢助力為金寨經濟社會發展；紮實推進「村企聯建」定點幫扶，在蘇中、蘇北10個聯建村落成14個產業振興項目，派員參與新一屆江蘇省委駐豐縣幫扶工作隊，開展駐村幫扶；全力支持「東西部協作幫扶」，公司工會實施消費幫扶、支持對口支援助地區2022至2023兩年行動計劃，2022年上半年累計採購消費幫扶產品人民幣136.48萬元。

## 重要事項

### 一、承諾事項履行情況

#### (一) 公司實際控制人、股東、關聯方、收購人以及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 |
|---------------|--------|------|---|-------------------------------|---------|----------|
| 其他對公司中小股東所作承諾 | 解決同業競爭 | 國信集團 | 國信集團及附屬公司或者附屬企業在今後的任何時間不會以任何方式(包括但不限於自營、合資或聯營)參與或進行與華泰證券主營業務存在競爭的業務活動(錦泰期貨有限公司除外)。凡國信集團及附屬公司或者附屬企業有任何商業機會可從事、參與或入股任何可能會與華泰證券生產經營構成競爭的業務,國信集團會將上述商業機會讓予華泰證券(錦泰期貨有限公司除外)。 | 承諾出具日: 2014年6月27日;<br>到期日: 長期 | 否       | 是        |

### 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

報告期內,公司無控股股東及其他關聯方非經營性佔用資金的情況。

### 三、違規擔保情況

報告期內,公司無違規擔保事項。

### 四、半年報審計情況

公司中期報告未經審計。



## 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

公司上年年度報告不存在非標準審計意見。

## 六、破產重整相關事項

報告期內，公司不存在破產重整相關事項。

## 七、重大訴訟、仲裁事項

報告期內，公司不存在《上海證券交易所股票上市規則》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。

### (一) 訴訟、仲裁事項已在臨時公告披露且無後續進展的

| 事項概述及類型                                   | 查詢索引               |
|---|--------------------|
| 公司與四川聖達集團有限公司債權債務糾紛案                      | 可在2021年年報中查詢       |
| 光大證券股份有限公司與公司《上海證券交易所債券質押式協議回購交易主協議》爭議仲裁案 | 可在2021年年報中查詢       |
| 華泰聯合證券與四通集團、四通集團財務公司債權債務糾紛案               | 可在2011年至2021年年報中查詢 |
| 華泰聯合證券與北京華資銀團集團債權債務糾紛案                    | 可在2011年至2021年年報中查詢 |
| 華泰聯合證券與中國華誠集團財務有限責任公司、華誠投資管理有限公司債權債務糾紛案   | 可在2011年至2021年年報中查詢 |
| 華泰聯合證券與郵儲銀行關於美吉特項目糾紛                      | 可在2021年年報中查詢       |
| 華泰資管公司關於集合資產管理計劃項下債券違約合同糾紛案件              | 可在2021年年報中查詢       |
| 華泰期貨公司客戶張曉東期貨賬戶穿倉案                        | 可在2013年至2021年年報中查詢 |

## (二) 臨時公告未披露或有後續進展的訴訟、仲裁情況

報告期內，公司尚未披露的新增(金額超過人民幣1億元)或已披露且有進展的訴訟、仲裁事項：

### 1、湖北稻花香酒業股份有限公司訴吳聲資產管理(廣州)有限公司、華泰證券股份有限公司合同糾紛

公司於2022年3月收到湖北省宜昌市中級人民法院發送的《應訴通知書》等相關訴訟材料。原告湖北稻花香酒業股份有限公司因投資「吳聲•春雨純債2號私募證券投資基金基金合同」未得到全額兌付，訴至法院要求基金管理人吳聲資產管理(廣州)有限公司(被告一)及託管人華泰證券(被告二)承擔連帶賠償責任，要求兩被告共同支付贖回款人民幣102,893,661.22元，要求被告一支付延期付款違約金人民幣5,779,002.15元並賠償投資本金及收益損失人民幣18,182,720.56元，要求兩被告承擔本案的訴訟費用。截至報告期末，本案尚未開庭審理。

## 2、質押式證券回購糾紛

| 事項                             | 詳情  |
|--------------------------------|---|
| 公司與楚金甫、唐付君、河南森源集團有限公司質押式證券回購糾紛 | 因楚金甫股票質押式回購交易違約，公司於2020年7月向南京市中級人民法院提起訴訟，請求法院判令楚金甫支付欠付本金人民幣57,180萬元以及相應的利息、違約金、債權實現費用等，判令唐付君承擔連帶清償責任，判令公司對楚金甫、河南森源集團有限公司(以下簡稱「森源集團」)質押給公司的相關股份、股權及相應孳息的折價、拍賣或變賣價款在相關付款義務的範圍內優先受償。2021年6月24日，公司收到南京市中級人民法院一審判決，判決被告楚金甫向公司償還融資本金、利息及違約金，並支付律師代理費，公司有權對楚金甫、森源集團質押給公司的相關股份、股權及相應孳息的折價、拍賣或變賣價款在上述付款義務的範圍內優先受償，唐付君對楚金甫的給付義務承擔連帶責任。2021年7月8日，森源集團、唐付君上訴至江蘇省高級人民法院。2021年12月23日，公司收到江蘇省高級人民法院二審判決，駁回上訴，維持原判。公司已向南京市中級人民法院申請執行。 |

## 事項

## 詳情

公司與河南森源集團  
有限公司、楚金甫  
質押式證券回購糾紛

因森源集團股票質押式回購交易違約，公司於2020年7月向南京市中級人民法院提起訴訟，請求法院判令森源集團支付欠付本金人民幣30,000萬元以及相應的違約金、債權實現費用等，判令楚金甫承擔連帶清償責任，判令公司對森源集團質押給公司的相關股份、股權及相應孳息的折價、拍賣或變賣價款在相關付款義務的範圍內優先受償。2021年6月24日，公司收到南京市中級人民法院一審判決，判決被告森源集團向公司償還融資本金、違約金，並支付律師代理費，公司有權對森源集團質押給公司的相關股份、股權及相應孳息處置所得價款在上述付款義務的範圍內優先受償，楚金甫對森源集團的上述付款義務承擔連帶清償責任。2021年7月8日，森源集團上訴至江蘇省高級人民法院。2021年12月23日，公司收到江蘇省高級人民法院二審判決，駁回上訴，維持原判。公司已向南京市中級人民法院申請執行。

公司與韓華、楊立軍  
質押式證券回購糾紛

因韓華股票質押式回購交易違約，公司於2020年8月向南京市中級人民法院提起訴訟，請求法院判令韓華支付欠付本金人民幣16,190.56萬元以及相應的利息、違約金、債權實現費用等，判令楊立軍承擔連帶清償責任，判令公司對韓華質押給公司的相關股份及相應孳息的折價、拍賣或變賣價款在相關付款義務的範圍內優先受償。2021年6月16日，公司收到南京市中級人民法院一審判決，判決韓華向公司支付股票回購交易價款及違約金，公司有權對韓華質押的相關股份處置所得價款優先受償，楊立軍對韓華的債務承擔共同清償責任。公司向南京市中級人民法院申請執行，南京市中級人民法院裁定由南京市建鄴區人民法院執行，截至報告期末，已執行到位人民幣24,007,579.91元。

| 事項                     | 詳情   |
|------------------------|--|
| 公司與楊立軍、韓華<br>質押式證券回購糾紛 | 因楊立軍股票質押式回購交易違約，公司於2020年9月向南京市中級人民法院提起訴訟，請求法院判令楊立軍支付欠付本金人民幣10,126.83萬元以及相應的利息、違約金、債權實現費用等，判令韓華承擔連帶清償責任，判令公司對楊立軍質押給公司的相關股份及相應孳息的折價、拍賣或變賣價款在相關付款義務的範圍內優先受償。2021年7月12日，公司收到南京市中級人民法院一審判決，判決楊立軍向公司支付股票回購交易價款及違約金，公司有權對楊立軍質押的相關股份處置所得價款優先受償，韓華對楊立軍的債務承擔共同清償責任。公司向南京市中級人民法院申請執行，南京市中級人民法院裁定由南京市建鄴區人民法院執行，截至報告期末，已執行到位人民幣4,153,182.67元。 |

### 3、 華泰聯合證券與16億陽債投資者糾紛

億陽集團股份有限公司2015年向合格投資者公開分期發行面值不超過人民幣25億元的公司債券（簡稱「16億陽債」），華泰聯合證券為聯席主承銷商。

#### (1) 已披露且有新進展的案件

2020年11月，原告中信信託有限責任公司以證券虛假陳述為由，起訴發行人億陽集團股份有限公司、主承銷商及聯席主承銷商，要求發行人向其賠付債券本金及利息，合計約人民幣2,353.64萬元，並要求主承銷商及聯席主承銷商承擔連帶責任。哈爾濱市中級人民法院於2021年7月一審判決駁回原告訴訟請求，公司勝訴。原告上訴，2022年2月二審法院判決駁回上訴，維持一審公司勝訴判決。

## (2) 新增案件

2022年3月，原告上海仟富來資產管理有限公司以證券虛假陳述為由起訴發行人億陽集團股份有限公司要求賠付債券本金及利息合計約人民幣509.81萬元，並起訴主承銷商、聯席主承銷商、會計師事務所、信用評級機構及律師事務所承擔連帶賠償責任。北京金融法院裁定本案移送哈爾濱市中級人民法院處理。原告不服裁定上訴，本案在北京市高級人民法院二審審理中，截至報告期末尚未收到裁判結果。

### 4、華泰資管公司關於華泰資管資本創新招商3號定向資產管理計劃股票質押式回購合同糾紛案件

華泰資管公司作為華泰資管資本創新招商3號定向資產管理計劃管理人，於2017年5月代表該資管產品分別與融資人劉虎軍、熊瑾玉簽訂股票質押式回購交易業務相關融資協議並開展業務交易，融資本金合計人民幣3.65億元（其中劉虎軍融資本金為人民幣2.35億元，熊瑾玉融資本金為人民幣1.3億元），質押股票標的為聯建光電（證券代碼：300269.SZ）。融資人劉虎軍、熊瑾玉因逾期未能購回構成違約。華泰資管公司於2020年11月以股票質押式回購合同糾紛為由向南京市中級人民法院起訴，要求被告劉虎軍、熊瑾玉承擔償付融資本金人民幣3.65億元等違約責任，並依法處置質押股票。南京市中級人民法院於2022年1月出具一審判決支持華泰資管公司訴訟請求，本案已申請進入執行情序。

## (三) 公司本報告期被處罰和公開譴責的情況

- 1、2022年4月，江蘇證監局對公司出具了《關於對華泰證券股份有限公司採取出具警示函措施的決定》（[2022]31號），指出公司申報託管資格期間，存在個別崗位人員配備不符合要求的情形，對公司採取出具警示函的行政監管措施。公司已採取了相應整改完善措施。
- 2、2022年5月，中國證監會對公司出具了《關於對華泰證券股份有限公司採取責令改正措施的決定》（[2022]22號），對公司場外期權內部控制不完善的相關問題採取責令改正的行政監管措施。針對存在的相關問題，公司從制度、流程、系統、人員等方面組織相關部門深入查找原因，認真檢視不足，完善管控措施，並借助科技賦能強化主要環節管控，促進整改落到實處。



- 3、2022年5月，江蘇證監局對華泰紫金投資出具了《江蘇證監局關於對華泰紫金投資有限責任公司採取出具警示函措施的決定》([2022]51號)。根據決定所述內容，截至2021年底，華泰紫金投資部分產品投資於除公募基金以外的其他資產管理產品，且未在規定期限內完成規範整改，江蘇證監局依據相關監管規定，對華泰紫金投資採取出具警示函的監督管理措施。公司已組織華泰紫金投資按照監管要求完善整改方案，編製新版整改台賬，並向江蘇證監局報送了整改報告，後續將持續督促華泰紫金投資盡快推進不合規資管產品的整改工作。

## 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

報告期內，公司董事、監事、高級管理人員、持有5%以上股份的股東、實際控制人不存在被有權機關調查、被司法機關或紀檢部門採取強制措施、被移送司法機關或追究刑事責任、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處罰以及被證券交易所公開譴責的情形。

報告期內，公司受到處罰及整改情況請參見本報告本節「重大訴訟、仲裁事項」[(三)公司本報告期被處罰和公開譴責的情況]。

## 九、報告期內，公司及其實際控制人誠信狀況良好，不存在未履行法院生效判決、所負數額較大的債務到期未清償等情況。

## 十、重大關聯交易

有關會計準則下的關聯交易情況請參閱本報告財務報表附註57「關聯方關係及交易」。本公司確認關聯方交易不歸入《香港上市規則》第十四A章有關「關連交易」或「持續關連交易」的定義(視屬何情況而定)及乃符合《香港上市規則》第十四A章的披露規定。

## 十一、重大合同及其履行情况

### 1 託管、承包、租賃事項

報告期內，本公司不存在託管、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：億元 幣種：人民幣

| 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）          | —      |
| 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                    | 138.99 |
| 報告期末對子公司擔保餘額合計(B)                  | 376.82 |
| 公司擔保總額情況（包括對子公司的擔保）                |        |
| 擔保總額(A+B)                          | 376.82 |
| 擔保總額佔公司淨資產的比例(%)                   | 24.71  |
| 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) | 285.82 |
| 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)                  | 285.82 |

未到期擔保可能承擔  
連帶清償責任說明  
擔保情況說明

承擔債券的本金、利息及其他相關費用

1、 本公司的擔保事項

- (1) 2015年1月，華泰資管公司正式營業。隨著公司資管業務的穩步發展和資產管理規模的快速擴大，為確保資管公司各項風控指標符合監管要求，公司股東大會於2015年3月30日和2016年9月13日，分別審議通過了相關議案，批准公司為華泰資管公司提供最高額度為人民幣12億元和人民幣50億元的淨資本擔保，並承諾當華泰資管公司開展業務需要現金支持時，將無條件在上述額度內提供現金。

2020年12月31日，上海證監局批准公司終止對華泰資管公司提供的人民幣20億元淨資本擔保承諾。報告期末，公司合計為華泰資管公司提供人民幣42億元的淨資本擔保。

- (2) 2017年，經本公司第四屆董事會第五次會議及2016年年度股東大會審議通過，本公司為華泰資管公司提供最高額度為人民幣19億元的淨資本擔保。報告期內，人民幣19億元淨資本擔保尚未使用。
- (3) 2018年，經本公司第四屆董事會第十六次會議審議通過，本公司為華泰聯合證券提供最高額度為人民幣20億元的淨資本擔保承諾，自2019年7月1日起正式啟用。2022年6月13日，公司向深圳證監局報告申請調整對華泰聯合證券淨資本擔保承諾，深圳證監局批准公司將2019年對華泰聯合證券提供的淨資本擔保承諾金額由人民幣20億元調整為人民幣10億元，調整日期為2022年6月21日。報告期末，公司合計為華泰聯合證券提供人民幣10億元的淨資本擔保。

- (4) 2020年，經公司第五屆董事會第二次會議審議通過，公司作為擔保人與花旗國際有限公司（作為受託人）簽署擔保協議，為華泰國際下屬公司Pioneer Reward Limited發行的4億美元債券提供無條件及不可撤銷的保證擔保。
- (5) 2020年，經本公司第五屆董事會第七次會議審議通過，本公司為華泰聯合證券提供不超過人民幣20億元的流動性擔保承諾，報告期內尚未使用。
- (6) 經公司第五屆董事會第十一次會議和2021年第一次臨時股東大會審議通過，由公司境內外債務融資工具一般性授權的獲授權人士簽署相關決定，2021年，公司作為擔保人與花旗國際有限公司（作為受託人）簽署擔保協議，為華泰國際下屬公司Pioneer Reward Limited發行的13億美元債券和後續增發的1億美元債券分別提供無條件及不可撤銷的保證擔保。報告期內，公司作為擔保人與花旗國際有限公司（作為受託人）簽署擔保協議，為華泰國際下屬公司Pioneer Reward Limited發行的10億美元債券提供無條件及不可撤銷的保證擔保。

## 2、 子公司的擔保事項

報告期內，華泰國際及其子公司存在擔保事項，相關擔保均是對其下屬子公司提供，且為滿足下屬子公司業務開展而進行的，主要為企業債擔保、中期票據擔保以及與交易對手方簽署國際衍生品框架協議涉及的交易擔保等。截至報告期末，上述擔保金額約合人民幣97.16億元。

- ## 3、 前述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為人民幣285.82億元，包括1) 公司為華泰國際下屬公司發行的28億美元債券所提供的保證擔保；2) 華泰國際及其子公司為滿足下屬子公司業務開展需要提供的擔保。

### 3 其他重大合同

- 1、 根據《上海證券交易所股票上市規則》及《公開發行證券的公司信息披露內容與格式準則第3號—半年度報告的內容與格式(2021年修訂)》，報告期內公司未簽署重大合同。
- 2、 已披露的有關重要合同在報告期內無進展。

## 十二、其他重大事項的說明

### 1、 報告期內，各證券營業部及分公司新設、遷址、撤銷等變化情況

- (1) 報告期內，公司證券營業部及分公司無新設、撤銷情況。

(2) 報告期內，分公司遷址情況：

| 序號 | 遷址前名稱 | 遷址後名稱 | 遷址後地址                                | 獲得許可證日期    |
|----|-------|-------|--------------------------------------|------------|
| 1  | 徐州分公司 | 徐州分公司 | 徐州市雲龍區和平路99號<br>寶龍廣場B號樓1-301#至1-308# | 2022年3月29日 |
| 2  | 天津分公司 | 天津分公司 | 天津市河西區友誼路5號<br>北方金融大廈5層C-I座          | 2022年4月13日 |

(3) 報告期內，證券營業部遷址情況：

| 序號 | 遷址前名稱                   | 遷址後名稱                  | 遷址後地址  | 獲得許可證日期    |
|----|-------------------------|------------------------|--|------------|
| 1  | 梧州西堤三路<br>證券營業部         | 梧州西堤三路<br>證券營業部        | 梧州市西堤三路19號一層3-2號<br>商務辦公、2801-2809號<br>商務公寓        | 2022年1月14日 |
| 2  | 鎮江句容<br>華陽北路<br>證券營業部   | 鎮江句容<br>華陽北路<br>證券營業部  | 句容市華陽鎮華陽北路1號                                       | 2022年1月14日 |
| 3  | 武漢新華路證<br>券營業部          | 武漢新華路證<br>券營業部         | 武漢市江漢區新華路314號                                      | 2022年3月4日  |
| 4  | 徐州和平路<br>證券營業部          | 徐州和平路<br>證券營業部         | 徐州市雲龍區和平路99號<br>寶龍廣場B號樓1-104                       | 2022年3月15日 |
| 5  | 成都天府新區<br>正東中街<br>證券營業部 | 成都天府大道<br>證券營業部        | 中國(四川)自由貿易試驗區<br>成都高新區天府大道中段588號<br>1棟14樓1401號04號房 | 2022年3月21日 |
| 6  | 鎮江丹徒谷陽<br>大道證券營<br>業部   | 鎮江丹徒谷陽<br>中大道證券<br>營業部 | 鎮江市丹徒區谷陽中大道<br>恒宇大廈131-133室                        | 2022年3月29日 |
| 7  | 應城西大街<br>證券營業部          | 應城西大街<br>證券營業部         | 湖北省孝感市應城市城中街道<br>古城大道古城新都20號門店                     | 2022年4月18日 |



| 序號 | 遷址前名稱                 | 遷址後名稱                | 遷址後地址   | 獲得許可證日期    |
|----|-----------------------|----------------------|---|------------|
| 8  | 成都南一環路<br>第二證券<br>營業部 | 成都天府廣場<br>證券業<br>營業部 | 四川省成都市青羊區西御街5號<br>1棟1單元21層02、03號                  | 2022年4月19日 |
| 9  | 成都蜀金路<br>證券營業部        | 成都蜀金路<br>證券營業部       | 四川省成都市青羊區蜀金路1號<br>金沙萬瑞中心B座1901、1905室              | 2022年4月19日 |
| 10 | 成都人民南路<br>證券營業部       | 成都人民南路<br>證券營業部      | 四川省成都市武侯區人民南路<br>四段45號新希望大廈1棟1單元<br>15層1506、1507號 | 2022年6月14日 |
| 11 | 廣州番禺<br>萬達廣場<br>證券營業部 | 廣州琶洲大道<br>證券營業部      | 廣州市海珠區琶洲大道109號<br>2304室2305室2306室2307室            | 2022年6月21日 |
| 12 | 貴陽中華北路<br>證券營業部       | 貴陽中華北路<br>證券營業部      | 貴州省貴陽市雲岩區毓秀街道<br>中華北路2號貴州郵政大廈<br>16-3號            | 2022年6月24日 |

## 2、控股參股公司重大事項說明

### (1) 華泰紫金投資

報告期內，華泰紫金投資發起設立的南京華泰紫金新興產業基金合夥企業（有限合夥）的總認繳規模由人民幣76,862.5萬元增加至人民幣178,112.5萬元，其中華泰紫金投資作為基金管理人、執行事務合夥人和普通合夥人認繳出資由人民幣15,372.5萬元增加至人民幣35,622.5萬元。報告期內，華泰紫金投資增加實繳出資人民幣4,050萬元；截至報告期末，華泰紫金投資累計實繳出資人民幣7,124.5萬元。

報告期內，華泰紫金投資對其出資設立的江蘇紫金弘雲健康產業投資合夥企業（有限合夥）增加實繳出資人民幣5,800萬元；截至報告期末，華泰紫金投資實繳出資人民幣2.9億元。

(2) 華泰國際

報告期內，華泰國際的子公司AssetMark Financial Holdings, Inc.完成了對其子公司AssetMark Financial, Inc.的吸收合併及註銷。

(3) 華泰創新投資

報告期內，公司對華泰創新投資實繳出資人民幣3億元，華泰創新投資的實繳出資額由人民幣23億元增加至人民幣26億元。

(4) 華泰期貨

報告期內，華泰期貨註冊地址由「廣州市越秀區東風東路761號麗豐大廈20層」變更為「廣州市南沙區橫瀝鎮明珠三街1號10層1001-1004、1011-1016房」。

報告期內，華泰期貨召開股東會，同意將其2021年12月31日經審計的未分配利潤中的人民幣133,000萬元按股東持股比例轉增為註冊資本，增資完成後，華泰期貨註冊資本增加至人民幣293,900萬元。增資相關的工商變更登記等手續已完成。

(5) 上海盛鉅資產經營管理有限公司(以下簡稱「上海盛鉅」)

2021年12月，公司第五屆董事會第二十次會議審議通過《關於收購上海盛鉅資產經營管理有限公司100%股權的議案》。同月，公司通過山東產權交易中心以公開招拍掛的方式受讓了上海盛鉅100%股權，以實際購置上海保利廣場C棟樓房產用於日常辦公。報告期內，上海盛鉅已完成相關工商變更登記和資產過戶手續。

(6) 南方基金

報告期內，南方基金的董事長變更為周易先生。

3、報告期內，公司已在《中國證券報》《上海證券報》《證券時報》《證券日報》以及上交所網站([www.sse.com.cn](http://www.sse.com.cn))上披露的其他重大事項見附錄。

#### 4、報告期內與股東溝通以及投資者關係工作開展情況

投資者關係是公司規範發展、合規經營的重要工作之一，公司董事會高度重視投資者關係管理工作。公司以高度負責的精神策劃、安排和組織各類投資者關係管理活動，包括協調來訪接待，保持與監管機構、投資者、中介機構及新聞媒體的聯繫等。

報告期內，公司維護好公司網站「投資者關係」欄目，並做好上交所網站e互動平台投資者諮詢問題答覆工作；上半年共接待境內外多家券商和基金公司等機構共3批次約53名研究員和投資人員的到訪調研或電話訪談；認真做好日常投資者諮詢工作，詳細回答投資者提出的問題。同時，為配合定期報告的公佈，公司舉行了1次業績發佈會和1次e互動業績說明會，並積極參加境內外證券經營機構舉辦的策略報告會與投資論壇。上半年共參加2場策略報告會與投資論壇，就行業發展趨勢、公司經營業績及業務發展戰略等問題與投資者和研究員進行了充分的溝通與交流，有效促進了投資者和研究員對公司經營情況和業績表現的深入了解，全面推介了公司業務發展優勢，有效引導了市場預期。公司堅持對機構投資者、研究員提出的各種問題進行歸納分析整理，以不斷提高公司投資者關係管理工作的專業性和規範性，提升投資者關係管理工作質量。

2022年上半年公司接待調研、溝通、採訪等工作開展情況：

| 序號 | 接待時間       | 接待 |      |                          | 談論的主要內容及提供的資料               |
|----|------------|----|------|--------------------------|-----------------------------|
|    |            | 地點 | 接待方式 | 接待對象                     |                             |
| 1  | 2022年4月12日 | 線上 | 電話訪談 | Balyasny (3人次)           | 公司業務發展情況、創新業務開展情況及公司長遠發展戰略等 |
| 2  | 2022年4月14日 | 線上 | 視頻訪談 | 威靈頓基金 (9人次)              |                             |
| 3  | 2022年4月14日 | 線上 | 視頻訪談 | 國泰君安證券、廣發基金、天弘基金等 (41人次) |                             |

2022年上半年公司參加境內外證券經營機構舉辦的策略報告會與投資論壇等工作開展情況：

| 序號 | 接待時間       | 會議名稱          | 接待方式 | 接待對象                     | 談論的主要內容及提供的資料            |
|----|------------|---------------|------|--------------------------|--------------------------|
|    |            |               |      |                          |                          |
| 1  | 2022年1月22日 | 瑞銀2022年中國投資峰會 | 電話訪談 | 瑞銀財富管理、千禧資管、大和資管等 (13人次) | 公司業務亮點、經營和財務情況及公司長期戰略規劃等 |
| 2  | 2022年5月26日 | 摩根士丹利2022中國峰會 | 電話訪談 | 荷寶投資管理集團、Balyasny等 (7人次) |                          |

## 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，公司股份總數及股本結構未發生變化。

2、 報告期內，本公司無認為必要或證券監管機構要求披露的其他內容。

#### (二) 限售股份變動情況

報告期內，公司限售股份未發生變化。

### 二、 股東情況

#### (一) 股東總數：

截至報告期末普通股股東總數(戶) 292,238  
截至報告期末表決權恢復的優先股股東總數(戶) —

截至報告期末，普通股股東總數中，A股股東284,990戶，H股登記股東7,248戶。

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

單位：股

| 股東名稱(全稱)                            | 報告期內增減      | 期末持股數量        | 比例(%) | 前十名股東持股情況   |                    |             |         |
|-------------------------------------|-------------|---------------|-------|-------------|--------------------|-------------|---------|
|                                     |             |               |       | 持有有限售條件股份數量 | 質押、標記或凍結情況<br>股份狀態 | 數量          | 股東性質    |
| 江蘇省國信集團有限公司                         | -           | 1,373,481,636 | 15.13 | -           | 無                  | -           | 國有法人    |
| 香港中央結算(代理人)有限公司                     | -48,971,400 | 1,369,289,327 | 15.09 | -           | 無                  | -           | 境外法人    |
| 江蘇交通控股有限公司                          | -           | 489,065,418   | 5.39  | -           | 無                  | -           | 國有法人    |
| 江蘇高科技投資集團有限公司                       | -143,200    | 356,090,006   | 3.92  | -           | 無                  | -           | 國有法人    |
| 阿里巴巴(中國)網絡技術有限公司                    | -           | 268,199,233   | 2.95  | -           | 無                  | -           | 境內非國有法人 |
| 江蘇省蘇豪控股集團有限公司                       | 47,440,600  | 233,985,299   | 2.58  | -           | 無                  | -           | 國有法人    |
| 香港中央結算有限公司                          | -6,965,625  | 224,526,149   | 2.47  | -           | 無                  | -           | 境外法人    |
| 中國證券金融股份有限公司                        | -           | 152,906,738   | 1.68  | -           | 無                  | -           | 未知      |
| 江蘇宏圖高科技股份有限公司                       | -           | 123,169,146   | 1.36  | -           | 未知                 | 123,169,146 | 境內非國有法人 |
| 中國工商銀行股份有限公司—廣發<br>多因子靈活配置混合型證券投資基金 | 30,118,852  | 121,273,601   | 1.34  | -           | 無                  | -           | 未知      |

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<br>流通股的數量 | 股份種類及數量   |               |
|-------------------------------------|-------------------|---|---------------|
|                                     |                   | 種類  | 數量            |
| 江蘇省國信集團有限公司                         | 1,373,481,636     | 人民幣普通股  | 1,271,072,836 |
|                                     |                   | 境外上市外資股   | 102,408,800   |
| 香港中央結算(代理人)有限公司                     | 1,369,289,327     | 境外上市外資股   | 1,369,289,327 |
| 江蘇交通控股有限公司                          | 489,065,418       | 人民幣普通股  | 452,065,418   |
|                                     |                   | 境外上市外資股   | 37,000,000    |
| 江蘇高科技投資集團有限公司                       | 356,090,006       | 人民幣普通股  | 341,884,806   |
|                                     |                   | 境外上市外資股   | 14,205,200    |
| 阿里巴巴(中國)網絡技術有限公司                    | 268,199,233       | 人民幣普通股  | 268,199,233   |
| 江蘇省蘇豪控股集團有限公司                       | 233,985,299       | 人民幣普通股  | 41,245,099    |
|                                     |                   | 境外上市外資股   | 192,740,200   |
| 香港中央結算有限公司                          | 224,526,149       | 人民幣普通股  | 224,526,149   |
| 中國證券金融股份有限公司                        | 152,906,738       | 人民幣普通股  | 152,906,738   |
| 江蘇宏圖高科技股份有限公司                       | 123,169,146       | 人民幣普通股  | 123,169,146   |
| 中國工商銀行股份有限公司－廣發多因子靈活配置混合型<br>證券投資基金 | 121,273,601       | 人民幣普通股  | 121,273,601   |
| 前十名股東中回購專戶情況說明                      |                   | 前十名股東中無回購專戶   |               |
| 上述股東委託表決權、受託表決權、放棄表決權的說明            |                   | 上述股東不存在委託表決權、受託表決權、放棄表決權的情況   |               |
| 上述股東關聯關係或一致行動的說明                    |                   | 國信集團、交通控股、江蘇高投和江蘇省蘇豪控股集團有限公司均為江蘇省國資委所屬獨資企業。此外，公司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                 |                   | 公司無優先股股東  |               |

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

2、 本公司境外上市外資股(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。截至報告期末，國信集團、交通控股、江蘇高投和江蘇省蘇豪控股集團有限公司通過港股通分別購入了本公司H股股份102,408,800股、37,000,000股、14,205,200股和192,740,200股，此部分股份亦為香港中央結算(代理人)有限公司代為持有。本報告披露時，特將此部分股份單獨列出，若將此部分股份包含在內，香港中央結算(代理人)有限公司實際代為持有股份為1,715,643,527股，佔公司總股本的18.90%。

3、 截至報告期末，江蘇高投持有的143,200股A股股票因參與轉融通業務仍出借在外，若全部歸還，則實際持有公司342,028,006股A股股份及14,205,200股H股股份，佔公司總股本的3.92%。

- 4、 香港中央結算有限公司是滬股通投資者所持有公司A股股份的名義持有人。
- 5、 根據公司GDR存託人Citibank, National Association統計，截至報告期末公司GDR存續數量為160,348份，佔中國證監會核准發行數量的0.19%。

### 前十名有限售條件股東持股數量及限售條件

單位：股

| 序號               | 有限售條件股東名稱 | 持有的<br>有限售條件<br>股份數量 | 有限售條件股份<br>可上市交易情況 |                         | 限售條件 |
|------------------|-----------|----------------------|--------------------|-------------------------|------|
|                  |           |                      | 可上市<br>交易時間        | 新增<br>可上市<br>交易股份<br>數量 |      |
| 1                | 周易        | 720,000              | 詳見附註               | —                       | 詳見附註 |
| 2                | 韓臻聰       | 600,000              | 詳見附註               | —                       | 詳見附註 |
| 3                | 李世謙       | 600,000              | 詳見附註               | —                       | 詳見附註 |
| 4                | 孫含林       | 600,000              | 詳見附註               | —                       | 詳見附註 |
| 5                | 姜健        | 600,000              | 詳見附註               | —                       | 詳見附註 |
| 6                | 張輝        | 600,000              | 詳見附註               | —                       | 詳見附註 |
| 7                | 陳天翔       | 600,000              | 詳見附註               | —                       | 詳見附註 |
| 8                | 焦曉寧       | 500,000              | 詳見附註               | —                       | 詳見附註 |
| 9                | 焦凱        | 500,000              | 詳見附註               | —                       | 詳見附註 |
| 10               | 王翀        | 500,000              | 詳見附註               | —                       | 詳見附註 |
| 上述股東關聯關係或一致行動的說明 |           | 公司未知關聯關係或者一致行動安排     |                    |                         |      |

註： 上述有限售條件股份為公司因實施A股限制性股票激勵計劃向激勵對象授予的股份，可上市交易情況和限售條件等內容詳見公司於2021年2月9日在上交所網站披露的《A股限制性股票股權激勵計劃》相關內容。

### (三) 戰略投資者或一般法人因配售新股成為前10名股東

報告期內，公司並無戰略投資者或一般法人因配售新股成為前10名股東。

### 三、控股股東或實際控制人變更情況

報告期內，公司並無控股股東或實際控制人出現變更。



#### 四、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

截至2022年6月30日，據本公司和董事合理查詢所知，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<br>股份數目(股) | 佔本公司<br>已發行股份<br>總數的<br>比例(%) | 佔本公司<br>已發行A股/<br>H股總數的<br>比例(%) | 好倉/<br>淡倉/<br>可供借出<br>的股份 |
|----|---------------|---------|--------|----------------|-------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 1  | 江蘇省國信集團有限公司   | A股      | 實益擁有人  | 1,271,072,836  | 14.00                         | 17.28                            | 好倉                        |
|    |               | H股(港股通) | 實益擁有人  | 102,408,800    | 1.13                          | 5.96                             | 好倉                        |
| 2  | 江蘇交通控股有限公司    | A股      | 實益擁有人  | 452,065,418    | 4.98                          | 6.14                             | 好倉                        |
|    |               | H股(港股通) | 實益擁有人  | 37,000,000     | 0.41                          | 2.15                             | 好倉                        |
| 3  | 江蘇省蘇豪控股集團有限公司 | A股      | 實益擁有人  | 41,245,099     | 0.45                          | 0.56                             | 好倉                        |
|    |               |         | 受控法團權益 | 27,562,833     | 0.30                          | 0.37                             | 好倉                        |
|    |               | H股(港股通) | 實益擁有人  | 192,740,200    | 2.12                          | 11.21                            | 好倉                        |
|    |               |         | 受控法團權益 | 87,554,000     | 0.96                          | 5.09                             | 好倉                        |

註1：根據《證券及期貨條例》第336條，倘若干條件達成，則本公司股東須呈交披露權益表格。倘股東於本公司的持股量變更，除非若干條件已達成，否則股東毋須知會本公司及香港聯交所，故主要股東於本公司之最新持股量可能與呈交予香港聯交所的持股量不同。

江蘇省蘇豪控股集團有限公司直接持有本公司41,245,099股A股好倉及192,740,200股H股好倉，並通過受其控制的法團江蘇蘇豪國際集團股份有限公司間接持有本公司27,562,833股A股好倉及87,554,000股H股好倉。

註2：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；及

註3：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)其有權要求另一個人購入相關股份；(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。

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

## 六、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

截至報告期末，因公司實施A股限制性股票激勵計劃授予本公司部分董事限制性股票的情況如下：

| 序號 | 姓名 | 股份類別 | 權益性質  | 持有的<br>股份數目<br>(股) | 佔本公司                      | 佔本公司                         | 好倉／<br>淡倉／<br>可供借出<br>的股份 |
|----|----|------|-------|--------------------|---------------------------|------------------------------|---------------------------|
|    |    |      |       |                    | 已發行<br>股份總數<br>的比例<br>(%) | 已發行<br>A股／H股<br>總數的<br>比例(%) |                           |
| 1  | 周易 | A股   | 實益擁有人 | 720,000            | 0.008                     | 0.010                        | 好倉                        |

除上述披露外，截至2022年6月30日，本公司並不知悉其他本公司董事、監事及最高行政人員在本公司或其相聯法團的股份、相關股份或債權證中擁有任何根據《證券及期貨條例》第XV部及第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。

## 七、購回、出售或贖回本公司及附屬公司的上市證券

報告期內，本公司及附屬公司未購回、出售或贖回本公司及附屬公司的任何上市證券。

## 八、董事及監事購買股份或債券之安排

報告期內，本公司、其控股公司或其任何附屬公司或同系附屬公司概無訂立任何安排，致使董事及監事借購買本公司或任何其他法人團體股份或債券而獲益。

## 九、優先股相關情況

報告期內，本公司無優先股事項。

## 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

報告期內，公司並無發行企業債券。

#### (二) 公司債券

##### 1. 公司債券基本情況

以下為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<br>餘額 | 利率(%) | 還本付息<br>方式    | 交易<br>場所 | 是否存在<br>終止上市<br>交易的<br>風險 |
|--|--------|-----------|------------|------------|------------|----------|-------|---------------|----------|---------------------------|
| 华泰證券股份有限公司<br>2013年公司債券(10年期)                    | 13華泰02 | 122262.SH | 2013-06-05 | 2013-06-05 | 2023-06-05 | 60       | 5.10  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰證券股份有限公司2018年面向合格<br>投資者公開發行公司債券<br>(第一期)(品種二) | 18華泰G2 | 155048.SH | 2018-11-22 | 2018-11-26 | 2023-11-26 | 10       | 4.17  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰證券股份有限公司2020年面向合格<br>投資者公開發行公司債券<br>(第一期)(品種一) | 20華泰G1 | 163353.SH | 2020-03-24 | 2020-03-26 | 2023-03-26 | 80       | 2.99  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰證券股份有限公司2020年面向合格<br>投資者公開發行公司債券(第二期)          | 20華泰G3 | 163482.SH | 2020-04-27 | 2020-04-29 | 2025-04-29 | 35       | 2.90  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰證券股份有限公司2020年面向合格<br>投資者公開發行公司債券(第三期)          | 20華泰G4 | 163558.SH | 2020-05-19 | 2020-05-21 | 2025-05-21 | 30       | 3.20  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰證券股份有限公司2020年面向合格<br>投資者公開發行公司債券<br>(第四期)(品種二) | 20華泰G6 | 163670.SH | 2020-06-16 | 2020-06-18 | 2023-06-18 | 32       | 3.10  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰證券股份有限公司2020年面向專業<br>投資者公開發行次級債券(第一期)          | 20華泰C1 | 175409.SH | 2020-11-11 | 2020-11-13 | 2025-11-13 | 50       | 4.48  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰證券股份有限公司2020年面向專業<br>投資者公開發行公司債券(第五期)          | 20華泰G7 | 175473.SH | 2020-11-20 | 2020-11-24 | 2023-11-24 | 35       | 3.90  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |

| 債券名稱                                     | 簡稱     | 代碼        | 發行日        | 起息日        | 到期日        | 債券 |       | 還本付息<br>方式    | 交易<br>場所 | 是否存在<br>終止上市<br>交易的<br>風險 |
|--|--------|-----------|------------|------------|------------|----|-------|---------------|----------|---------------------------|
|  |        |           |            |            |            | 餘額 | 利率(%) |               |          |                           |
| 华泰证券股份有限公司2020年面向專業投資者公開發行公司債券(第六期)(品種一) | 20華泰G8 | 175534.SH | 2020-12-07 | 2020-12-09 | 2022-12-09 | 40 | 3.67  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2020年面向專業投資者公開發行公司債券(第六期)(品種二) | 20華泰G9 | 175535.SH | 2020-12-07 | 2020-12-09 | 2023-12-09 | 40 | 3.79  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行公司債券(第一期)(品種一) | 21華泰G1 | 175648.SH | 2021-01-18 | 2021-01-20 | 2024-01-20 | 40 | 3.58  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行次級債券(第一期)      | 21華泰C1 | 175721.SH | 2021-01-27 | 2021-01-29 | 2026-01-29 | 90 | 4.50  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行公司債券(第二期)      | 21華泰G3 | 188047.SH | 2021-04-22 | 2021-04-26 | 2024-04-26 | 50 | 3.42  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行公司債券(第三期)      | 21華泰G4 | 188106.SH | 2021-05-13 | 2021-05-17 | 2026-05-17 | 60 | 3.71  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行公司債券(第四期)(品種一) | 21華泰G5 | 188134.SH | 2021-05-20 | 2021-05-24 | 2024-05-24 | 40 | 3.28  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行公司債券(第四期)(品種二) | 21華泰G6 | 188140.SH | 2021-05-20 | 2021-05-24 | 2026-05-24 | 20 | 3.63  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行公司債券(第五期)(品種一) | 21華泰G7 | 188239.SH | 2021-06-10 | 2021-06-15 | 2024-06-15 | 20 | 3.40  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行公司債券(第六期)(品種一) | 21華泰09 | 188282.SH | 2021-06-17 | 2021-06-21 | 2024-06-21 | 25 | 3.45  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行公司債券(第七期)(品種一) | 21華泰11 | 188324.SH | 2021-09-03 | 2021-09-07 | 2024-09-07 | 15 | 3.03  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行公司債券(第七期)(品種二) | 21華泰12 | 188325.SH | 2021-09-03 | 2021-09-07 | 2031-09-07 | 27 | 3.78  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行永續次級債券(第一期)    | 21華泰Y1 | 188785.SH | 2021-09-15 | 2021-09-17 | 2026-09-17 | 30 | 3.85  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |

| 債券名稱                                       | 簡稱     | 代碼        | 發行日        | 起息日        | 到期日        | 債券<br>餘額 | 利率(%) | 還本付息<br>方式    | 交易<br>場所 | 是否存在<br>終止上市<br>交易的<br>風險 |
|--|--------|-----------|------------|------------|------------|----------|-------|---------------|----------|---------------------------|
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行公司債券(第八期)(品種一)   | 21華泰13 | 188874.SH | 2021-10-14 | 2021-10-18 | 2024-10-18 | 21       | 3.25  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行公司債券(第八期)(品種二)   | 21華泰14 | 188875.SH | 2021-10-14 | 2021-10-18 | 2031-10-18 | 34       | 3.99  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行公司債券(第九期)(品種一)   | 21華泰15 | 188926.SH | 2021-10-21 | 2021-10-25 | 2024-10-25 | 22       | 3.22  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行公司債券(第九期)(品種二)   | 21華泰16 | 188927.SH | 2021-10-21 | 2021-10-25 | 2031-10-25 | 11       | 3.94  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行永續次級債券(第二期)      | 21華泰Y2 | 188942.SH | 2021-10-26 | 2021-10-28 | 2026-10-28 | 50       | 4.00  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行永續次級債券(第三期)      | 21華泰Y3 | 185019.SH | 2021-11-16 | 2021-11-18 | 2026-11-18 | 20       | 3.80  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行短期公司債券(第七期)(品種二) | 21華S10 | 185101.SH | 2021-12-02 | 2021-12-06 | 2022-11-25 | 27       | 2.70  | 到期一次<br>還本付息  | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行短期公司債券(第九期)(品種一) | 21華S12 | 185162.SH | 2021-12-17 | 2021-12-21 | 2022-09-21 | 10       | 2.70  | 到期一次<br>還本付息  | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行短期公司債券(第九期)(品種二) | 21華S13 | 185158.SH | 2021-12-17 | 2021-12-21 | 2022-12-21 | 40       | 2.75  | 到期一次<br>還本付息  | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行短期公司債券(第十期)      | 21華S14 | 185188.SH | 2021-12-27 | 2021-12-29 | 2022-11-29 | 40       | 2.75  | 到期一次<br>還本付息  | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2022年面向專業投資者公開發行永續次級債券(第一期)      | 22華泰Y1 | 185337.SH | 2022-01-24 | 2022-01-26 | 2027-01-26 | 27       | 3.49  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2022年面向專業投資者公開發行公司債券(第一期)        | 22華泰G1 | 185364.SH | 2022-02-10 | 2022-02-14 | 2025-02-14 | 50       | 2.79  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |
| 华泰证券股份有限公司2022年面向專業投資者公開發行永續次級債券(第二期)      | 22華泰Y2 | 185388.SH | 2022-07-07 | 2022-07-11 | 2027-07-11 | 30       | 3.59  | 到期還本，<br>按年付息 | 上交所      | 否                         |

| 債券名稱                                  | 簡稱     | 代碼        | 發行日        | 起息日        | 到期日        | 債券 |       | 還本付息      | 交易  | 是否終止上市 |
|---------------------------------------|--------|-----------|------------|------------|------------|----|-------|-----------|-----|--------|
|                                       |        |           |            |            |            | 餘額 | 利率(%) |           |     |        |
| 华泰證券股份有限公司2022年面向專業投資者公開發行短期公司債券(第一期) | 22華泰S1 | 137631.SH | 2022-08-05 | 2022-08-09 | 2022-11-09 | 50 | 1.65  | 到期一次還本付息  | 上交所 | 否      |
| 华泰證券股份有限公司2022年面向專業投資者公開發行公司債券(第二期)   | 22華泰G2 | 137666.SH | 2022-08-11 | 2022-08-15 | 2024-08-15 | 20 | 2.43  | 到期還本，按年付息 | 上交所 | 否      |
| 华泰證券股份有限公司2022年面向專業投資者公開發行短期公司債券(第二期) | 22華泰S2 | 137682.SH | 2022-08-17 | 2022-08-19 | 2023-02-17 | 50 | 1.78  | 到期一次還本付息  | 上交所 | 否      |
| 华泰證券股份有限公司2022年面向專業投資者公開發行公司債券(第三期)   | 22華泰G3 | 137732.SH | 2022-08-23 | 2022-08-26 | 2024-08-26 | 30 | 2.33  | 到期還本，按年付息 | 上交所 | 否      |

註1：投資者適當性安排：發行對象為持有中國證券登記結算有限責任公司上海分公司A股證券賬戶且符合《公司債券發行與交易管理辦法》《上海證券交易所債券市場投資者適當性管理辦法》《證券期貨投資者適當性管理辦法》及相關法律法規規定的專業投資者（法律、法規禁止購買者除外）。投資者不得非法利用他人賬戶或資金賬戶進行認購，也不得違規融資或替代違規融資認購。投資者認購本期債券應遵守相關法律法規和中國證監會的有關規定，並自行承擔相應的法律責任。

註2：上述債券均在上交所上市，根據《上海證券交易所債券交易規則》，可採取匹配成交、點擊成交、詢價成交、競買成交和協商成交的交易方式。各期債券的主承銷商和受託管理人的詳細信息請參見公司在上交所網站上披露的債券發行公告。

註3：21華泰Y1、21華泰Y2、21華泰Y3、22華泰Y1、22華泰Y2均設發行人續期選擇權、發行人贖回權、滿足特定條件時發行人贖回選擇權、發行人遞延支付利息權。存續的前5個計息年度的票面利率通過簿記建檔方式確定，在前5個計息年度內保持不變，自第6個計息年度起，每5年重置一次票面利率。如果發行人不行使贖回權，則從第6個計息年度開始票面利率調整為當期基準利率加上初始利差再加上300個基點，在第6個計息年度至第10個計息年度內保持不變。此後每5年重置票面利率為當期基準利率加上初始利差再加上300個基點。初始利差為前5個計息年度的票面利率與初始基準利率之間的差值。

## 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

公司發行的21華泰Y1、21華泰Y2、21華泰Y3、22華泰Y1、22華泰Y2均設發行人續期選擇權、發行人贖回權，截至本報告披露日尚未到發行人續期選擇權行權日；設滿足特定條件時發行人贖回選擇權，截至本報告披露日未觸發；設發行人遞延支付利息權，因公司於2022年6月22日召開的2021年度股東大會審議通過《關於公司2021年度利潤分配的議案》，屬於上述債券募集說明書約定的強制付息事件，公司將在付息日按時、足額支付債券利息。

截至本報告披露日，公司按照公司債券募集說明書的約定，嚴格執行投資者保護條款、償債保障措施的相關約定，並按時、足額兌付各項債券的本金和／或利息。



### 3. 報告期末募集資金使用情況

報告期末，公司存續債券的募集資金使用情況如下：

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 |
| 13華泰02 | 60.00 | 60.00 | —     |
| 18華泰G2 | 10.00 | 10.00 | —     |
| 20華泰G1 | 80.00 | 80.00 | —     |
| 20華泰G3 | 35.00 | 35.00 | —     |
| 20華泰G4 | 30.00 | 30.00 | —     |
| 20華泰G6 | 32.00 | 32.00 | —     |
| 20華泰C1 | 50.00 | 50.00 | —     |
| 20華泰G7 | 35.00 | 35.00 | —     |
| 20華泰G8 | 40.00 | 40.00 | —     |
| 20華泰G9 | 40.00 | 40.00 | —     |
| 21華泰G1 | 40.00 | 40.00 | —     |
| 21華泰C1 | 90.00 | 90.00 | —     |
| 21華泰G3 | 50.00 | 50.00 | —     |
| 21華泰G4 | 60.00 | 60.00 | —     |
| 21華泰G5 | 40.00 | 40.00 | —     |
| 21華泰G6 | 20.00 | 20.00 | —     |
| 21華泰G7 | 20.00 | 20.00 | —     |
| 21華泰09 | 25.00 | 25.00 | —     |
| 21華泰S4 | 40.00 | 40.00 | —     |
| 21華泰S5 | 30.00 | 30.00 | —     |
| 21華泰11 | 15.00 | 15.00 | —     |
| 21華泰12 | 27.00 | 27.00 | —     |
| 21華泰Y1 | 30.00 | 30.00 | —     |
| 21華泰13 | 21.00 | 21.00 | —     |
| 21華泰14 | 34.00 | 34.00 | —     |
| 21華泰15 | 22.00 | 22.00 | —     |
| 21華泰16 | 11.00 | 11.00 | —     |
| 21華泰Y2 | 50.00 | 50.00 | —     |
| 21華泰Y3 | 20.00 | 20.00 | —     |
| 21華S10 | 27.00 | 27.00 | —     |

| 債券名稱   | 募集資金  |       |       |
|--------|-------|-------|-------|
|        | 總金額   | 已使用金額 | 未使用金額 |
| 21華S12 | 10.00 | 10.00 | —     |
| 21華S13 | 40.00 | 40.00 | —     |
| 21華S14 | 40.00 | 40.00 | —     |
| 22華泰Y1 | 27.00 | 27.00 | —     |
| 22華泰G1 | 50.00 | 50.00 | —     |

註：根據《公司債券發行與交易管理辦法》的要求，為確保募集資金的使用與募集說明書一致，保證債券持有人的合法權力，公司在監管銀行對募集資金設立募集資金使用專項賬戶，由監管銀行對賬戶進行監管。公司債券募集資金已使用完畢，募集資金的使用與募集說明書承諾的用途、使用計劃及其他約定一致。

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

| 現狀   | 執行情況   | 是否發生變更 |
|--|--|--------|
| 公司存續的公司債券均採用無擔保方式發行，根據公司債券募集說明書的約定，履行償債計劃。根據公司債券募集說明書的約定，公司償債保障措施包括但不限於制定《債券持有人會議規則》、聘請債券受託管理人、設立專門的償付工作小組、嚴格履行信息披露義務、設置專項償債賬戶等內容。 | 公司嚴格履行募集說明書中有關償債計劃的約定，按時兌付公司債券利息，及時披露公司相關信息，以保障投資者的合法權益。 | 否      |

#### (三) 銀行間債券市場非金融企業債務融資工具

報告期內，公司並無發行銀行間債券市場非金融企業債務融資工具。

#### (四) 公司報告期內未發生合併報表範圍虧損超過上年末淨資產10%的情況

## (五) 主要會計數據和財務指標

單位：千元 幣種：人民幣

| 主要指標     | 本報告期末 | 上年度末  | 本報告期末<br>比上年度末 |      |
|----------|-------|-------|----------------|------|
|          |       |       | 增減(%)          | 變動原因 |
| 流動比率     | 1.34  | 1.41  | (4.96)         |      |
| 速動比率     | 1.34  | 1.41  | (4.96)         |      |
| 資產負債率(%) | 77.35 | 76.93 | 增加0.42個<br>百分點 |      |

| 主要指標           | 本報告期<br>(1-6月) | 上年同期      | 本報告期<br>比上年同期  |                         |
|----------------|----------------|-----------|----------------|-------------------------|
|                |                |           | 增減(%)          | 變動原因                    |
| 扣除非經常性損益後淨利潤   | 5,306,756      | 7,719,866 | (31.26)        | 營業收入減少<br>和營業支出<br>增加導致 |
| EBITDA全部債務比(%) | 3.18           | 4.44      | 減少1.26個<br>百分點 |                         |
| 利息保障倍數         | 2.32           | 3.02      | (23.18)        | 所得稅前<br>利潤減少            |
| 現金利息保障倍數       | 3.94           | (5.37)    | 不適用            |                         |
| EBITDA利息保障倍數   | 2.46           | 3.17      | (22.40)        | 淨利潤減少                   |
| 貸款償還率(%)       | 100.00         | 100.00    | -              |                         |
| 利息償付率(%)       | 100.00         | 100.00    | -              |                         |

註：上述指標均未考慮客戶資金。

## 二、可轉換公司債券情況

報告期內，公司並無發行可轉換公司債券。

## 備查文件目錄

備查文件目錄 載有公司法定代表人、主管會計工作負責人、會計機構負責人簽名並蓋章的財務報表  
報告期內公開披露過的所有公司文件的正本及公告的原稿  
公司章程

董事長：張偉  
董事會批准報送日期：2022年8月30日

## 證券公司信息披露

### 公司重大行政許可事項的相關情況

2022年1月20日，《關於同意华泰證券股份有限公司向專業投資者公開發行公司債券註冊的批覆》（證監許可[2022]161號）。

## 附錄： 信息披露索引

1、 報告期內，公司在《中國證券報》《上海證券報》《證券時報》《證券日報》以及上交所網站(www.sse.com.cn)上披露的信息如下：

| 序號 | 日期         | 公告事項  |
|----|------------|---|
| 1  | 2022-01-07 | 華泰證券H股公告(截至2021年12月31日股份發行人的證券變動月報表)  |
| 2  | 2022-02-07 | 华泰证券股份有限公司關於向專業投資者公開發行公司債券獲得中國證監會註冊批覆的公告  |
| 3  | 2022-02-10 | 華泰證券H股公告(截至2022年1月31日股份發行人的證券變動月報表)   |
| 4  | 2022-03-04 | 华泰证券股份有限公司關於發起設立公益基金會的公告、华泰证券股份有限公司關於境外債券於香港聯合交易所有限公司上市的公告、华泰证券股份有限公司為境外全資附屬公司發行美元債券提供擔保的公告 |
| 5  | 2022-03-05 | 華泰證券H股公告(截至2022年2月28日股份發行人的證券變動月報表)   |
| 6  | 2022-03-19 | 華泰證券H股公告(董事會召開日期)   |
| 7  | 2022-03-23 | 华泰证券股份有限公司關於召開2021年度業績說明會的公告  |
| 8  | 2022-03-26 | 华泰证券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告   |
| 9  | 2022-03-28 | 华泰证券股份有限公司2021年度業績快報公告、华泰证券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告                        |

| 序號 | 日期         | 公告事項  |
|----|------------|---|
| 10 | 2022-03-31 | 北京市金杜(南京)律師事務所關於华泰證券股份有限公司A股限制性股票股權激勵計劃之回購註銷部分限制性股票的法律意見書、华泰證券股份有限公司2021年度非經營性資金佔用及其他關聯資金佔用及其他關聯資金往來情況的專項說明、华泰證券股份有限公司2021年度內部控制審計報告、华泰證券股份有限公司2021年度社會責任報告、华泰證券股份有限公司2021年度審計報告、华泰證券股份有限公司2021年內部控制評價報告、华泰證券股份有限公司2021年年度報告、华泰證券股份有限公司2021年年度報告摘要、华泰證券股份有限公司2021年年度利潤分配方案公告、华泰證券股份有限公司第五屆董事會第二十一次會議決議公告、华泰證券股份有限公司第五屆監事會第十二次會議決議公告、华泰證券股份有限公司董事會審計委員會2021年度履職情況報告、华泰證券股份有限公司獨立董事2021年度履職報告、华泰證券股份有限公司獨立董事關於公司2021年度報告相關事項的獨立意見、华泰證券股份有限公司獨立董事關於公司回購註銷部分A股限制性股票事項的獨立意見、华泰證券股份有限公司獨立董事關於提名公司董事候選人的獨立意見、华泰證券股份有限公司獨立董事候選人聲明、华泰證券股份有限公司獨立董事提名人聲明、华泰證券股份有限公司關於變更會計師事務所的公告、华泰證券股份有限公司關於獨立非執行董事辭職的公告、华泰證券股份有限公司關於回購註銷部分A股限制性股票的公告、华泰證券股份有限公司關於修訂公司《章程》的公告、华泰證券股份有限公司關於預計2022年度日常關聯交易的公告 |
| 11 | 2022-04-02 | 华泰證券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告   |
| 12 | 2022-04-07 | 華泰證券H股公告(截至2022年3月31日股份發行人的證券變動月報表)、华泰證券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告   |
| 13 | 2022-04-09 | 华泰證券股份有限公司第五屆董事會第二十二次會議決議公告、华泰證券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告、华泰證券股份有限公司關於聘任公司執行委員會委員、首席信息官的獨立意見  |
| 14 | 2022-04-15 | 华泰證券股份有限公司關於非執行董事辭職的公告  |



| 序號 | 日期         | 公告事項   |
|----|------------|--|
| 15 | 2022-04-20 | 華泰證券H股公告(董事會召開日期)  |
| 16 | 2022-04-28 | 华泰证券股份有限公司關於控股子公司華泰期貨有限公司註冊地址變更的公告   |
| 17 | 2022-04-30 | 华泰证券股份有限公司2022年第一季度報告  |
| 18 | 2022-05-06 | 华泰证券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告  |
| 19 | 2022-05-07 | 華泰證券H股公告(截至2022年4月30日股份發行人的證券變動月報表)、华泰证券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告、华泰证券股份有限公司關於控股子公司華泰期貨有限公司增加註冊資本的公告 |
| 20 | 2022-05-11 | 华泰证券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告  |
| 21 | 2022-05-14 | 华泰证券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告  |
| 22 | 2022-05-21 | 华泰证券股份有限公司2021年度股東大會、2022年第一次A股類別股東會、2022年第一次H股類別股東會會議文件，华泰证券股份有限公司關於召開2021年年度股東大會、2022年第一次A股類別股東會的通知                |
| 23 | 2022-05-28 | 华泰证券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告  |
| 24 | 2022-06-01 | 华泰证券股份有限公司第五屆董事會第二十四次會議決議公告  |
| 25 | 2022-06-03 | 华泰证券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告  |
| 26 | 2022-06-07 | 華泰證券H股公告(截至2022年5月31日股份發行人的證券變動月報表)  |
| 27 | 2022-06-11 | 华泰证券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告  |
| 28 | 2022-06-14 | 华泰证券股份有限公司關於疫情防控期間參加2021年年度股東大會、2022年第一次A股類別股東會相關注意事項的提示性公告  |

| 序號 | 日期         | 公告事項   |
|----|------------|--|
| 29 | 2022-06-23 | 北京市金杜律師事務所關於华泰證券股份有限公司2021年年度股東大會、2022年第一次A股類別股東會、2022年第一次H股類別股東會之法律意見書，华泰證券股份有限公司2021年年度股東大會、2022年第一次A股類別股東會、2022年第一次H股類別股東會決議公告，华泰證券股份有限公司第五屆董事會第二十五次會議決議公告、华泰證券股份有限公司關於董事任職的公告、华泰證券股份有限公司關於回購註銷部分A股限制性股票減少註冊資本通知債權人的公告、华泰證券股份有限公司章程 |

2、 報告期內，公司在香港交易所披露易網站( [www.hkexnews.hk](http://www.hkexnews.hk))上披露的信息如下：

| 序號 | 日期         | 公告事項   |
|----|------------|--|
| 1  | 2022-01-06 | 截至二零二一年十二月三十一日止股份發行人的證券變動月報表                               |
| 2  | 2022-01-12 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行短期公司債券(第五期)2022年本息兌付及摘牌公告 |
| 3  | 2022-01-13 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行公司債券(第一期)(品種一)2022年付息公告   |
| 4  | 2022-01-14 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司2022年面向專業投資者非公開發行公司債券(第一期)票面利率公告          |
| 5  | 2022-01-18 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司2022年面向專業投資者非公開發行公司債券(第一期)發行結果公告          |
| 6  | 2022-01-25 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司2022年面向專業投資者非公開發行公司債券(第一期)票面利率公告          |
| 7  | 2022-01-27 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司2022年面向專業投資者公開發行永續次級債券(第一期)發行結果公告         |
| 8  | 2022-02-07 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司關於向專業投資者公開發行公司債券獲得中國證監會註冊批覆的公告            |
| 9  | 2022-02-08 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行短期公司債券(第四期)2022年本息兌付及摘牌公告 |
| 10 | 2022-02-09 | 截至二零二二年一月三十一日止股份發行人的證券變動月報表                                |

| 序號 | 日期         | 公告事項  |
|----|------------|---|
| 11 | 2022-02-11 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司2022年面向專業投資者公開發行公司債券(第一期)票面利率公告、华泰證券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行短期公司債券(第二期)(品種一)2022年本息兌付及摘牌公告 |
| 12 | 2022-02-15 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司2022年面向專業投資者公開發行公司債券(第一期)發行結果公告  |
| 13 | 2022-03-03 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司關於發起設立公益基金會的公告、华泰證券股份有限公司關於境外債券於香港聯合交易所有限公司上市的公告、华泰證券股份有限公司為境外全資附屬公司發行美元債券提供擔保的公告        |
| 14 | 2022-03-04 | 截至二零二二年二月二十八日止股份發行人的證券變動月報表   |
| 15 | 2022-03-15 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司2019年面向合格投資者公開發行公司債券(第一期)(品種一)2022年本息兌付及摘牌公告   |
| 16 | 2022-03-18 | 董事會召開日期   |
| 17 | 2022-03-22 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司2020年面向合格投資者公開發行公司債券(第一期)(品種一)2022年付息公告、华泰證券股份有限公司關於召開2021年度業績說明會的公告                     |
| 18 | 2022-03-25 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告  |
| 19 | 2022-03-27 | 2021年度業績快報公告、海外監管公告－华泰證券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告   |

| 序號 | 日期         | 公告事項   |
|----|------------|--|
| 20 | 2022-03-30 | <p>截至2021年12月31日止年度之業績公告、2021社會責任報告、截至2021年12月31日止年度之末期股息、建議修訂公司章程、建議變更會計師事務所、建議變更董事、關於回購註銷部份A股限制性股票的公告、海外監管公告－2021年年度報告、2021年年度報告摘要、华泰證券股份有限公司第五屆董事會第二十二次會議決議公告、华泰證券股份有限公司第五屆監事會第十二次會議決議公告、华泰證券股份有限公司2021年年度利潤分配方案公告、华泰證券股份有限公司關於預計2022年度日常關聯交易的公告、华泰證券股份有限公司獨立董事關於提名公司董事候選人的獨立意見、华泰證券股份有限公司獨立董事關於公司2021年度報告相關事項的獨立意見、华泰證券股份有限公司獨立董事關於公司回購註銷部分A股限制性股票事項的獨立意見、华泰證券股份有限公司獨立董事2021年度履職報告、华泰證券股份有限公司董事會審計委員會2021年度履職情況報告、华泰證券股份有限公司2021年度內部控制評價報告、华泰證券股份有限公司獨立董事提名人聲明、华泰證券股份有限公司獨立董事候選人聲明、北京市金杜(南京)律師事務所關於华泰證券股份有限公司A股限制性股票股權激勵計劃之回購註銷部分限制性股票的法律意見書、华泰證券股份有限公司2021年度非經營性資金佔用及其他關聯資金往來情況的專項說明、华泰證券股份有限公司內部控制審計報告</p> |
| 21 | 2022-04-01 | <p>海外監管公告－华泰證券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告</p>  |

| 序號 | 日期         | 公告事項   |
|----|------------|--|
| 22 | 2022-04-06 | 截至二零二二年三月三十一日止股份發行人的證券變動月報表、海外監管公告－华泰證券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告   |
| 23 | 2022-04-08 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司獨立董事關於聘任公司執行委員會委員、首席信息官的獨立意見，华泰證券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告、华泰證券股份有限公司第五屆董事會第二十二次會議決議公告  |
| 24 | 2022-04-14 | 非執行董事辭任、董事名單與其角色和職能  |
| 25 | 2022-04-19 | 董事會召開日期、海外監管公告－华泰證券股份有限公司2019年面向合格投資者公開發行公司債券(第二期)(品種一)2022年本息兌付及摘牌公告、华泰證券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行公司債券(第二期)2022年付息公告   |
| 26 | 2022-04-26 | 2021年年度報告、致登記股東的通知信函及申請表格、致非登記持有人的通知信函及申請表格  |
| 27 | 2022-04-27 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司關於控股子公司華泰期貨有限公司註冊地址變更的公告  |
| 28 | 2022-04-29 | 2022年第一季度報告  |
| 29 | 2022-05-05 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告   |
| 30 | 2022-05-06 | 截至二零二二年四月三十日止股份發行人的證券變動月報表、海外監管公告－华泰證券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行短期公司債券(第八期)2022年本息兌付及摘牌公告、华泰證券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告、华泰證券股份有限公司關於控股子公司華泰期貨有限公司增加註冊資本的公告 |
| 31 | 2022-05-10 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告、华泰證券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行公司債券(第三期)2022年付息公告  |
| 32 | 2022-03-15 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告   |



| 序號 | 日期         | 公告事項   |
|----|------------|--|
| 33 | 2022-05-20 | 2021年度股東大會通告、2021年度股東大會通函、2022年6月22日舉行的年度股東大會H股股東代表委任表格、2022年第一次H股類別股東會通告、2022年6月22日舉行的2022年第一次H股類別股東會H股股東代表委任表格、截至2021年12月31日止年度之末期股息(更新)   |
| 34 | 2022-05-27 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司2013年公司債券(10年期)2022年付息公告、华泰證券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告  |
| 35 | 2022-05-31 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司第五屆董事會第二十四次會議決議公告   |
| 36 | 2022-06-02 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告   |
| 37 | 2022-06-06 | 截至二零二二年五月三十一日止股份發行人的證券變動月報表  |
| 38 | 2022-06-08 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行公司債券(第五期)(品種一)2022年付息公告   |
| 39 | 2022-06-10 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司關於間接全資子公司根據中期票據計劃進行發行並由全資子公司提供擔保的公告   |
| 40 | 2022-06-13 | 海外監管公告－华泰證券股份有限公司關於疫情防控期間參加2021年年度股東大會、2022年第一次A股類別股東會相關注意事項的提示性公告   |
| 41 | 2022-06-22 | 2021年度股東大會、2022年第一次A股類別股東會及2022年第一次H股類別股東會之投票表決結果；派付末期股息；變更會計師事務所；董事變更；調整董事會專門委員會組成方案；及《公司章程》的核准生效、董事名單與其角色和職能、章程、截至2021年12月31日止年度之末期股息(更新)、海外監管公告－华泰證券股份有限公司第五屆董事會第二十五次會議決議公告，北京市金杜律師事務所關於华泰證券股份有限公司2021年年度股東大會、2022年第一次A股類別股東會、2022年第一次H股類別股東會之法律意見書，华泰證券股份有限公司關於回購註銷部分A股限制性股票減少註冊資本通知債權人的公告 |



3、 報告期內，公司在倫敦證券交易所網站( [www.londonstockexchange.com](http://www.londonstockexchange.com))上披露的信息如下：

| 序號 | 日期         | 公告事項  |
|----|------------|---|
| 1  | 2022-03-03 | NOTICE OF BOND LISTING (債券上市公告)   |
| 2  | 2022-03-28 | PRELIMINARY FINANCIAL DATA FOR THE YEAR OF 2021 (2021年度業績快報)  |
| 3  | 2022-03-30 | PROPOSED CHANGE OF DIRECTORS (建議變更董事)、PROPOSED CHANGE OF ACCOUNTING FIRMS (建議變更會計師事務所)、PROPOSED AMENDMENTS OF THE ARTICLES OF ASSOCIATION (建議修訂公司章程)、REPURCHASE AND CANCELLATION OF PART OF SHARES (回購註銷部分股票)、2021 CORPORATE SOCIAL RESPONSIBILITY REPORT (2021社會責任報告)、2021 ANNUAL FINANCIAL REPORT (2021年財務報告) |
| 4  | 2022-04-14 | LIST OF DIRECTORS AND THEIR ROLE AND FUNCTION (董事名單與其角色和職能)、RESIGNATION OF NON-EXECUTIVE DIRECTOR (非執行董事辭任)   |
| 5  | 2022-04-26 | 2021 ANNUAL REPORT (2021年度報告)   |
| 6  | 2022-04-29 | FIRST QUARTERLY REPORT OF 2022 (2022年第一季度報告)  |
| 7  | 2022-05-20 | NOTICE OF AGM AND THE A SHAREHOLDERS CLASS MEETING (年度股東大會及A股類別股東會通知)   |
| 8  | 2022-06-22 | ARTICLES OF ASSOCIATION (公司章程)、LIST OF DIRECTORS AND THEIR ROLE AND FUNCTION (董事名單與其角色和職能)、RESULTS OF AGM AND A SHARE & H SHARE CLASS MEETING (年度股東大會及A股、H股類別股東會之投票表決結果)  |

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表及審閱報告  
截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

| <u>目錄</u>      | <u>頁碼</u> |
|----------------|-----------|
| 中期審閱報告         | 1 - 2     |
| 簡明合併收益表        | 3         |
| 簡明合併損益及其他綜合收益表 | 4         |
| 簡明合併財務狀況表      | 5 - 7     |
| 簡明合併權益變動表      | 8 - 9     |
| 簡明合併現金流量表      | 10 - 12   |
| 簡明合併財務報表附註     | 13 - 95   |

## 中期審閱報告

致華泰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)

### 緒言

我們審閱了列載於第 3 頁至第 95 頁的華泰證券股份有限公司(「貴公司」)及其子公司(統稱「貴集團」)簡明合併財務報表，包括於 2022 年 6 月 30 日的簡明合併財務狀況表、截至該日止六個月期間的相關簡明合併收益表、簡明合併損益及其他綜合收益表、簡明合併權益變動表和簡明合併現金流量表，及若干附註解釋。根據《香港聯合交易所有限公司證券上市規則》(「上市規則」)，上市公司就中期財務資料編製的報告必須符合上市規則中的相關規定和國際會計準則理事會頒佈的《國際會計準則》第 34 號「中期財務報告」的規定。貴公司董事負責根據《國際會計準則》第 34 號編製及列報該等簡明合併財務報表。我們的責任是根據我們的審閱對該等簡明合併財務報表作出結論，並按照委聘的條款僅向整體董事會報告，除此之外本報告不可用作其他用途。我們不會就本報告的內容向任何其他人士承擔任何義務或接受任何責任。

### 審閱範圍

我們根據國際審計和鑒證準則理事會頒佈的國際審閱工作準則第 2410 號「實體的獨立核數師對企業中期財務信息執行審閱」進行審閱。該等簡明合併財務報表審閱工作包括向主要財務及會計事項負責人作出詢問，並執行分析性複核及其他審閱程序。由於審閱的範圍遠小於按照《國際審計準則》進行審計的範圍，所以無法保證我們會注意到在審計中可能會被發現的所有重大事項。因此，我們不會發表審計意見。

## 中期審閱報告

致華泰證券股份有限公司董事會 - 續  
(於中華人民共和國註冊成立的有限公司)

### 結論

基於我們的審閱，並無任何事項致使我們認為於 2022 年 6 月 30 日的簡明合併財務報表在所有重大方面沒有按照國際會計準則第 34 號編製。

德勤·關黃陳方會計師行  
執業會計師  
香港

2022 年 8 月 30 日

簡明合并收益表

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

|                     | 附註 | 截至 6 月 30 日止六個月     |                     |
|---------------------|----|---------------------|---------------------|
|                     |    | 2022 年<br>(未經審計)    | 2021 年<br>(未經審計)    |
| <b>收入</b>           |    |                     |                     |
| 備金及手續費收入            | 5  | 9,931,122           | 9,834,181           |
| 利息收入                | 6  | 6,758,476           | 7,148,805           |
| 投資收益淨額              | 7  | 3,754,431           | 7,191,441           |
|                     |    | <u>20,444,029</u>   | <u>24,174,427</u>   |
| 其他收入及收益             | 8  | 3,034,993           | 441,102             |
| <b>收入、其他收入及收益總計</b> |    | <u>23,479,022</u>   | <u>24,615,529</u>   |
| 備金及手續費支出            | 9  | (2,402,224)         | (2,727,742)         |
| 利息支出                | 10 | (5,373,126)         | (5,237,852)         |
| 僱員成本                | 11 | (4,628,022)         | (5,684,559)         |
| 折舊和攤銷費用             | 12 | (727,809)           | (705,826)           |
| 稅金及附加               |    | (105,128)           | (109,880)           |
| 其他營業支出              | 13 | (4,269,814)         | (1,889,652)         |
| 金融資產減值轉回            | 14 | 337,624             | 193,027             |
| <b>支出合計</b>         |    | <u>(17,168,499)</u> | <u>(16,162,484)</u> |
| <b>經營利潤</b>         |    | 6,310,523           | 8,453,045           |
| 分佔聯營及合營企業利潤         |    | 463,473             | 1,583,856           |
| <b>所得稅前利潤</b>       |    | 6,773,996           | 10,036,901          |
| 所得稅費用               | 15 | (1,221,857)         | (2,150,117)         |
| <b>本期利潤</b>         |    | <u>5,552,139</u>    | <u>7,886,784</u>    |
| 歸屬於：                |    |                     |                     |
| 本公司股東               |    | 5,375,208           | 7,770,308           |
| 非控制性權益              |    | 176,931             | 116,476             |
|                     |    | <u>5,552,139</u>    | <u>7,886,784</u>    |
| 每股盈利(每股人民幣元)        | 16 |                     |                     |
| - 基本                |    | <u>0.58</u>         | <u>0.86</u>         |
| - 稀釋                |    | <u>0.56</u>         | <u>0.86</u>         |

刊載於第 13 至 95 頁的財務報表附註為本財務報告的組成部分。



簡明合併損益及其他綜合收益表

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

|                   | 附註 | 截至 6 月 30 日止六個月  |                  |
|-------------------|----|------------------|------------------|
|                   |    | 2022 年<br>(未經審計) | 2021 年<br>(未經審計) |
| 本期利潤              |    | 5,552,139        | 7,886,784        |
| 本期其他綜合收益          |    |                  |                  |
| 之後不能重新分類至損益的項目：   |    |                  |                  |
| 以公允價值計量且其變動計入     |    |                  |                  |
| 其他綜合收益的權益投資       |    |                  |                  |
| - 公允價值變動淨額        |    | (35,494)         | (483,824)        |
| - 所得稅影響           |    | 5,925            | 120,956          |
| 之後將重新分類至損益的項目：    |    |                  |                  |
| 以公允價值計量且其變動計入     |    |                  |                  |
| 其他綜合收益的債務投資淨虧損    |    | (187,376)        | (25,160)         |
| 現金流量套期工具儲備        |    |                  |                  |
| 指定為現金流量套期的套期工具    |    |                  |                  |
| 公允價值變動收益          |    | 24,820           | 8,773            |
| 分佔聯營企業及合營企業其他綜合收益 |    | (2,439)          | 10,331           |
| 外幣報表折算差額          |    | 682,828          | (94,103)         |
| 所得稅的影響            |    | 27,350           | -                |
| 本期稅後其他綜合收益總額      |    | 515,614          | (463,027)        |
| 本期綜合收益總額          |    | 6,067,753        | 7,423,757        |
| 歸屬於：              |    |                  |                  |
| 本公司股東             |    | 5,788,596        | 7,322,343        |
| 非控制性權益            |    | 279,157          | 101,414          |
| 總計                |    | 6,067,753        | 7,423,757        |

刊載於第 13 至 95 頁的財務報表附註為本財務報告的組成部分。

簡明合併財務狀況表

於 2022 年 6 月 30 日

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

|                              | 附註 | 2022 年<br>6 月 30 日<br>(未經審計) | 2021 年<br>12 月 31 日<br>(經審計) |
|------------------------------|----|------------------------------|------------------------------|
| <b>非流動資產</b>                 |    |                              |                              |
| 物業及設備                        | 17 | 6,030,947                    | 5,178,222                    |
| 投資物業                         |    | 233,936                      | 294,008                      |
| 商譽                           | 18 | 2,984,528                    | 2,836,429                    |
| 土地使用權及其他無形資產                 | 19 | 7,047,773                    | 6,790,673                    |
| 聯營企業權益                       | 20 | 17,667,964                   | 18,269,459                   |
| 合營企業權益                       | 21 | 1,833,112                    | 1,749,065                    |
| 以攤余成本計量的債權投資                 | 22 | 29,127,033                   | 25,299,666                   |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>其他綜合收益的債務工具 | 23 | 4,285,003                    | 4,857,284                    |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>其他綜合收益的權益工具 | 24 | 123,778                      | 163,138                      |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>當期損益的金融資產   | 25 | 9,028,185                    | 9,896,339                    |
| 存出保證金                        | 26 | 32,390,559                   | 27,627,129                   |
| 遞延所得稅資產                      | 27 | 704,761                      | 654,651                      |
| 其他非流動資產                      | 28 | 242,827                      | 282,227                      |
| <b>非流動資產總額</b>               |    | <b>111,700,406</b>           | <b>103,898,290</b>           |
| <b>流動資產</b>                  |    |                              |                              |
| 應收款項                         | 29 | 10,141,361                   | 10,287,174                   |
| 其他應收款、預付款項<br>及其他流動資產        | 30 | 1,752,325                    | 2,122,246                    |
| 融出資金                         | 31 | 103,346,385                  | 116,942,245                  |
| 以攤余成本計量的債權投資                 | 22 | 10,500,637                   | 7,121,850                    |
| 買入返售金融資產                     | 32 | 13,837,737                   | 11,751,970                   |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>其他綜合收益的債務工具 | 23 | 2,695,716                    | 4,457,415                    |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>當期損益的金融資產   | 25 | 377,388,270                  | 345,362,833                  |
| 衍生金融資產                       | 33 | 22,880,610                   | 15,247,805                   |
| 結算備付金                        | 34 | 7,884,492                    | 8,580,941                    |
| 代經紀客戶持有的現金                   | 35 | 147,177,814                  | 143,640,263                  |
| 現金及銀行結餘                      | 36 | 40,016,952                   | 37,237,801                   |
| <b>流動資產總額</b>                |    | <b>737,622,299</b>           | <b>702,752,543</b>           |
| <b>資產總額</b>                  |    | <b>849,322,705</b>           | <b>806,650,833</b>           |

簡明合併財務狀況表 - 續

於 2022 年 6 月 30 日

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

|                            | 附註 | 2022 年<br>6 月 30 日<br>(未經審計) | 2021 年<br>12 月 31 日<br>(經審計) |
|----------------------------|----|------------------------------|------------------------------|
| <b>流動負債</b>                |    |                              |                              |
| 短期銀行借款                     | 38 | 5,668,727                    | 8,492,290                    |
| 已發行的短期債務工具                 | 39 | 48,840,031                   | 53,598,658                   |
| 拆入資金                       | 40 | 43,339,686                   | 14,018,721                   |
| 應付經紀客戶賬款                   | 41 | 158,777,534                  | 147,501,833                  |
| 應付職工薪酬                     |    | 4,799,480                    | 5,757,598                    |
| 其他應付款項及應計費用                | 42 | 109,403,082                  | 106,620,755                  |
| 合同負債                       |    | 350,611                      | 265,637                      |
| 当期稅項負債                     |    | 926,039                      | 1,245,374                    |
| 賣出回購金融資產款                  | 43 | 133,289,382                  | 130,710,001                  |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>当期損益的金融負債 | 44 | 38,142,967                   | 28,289,462                   |
| 衍生金融負債                     | 33 | 11,547,959                   | 10,643,222                   |
| 一年內到期的長期債券                 | 45 | 35,106,479                   | 35,372,308                   |
| <b>流動負債總額</b>              |    | <u>590,191,977</u>           | <u>542,515,859</u>           |
| <b>流動資產淨額</b>              |    | <u>147,430,322</u>           | <u>160,236,684</u>           |
| <b>總資產減流動負債</b>            |    | <u>259,130,728</u>           | <u>264,134,974</u>           |
| <b>非流動負債</b>               |    |                              |                              |
| 長期債券                       | 46 | 89,805,662                   | 97,966,119                   |
| 長期銀行借款                     | 47 | 793,650                      | 722,816                      |
| 長期應付職工薪酬                   |    | 5,988,858                    | 7,057,339                    |
| 遞延所得稅負債                    | 27 | 2,377,925                    | 2,619,161                    |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>当期損益的金融負債 | 44 | 2,731,642                    | 2,833,456                    |
| 其他應付款項及應計費用                | 42 | 1,040,443                    | 900,299                      |
| <b>非流動負債總額</b>             |    | <u>102,738,180</u>           | <u>112,099,190</u>           |
| <b>淨資產</b>                 |    | <u><u>156,392,548</u></u>    | <u><u>152,035,784</u></u>    |

簡明合併財務狀況表 - 續

於 2022 年 6 月 30 日

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

|               | 附註 | 2022 年<br>6 月 30 日<br>(未經審計) | 2021 年<br>12 月 31 日<br>(經審計) |
|---------------|----|------------------------------|------------------------------|
| <b>股東權益</b>   |    |                              |                              |
| 股本            | 48 | 9,076,650                    | 9,076,650                    |
| 其他權益工具        | 49 | 12,694,871                   | 9,996,425                    |
| 庫存股           | 50 | (1,211,555)                  | (1,231,547)                  |
| 儲備            | 51 | 95,566,965                   | 95,021,503                   |
| 未分配利潤         | 52 | 36,342,666                   | 35,559,779                   |
| 本公司股東應佔總權益    |    | 152,469,597                  | 148,422,810                  |
| 非控制性權益        |    | 3,922,951                    | 3,612,974                    |
| <b>股東權益合計</b> |    | <b>156,392,548</b>           | <b>152,035,784</b>           |

刊載於第 13 至 95 頁的財務報表附註為本財務報告的組成部分。

本財務報表獲本公司董事會于 2022 年 8 月 30 日批准。

張偉  
董事長

陳志斌  
董事

簡明合併權益變動表

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

|                                | 歸屬於本公司股東權益    |                       |                |                 |                 |                 |                   |                         |                         |                  | 非控制性權益      | 權益合計      |             |
|--------------------------------|---------------|-----------------------|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|-------------------------|-------------------------|------------------|-------------|-----------|-------------|
|                                | 股本<br>(附註 48) | 其他權益<br>工具<br>(附註 49) | 庫存股<br>(附註 50) | 資本公積<br>(附註 51) | 盈餘公積<br>(附註 51) | 一般儲備<br>(附註 51) | 公允價值儲備<br>(附註 51) | 現金流量<br>套期工具<br>(附註 51) | 外幣報表<br>折算差額<br>(附註 51) | 未分配利潤<br>(附註 52) |             |           | 總計          |
| <b>於 2022 年 1 月 1 日</b>        | 9,076,650     | 9,996,425             | (1,231,547)    | 70,562,359      | 6,569,922       | 18,106,044      | 223,143           | (14,184)                | (425,781)               | 35,559,779       | 148,422,810 | 3,612,974 | 152,035,784 |
| <b>本期權益變動</b>                  |               |                       |                |                 |                 |                 |                   |                         |                         |                  |             |           |             |
| 本期利潤                           | -             | -                     | -              | -               | -               | -               | -                 | -                       | -                       | 5,375,208        | 5,375,208   | 176,931   | 5,552,139   |
| 其他綜合收益                         | -             | -                     | -              | -               | -               | -               | (173,053)         | 24,820                  | 561,621                 | -                | 413,388     | 102,226   | 515,614     |
| 綜合收益總額                         | -             | -                     | -              | -               | -               | -               | (173,053)         | 24,820                  | 561,621                 | 5,375,208        | 5,788,596   | 279,157   | 6,067,753   |
| 發行永續債                          | -             | 2,698,446             | -              | -               | -               | -               | -                 | -                       | -                       | -                | 2,698,446   | -         | 2,698,446   |
| 以權益結算的股份支付                     | -             | -                     | 19,992         | 89,123          | -               | -               | -                 | -                       | -                       | -                | 109,115     | 30,820    | 139,935     |
| 提取一般儲備                         | -             | -                     | -              | -               | -               | 42,951          | -                 | -                       | -                       | (42,951)         | -           | -         | -           |
| 本期宣派股利                         | -             | -                     | -              | -               | -               | -               | -                 | -                       | -                       | (4,063,640)      | (4,063,640) | -         | (4,063,640) |
| 永續債利息                          | -             | -                     | -              | -               | -               | -               | -                 | -                       | -                       | (485,730)        | (485,730)   | -         | (485,730)   |
| <b>於 2022 年 6 月 30 日(未經審計)</b> | 9,076,650     | 12,694,871            | (1,211,555)    | 70,651,482      | 6,569,922       | 18,148,995      | 50,090            | 10,636                  | 135,840                 | 36,342,666       | 152,469,597 | 3,922,951 | 156,392,548 |
| <b>於 2021 年 1 月 1 日</b>        | 9,076,650     | -                     | (1,626,546)    | 70,750,052      | 5,711,067       | 15,792,946      | 605,917           | (34,348)                | (202,856)               | 28,998,618       | 129,071,500 | 3,240,535 | 132,312,035 |
| <b>本期權益變動</b>                  |               |                       |                |                 |                 |                 |                   |                         |                         |                  |             |           |             |
| 本期利潤                           | -             | -                     | -              | -               | -               | -               | -                 | -                       | -                       | 7,770,308        | 7,770,308   | 116,476   | 7,886,784   |
| 其他綜合收益                         | -             | -                     | -              | -               | -               | -               | (377,697)         | 8,773                   | (79,041)                | -                | (447,965)   | (15,062)  | (463,027)   |
| 綜合收益總額                         | -             | -                     | -              | -               | -               | -               | (377,697)         | 8,773                   | (79,041)                | 7,770,308        | 7,322,343   | 101,414   | 7,423,757   |
| 以權益結算的股份支付                     | -             | -                     | 443,963        | (349,108)       | -               | -               | -                 | -                       | -                       | -                | 94,855      | 22,414    | 117,269     |
| 回購股份                           | -             | -                     | (48,964)       | -               | -               | -               | -                 | -                       | -                       | -                | (48,964)    | -         | (48,964)    |
| 提取一般儲備                         | -             | -                     | -              | -               | -               | 53,188          | -                 | -                       | -                       | (53,188)         | -           | -         | -           |
| 本期宣派股利                         | -             | -                     | -              | -               | -               | -               | -                 | -                       | -                       | (3,612,548)      | (3,612,548) | -         | (3,612,548) |
| 其他                             | -             | -                     | -              | 1               | -               | -               | -                 | -                       | -                       | -                | 1           | -         | 1           |
| <b>於 2021 年 6 月 30 日(未經審計)</b> | 9,076,650     | -                     | (1,231,547)    | 70,400,945      | 5,711,067       | 15,846,134      | 228,220           | (25,575)                | (281,897)               | 33,103,190       | 132,827,187 | 3,364,363 | 136,191,550 |

簡明合併權益變動表 - 續

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

|                         | 歸屬於本公司股東權益    |                       |                |                 |                 |                 |                   |                         |                         |                  | 總計          | 非控制性權益    | 權益合計        |
|-------------------------|---------------|-----------------------|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-------------------|-------------------------|-------------------------|------------------|-------------|-----------|-------------|
|                         | 股本<br>(附註 48) | 其他權益<br>工具<br>(附註 49) | 庫存股<br>(附註 50) | 資本公積<br>(附註 51) | 盈餘公積<br>(附註 51) | 一般儲備<br>(附註 51) | 公允價值儲備<br>(附註 51) | 現金流量<br>套期工具<br>(附註 51) | 外幣報表<br>折算差額<br>(附註 51) | 未分配利潤<br>(附註 52) |             |           |             |
| 於 2021 年 1 月 1 日(經審計)   | 9,076,650     | -                     | (1,626,546)    | 70,750,052      | 5,711,067       | 15,792,946      | 605,917           | (34,348)                | (202,856)               | 28,998,618       | 129,071,500 | 3,240,535 | 132,312,035 |
| <b>本年權益變動</b>           |               |                       |                |                 |                 |                 |                   |                         |                         |                  |             |           |             |
| 本年利潤                    | -             | -                     | -              | -               | -               | -               | -                 | -                       | -                       | 13,346,106       | 13,346,106  | 254,787   | 13,600,893  |
| 其他綜合收益                  | -             | -                     | -              | -               | -               | -               | (383,217)         | 20,164                  | (222,925)               | -                | (585,978)   | (40,106)  | (626,084)   |
| 綜合收益總額                  | -             | -                     | -              | -               | -               | -               | (383,217)         | 20,164                  | (222,925)               | 13,346,106       | 12,760,128  | 214,681   | 12,974,809  |
| 發行永續債                   | -             | 9,996,425             | -              | -               | -               | -               | -                 | -                       | -                       | -                | 9,996,425   | -         | 9,996,425   |
| 以權益結算的股份支付              | -             | -                     | 443,963        | (235,027)       | -               | -               | -                 | -                       | -                       | -                | 208,936     | 43,893    | 252,829     |
| 非控股股東注資                 | -             | -                     | -              | 47,327          | -               | -               | -                 | -                       | -                       | -                | 47,327      | 113,865   | 161,192     |
| 回購股份                    | -             | -                     | (48,964)       | -               | -               | -               | -                 | -                       | -                       | -                | (48,964)    | -         | (48,964)    |
| 提取盈餘公積                  | -             | -                     | -              | -               | 858,855         | -               | -                 | -                       | -                       | (858,855)        | -           | -         | -           |
| 提取一般儲備                  | -             | -                     | -              | -               | -               | 2,313,098       | -                 | -                       | -                       | (2,313,098)      | -           | -         | -           |
| 本年宣派股利                  | -             | -                     | -              | -               | -               | -               | -                 | -                       | -                       | (3,612,549)      | (3,612,549) | -         | (3,612,549) |
| 其他綜合收益結轉留存收益            | -             | -                     | -              | -               | -               | -               | 443               | -                       | -                       | (443)            | -           | -         | -           |
| 其他                      | -             | -                     | -              | 7               | -               | -               | -                 | -                       | -                       | -                | 7           | -         | 7           |
| 於 2021 年 12 月 31 日(經審計) | 9,076,650     | 9,996,425             | (1,231,547)    | 70,562,359      | 6,569,922       | 18,106,044      | 223,143           | (14,184)                | (425,781)               | 35,559,779       | 148,422,810 | 3,612,974 | 152,035,784 |

刊載於第 13 至 95 頁的財務報表附註為本財務報告的組成部分。



簡明合併現金流量表

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

|   | 截至 6 月 30 日止六個月 |                  |                  |
|---|-----------------|------------------|------------------|
|   | 附註              | 2022 年<br>(未經審計) | 2021 年<br>(未經審計) |
| <b>經營活動的現金流量：</b>                                       |                 |                  |                  |
| 所得稅前利潤  |                 | 6,773,996        | 10,036,901       |
| 經調整：  |                 |                  |                  |
| 利息支出  |                 | 5,373,126        | 5,237,852        |
| 分佔聯營企業及合營企業利潤   |                 | (463,473)        | (1,583,856)      |
| 折舊和攤銷支出   |                 | 727,809          | 705,826          |
| 減值轉回  |                 | (337,624)        | (193,027)        |
| 權益結算的股份支付確認的費用  |                 | 121,471          | 99,088           |
| 出售物業及設備收益   |                 | (189)            | (319)            |
| 外匯 (收益) / 損失  |                 | (881,435)        | 141,239          |
| 以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的<br>金融資產及以攤余成本計量的債權投資的<br>股利收入及利息收入 |                 | (635,732)        | (1,226,870)      |
| 終止確認以公允價值計量且其變動計入<br>其他綜合收益的金融資產的已實現<br>損失 / (收益) 淨額    |                 | 139,444          | (1,779)          |
| 終止確認以攤余成本計量的債權投資的<br>已實現收益淨額                            |                 | -                | (50,256)         |
| 以公允價值計量且其變動計入當期損益的<br>金融工具的未實現公允價值變動                    |                 | 3,768,736        | 2,086,518        |
| 衍生金融工具未實現公允價值變動   |                 | (6,052,899)      | (3,872,745)      |
| 營運資金變動前經營活動現金流量   |                 | 8,533,230        | 11,378,572       |
| 存出保證金增加   |                 | (4,763,430)      | (1,572,787)      |
| 融出資金減少 / (增加)   |                 | 13,937,116       | (25,495,891)     |
| 應收賬款、其他應收款項及預付款項增加                                      |                 | (23,815)         | (1,306,755)      |
| 買入返售金融資產減少 / (增加)                                       |                 | 2,349,832        | (774,069)        |
| 以公允價值計量且其變動計入當期損益的<br>金融工具增加                            |                 | (26,204,796)     | (12,718,799)     |
| 受限制銀行存款減少 / (增加)  |                 | 685,513          | (4,592,183)      |
| 代經紀客戶持有的現金增加  |                 | (3,663,831)      | (13,001,347)     |
| 應付經紀客戶賬款增加  |                 | 11,275,701       | 12,883,693       |
| 其他應付款項及應計費用 (減少) / 增加                                   |                 | (1,388,351)      | 11,597,497       |
| 應付職工薪酬減少  |                 | (2,026,599)      | (537,841)        |
| 賣出回購金融資產款增加 / (減少)                                      |                 | 2,579,381        | (3,289,584)      |
| 拆入資金增加  |                 | 29,310,555       | 1,301,130        |
| 經營活動所用  |                 | 30,600,506       | (26,128,364)     |
| 已付所得稅   |                 | (1,800,493)      | (2,136,302)      |
| 已付利息  |                 | (2,781,700)      | (2,266,354)      |
| 經營活動所得 / (所用) 現金淨額                                      |                 | 26,018,313       | (30,531,020)     |

簡明合併現金流量表 - 續

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

|   | 附註 | 截至 6 月 30 日止六個月    |                  |
|---|----|--------------------|------------------|
|   |    | 2022 年<br>(未經審計)   | 2021 年<br>(未經審計) |
| <b>投資活動的現金流量：</b>                                       |    |                    |                  |
| 出售物業及設備所得款項   |    | 17,573             | 3,939            |
| 聯營企業分紅所得款項  |    | 1,004,552          | 757,224          |
| 以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的<br>金融資產及以攤余成本計量的債權投資的<br>股利收入及利息收入 |    | 635,732            | 1,226,870        |
| 購買或處置以公允價值計量且其變動計入其他<br>綜合收益的金融資產的所得款項淨額                |    | 2,052,111          | 3,611,231        |
| 購買或處置以攤餘成本計量的債權投資的<br>所得款項淨額                            |    | (7,206,721)        | (3,047,003)      |
| 收回對聯營企業及合營企業的投資   |    | 96,051             | 521,699          |
| 購買子公司產生的現金流量淨額  |    | 16,309             | -                |
| 購買物業及設備、投資物業、其他無形資產及<br>其他非流動資產                         |    | (447,514)          | (417,114)        |
| 對聯營企業的投資增加  |    | (81,100)           | (147,000)        |
| 投資活動 (所用) / 所得現金淨額                                      |    | <u>(3,913,007)</u> | <u>2,509,846</u> |

簡明合併現金流量表 - 續

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

|                   | 附註 | 截至 6 月 30 日止六個月     |                   |
|-------------------|----|---------------------|-------------------|
|                   |    | 2022 年<br>(未經審計)    | 2021 年<br>(未經審計)  |
| <b>融資活動的現金流量：</b> |    |                     |                   |
| 發行短期債務工具所得款項      |    | 31,616,903          | 56,174,688        |
| 發行長期債券所得款項        |    | 12,679,939          | 43,516,419        |
| 發行永續債所得           |    | 2,698,446           | -                 |
| 銀行借款所得款項          |    | (2,752,980)         | 3,478,127         |
| 償付已發行債務工具支付的現金    |    | (56,916,128)        | (68,097,918)      |
| 已付短期債務工具利息        |    | (397,679)           | (374,575)         |
| 已付短期銀行借款利息        |    | (37,233)            | (101,946)         |
| 已付長期銀行借款利息        |    | (9,236)             | (9,995)           |
| 已付長期債券利息          |    | (2,967,286)         | (1,703,100)       |
| A 股限制性股票激勵計劃收到的現金 |    | -                   | 413,941           |
| 已付租賃負債的現金         |    | (283,104)           | (313,985)         |
| 回購股份支付的現金         |    | -                   | (48,964)          |
| 融資活動(所用)/所得現金淨額   |    | <u>(16,368,358)</u> | <u>32,932,692</u> |
| 現金及現金等價物增加淨額      |    | 5,736,948           | 4,911,518         |
| 期初現金及現金等價物        |    | 45,901,362          | 67,646,413        |
| 匯率變動的影響           |    | 1,223,020           | (161,411)         |
| 期末現金及現金等價物        | 37 | <u>52,861,330</u>   | <u>72,396,520</u> |

刊載於第 13 至 95 頁的財務報表附註為本財務報告的組成部分。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

## 1. 基本情況

华泰证券股份有限公司(「本公司」)的前身為江蘇省證券公司，經中國人民銀行批准，於 1991 年 4 月 9 日在江蘇省工商行政管理局登記註冊，註冊資本為人民幣 10 百萬元。本公司於 1999 年 12 月 21 日更名為華泰證券有限責任公司，並於 2007 年 12 月 7 日轉為股份有限公司後更名為华泰证券股份有限公司。

本公司於 2010 年 2 月 26 日公開發行人民幣普通股(A 股)784,561,275 股，並在上海證券交易所掛牌上市。

本公司於 2015 年 6 月公開發行境外上市外資股(H 股)1,562,768,800 股，並在香港聯合交易所有限公司(「香港聯交所」)掛牌上市。

本公司於 2018 年 7 月非公開發行 A 股 1,088,731,200 股。

本公司於 2019 年 6 月發售全球存托憑證(GDRs)82,515,000 份並在倫敦證券交易所上市，對應基礎 A 股股票上市數量為 825,150,000 股。

截至 2022 年 6 月 30 日，本公司註冊資本為人民幣 9,076,650,000 元，累計發行 9,076,650,000 股每股面值人民幣 1 元的股份。

本公司及子公司(以下簡稱「本集團」)主要經營範圍：證券經紀業務，證券自營，證券承銷保薦業務，證券投資諮詢，證券資產管理業務，融資融券業務，代銷金融產品業務，為期貨公司提供中間介紹業務，證券投資基金代銷，證券投資基金託管，公開募集證券投資基金管理業務，黃金等貴金屬現貨合約代理和黃金現貨合約自營業務，直接投資業務，創新投資業務，股票期權做市業務，期貨經紀業務以及中國證券監督管理委員會(「中國證監會」)批准的其他業務。

## 2. 編制基礎

簡明合併財務報表根據國際會計準則理事會頒佈的國際會計準則第34號「中期財務報告」以及《香港聯合交易所有限公司證券上市規則》附錄16中適用的披露要求編製。簡明合併財務報表於2022年8月30日批准報出。

## 3. 主要會計政策

簡明合併財務報表根據歷史成本編制，但某些金融工具則酌情以公允價值計量。

除因採用經修訂的國際財務報告準則所致變動外，本截至2022年6月30日止六個月的簡明合併財務報表採用的會計政策和計算方法與2021年度合併財務報告一致。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

### 3. 主要會計政策 - 續

#### 應用經修訂《國際財務報告準則》

於本中期期間，本集團首次採用國際會計準則理事會所頒佈的以下國際財務報告準則修訂。該等經修訂的國際財務報告準則應用於在2022年1月1日及之後編制的簡明合併財務報表：

|                   |                               |
|-------------------|-------------------------------|
| 國際財務報告準則第 3 號（修訂） | 概念框架的提述                       |
| 國際會計準則第 16 號（修訂）  | 不動產、廠房及設備：達到預定使用前的價款          |
| 國際會計準則第 37 號（修訂）  | 虧損合同 - 合同履約成本                 |
| 國際財務報告準則（修訂）      | 國際財務報告準則 2018 年至 2020 年週期年度改進 |

於本中期應用上述經修訂的國際財務報告準則不會對本集團簡明合併財務報表所載之本期及前期的財務狀況及業績和／或披露產生重大影響。

本中期合併財務報表並無包含根據國際財務報告準則編製整份財務報表要求的全部資料。然而，節選附註旨在闡釋對於2021年12月31日及截至該日止年度之合併財務報表刊發以來對本集團財務狀況及業績變化有重大影響之事件及交易。

本中期合併財務報告未經審計，但經德勤·關黃陳方會計師行按照國際審計和鑒證準則理事會頒佈的國際審閱工作準則第2410號「實體的獨立核數師對企業中期財務信息執行審閱」實施審閱。德勤·關黃陳方會計師行呈報董事會的審閱報告已於2022年8月30日簽發。

### 4. 判断与估计的使用

編製簡明合併財務報表要求管理層作出判斷、估計和假設，這些判斷、估計和假設會影響會計政策的應用以及資產、負債、收入及支出的呈報金額。由於使用了對未來的估計和假設，未來的實際結果可能與所披露的結果不同。

在編製簡明合併財務報表時，管理層在應用本集團會計政策時作出的重大判斷和估計所引致的不確定性的主要來源與編製本集團截至2021年12月31日止年度的合併財務報表時相同。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

## 5. 備金及手續費收入

|             | 截至 6 月 30 日止六個月  |                  |
|-------------|------------------|------------------|
|             | 2022 年           | 2021 年           |
| 證券經紀及諮詢業務收入 | 4,699,482        | 4,802,969        |
| 資產管理業務收入    | 2,660,549        | 2,069,298        |
| 承銷及保薦業務收入   | 1,580,415        | 1,766,705        |
| 期貨經紀業務收入    | 751,103          | 939,960          |
| 財務顧問業務收入    | 142,979          | 174,302          |
| 其他備金收入      | 96,594           | 80,947           |
| 總計          | <u>9,931,122</u> | <u>9,834,181</u> |

## 6. 利息收入

|                                  | 截至 6 月 30 日止六個月  |                  |
|----------------------------------|------------------|------------------|
|                                  | 2022 年           | 2021 年           |
| 融資融券利息收入                         | 3,930,960        | 4,355,751        |
| 金融機構利息收入                         | 1,914,084        | 1,926,523        |
| 以攤余成本計量的債權投資利息收入                 | 486,456          | 482,891          |
| 以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益<br>的債務工具利息收入 | 149,276          | 125,109          |
| 股票質押式回購利息收入                      | 134,769          | 188,777          |
| 其他買入返售金融資產利息收入                   | 134,593          | 68,689           |
| 其他                               | 8,338            | 1,065            |
| 總計                               | <u>6,758,476</u> | <u>7,148,805</u> |



簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

## 7. 投資收益淨額

|                        | 截至 6 月 30 日止六個月  |                  |
|------------------------|------------------|------------------|
|                        | 2022 年           | 2021 年           |
| 以公允價值計量且其變動計入當期損益的     |                  |                  |
| 金融工具的股利收入及利息收入         | 4,330,578        | 4,330,530        |
| 處置聯營企業實現的淨損失           | (504)            | -                |
| 以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的   |                  |                  |
| 權益工具的股利收入              | -                | 618,870          |
| 出售以公允價值計量且其變動計入當期損益的   |                  |                  |
| 金融工具的已實現(損失)/收益        | (11,052,860)     | 11,097,226       |
| 出售以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益  |                  |                  |
| 的債務工具的已實現(損失)/收益       | (139,444)        | 1,779            |
| 終止確認以攤余成本計量的債權投資的      |                  |                  |
| 已實現收益淨額 <sup>(1)</sup> | -                | 50,256           |
| 出售衍生金融工具的已實現收益/(損失)淨額  | 7,139,552        | (11,249,575)     |
| 衍生金融工具未實現公允價值變動        | 7,245,845        | 4,428,873        |
| 以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融工  |                  |                  |
| 具的未實現公允價值變動            | (3,768,736)      | (2,086,518)      |
| 總計                     | <u>3,754,431</u> | <u>7,191,441</u> |

- (1) 截至 2021 年 6 月 30 日止期間，本集團出售部分以攤余成本計量的債權投資。該等金融資產由於信用等級下降，不再滿足集團投資政策而被出售（截至 2022 年 6 月 30 日止期間：人民幣零元）。

## 8. 其他收入及收益

|                     | 截至 6 月 30 日止六個月  |                |
|---------------------|------------------|----------------|
|                     | 2022 年           | 2021 年         |
| 貿易銷售收入              | 1,942,967        | 416,260        |
| 政府補助 <sup>(1)</sup> | 113,650          | 74,336         |
| 租賃收入                | 38,370           | 25,607         |
| 出售物業及設備的收益          | 189              | 319            |
| 匯兌收益/(損失)           | 881,435          | (141,239)      |
| 其他                  | 58,382           | 65,819         |
| 總計                  | <u>3,034,993</u> | <u>441,102</u> |

- (1) 本集團從所在當地政府收取無附帶條件的政府補助。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

9. 備金及手續費支出

|             | 截至 6 月 30 日止六個月  |                  |
|-------------|------------------|------------------|
|             | 2022 年           | 2021 年           |
| 證券經紀及諮詢業務支出 | 1,379,549        | 1,506,340        |
| 資產管理業務支出    | 538,763          | 467,980          |
| 期貨經紀業務支出    | 450,155          | 629,325          |
| 承銷與保薦業務支出   | 31,400           | 122,750          |
| 財務顧問業務支出    | 1,416            | 360              |
| 其他備金支出      | 941              | 987              |
| 總計          | <u>2,402,224</u> | <u>2,727,742</u> |

10. 利息支出

|                | 截至 6 月 30 日止六個月  |                  |
|----------------|------------------|------------------|
|                | 2022 年           | 2021 年           |
| 長期債券利息支出       | 2,322,531        | 2,048,071        |
| 賣出回購金融資產款利息支出  | 1,265,259        | 1,454,027        |
| 拆入資金利息支出       | 944,405          | 832,610          |
| 已發行的短期債務工具利息支出 | 476,806          | 450,383          |
| 應付經紀客戶賬款利息支出   | 222,246          | 276,181          |
| 租賃負債利息支出       | 39,455           | 28,285           |
| 短期銀行借款利息支出     | 37,484           | 87,610           |
| 長期銀行借款利息支出     | 9,236            | 9,995            |
| 其他             | 55,704           | 50,690           |
| 總計             | <u>5,373,126</u> | <u>5,237,852</u> |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

## 11. 僱員成本

|              | 截至 6 月 30 日止六個月  |                  |
|--------------|------------------|------------------|
|              | 2022 年           | 2021 年           |
| 工資、獎金及津貼     | 3,542,926        | 4,854,612        |
| 退休金計劃供款      | 442,099          | 352,833          |
| 以權益結算的股份支付費用 | 121,471          | 99,088           |
| 其他社會福利       | 521,526          | 378,026          |
| 總計           | <u>4,628,022</u> | <u>5,684,559</u> |

本集團中國境內僱員參與政府機關組織及管理的社會福利計劃，包括退休金、醫療、住房及其他福利待遇。根據相關法規，本集團定期向勞動和社會福利機關支付須承擔的保險費和福利供款。該等社會保障計劃為設定提存計劃，計劃供款於產生時計入開支。本集團亦根據強制性公積金計劃條例就全部香港合資格僱員營運強制性公積金計劃。

## 12. 折舊和攤銷費用

|                 | 截至 6 月 30 日止六個月 |                |
|-----------------|-----------------|----------------|
|                 | 2022 年          | 2021 年         |
| 土地使用權和其他無形資產攤銷  | 199,475         | 248,073        |
| 物業及設備折舊         |                 |                |
| - 使用權資產         | 245,316         | 215,543        |
| - 其他物業及設備       | 221,455         | 183,901        |
| 租賃物業改良和長期遞延支出攤銷 | 55,003          | 50,564         |
| 投資物業折舊          | 6,560           | 7,745          |
| 總計              | <u>727,809</u>  | <u>705,826</u> |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

### 13. 其他營業支出

|           | 截至 6 月 30 日止六個月  |                  |
|-----------|------------------|------------------|
|           | 2022 年           | 2021 年           |
| 貿易銷售成本    | 1,957,805        | 413,314          |
| 信息技術費     | 949,388          | 296,068          |
| 交易所費用     | 231,527          | 136,364          |
| 業務宣傳費     | 184,146          | 142,369          |
| 諮詢費       | 169,860          | 132,639          |
| 郵電及通訊支出   | 117,484          | 79,036           |
| 證券投資者保護基金 | 52,538           | 62,689           |
| 產品代銷支出    | 33,901           | 66,284           |
| 水電費       | 25,893           | 22,946           |
| 租賃支出      | 21,469           | 28,834           |
| 核數師薪酬     | 10,813           | 8,036            |
| 其他        | 514,990          | 501,073          |
| 總計        | <u>4,269,814</u> | <u>1,889,652</u> |

### 14. 金融資產減值轉回

|                                  | 截至 6 月 30 日止六個月  |                  |
|----------------------------------|------------------|------------------|
|                                  | 2022 年           | 2021 年           |
| 買入返售金融資產減值損失 / (轉回)              | 56,015           | (174,688)        |
| 其他應收款項及預付款項減值損失                  | 6,755            | 69,412           |
| 以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的<br>金融資產減值轉回 | (57,345)         | (1,095)          |
| 應收賬款減值轉回                         | (1,768)          | (16,474)         |
| 融出資金減值轉回                         | (341,256)        | (84,327)         |
| 現金及銀行結餘減值 (轉回) / 損失              | (592)            | 4,617            |
| 以攤余成本計量的債權投資的減值損失                | 567              | 9,528            |
| 總計                               | <u>(337,624)</u> | <u>(193,027)</u> |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

**15. 所得稅費用**

**(a) 合併收益表所列稅項指：**

|             | 截至 6 月 30 日止六個月  |                  |
|-------------|------------------|------------------|
|             | 2022 年           | 2021 年           |
| 当期所得稅項      |                  |                  |
| - 大陸        | 1,303,574        | 1,104,876        |
| - 香港        | 54,899           | 96,159           |
| - 境外        | 96,608           | 57,658           |
|             | <u>1,455,081</u> | <u>1,258,693</u> |
| 就過往年度調整     |                  |                  |
| - 大陸        | 26,077           | 15,526           |
| - 香港        | -                | -                |
|             | <u>26,077</u>    | <u>15,526</u>    |
| 遞延稅項        |                  |                  |
| 暫時性差異的產生及轉回 | (259,301)        | 875,898          |
| 總計          | <u>1,221,857</u> | <u>2,150,117</u> |

- (1) 根據 2008 年 1 月 1 日生效的中國企業所得稅(「企業所得稅」)法，本公司及本集團大陸子公司須按法定稅率 25% 繳納企業所得稅。
- (2) 按估計應課稅利潤 16.5% 的稅率撥備香港利得稅。美國子公司的聯邦所得稅按 21% 的稅率繳納，而美國的州稅則按適用的地方稅率徵收。

**(b) 按相關稅率計算的所得稅費用與會計利潤的對賬如下：**

|                        | 截至 6 月 30 日止六個月  |                  |
|------------------------|------------------|------------------|
|                        | 2022 年           | 2021 年           |
| 所得稅前利潤                 | 6,773,996        | 10,036,901       |
| 按中國法定稅率計算的稅項           | 1,693,499        | 2,509,225        |
| 子公司稅率差別的影響             | (210,725)        | (29,832)         |
| 不可抵扣支出的稅務影響            | 132,916          | 56,747           |
| 動用前期未確認遞延所得稅資產的稅務虧損的影響 | (30,905)         | (30,605)         |
| 非應課稅收入的稅務影響            | (388,480)        | (368,639)        |
| 就以前年度調整                | 26,077           | 15,526           |
| 其他                     | (525)            | (2,305)          |
| 本期所得稅費用總額              | <u>1,221,857</u> | <u>2,150,117</u> |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

## 16. 每股基本及稀釋盈利

### (1) 每股基本盈利

每股基本盈利以本公司股東應佔利潤除以已發行普通股加權平均數計算：

|                         | 附註  | 截至 6 月 30 日止六個月 |           |
|-------------------------|-----|-----------------|-----------|
|                         |     | 2022 年          | 2021 年    |
| 本公司股東應佔利潤 (調節後) (人民幣千元) | (a) | 5,179,599       | 7,752,113 |
| 已發行普通股加權平均數 (千股)        | (b) | 8,985,884       | 8,986,002 |
| 股東應佔每股基本盈利 (每股人民幣元)     |     | 0.58            | 0.86      |

### (a) 本公司股東應佔利潤 (調節後) (人民幣千元)

|                             | 截至 6 月 30 日止六個月 |           |
|-----------------------------|-----------------|-----------|
|                             | 2022 年          | 2021 年    |
| 本公司股東應佔利潤                   | 5,375,208       | 7,770,308 |
| 限制性股票激勵計劃股利                 | (19,992)        | (18,195)  |
| 歸屬於永續債持有人的股息 <sup>(i)</sup> | (175,617)       | -         |
| 本公司股東應佔利潤 (調節後)             | 5,179,599       | 7,752,113 |

(i) 本公司在計算截至 2022 年 6 月 30 日止的六個月期間基本每股收益時，將歸屬於永續債持有人的股息共計人民幣 176 百萬元從本公司股東應佔利潤中予以扣除（截至 2021 年 6 月 30 日止的六個月期間：不適用）。

### (b) 普通股加權平均數 (千股)

|             | 截至 6 月 30 日止六個月 |           |
|-------------|-----------------|-----------|
|             | 2022 年          | 2021 年    |
| 期初普通股股數     | 9,076,650       | 9,076,650 |
| 普通股加權平均數的減少 | (90,766)        | (90,648)  |
| 普通股加權平均數    | 8,985,884       | 8,986,002 |



簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

16. 每股基本及稀釋盈利 - 續

(2) 每股稀釋盈利

每股稀釋盈利以本公司股東應佔利潤(稀釋)除以已發行普通股加權平均數(稀釋)計算：

|                    | 附註  | 截至 6 月 30 日止六個月 |           |
|--------------------|-----|-----------------|-----------|
|                    |     | 2022 年          | 2021 年    |
| 本公司普通股股東應佔利潤(稀釋)   | (a) | 5,068,403       | 7,694,514 |
| 已發行普通股加權平均數(千股)    | (b) | 8,985,884       | 8,987,069 |
| 股東應佔每股稀釋盈利(每股人民幣元) |     | 0.56            | 0.86      |

(a) 本公司股東應佔利潤(稀釋)計算：

|   | 截至 6 月 30 日止六個月 |           |
|---|-----------------|-----------|
|   | 2022 年          | 2021 年    |
| 本公司股東應佔淨利潤(調整後)                                   | 5,179,599       | 7,752,113 |
| 稀釋調整：   |                 |           |
| A 股限制性股票激勵計畫宣佈的股息的影響 <sup>(i)</sup>               | -               | 18,195    |
| 聯營企業可轉換公司債券的影響 <sup>(ii)</sup>                    | (111,054)       | (75,721)  |
| 假定子公司員工股權激勵計劃的<br>股份數全部轉換為子公司普通股 <sup>(iii)</sup> | (142)           | (73)      |
| 歸屬於本公司普通股股東的合併淨利潤(稀釋)                             | 5,068,403       | 7,694,514 |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

**16. 每股基本及稀釋盈利 - 續**

**(2) 每股稀釋盈利 - 續**

**(a) 本公司股東應佔利潤(稀釋)計算:**

- (i) 於 2021 年，本公司授予了部分員工 A 股限制性股票激勵計畫。攤薄每股收益應考慮到當期分配給預期達到解禁條件的限售股股東的現金股利的影響和預計將解禁的限售股數量。考慮到上述影響後，限制性股票激勵計畫具有抗稀釋效應，並將其排除在截至 2022 年 6 月 30 日期間的攤薄每股收益計算之外。
- (ii) 於 2019 年，本公司的聯營公司江蘇銀行股份有限公司(「江蘇銀行」)發行了可轉換公司債券。稀釋每股收益考慮該可轉換債券全部轉換為普通股對歸屬於本公司合併淨利潤的潛在影響。
- (iii) 為 AssetMark Financial Holdings, Inc.(「AssetMark」)股權激勵計劃產生的稀釋效應。

**(b) 本公司已發行普通股加權平均數(稀釋)計算:**

|               | 截至 6 月 30 日止六個月  |                  |
|---------------|------------------|------------------|
|               | 2022 年           | 2021 年           |
| 期末普通股加權平均數    | 8,985,884        | 8,986,002        |
| 稀釋調整:         |                  |                  |
| 股份獎勵計劃項下的獎勵股份 | -                | 1,067            |
| 普通股加權平均數(稀釋)  | <u>8,985,884</u> | <u>8,987,069</u> |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

17. 物業及設備

|                         | 樓宇                 | 汽車               | 電子設備             | 傢具及<br>固定裝置      | 在建工程           | 使用權<br>資產        | 總計                 |
|-------------------------|--------------------|------------------|------------------|------------------|----------------|------------------|--------------------|
| <b>成本</b>               |                    |                  |                  |                  |                |                  |                    |
| 2022 年 1 月 1 日          | 3,910,449          | 151,202          | 1,711,037        | 348,516          | 96,059         | 2,054,590        | 8,271,853          |
| 添置                      | 1,093              | 21,254           | 38,791           | 42,076           | 52,708         | 487,477          | 643,399            |
| 本期轉出                    | -                  | 723              | 22               | 345              | (10,737)       | -                | (9,647)            |
| 自投資物業轉入                 | 55,447             | -                | -                | -                | -              | -                | 55,447             |
| 收購子公司                   | 656,612            | -                | -                | 4                | -              | -                | 656,616            |
| 處置                      | (185)              | (10,610)         | (117,065)        | (8,033)          | -              | (202,470)        | (338,363)          |
| 自投資物業轉出                 | (565)              | -                | -                | -                | -              | -                | (565)              |
| 2022 年 6 月 30 日         | <u>4,622,851</u>   | <u>162,569</u>   | <u>1,632,785</u> | <u>382,908</u>   | <u>138,030</u> | <u>2,339,597</u> | <u>9,278,740</u>   |
| <b>累計折舊</b>             |                    |                  |                  |                  |                |                  |                    |
| 2022 年 1 月 1 日          | (1,014,410)        | (110,198)        | (803,768)        | (243,106)        | -              | (922,149)        | (3,093,631)        |
| 本期計提                    | (62,461)           | (4,225)          | (136,063)        | (18,706)         | -              | (245,316)        | (466,771)          |
| 自投資物業轉入                 | (1,739)            | -                | -                | -                | -              | -                | (1,739)            |
| 處置                      | -                  | 9,839            | 102,128          | 6,542            | -              | 195,470          | 313,979            |
| 自投資物業轉出                 | 369                | -                | -                | -                | -              | -                | 369                |
| 2022 年 6 月 30 日         | <u>(1,078,241)</u> | <u>(104,584)</u> | <u>(837,703)</u> | <u>(255,270)</u> | <u>-</u>       | <u>(971,995)</u> | <u>(3,247,793)</u> |
| <b>賬面價值</b>             |                    |                  |                  |                  |                |                  |                    |
| 2022 年 6 月 30 日         | <u>3,544,610</u>   | <u>57,985</u>    | <u>795,082</u>   | <u>127,638</u>   | <u>138,030</u> | <u>1,367,602</u> | <u>6,030,947</u>   |
| <b>2021 年 12 月 31 日</b> |                    |                  |                  |                  |                |                  |                    |
|                         | 樓宇                 | 汽車               | 電子設備             | 傢具及<br>固定裝置      | 在建工程           | 使用權<br>資產        | 總計                 |
| <b>成本</b>               |                    |                  |                  |                  |                |                  |                    |
| 2021 年 1 月 1 日          | 3,778,317          | 153,956          | 1,393,319        | 288,254          | 36,551         | 1,797,496        | 7,447,893          |
| 添置                      | -                  | 1,640            | 394,584          | 66,158           | 141,329        | 425,077          | 1,028,788          |
| 年內轉出                    | -                  | -                | 959              | 3,529            | (81,821)       | -                | (77,333)           |
| 自投資物業轉入                 | 142,890            | -                | -                | -                | -              | -                | 142,890            |
| 處置                      | -                  | (4,394)          | (77,825)         | (9,425)          | -              | (167,983)        | (259,627)          |
| 自投資物業轉出                 | (10,758)           | -                | -                | -                | -              | -                | (10,758)           |
| 2021 年 12 月 31 日        | <u>3,910,449</u>   | <u>151,202</u>   | <u>1,711,037</u> | <u>348,516</u>   | <u>96,059</u>  | <u>2,054,590</u> | <u>8,271,853</u>   |
| <b>累計折舊</b>             |                    |                  |                  |                  |                |                  |                    |
| 2021 年 1 月 1 日          | (871,680)          | (106,561)        | (663,130)        | (193,919)        | -              | (598,519)        | (2,433,809)        |
| 年內計提                    | (109,919)          | (7,901)          | (214,463)        | (56,828)         | -              | (462,505)        | (851,616)          |
| 自投資物業轉入                 | (38,154)           | -                | -                | -                | -              | -                | (38,154)           |
| 處置                      | -                  | 4,264            | 73,825           | 7,641            | -              | 138,875          | 224,605            |
| 自投資物業轉出                 | 5,343              | -                | -                | -                | -              | -                | 5,343              |
| 2021 年 12 月 31 日        | <u>(1,014,410)</u> | <u>(110,198)</u> | <u>(803,768)</u> | <u>(243,106)</u> | <u>-</u>       | <u>(922,149)</u> | <u>(3,093,631)</u> |
| <b>賬面價值</b>             |                    |                  |                  |                  |                |                  |                    |
| 2021 年 12 月 31 日        | <u>2,896,039</u>   | <u>41,004</u>    | <u>907,269</u>   | <u>105,410</u>   | <u>96,059</u>  | <u>1,132,441</u> | <u>5,178,222</u>   |

於 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，本集團樓宇中賬面價值為人民幣 43.03 百萬元和人民幣 44.40 百萬元的土地或房產權證有待取得。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

**18. 商譽**

**成本**

|                 |                  |
|-----------------|------------------|
| 2022 年 1 月 1 日  | 2,836,429        |
| 商業合併取得          | -                |
| 匯率變動的影響         | 148,099          |
| 2022 年 6 月 30 日 | <u>2,984,528</u> |

**減值損失準備**

|                 |          |
|-----------------|----------|
| 2022 年 1 月 1 日  | -        |
| 減值損失準備          | -        |
| 2022 年 6 月 30 日 | <u>-</u> |

**賬面價值**

|                 |                  |
|-----------------|------------------|
| 2022 年 1 月 1 日  | <u>2,836,429</u> |
| 2022 年 6 月 30 日 | <u>2,984,528</u> |

**成本**

|                  |                  |
|------------------|------------------|
| 2021 年 1 月 1 日   | 2,260,945        |
| 商業合併取得           | 633,975          |
| 匯率變動的影響          | (58,491)         |
| 2021 年 12 月 31 日 | <u>2,836,429</u> |

**減值損失準備**

|                  |          |
|------------------|----------|
| 2021 年 1 月 1 日   | -        |
| 減值損失準備           | -        |
| 2021 年 12 月 31 日 | <u>-</u> |

**賬面價值**

|                  |                  |
|------------------|------------------|
| 2021 年 1 月 1 日   | <u>2,260,945</u> |
| 2021 年 12 月 31 日 | <u>2,836,429</u> |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

19. 土地使用權及其他無形資產

|                  | 土地使用權            | 與現有經紀商的關係        | 與現有客戶的關係       | 商標               | 軟件及其他              | 總計                 |
|------------------|------------------|------------------|----------------|------------------|--------------------|--------------------|
| <b>成本</b>        |                  |                  |                |                  |                    |                    |
| 2022 年 1 月 1 日   | 1,768,330        | 3,636,197        | 202,009        | 312,824          | 3,298,487          | 9,217,847          |
| 添置               | -                | -                | -              | -                | 246,320            | 246,320            |
| 處置               | -                | -                | -              | -                | (57)               | (57)               |
| 外幣報表折算差額         | -                | 135,144          | 7,508          | 11,022           | 90,116             | 243,790            |
| 2022 年 6 月 30 日  | <u>1,768,330</u> | <u>3,771,341</u> | <u>209,517</u> | <u>323,846</u>   | <u>3,634,866</u>   | <u>9,707,900</u>   |
| <b>累計攤銷</b>      |                  |                  |                |                  |                    |                    |
| 2022 年 1 月 1 日   | (117,114)        | -                | -              | (131,462)        | (2,178,598)        | (2,427,174)        |
| 本期計提             | (20,886)         | -                | -              | (20,507)         | (158,082)          | (199,475)          |
| 處置               | -                | -                | -              | -                | 57                 | 57                 |
| 外幣報表折算差額         | -                | -                | -              | (4,711)          | (28,824)           | (33,535)           |
| 2022 年 6 月 30 日  | <u>(138,000)</u> | <u>-</u>         | <u>-</u>       | <u>(156,680)</u> | <u>(2,365,447)</u> | <u>(2,660,127)</u> |
| <b>賬面價值</b>      |                  |                  |                |                  |                    |                    |
| 2022 年 6 月 30 日  | <u>1,630,330</u> | <u>3,771,341</u> | <u>209,517</u> | <u>167,166</u>   | <u>1,269,419</u>   | <u>7,047,773</u>   |
| <b>成本</b>        |                  |                  |                |                  |                    |                    |
| 2021 年 1 月 1 日   | 362,281          | 3,738,930        | -              | 300,370          | 2,846,622          | 7,248,203          |
| 收購子公司            | -                | -                | 207,716        | 20,707           | 167,596            | 396,019            |
| 添置               | 1,406,049        | -                | -              | -                | 324,973            | 1,731,022          |
| 處置               | -                | -                | -              | -                | (1,667)            | (1,667)            |
| 外幣報表折算差額         | -                | (102,733)        | (5,707)        | (8,253)          | (39,037)           | (155,730)          |
| 2021 年 12 月 31 日 | <u>1,768,330</u> | <u>3,636,197</u> | <u>202,009</u> | <u>312,824</u>   | <u>3,298,487</u>   | <u>9,217,847</u>   |
| <b>累計攤銷</b>      |                  |                  |                |                  |                    |                    |
| 2021 年 1 月 1 日   | (92,622)         | -                | -              | (87,012)         | (1,792,500)        | (1,972,134)        |
| 年內計提             | (24,492)         | -                | -              | (46,907)         | (405,762)          | (477,161)          |
| 處置               | -                | -                | -              | -                | 1,666              | 1,666              |
| 外幣報表折算差額         | -                | -                | -              | 2,457            | 17,998             | 20,455             |
| 2021 年 12 月 31 日 | <u>(117,114)</u> | <u>-</u>         | <u>-</u>       | <u>(131,462)</u> | <u>(2,178,598)</u> | <u>(2,427,174)</u> |
| <b>賬面價值</b>      |                  |                  |                |                  |                    |                    |
| 2021 年 12 月 31 日 | <u>1,651,216</u> | <u>3,636,197</u> | <u>202,009</u> | <u>181,362</u>   | <u>1,119,889</u>   | <u>6,790,673</u>   |

本集團無法預見與現有經紀商及現有客戶的關係為企業帶來的經濟利益期限，將該項無形資產視為使用壽命不確定且不攤銷的無形資產。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

## 20. 聯營企業權益

|        | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| 分佔資產淨值 | <u>17,667,964</u>  | <u>18,269,459</u>   |

於 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，本集團向中國證券金融股份有限公司 ("證金公司") 質押賬面價值總值分別為人民幣 4,313 百萬元和人民幣 4,133 百萬元的聯營企業股份以進行轉融通業務。

下表僅載列重大聯營企業詳情，除江蘇銀行在上海證券交易所上市外，其餘公司均為非上市企業實體，無法獲得其市場報價。

| 聯營企業名稱                            | 註冊地點 | 註冊資本                    |                          | 所有權權益百分比                  |                           |                           | 主要業務 |
|-----------------------------------|------|-------------------------|--------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|------|
|                                   |      |                         |                          | 本集團<br>實際權益               | 本公司<br>所持權益               | 子公司<br>所持權益               |      |
|                                   |      |                         |                          | 2022/6/30 &<br>2021/12/31 | 2022/6/30 &<br>2021/12/31 | 2022/6/30 &<br>2021/12/31 |      |
| 江蘇銀行 <sup>(1)</sup>               | 南京   | 2022/6/30<br>14,769,647 | 2021/12/31<br>14,769,628 | 5.63%                     | 5.63%                     | -                         | 商業銀行 |
| 南方基金管理股份有限公司                      | 深圳   | 361,720                 | 361,720                  | 41.16%                    | 41.16%                    | -                         | 基金管理 |
| 南京華泰瑞聯並購基金一號(有限合夥) <sup>(2)</sup> | 南京   | 5,442,000               | 5,442,000                | 48.27%                    | -                         | 48.27%                    | 股權投資 |

所有上述聯營企業均使用權益法於合併財務報表列賬。

- 於 2022 年 6 月 30 日止六個月期間，本公司在江蘇銀行董事會中派有一名董事，且本公司通過派出的董事參與江蘇銀行的財務和經營政策的制定，從而繼續實施對江蘇銀行的重大影響，因此確認為聯營企業權益按權益法核算。截至 2022 年 6 月 30 日，江蘇銀行將發行的人民幣 803 千元蘇銀轉債轉為 113,154 股普通股，占蘇銀轉債轉股前江蘇銀行已發行普通股股份總額的 0.0010%，本公司持有的江蘇銀行股權比例由 5.63318% 變更為 5.63317%。
- 截至 2022 年 6 月 30 日，本集團持有南京華泰瑞聯並購基金一號 (有限合夥) 48.27% 的股權。根據該有限合夥基金的合夥協議，本集團為該有限合夥基金的共同管理人，對該有限合夥基金具有重大影響，故將其作為本集團的聯營企業核算。



簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

21. 合營企業權益

|                       | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|-----------------------|--------------------|---------------------|
| 以公允價值計量且其變動計入當期損益的    |                    |                     |
| 合營企業投資 <sup>(1)</sup> | 865,809            | 823,289             |
| 非上市合營企業投資             | 967,303            | 925,776             |
| 合計                    | <u>1,833,112</u>   | <u>1,749,065</u>    |

- (1) 本集團選擇以公允價值計量且其變動計入當期損益計量其通過華泰金融控股(香港)有限公司(本集團的全資子公司)持有的 Huatai International Greater Bay Area Investment Fund, L.P. 的投資人民幣 865.81 百萬元，原因是管理層於 2022 年 6 月 30 日按公允價值基準計量該合營企業的業績。

下表僅載列使用權益法於合併財務報表列賬的合營企業詳情，截至 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 12 月 31 日該合營企業詳情如下：

| 合營企業名稱                      | 註冊地點 | 註冊資本       | 所有權權益百分比    |             |             | 主要業務 |
|-----------------------------|------|------------|-------------|-------------|-------------|------|
|                             |      |            | 本集團<br>實際權益 | 本公司<br>所持權益 | 子公司<br>所持權益 |      |
| 華泰招商(江蘇)資本市場投資母基金<br>(有限合夥) | 南京   | 10,001,000 | 10.00%      | -           | 10.00%      | 股權投資 |

截至 2022 年 6 月 30 日，本集團持有華泰招商(江蘇)資本市場投資母基金(有限合夥)10.00% 的股權。根據該有限合夥基金的合夥協議，本集團與第三方約定分享該基金的控制權，並有權擁有該基金的淨資產。因此，本集團管理層認為本集團與第三方共同對該基金具有實際控制，故將其作為本集團的合營企業核算。

22. 以攤余成本計量的債權投資

(a) 按性質分析：

非流動

|          | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|----------|--------------------|---------------------|
| 債務證券     | 29,130,089         | 25,302,591          |
| 減：減值損失準備 | (3,056)            | (2,925)             |
| 總計       | <u>29,127,033</u>  | <u>25,299,666</u>   |

分析如下：

|           |                   |                   |
|-----------|-------------------|-------------------|
| 於香港以外地區上市 | 10,396,801        | 10,987,272        |
| 於香港以內地區上市 | 129,933           | 123,799           |
| 未上市       | 18,600,299        | 14,188,595        |
| 總計        | <u>29,127,033</u> | <u>25,299,666</u> |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

22. 以攤余成本計量的債權投資 - 續

(a) 按性質分析： - 續

流動

|          | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|----------|--------------------|---------------------|
| 債務證券     | 10,513,263         | 7,134,040           |
| 減：減值損失準備 | (12,626)           | (12,190)            |
| 總計       | <u>10,500,637</u>  | <u>7,121,850</u>    |

分析如下：

|           |                   |                  |
|-----------|-------------------|------------------|
| 於香港以外地區上市 | 3,807,679         | 3,904,501        |
| 未上市       | 6,692,958         | 3,217,349        |
| 總計        | <u>10,500,637</u> | <u>7,121,850</u> |

於 2022 年 6 月 30 日，本集團質押公允價值總值為人民幣 25,907 百萬元及賬面價值為人民幣 25,659 百萬元的以攤余成本計量的債權投資進行賣出回購業務。(於 2021 年 12 月 31 日：公允價值總值人民幣 25,841 百萬元，賬面價值人民幣 25,565 百萬元)。

(b) 減值損失準備變動分析：

|                    | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|--------------------|--------------------|---------------------|
| 期 / 年初             | 15,115             | 28,568              |
| 期 / 年內計提 / (轉回) 淨額 | 567                | (12,906)            |
| 核銷                 | -                  | (547)               |
| 期 / 年末             | <u>15,682</u>      | <u>15,115</u>       |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

23. 以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的債務工具

(a) 按性質分析：

非流動

|           | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|-----------|--------------------|---------------------|
| 債權證券      | 4,015,069          | 4,576,580           |
| 貸款及墊款     | 269,934            | 280,704             |
| 總計        | <u>4,285,003</u>   | <u>4,857,284</u>    |
| 分析如下：     |                    |                     |
| 於香港以外地區上市 | 172,302            | 957,186             |
| 於香港以內地區上市 | 1,228,300          | 1,346,510           |
| 未上市       | 2,884,401          | 2,553,588           |
| 總計        | <u>4,285,003</u>   | <u>4,857,284</u>    |

流動

|           | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|-----------|--------------------|---------------------|
| 債務證券      | 2,238,930          | 3,828,594           |
| 貸款及墊款     | 456,786            | 628,821             |
| 總計        | <u>2,695,716</u>   | <u>4,457,415</u>    |
| 分析如下：     |                    |                     |
| 於香港以外地區上市 | 1,651,908          | 2,937,220           |
| 於香港以內地區上市 | 587,022            | 858,805             |
| 未上市       | 456,786            | 661,390             |
| 總計        | <u>2,695,716</u>   | <u>4,457,415</u>    |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

23. 以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的債務工具 - 續

(a) 按性質分析: - 續

於 2022 年 6 月 30 日，本集團就向證金公司質押公允價值總值為人民幣 1,628 百萬元的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進行轉融通業務(於 2021 年 12 月 31 日: 人民幣 3,396 百萬元)。

於 2022 年 6 月 30 日，本集團質押公允價值總值為人民幣 3,877 百萬元的以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的債務工具進行賣出回購業務 (於 2021 年 12 月 31 日: 人民幣 2,408 百萬元)。

24. 以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的權益工具

(a) 按性質分析:

非流動

|                                 | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|---------------------------------|--------------------|---------------------|
| 指定為以公允價值計量且其變動計入<br>其他綜合收益的權益證券 |                    |                     |
| -非上市權益證券                        | 123,778            | 163,138             |
| 總計                              | <u>123,778</u>     | <u>163,138</u>      |
| 分析如下:                           |                    |                     |
| 非上市                             | <u>123,778</u>     | <u>163,138</u>      |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

**25. 以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產**

非流動

**(a) 按類型分析：**

|       | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|-------|--------------------|---------------------|
| 權益類證券 | 6,632,489          | 6,487,136           |
| 債務證券  | -                  | 219,793             |
| 理財產品  | 32,753             | 96,888              |
| 基金    | 348,222            | 177,098             |
| 貸款及墊款 | 2,014,721          | 2,915,424           |
| 總計    | <u>9,028,185</u>   | <u>9,896,339</u>    |

**(b) 分析如下：**

|           | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|-----------|--------------------|---------------------|
| 於香港以外地區上市 | 473,090            | 822,231             |
| 未上市       | 8,555,095          | 9,074,108           |
| 總計        | <u>9,028,185</u>   | <u>9,896,339</u>    |

流動

**(a) 按類型分析：**

|       | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|-------|--------------------|---------------------|
| 債務證券  | 174,562,832        | 160,377,098         |
| 權益類證券 | 91,496,415         | 115,635,048         |
| 基金    | 94,529,490         | 49,457,647          |
| 理財產品  | 15,794,718         | 19,197,235          |
| 貸款及墊款 | 1,004,815          | 695,805             |
| 總計    | <u>377,388,270</u> | <u>345,362,833</u>  |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

25. 以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產- 續

流動 - 續

(b) 分析如下:

|           | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|-----------|--------------------|---------------------|
| 於香港以外地區上市 | 140,155,814        | 162,578,038         |
| 於香港上市     | 39,610,318         | 35,365,407          |
| 未上市       | 197,622,138        | 147,419,388         |
| 總計        | <u>377,388,270</u> | <u>345,362,833</u>  |

於 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，本集團所持禁售期基金投資分別為人民幣 260 百萬元和人民幣 177 百萬元。

於 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，本集團所持上市股權證券包括受限制股份分別約人民幣 4,802 百萬元和人民幣 3,967 百萬元。受限制股份於中國境內上市，有關該等證券可依法執行的限制禁止本集團於指定期限出售證券。該等證券的公允價值已考慮包括出售限制在內的相關特點。

本集團所持未上市權益類證券由非上市公司發行。對於所持權益的公允價值通過可比上市公司對比法確定或其他估值模型來計量。

非流動以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產投資預計將自各報告期末始一年後變現或受限制。本集團於未上市基金投資(主要投資於在中國上市的公開買賣權益類證券)的公允價值基於基金資產淨值估值，有關基金資產淨值由各基金經理參考相關資產及負債的公允價值而計算。

本集團於無限制的權益類證券投資、上市交易基金及債務證券的公允價值是參考截至報告日期的報價釐定。

於 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，本集團就向外部客戶轉讓公允價值總值分別為人民幣 4,144 百萬元和人民幣 5,156 百萬元的以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產投資與客戶訂立融券安排，不會因而終止確認金融資產。融券業務抵押品的公允價值與融資業務抵押品的公允價值分析載於附註 31(c)。

於 2021 年 12 月 31 日，本集團向證金公司質押公允價值總值為人民幣 856 百萬元的以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產投資進行轉融通業務(2022 年 6 月 30 日：零元)。



簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

## 25. 以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產 - 續

於 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，本集團質押公允價值總值分別為人民幣 105,404 百萬元和人民幣 110,282 百萬元的以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產投資進行賣出回購、債券借貸及衍生品業務。

於 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，本集團所持有理財產品包括受限制產品約人民幣 193 百萬元和人民幣 105 百萬元。本集團以管理人身份認購該等產品，有關該等產品可依法執行的限制禁止本集團於指定期限出售產品。

## 26. 存出保證金

|                  | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|------------------|--------------------|---------------------|
| 於證券交易所的保證金       |                    |                     |
| - 香港中央結算有限公司     | 5,153,268          | 3,117,411           |
| - 中國證券登記結算有限責任公司 | 951,107            | 954,971             |
| - 香港聯合交易所        | 3,473              | 1,495               |
| - 香港交易及結算所有限公司   | -                  | 1,226               |
|                  | <u>6,107,848</u>   | <u>4,075,103</u>    |
| 於期貨及商品交易所的保證金    |                    |                     |
| - 中國金融期貨交易所      | 9,321,518          | 12,116,762          |
| - 上海期貨交易所        | 5,736,064          | 3,523,566           |
| - 大連商品交易所        | 4,337,464          | 2,955,805           |
| - 鄭州商品交易所        | 3,049,722          | 2,210,118           |
| - 上海國際能源交易中心     | 1,459,691          | 503,373             |
| - 境外期貨交易所        | 43,531             | 34,945              |
|                  | <u>23,947,990</u>  | <u>21,344,569</u>   |
| 於其他機構的保證金        |                    |                     |
| - 中國證券金融股份有限公司   | 1,339,233          | 1,626,444           |
| - 上海清算所          | 886,179            | 456,280             |
| - 上海黃金交易所        | 400                | 400                 |
| - 其他             | 108,909            | 124,333             |
|                  | <u>2,334,721</u>   | <u>2,207,457</u>    |
| 總計               | <u>32,390,559</u>  | <u>27,627,129</u>   |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

## 27. 遞延稅項

(a) 於合併財務狀況表確認的遞延所得稅資產/(負債)組成及變動如下:

| 遞延稅項來自:          | 減值損失準備         | 應付職工薪酬           | 以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融工具公允價值變動 | 衍生金融工具公允價值變動     | 以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產公允價值變動 | 與收購中確認的無形資產        | 其他                 | 總計                 |
|------------------|----------------|------------------|------------------------------|------------------|--------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 2022 年 1 月 1 日   | 981,491        | 1,811,033        | (1,181,623)                  | 240,379          | (34,248)                       | (1,181,118)        | (2,600,424)        | (1,964,510)        |
| 於損益確認            | (71,344)       | 147,378          | 441,058                      | (592,505)        | -                              | (59,771)           | 394,485            | 259,301            |
| 收購子公司            | 298            | -                | -                            | -                | -                              | -                  | -                  | 298                |
| 於儲備確認            | -              | -                | -                            | -                | 33,275                         | -                  | (1,528)            | 31,747             |
| 2022 年 6 月 30 日  | <u>910,445</u> | <u>1,958,411</u> | <u>(740,565)</u>             | <u>(352,126)</u> | <u>(973)</u>                   | <u>(1,240,889)</u> | <u>(2,207,467)</u> | <u>(1,673,164)</u> |
| 2021 年 1 月 1 日   | 857,752        | 1,782,677        | (1,283,850)                  | 181,924          | (153,312)                      | (1,174,738)        | (2,416,598)        | (2,206,145)        |
| 於損益確認            | 123,894        | 28,356           | 102,227                      | 58,455           | -                              | 64,722             | (185,354)          | 192,300            |
| 收購子公司            | -              | -                | -                            | -                | -                              | (71,102)           | -                  | (71,102)           |
| 於儲備確認            | (155)          | -                | -                            | -                | 119,064                        | -                  | 1,528              | 120,437            |
| 2021 年 12 月 31 日 | <u>981,491</u> | <u>1,811,033</u> | <u>(1,181,623)</u>           | <u>240,379</u>   | <u>(34,248)</u>                | <u>(1,181,118)</u> | <u>(2,600,424)</u> | <u>(1,964,510)</u> |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

**27. 遞延稅項 - 續**

**(b) 合併財務狀況表對賬**

|                     | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|---------------------|--------------------|---------------------|
| 於合併財務狀況表確認的遞延稅項資產淨額 | 704,761            | 654,651             |
| 於合併財務狀況表確認的遞延稅項負債淨額 | <u>(2,377,925)</u> | <u>(2,619,161)</u>  |
| 總計                  | <u>(1,673,164)</u> | <u>(1,964,510)</u>  |

**(c) 未確認遞延所得稅資產**

由於本集團在有關稅務司法權區及有關公司很有可能存在未來應課稅盈利不足以抵銷可供動用之稅務虧損，故本集團未就 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日金額分別為人民幣 811 百萬元及人民幣 935 百萬元的累計稅務虧損確認遞延稅項資產。根據現行稅務規例，大部分稅務損失不會到期。

**28. 其他非流動資產**

**(a) 按性質分析：**

|               | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 租賃物業改良及長期遞延支出 | <u>242,827</u>     | <u>282,227</u>      |

**(b) 租賃物業裝修及長期遞延支出變動如下：**

|          | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|----------|--------------------|---------------------|
| 期 / 年初結餘 | 282,227            | 283,320             |
| 添置       | 5,956              | 41,363              |
| 自物業及設備轉入 | 9,647              | 77,333              |
| 攤銷       | (55,003)           | (88,859)            |
| 其他減少     | -                  | (30,930)            |
| 期 / 年末結餘 | <u>242,827</u>     | <u>282,227</u>      |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

## 29. 應收款項

### (a) 按性質分析：

|              | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 應收款項：        |                    |                     |
| - 收益互換及場外期權  | 4,554,306          | 5,988,041           |
| - 經紀，交易商及結算所 | 1,899,578          | 991,861             |
| - 手續費及備金     | 1,322,166          | 1,859,488           |
| - 結算款        | 1,256,985          | 444,084             |
| - 開放式基金贖回款   | 1,082,952          | 1,007,777           |
| - 申購款        | 61,954             | 1,646               |
| - 其他         | 59,363             | 92,016              |
| 減：減值損失準備     | (95,943)           | (97,739)            |
| 總計           | <u>10,141,361</u>  | <u>10,287,174</u>   |

### (b) 按賬齡分類：

於報告期末，基於交易日期的應收賬款賬齡分析如下：

|          | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|----------|--------------------|---------------------|
| 1 個月內    | 5,303,775          | 4,894,477           |
| 1 至 3 個月 | 482,163            | 711,876             |
| 3 個月以上   | 4,355,423          | 4,680,821           |
| 總計       | <u>10,141,361</u>  | <u>10,287,174</u>   |

### (c) 減值損失準備變動分析：

|                    | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|--------------------|--------------------|---------------------|
| 期 / 年初             | 97,739             | 63,300              |
| 期 / 年內 (轉回) / 計提淨額 | (1,768)            | 34,439              |
| 核銷                 | (28)               | -                   |
| 期 / 年末             | <u>95,943</u>      | <u>97,739</u>       |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

**29. 應收款項 - 續**

**(d) 未減值應收款項**

既無逾期亦無減值的應收款項與近期並無拖欠記錄的客戶有關。

應收款項餘額中未包含股票質押式回購業務。

**30. 其他應收款項，預付款項及其他流動資產**

**(a) 按性質分析：**

|                       | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|-----------------------|--------------------|---------------------|
| 其他應收款項 <sup>(1)</sup> | 744,657            | 488,998             |
| 預付賬款                  | 259,812            | 822,411             |
| 應收利息 <sup>(2)</sup>   | 72,863             | 180,664             |
| 應收股利                  | 71,126             | 23,217              |
| 可抵扣增值稅                | 39,790             | 76,308              |
| 遞延支出                  | 30,655             | 25,211              |
| 其他                    | 533,422            | 505,437             |
| 總計                    | <u>1,752,325</u>   | <u>2,122,246</u>    |

其他應收款項結餘主要指一般業務過程中產生的大宗商品以及其他預收款等。

**(1) 其他應收款項：**

|        | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| 其他應收款  | 1,514,766          | 1,254,107           |
| 減：減值損失 | <u>(770,109)</u>   | <u>(765,109)</u>    |
| 總計     | <u>744,657</u>     | <u>488,998</u>      |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

30. 其他應收款項，預付款項及其他流動資產 - 續

(a) 按性質分析： - 續

(1) 其他應收款項： - 續

其他應收款項減值損失準備變動分析：

|                    | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|--------------------|--------------------|---------------------|
| 期 / 年初             | 765,109            | 798,053             |
| 期 / 年內計提 / (轉回) 淨額 | 5,028              | (31,413)            |
| 轉銷                 | (28)               | (1,531)             |
| 期 / 年末             | <u>770,109</u>     | <u>765,109</u>      |

(2) 應收利息：

|        | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| 應收利息   | 111,188            | 217,610             |
| 減：減值損失 | (38,325)           | (36,946)            |
| 總計     | <u>72,863</u>      | <u>180,664</u>      |

應收利息減值損失準備變動分析：

|            | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 期 / 年初     | 36,946             | 34,283              |
| 期 / 年內計提淨額 | 1,727              | 2,663               |
| 核銷         | (348)              | -                   |
| 期 / 年末     | <u>38,325</u>      | <u>36,946</u>       |



簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

### 31. 融出資金

#### (a) 按性質分析：

|        | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| 個人     | 92,649,173         | 107,203,947         |
| 機構     | 12,270,267         | 11,652,609          |
| 減：減值損失 | (1,573,055)        | (1,914,311)         |
| 總計     | <u>103,346,385</u> | <u>116,942,245</u>  |

#### (b) 減值損失準備變動分析：

|                    | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|--------------------|--------------------|---------------------|
| 期 / 年初             | 1,914,311          | 1,468,251           |
| 期 / 年內 (轉回) / 計提淨額 | <u>(341,256)</u>   | <u>446,060</u>      |
| 期 / 年末             | <u>1,573,055</u>   | <u>1,914,311</u>    |

#### (c) 融資融券業務抵押品公允價值分析如下：

|          | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|----------|--------------------|---------------------|
| 抵押品公允價值： |                    |                     |
| - 權益類證券  | 360,321,880        | 409,894,030         |
| - 基金     | 29,767,745         | 38,617,145          |
| - 現金     | 18,563,430         | 17,893,342          |
| - 債務證券   | 1,337,706          | 1,103,497           |
| 總計       | <u>409,990,761</u> | <u>467,508,014</u>  |

根據管理層對每名融資融券客戶的信貸率、抵押品價值及過往還款記錄的評估，本集團對應收融資融券客戶款項的可收回性進行評估。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

**32. 買入返售金融資產**

**(a) 按抵押品分類:**

|        | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| 債務證券   | 8,684,688          | 6,489,324           |
| 權益類證券  | 6,327,989          | 6,381,423           |
| 減：減值損失 | (1,174,940)        | (1,118,777)         |
| 總計     | <u>13,837,737</u>  | <u>11,751,970</u>   |

**(b) 按市場分類:**

|         | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|---------|--------------------|---------------------|
| 上海證券交易所 | 2,844,483          | 2,311,925           |
| 深圳證券交易所 | 4,650,586          | 5,079,673           |
| 銀行同業市場  | 5,495,779          | 2,807,218           |
| 其他      | 2,021,829          | 2,671,931           |
| 減：減值損失  | (1,174,940)        | (1,118,777)         |
| 總計      | <u>13,837,737</u>  | <u>11,751,970</u>   |

**(c) 減值損失準備變動分析:**

|            | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 期 / 年初     | 1,118,777          | 1,039,412           |
| 期 / 年內計提淨額 | 56,015             | 80,513              |
| 核銷         | -                  | (1,148)             |
| 其他增加       | 148                | -                   |
| 期 / 年末     | <u>1,174,940</u>   | <u>1,118,777</u>    |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

32. 買入返售金融資產 - 續

(d) 股票質押式回購業務按剩餘期限列示:

|            | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 1 個月內      | 2,084,526          | 1,357,437           |
| 1 個月至 3 個月 | 1,846,707          | 836,464             |
| 3 個月至 1 年  | 2,396,756          | 4,187,522           |
| 減：減值損失     | (1,122,744)        | (1,069,179)         |
| 合計         | <u>5,205,245</u>   | <u>5,312,244</u>    |

(e) 股票質押式回購按預期信用損失階段列示:

|       | 2022 年 6 月 30 日    |                              |                              | 合計                |
|-------|--------------------|------------------------------|------------------------------|-------------------|
|       | 未來 12 個月<br>預期信用損失 | 整個存續期<br>預期信用損失<br>(未發生信用減值) | 整個存續期<br>預期信用損失<br>(已發生信用減值) |                   |
| 攤余成本  | 4,975,584          | 53,926                       | 1,298,479                    | 6,327,989         |
| 減值準備  | (11,791)           | (545)                        | (1,110,408)                  | (1,122,744)       |
| 賬面價值  | <u>4,963,793</u>   | <u>53,381</u>                | <u>188,071</u>               | <u>5,205,245</u>  |
| 擔保物價值 | <u>16,424,948</u>  | <u>333,030</u>               | <u>1,302,090</u>             | <u>18,060,068</u> |
|       | 2021 年 12 月 31 日   |                              |                              | 合計                |
|       | 未來 12 個月<br>預期信用損失 | 整個存續期<br>預期信用損失<br>(未發生信用減值) | 整個存續期<br>預期信用損失<br>(已發生信用減值) |                   |
| 攤余成本  | 5,250,484          | -                            | 1,130,939                    | 6,381,423         |
| 減值準備  | (12,440)           | -                            | (1,056,739)                  | (1,069,179)       |
| 賬面價值  | <u>5,238,044</u>   | <u>-</u>                     | <u>74,200</u>                | <u>5,312,244</u>  |
| 擔保物價值 | <u>20,081,029</u>  | <u>-</u>                     | <u>786,652</u>               | <u>20,867,681</u> |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

### 33. 衍生金融工具

|        | 2022 年 6 月 30 日      |                   |                     |
|--------|----------------------|-------------------|---------------------|
|        | 名義金額                 | 公允價值              |                     |
|        |                      | 資產                | 負債                  |
| 利率衍生工具 | 877,872,421          | 767,526           | (1,057,450)         |
| 貨幣衍生工具 | 93,215,092           | 745,576           | (1,222,041)         |
| 權益衍生工具 | 506,782,421          | 19,842,957        | (9,350,592)         |
| 信用衍生工具 | 2,533,521            | 127,726           | (34,123)            |
| 其他     | 116,521,620          | 2,142,280         | (2,365,978)         |
| 總計     | <u>1,596,925,075</u> | <u>23,626,065</u> | <u>(14,030,184)</u> |
| 減：結算   |                      | <u>(745,455)</u>  | <u>2,482,225</u>    |
| 淨頭寸    |                      | <u>22,880,610</u> | <u>(11,547,959)</u> |

|        | 2021 年 12 月 31 日     |                   |                     |
|--------|----------------------|-------------------|---------------------|
|        | 名義金額                 | 公允價值              |                     |
|        |                      | 資產                | 負債                  |
| 利率衍生工具 | 672,114,240          | 90,322            | (1,337,816)         |
| 貨幣衍生工具 | 53,868,333           | 479,737           | (868,927)           |
| 權益衍生工具 | 593,376,992          | 13,054,672        | (10,585,895)        |
| 信用衍生工具 | 3,648,567            | 410,318           | (68)                |
| 其他     | 88,218,718           | 1,242,478         | (809,954)           |
| 總計     | <u>1,411,226,850</u> | <u>15,277,527</u> | <u>(13,602,660)</u> |
| 減：結算   |                      | <u>(29,722)</u>   | <u>2,959,438</u>    |
| 淨頭寸    |                      | <u>15,247,805</u> | <u>(10,643,222)</u> |

在當日無負債結算制度下，本集團於上海清算所結算的利率互換合約、以及通過中國金融期貨交易所結算的股指期貨、國債期貨和通過期貨公司進行交易的商品期貨合約的持倉損益已經結算並包含在結算備付金中。因此，於 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，上述合約按抵銷後的淨額列示，為人民幣零元。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

### 33. 衍生金融工具 - 續

#### 現金流量套期

本集團的現金流量套期工具包括利率掉期，主要用於對現金流波動進行套期。

上述衍生金融工具中，本集團認定為現金流量套期的套期工具如下：

|        | 2022 年 6 月 30 日 |           |         |       |           |        |    |
|--------|-----------------|-----------|---------|-------|-----------|--------|----|
|        | 名義金額            |           |         |       |           | 公允價值   |    |
|        | 3 個月以內          | 3 個月至 1 年 | 1 至 5 年 | 5 年以上 | 總計        | 資產     | 負債 |
| 利率衍生工具 | -               | 1,342,280 | -       | -     | 1,342,280 | 10,636 | -  |

|        | 2021 年 12 月 31 日 |           |           |       |           |      |          |
|--------|------------------|-----------|-----------|-------|-----------|------|----------|
|        | 名義金額             |           |           |       |           | 公允價值 |          |
|        | 3 個月以內           | 3 個月至 1 年 | 1 至 5 年   | 5 年以上 | 總計        | 資產   | 負債       |
| 利率衍生工具 | -                | -         | 1,275,160 | -     | 1,275,160 | -    | (14,184) |

本集團在現金流量套期策略中被套期風險敞口及對權益的影響的具體資訊列示如下：

|    | 2022 年 6 月 30 日 |             |         |        |       |
|----|-----------------|-------------|---------|--------|-------|
|    | 被套期項目賬面價值       |             | 套期工具本期  | 套期工具累計 | 財務狀況表 |
|    | 資產              | 負債          | 對其他綜合收益 | 計入其他綜合 |       |
| 債券 | -               | (2,687,314) | 24,820  | 10,636 | 長期債券  |

|    | 2021 年 12 月 31 日 |             |         |          |       |
|----|------------------|-------------|---------|----------|-------|
|    | 被套期項目賬面價值        |             | 套期工具本期  | 套期工具累計   | 財務狀況表 |
|    | 資產               | 負債          | 對其他綜合收益 | 計入其他綜合   |       |
| 債券 | -                | (2,552,586) | 20,164  | (14,184) | 長期債券  |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

### 34. 結算備付金

|                  | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|------------------|--------------------|---------------------|
| 於證券交易所的備付金       |                    |                     |
| - 中國證券登記結算有限責任公司 | 5,433,142          | 8,118,615           |
| - 香港中央結算有限公司     | 43,744             | 200,287             |
| 於其他機構的備付金        | 2,407,606          | 262,039             |
| 總計               | <u>7,884,492</u>   | <u>8,580,941</u>    |

### 35. 代經紀客戶持有的現金

本集團於銀行及授權機構開設獨立存款金賬戶，以存放日常業務過程中產生的客戶款項。本集團已將經紀客戶款項分類為合併財務狀況表流動資產項目之代經紀客戶持有的現金，並在對任何損失及挪用經紀客戶款項負責的情況下，確認應付相關經紀客戶的相應賬款。在中國大陸，代經紀客戶持有的現金受中國證監會所頒佈有關第三方保證金條例的限制及規管。在香港，代經紀客戶持有的現金受證券及期貨條例下之證券及期貨（客戶款項）規則限制及規管。

### 36. 現金及銀行結餘

#### (a) 按性質分析：

|        | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| 現金     | 386                | 208                 |
| 銀行結餘   | 40,017,131         | 37,238,750          |
| 減：減值準備 | (565)              | (1,157)             |
| 總計     | <u>40,016,952</u>  | <u>37,237,801</u>   |

銀行結餘主要包括定期及活期存款 (按現行市場利率計息)。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

36. 現金及銀行結餘 - 續

(b) 減值損失準備變動分析:

|              | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 期 / 年初       | 1,157              | 1,430               |
| 期 / 年內減值轉回淨額 | <u>(592)</u>       | <u>(273)</u>        |
| 期 / 年末       | <u>565</u>         | <u>1,157</u>        |

37. 現金及現金等價物

|                           | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|---------------------------|--------------------|---------------------|
| 現金                        | 386                | 208                 |
| 銀行結餘                      | 39,990,914         | 37,203,291          |
| 結算備付金                     | 7,884,479          | 8,580,920           |
| 原定到期日三個月內的買入返售金融資產        | 8,683,590          | 4,191,977           |
| 原定到期日三個月內的債券投資            | 79,669             | 388,187             |
| 減：受限制銀行存款及原定到期日超過三個月的銀行存款 | <u>(3,777,708)</u> | <u>(4,463,221)</u>  |
| 總計                        | <u>52,861,330</u>  | <u>45,901,362</u>   |

受限制銀行存款主要包括本集團所持為資管產品代繳增值稅計提的金額、最低流動資本限制、風險儲備保證金及代理承銷證券款。

38. 短期銀行借款

|      | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|------|--------------------|---------------------|
| 信用借款 | 5,540,443          | 8,492,290           |
| 質押借款 | <u>128,284</u>     | <u>-</u>            |
| 總計   | <u>5,668,727</u>   | <u>8,492,290</u>    |

截至 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，短期借款的年利率分別為 1.65% - 2.83% 及 0.8% - 1.35%。



簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

### 39. 已發行的短期債務工具

2022 年 6 月 30 日

| 名稱        | 面值<br>原幣      | 起息日        | 到期日        | 發行金額<br>原幣    | 票面利率  |
|-----------|---------------|------------|------------|---------------|-------|
| 21 華泰 S2  | 人民幣 4,000,000 | 28/06/2021 | 28/06/2022 | 人民幣 4,000,000 | 2.95% |
| 21 華泰 S3  | 人民幣 2,000,000 | 09/07/2021 | 22/02/2022 | 人民幣 2,000,000 | 2.75% |
| 21 華泰 S4  | 人民幣 4,000,000 | 09/07/2021 | 09/07/2022 | 人民幣 4,000,000 | 2.87% |
| 21 華泰 S5  | 人民幣 3,000,000 | 19/07/2021 | 19/07/2022 | 人民幣 3,000,000 | 2.75% |
| 21 華泰 S6  | 人民幣 4,000,000 | 09/08/2021 | 11/02/2022 | 人民幣 4,000,000 | 2.55% |
| 21 華泰 S7  | 人民幣 4,000,000 | 16/08/2021 | 20/01/2022 | 人民幣 4,000,000 | 2.51% |
| 21 華泰 S9  | 人民幣 2,300,000 | 06/12/2021 | 08/06/2022 | 人民幣 2,300,000 | 2.64% |
| 21 華 S10  | 人民幣 2,700,000 | 06/12/2021 | 25/11/2022 | 人民幣 2,700,000 | 2.7%  |
| 21 華 S11  | 人民幣 2,000,000 | 13/12/2021 | 13/05/2022 | 人民幣 2,000,000 | 2.62% |
| 21 華 S12  | 人民幣 1,000,000 | 21/12/2021 | 21/09/2022 | 人民幣 1,000,000 | 2.7%  |
| 21 華 S13  | 人民幣 4,000,000 | 21/12/2021 | 21/12/2022 | 人民幣 4,000,000 | 2.75% |
| 21 華 S14  | 人民幣 4,000,000 | 29/12/2021 | 29/11/2022 | 人民幣 4,000,000 | 2.75% |
| 22 華泰 F1  | 人民幣 4,000,000 | 17/01/2022 | 17/01/2024 | 人民幣 4,000,000 | 2.75% |
| 華泰 B2203a | 美元 100,000    | 23/03/2021 | 21/03/2022 | 美元 100,000    | 0.35% |
| 華泰 B2206  | 美元 100,000    | 11/06/2021 | 09/06/2022 | 美元 100,000    | 0.70% |
| 華泰 B2203b | 港幣 300,000    | 07/12/2021 | 10/03/2022 | 港幣 300,000    | 0.55% |
| 華泰 B2203c | 美元 30,000     | 29/12/2021 | 29/03/2022 | 美元 30,000     | 0.65% |
| 華泰 B2204a | 美元 100,000    | 18/01/2022 | 18/04/2022 | 美元 100,000    | 0.65% |
| 華泰 B2204b | 美元 60,000     | 24/01/2022 | 25/04/2022 | 美元 60,000     | 0.65% |
| 華泰 B2207  | 美元 100,000    | 28/01/2022 | 28/07/2022 | 美元 100,000    | 0.80% |
| 華泰 B2205a | 美元 20,000     | 10/02/2022 | 10/05/2022 | 美元 20,000     | 1.05% |
| 華泰 B2204c | 美元 50,000     | 25/02/2022 | 25/04/2022 | 美元 50,000     | 0.70% |
| 華泰 B2212a | 美元 100,000    | 24/03/2022 | 23/12/2022 | 美元 100,000    | 1.00% |
| 華泰 B2212b | 美元 100,000    | 24/03/2022 | 23/12/2022 | 美元 100,000    | 1.00% |
| 華泰 B2212c | 美元 50,000     | 24/03/2022 | 23/12/2022 | 美元 50,000     | 1.00% |
| 華泰 B2209a | 美元 50,000     | 24/03/2022 | 23/09/2022 | 美元 50,000     | 1.65% |
| 華泰 B2209b | 美元 50,000     | 25/03/2022 | 26/09/2022 | 美元 50,000     | 0.95% |
| 華泰 B2304a | 美元 100,000    | 07/04/2022 | 06/04/2023 | 美元 100,000    | 1.50% |
| 華泰 B2304b | 美元 100,000    | 07/04/2022 | 06/04/2023 | 美元 100,000    | 1.50% |
| 華泰 B2304c | 美元 100,000    | 07/04/2022 | 06/04/2023 | 美元 100,000    | 1.50% |
| 華泰 B2209c | 美元 30,000     | 06/04/2022 | 30/09/2022 | 美元 30,000     | 1.75% |
| 華泰 B2211a | 美元 50,000     | 05/05/2022 | 04/11/2022 | 美元 50,000     | 2.04% |
| 華泰 B2211b | 美元 18,000     | 10/05/2022 | 10/11/2022 | 美元 18,000     | 2.15% |
| 華泰 B2211c | 美元 50,000     | 05/05/2022 | 04/11/2022 | 美元 50,000     | 1.75% |
| 華泰 B2208a | 美元 60,000     | 04/05/2022 | 04/08/2022 | 美元 60,000     | 1.25% |
| 華泰 B2305a | 美元 50,000     | 27/05/2022 | 25/05/2023 | 美元 50,000     | 2.85% |
| 華泰 B2302a | 美元 50,000     | 27/05/2022 | 28/02/2023 | 美元 50,000     | 2.81% |
| 華泰 B2208b | 美元 30,000     | 02/06/2022 | 31/08/2022 | 美元 30,000     | 2.00% |
| 華泰 B2208c | 美元 20,000     | 02/06/2022 | 12/08/2022 | 美元 20,000     | 1.90% |
| 華泰 B2306  | 美元 100,000    | 10/06/2022 | 08/06/2023 | 美元 100,000    | 2.86% |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

39. 已發行的短期債務工具 - 續

2022 年 6 月 30 日 - 續

| 名稱        | 面值<br>原幣       | 起息日        | 到期日        | 發行金額<br>原幣     | 票面利率  |
|-----------|----------------|------------|------------|----------------|-------|
| 華泰 B2205b | 港幣 280,000     | 10/02/2022 | 10/05/2022 | 港幣 280,000     | 1.00% |
| 華泰 B2209d | 港幣 800,000     | 01/04/2022 | 30/09/2022 | 港幣 800,000     | 0.65% |
| 華泰 B2211d | 港幣 300,000     | 10/05/2022 | 10/11/2022 | 港幣 300,000     | 1.50% |
| 華泰 B2211e | 港幣 490,000     | 13/05/2022 | 14/11/2022 | 港幣 490,000     | 1.73% |
| 華泰 B2302b | 港幣 300,000     | 13/05/2022 | 13/02/2023 | 港幣 300,000     | 2.15% |
| 收益憑證      | 人民幣 15,998,560 | 註釋(1)      | 註釋(1)      | 人民幣 15,998,560 | 註釋(1) |

| 名稱        | 2022 年<br>1 月 1 日<br>賬面價值<br>等值人民幣 | 增加<br>等值人民幣 | 減少<br>等值人民幣 | 2022 年<br>6 月 30 日<br>賬面價值<br>等值人民幣 |
|-----------|------------------------------------|-------------|-------------|-------------------------------------|
| 21 華泰 S2  | 4,059,983                          | 58,017      | (4,118,000) | -                                   |
| 21 華泰 S3  | 2,026,317                          | 8,039       | (2,034,356) | -                                   |
| 21 華泰 S4  | 4,054,931                          | 57,400      | -           | 4,112,331                           |
| 21 華泰 S5  | 3,037,258                          | 41,250      | -           | 3,078,508                           |
| 21 華泰 S6  | 4,040,306                          | 11,672      | (4,051,978) | -                                   |
| 21 華泰 S7  | 4,037,785                          | 5,401       | (4,043,186) | -                                   |
| 21 華泰 S9  | 2,304,244                          | 26,366      | (2,330,610) | -                                   |
| 21 華 S10  | 2,705,095                          | 36,450      | -           | 2,741,545                           |
| 21 華 S11  | 2,002,676                          | 19,002      | (2,021,678) | -                                   |
| 21 華 S12  | 1,000,798                          | 13,500      | -           | 1,014,298                           |
| 21 華 S13  | 4,003,253                          | 55,000      | -           | 4,058,253                           |
| 21 華 S14  | 4,000,887                          | 55,000      | -           | 4,055,887                           |
| 22 華泰 F1  | -                                  | 4,050,269   | -           | 4,050,269                           |
| 華泰 B2203a | 636,859                            | 36,617      | (673,476)   | -                                   |
| 華泰 B2206  | 639,724                            | 36,088      | (675,812)   | -                                   |
| 華泰 B2203b | 245,294                            | 11,626      | (256,920)   | -                                   |
| 華泰 B2203c | 191,212                            | 10,453      | (201,665)   | -                                   |
| 華泰 B2204a | -                                  | 672,067     | (672,067)   | -                                   |
| 華泰 B2204b | -                                  | 403,244     | (403,244)   | -                                   |
| 華泰 B2207  | -                                  | 673,132     | -           | 673,132                             |
| 華泰 B2205a | -                                  | 134,547     | (134,547)   | -                                   |
| 華泰 B2204c | -                                  | 335,879     | (335,879)   | -                                   |
| 華泰 B2212a | -                                  | 670,432     | -           | 670,432                             |
| 華泰 B2212b | -                                  | 670,388     | -           | 670,388                             |
| 華泰 B2212c | -                                  | 335,216     | -           | 335,216                             |
| 華泰 B2209a | -                                  | 336,994     | -           | 336,994                             |
| 華泰 B2209b | -                                  | 335,749     | -           | 335,749                             |
| 華泰 B2304a | -                                  | 669,043     | -           | 669,043                             |
| 華泰 B2304b | -                                  | 669,043     | -           | 669,043                             |
| 華泰 B2304c | -                                  | 669,043     | -           | 669,043                             |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

39. 已發行的短期債務工具 - 續

2022 年 6 月 30 日 - 續

| 名稱        | 2022 年<br>1 月 1 日<br>賬面價值<br>等值人民幣 | 增加<br>等值人民幣 | 減少<br>等值人民幣  | 2022 年<br>6 月 30 日<br>賬面價值<br>等值人民幣 |
|-----------|------------------------------------|-------------|--------------|-------------------------------------|
| 華泰 B2209c | -                                  | 202,050     | -            | 202,050                             |
| 華泰 B2211a | -                                  | 336,551     | -            | 336,551                             |
| 華泰 B2211b | -                                  | 121,143     | -            | 121,143                             |
| 華泰 B2211c | -                                  | 335,878     | -            | 335,878                             |
| 華泰 B2208a | -                                  | 403,211     | -            | 403,211                             |
| 華泰 B2305a | -                                  | 335,796     | -            | 335,796                             |
| 華泰 B2302a | -                                  | 336,377     | -            | 336,377                             |
| 華泰 B2208b | -                                  | 200,924     | -            | 200,924                             |
| 華泰 B2208c | -                                  | 134,393     | -            | 134,393                             |
| 華泰 B2306  | -                                  | 670,924     | -            | 670,924                             |
| 華泰 B2205b | -                                  | 240,037     | (240,037)    | -                                   |
| 華泰 B2209d | -                                  | 684,027     | -            | 684,027                             |
| 華泰 B2211d | -                                  | 257,423     | -            | 257,423                             |
| 華泰 B2211e | -                                  | 419,679     | -            | 419,679                             |
| 華泰 B2302b | -                                  | 256,961     | -            | 256,961                             |
| 收益憑證(1)   | 14,612,036                         | 16,157,178  | (14,764,651) | 16,004,563                          |
| 總計        | 53,598,658                         | 32,199,479  | (36,958,106) | 48,840,031                          |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

39. 已發行的短期債務工具 - 續

2021 年 12 月 31 日

| 名稱          | 面值<br>原幣       | 起息日        | 到期日        | 發行金額<br>原幣     | 票面利率  |
|-------------|----------------|------------|------------|----------------|-------|
| 20 華泰 G5    | 人民幣 2,300,000  | 18/06/2020 | 18/06/2021 | 人民幣 2,300,000  | 2.58% |
| 20 華泰 S1    | 人民幣 5,500,000  | 31/08/2020 | 31/08/2021 | 人民幣 5,500,000  | 3.10% |
| 20 華泰 S2    | 人民幣 1,500,000  | 31/08/2020 | 28/05/2021 | 人民幣 1,500,000  | 3.05% |
| 20 華泰 S3    | 人民幣 5,000,000  | 11/09/2020 | 11/08/2021 | 人民幣 5,000,000  | 3.20% |
| 20 華泰 S4    | 人民幣 4,000,000  | 17/09/2020 | 17/04/2021 | 人民幣 4,000,000  | 3.15% |
| 20 華泰 CP010 | 人民幣 5,000,000  | 15/12/2020 | 15/03/2021 | 人民幣 5,000,000  | 2.94% |
| 21 華泰 CP001 | 人民幣 3,000,000  | 25/01/2021 | 25/04/2021 | 人民幣 3,000,000  | 2.48% |
| 21 華泰 CP002 | 人民幣 3,000,000  | 27/01/2021 | 27/04/2021 | 人民幣 3,000,000  | 2.42% |
| 21 華泰 CP003 | 人民幣 3,000,000  | 09/03/2021 | 07/06/2021 | 人民幣 3,000,000  | 2.68% |
| 21 華泰 CP004 | 人民幣 4,000,000  | 25/06/2021 | 23/09/2021 | 人民幣 4,000,000  | 2.40% |
| 21 華泰 CP005 | 人民幣 4,000,000  | 15/07/2021 | 13/10/2021 | 人民幣 4,000,000  | 2.15% |
| 21 華泰 CP006 | 人民幣 3,000,000  | 22/07/2021 | 20/10/2021 | 人民幣 3,000,000  | 2.15% |
| 21 華泰 S2    | 人民幣 4,000,000  | 28/06/2021 | 26/09/2021 | 人民幣 4,000,000  | 2.95% |
| 21 華泰 S3    | 人民幣 2,000,000  | 09/07/2021 | 22/02/2022 | 人民幣 2,000,000  | 2.75% |
| 21 華泰 S4    | 人民幣 4,000,000  | 09/07/2021 | 09/07/2022 | 人民幣 4,000,000  | 2.87% |
| 21 華泰 S5    | 人民幣 3,000,000  | 19/07/2021 | 19/07/2022 | 人民幣 3,000,000  | 2.75% |
| 21 華泰 S6    | 人民幣 4,000,000  | 09/08/2021 | 11/02/2022 | 人民幣 4,000,000  | 2.55% |
| 21 華泰 S7    | 人民幣 4,000,000  | 16/08/2021 | 20/01/2022 | 人民幣 4,000,000  | 2.51% |
| 21 華泰 S8    | 人民幣 3,000,000  | 26/08/2021 | 09/11/2021 | 人民幣 3,000,000  | 2.40% |
| 21 華泰 S9    | 人民幣 2,300,000  | 06/12/2021 | 08/06/2022 | 人民幣 2,300,000  | 2.64% |
| 21 華 S10    | 人民幣 2,700,000  | 06/12/2021 | 25/11/2022 | 人民幣 2,700,000  | 2.70% |
| 21 華 S11    | 人民幣 2,000,000  | 13/12/2021 | 13/05/2022 | 人民幣 2,000,000  | 2.62% |
| 21 華 S12    | 人民幣 1,000,000  | 21/12/2021 | 21/09/2022 | 人民幣 1,000,000  | 2.70% |
| 21 華 S13    | 人民幣 4,000,000  | 21/12/2021 | 21/12/2022 | 人民幣 4,000,000  | 2.75% |
| 21 華 S14    | 人民幣 4,000,000  | 29/12/2021 | 29/11/2022 | 人民幣 4,000,000  | 2.75% |
| 華泰 B2111    | 美元 50,000      | 27/11/2020 | 26/11/2021 | 美元 50,000      | 0.50% |
| 華泰 B2112    | 美元 60,000      | 03/02/2021 | 28/12/2021 | 美元 60,000      | 1.35% |
| 華泰 B2108a   | 美元 20,000      | 10/02/2021 | 10/08/2021 | 美元 20,000      | 1.23% |
| 華泰 B2203    | 美元 100,000     | 23/03/2021 | 21/03/2022 | 美元 100,000     | 0.35% |
| 華泰 B2108b   | 美元 35,000      | 12/05/2021 | 12/08/2021 | 美元 35,000      | 0.50% |
| 華泰 B2112b   | 美元 100,000     | 02/06/2021 | 02/12/2021 | 美元 100,000     | 0.60% |
| 華泰 B2206    | 美元 100,000     | 11/06/2021 | 09/06/2022 | 美元 100,000     | 0.70% |
| 華泰 B2111b   | 港幣 300,000     | 27/08/2021 | 26/11/2021 | 港幣 300,000     | 0.50% |
| 華泰 B2203b   | 港幣 300,000     | 07/12/2021 | 10/03/2022 | 港幣 300,000     | 0.55% |
| 華泰 B2203c   | 美元 30,000      | 29/12/2021 | 29/03/2022 | 美元 30,000      | 0.65% |
| 收益憑證        | 人民幣 14,605,615 | 註釋(1)      | 註釋(1)      | 人民幣 14,605,615 | 註釋(1) |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

39. 已發行的短期債務工具 - 續

2021 年 12 月 31 日 - 續

| 名稱          | 2021 年<br>1 月 1 日<br>賬面價值<br>等值人民幣 | 增加<br>等值人民幣 | 減少<br>等值人民幣   | 2021 年<br>12 月 31 日<br>賬面價值<br>等值人民幣 |
|-------------|------------------------------------|-------------|---------------|--------------------------------------|
| 20 华泰 G5    | 2,331,813                          | 27,527      | (2,359,340)   | -                                    |
| 20 華泰 S1    | 5,557,300                          | 113,208     | (5,670,508)   | -                                    |
| 20 華泰 S2    | 1,515,375                          | 18,937      | (1,534,312)   | -                                    |
| 20 華泰 S3    | 5,053,333                          | 97,634      | (5,150,967)   | -                                    |
| 20 華泰 S4    | 4,042,000                          | 37,100      | (4,079,100)   | -                                    |
| 20 華泰 CP010 | 5,006,847                          | 29,400      | (5,036,247)   | -                                    |
| 21 華泰 CP001 | -                                  | 3,018,345   | (3,018,345)   | -                                    |
| 21 華泰 CP002 | -                                  | 3,017,901   | (3,017,901)   | -                                    |
| 21 華泰 CP003 | -                                  | 3,019,825   | (3,019,825)   | -                                    |
| 21 華泰 CP004 | -                                  | 4,023,671   | (4,023,671)   | -                                    |
| 21 華泰 CP005 | -                                  | 4,021,205   | (4,021,205)   | -                                    |
| 21 華泰 CP006 | -                                  | 3,015,904   | (3,015,904)   | -                                    |
| 21 華泰 S2    | -                                  | 4,059,983   | -             | 4,059,983                            |
| 21 華泰 S3    | -                                  | 2,026,317   | -             | 2,026,317                            |
| 21 華泰 S4    | -                                  | 4,054,931   | -             | 4,054,931                            |
| 21 華泰 S5    | -                                  | 3,037,258   | -             | 3,037,258                            |
| 21 華泰 S6    | -                                  | 4,040,306   | -             | 4,040,306                            |
| 21 華泰 S7    | -                                  | 4,037,785   | -             | 4,037,785                            |
| 21 華泰 S8    | -                                  | 3,014,761   | (3,014,761)   | -                                    |
| 21 華泰 S9    | -                                  | 2,304,244   | -             | 2,304,244                            |
| 21 華 S10    | -                                  | 2,705,095   | -             | 2,705,095                            |
| 21 華 S11    | -                                  | 2,002,676   | -             | 2,002,676                            |
| 21 華 S12    | -                                  | 1,000,798   | -             | 1,000,798                            |
| 21 華 S13    | -                                  | 4,003,253   | -             | 4,003,253                            |
| 21 華 S14    | -                                  | 4,000,887   | -             | 4,000,887                            |
| 華泰 B2111    | 323,745                            | 1,434       | (325,179)     | -                                    |
| 華泰 B2112    | -                                  | 386,378     | (386,378)     | -                                    |
| 華泰 B2108a   | -                                  | 128,025     | (128,025)     | -                                    |
| 華泰 B2203    | -                                  | 636,859     | -             | 636,859                              |
| 華泰 B2108b   | -                                  | 223,308     | (223,308)     | -                                    |
| 華泰 B2112b   | -                                  | 638,159     | (638,159)     | -                                    |
| 華泰 B2206    | -                                  | 639,724     | -             | 639,724                              |
| 華泰 B2211b   | -                                  | 245,586     | (245,586)     | -                                    |
| 華泰 B2203b   | -                                  | 245,294     | -             | 245,294                              |
| 華泰 B2203c   | -                                  | 191,212     | -             | 191,212                              |
| 收益憑證        | 20,120,975                         | 65,875,960  | (71,384,899)  | 14,612,036                           |
| 總計          | 43,951,388                         | 129,940,890 | (120,293,620) | 53,598,658                           |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

### 39. 已發行的短期債務工具 - 續

- (1) 截至 2022 年 6 月 30 日止期間，本公司已發行 1,509 期收益憑證，利率範圍為 1.60% - 6.58%，到期期限一年內。一年以上到期的收益憑證已分類至長期債券，詳見附註 46(於 2021 年度，本公司已發行 3,849 期收益憑證，利率範圍為 2.00% - 6.58%)。

### 40. 拆入資金

|        | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| 銀行同業拆借 | <u>43,339,686</u>  | <u>14,018,721</u>   |

截至 2022 年 6 月 30 日，向銀行的拆入資金未設有擔保，年利率 1.10% - 2.53%，到期日為 91 天以內（截至 2021 年 12 月 31 日，向銀行的拆入資金未設有擔保，年利率 0.25% - 3.10%，到期日為 132 天以內）。

### 41. 應付經紀客戶賬款

|            | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 客戶的經紀業務保證金 | 138,607,534        | 127,624,066         |
| 客戶融資融券保證金  | <u>20,170,000</u>  | <u>19,877,767</u>   |
| 總計         | <u>158,777,534</u> | <u>147,501,833</u>  |

應付經紀客戶賬款指已收及應償還經紀客戶款項，主要為本集團持有並存於銀行及清算所。應付經紀客戶賬款按現行利率計息。

大部分應付賬款結餘須於要求時償還，惟若干應付經紀客戶之賬款就客戶於正常業務過程(如融資融券交易)中進行融資交易活動收取客戶之款項除外。僅有超出規定保證金及抵押現金之金額須於要求時償還。

考慮到該等業務之性質，本公司董事認為賬齡分析並無進一步意義，因此並未披露賬齡分析。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

#### 42. 其他應付款項及應計費用

非流動

|                 | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|-----------------|--------------------|---------------------|
| 租賃負債            |                    |                     |
| 1 至 2 年 (含 2 年) | 407,901            | 424,798             |
| 2 至 5 年 (含 5 年) | 610,213            | 473,956             |
| 5 年以上           | 22,329             | 1,545               |
| 總計              | <u>1,040,443</u>   | <u>900,299</u>      |

本集團的租賃物主要是用於經營的土地及建築物。大多數合同租賃期為 1 年至 5 年。

- (1) 截至 2022 年 6 月 30 日止 6 個月期間，短期租賃和低值租賃相關的費用為人民幣 21 百萬元 (截至 2021 年 6 月 30 日止 6 個月期間：人民幣 29 百萬元) 計入當期損益。
- (2) 於 2022 年 6 月 30 日，本集團已承諾但尚未開始的租賃預計未來年度現金流出不重大。

流動

|                                | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|--------------------------------|--------------------|---------------------|
| 應付交易款項                         | 89,211,820         | 84,166,271          |
| 應付經紀，交易商及結算所                   | 11,567,128         | 13,443,598          |
| 應付股利                           | 4,562,467          | 13,097              |
| 應付開放式基金款                       | 764,865            | 5,441,731           |
| 代理承銷證券款                        | 579,587            | 38,747              |
| 租賃負債                           | 426,940            | 330,256             |
| 限制性回購義務                        | 375,753            | 395,746             |
| 應付其他稅項                         | 323,874            | 790,446             |
| 期貨風險準備金                        | 193,363            | 178,120             |
| 應付外包服務費                        | 168,781            | 120,474             |
| 應付傭金及手續費                       | 61,708             | 253,680             |
| 應付證券投資者保護基金款項                  | 54,345             | 68,238              |
| 應付寫字樓項目資金支出                    | 31,571             | 35,315              |
| 應付可交換債質押款                      | -                  | 372,768             |
| 應付合併結構實體權益持有人款項 <sup>(1)</sup> | -                  | 44,954              |
| 應付贖回款                          | -                  | 26,761              |
| 其他 <sup>(2)</sup>              | 1,080,880          | 900,553             |
| 總計                             | <u>109,403,082</u> | <u>106,620,755</u>  |



簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

**42. 其他應付款項及應計費用 - 續**

流動 - 續

- (1) 在合併財務報表中，由於本集團有義務於結構實體到期日按照賬面淨值及該等合併資產管理計劃的有關條款向其他投資者進行支付，本集團將主要投資於貨幣市場投資及固定收益類投資的結構實體合併所產生的金融負債列為其他應付款項及應計費用。
- (2) 其他結餘主要指應付經紀人款項及一般業務過程中產生的其他應付款項。

**43. 賣出回購金融資產款**

**(1) 按抵押品類型分析：**

|       | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|-------|--------------------|---------------------|
| 債務證券  | 118,030,188        | 104,067,070         |
| 權益類證券 | 14,125,799         | 17,565,523          |
| 貴金屬   | 1,133,395          | 9,077,408           |
| 總計    | <u>133,289,382</u> | <u>130,710,001</u>  |

於 2022 年 6 月 30 日，本集團賣出回購金融資產款的擔保物價值為人民幣 155,402 百萬元 (於 2021 年 12 月 31 日：人民幣 144,064 百萬元)。

**(2) 按市場分析：**

|         | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|---------|--------------------|---------------------|
| 上海證券交易所 | 27,816,977         | 26,817,766          |
| 銀行同業市場  | 75,519,584         | 60,896,105          |
| 場外      | 22,318,528         | 36,936,138          |
| 深圳證券交易所 | 7,634,293          | 6,059,992           |
| 總計      | <u>133,289,382</u> | <u>130,710,001</u>  |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

44. 以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債

非流動

|                           | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|---------------------------|--------------------|---------------------|
| 指定為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債 | <u>2,731,642</u>   | <u>2,833,456</u>    |

流動

|  | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|--|--------------------|---------------------|
| 持作交易金融負債                                 | 36,107,359         | 27,171,191          |
| 指定為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債 <sup>(1)</sup> | <u>2,035,608</u>   | <u>1,118,271</u>    |
| 總計                                       | <u>38,142,967</u>  | <u>28,289,462</u>   |

(1)在合併財務報表中，由於本集團有義務於結構實體到期日按照賬面淨值及相關合併資產管理計劃或私募基金的有關條款向其他投資者或有限合夥人進行支付，本集團將主要投資於活躍市場的上市股權投資及非上市股權投資的資產管理計劃或私募股權基金合併所產生的金融負債指定為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債。

於 2022 年 6 月 30 日，本集團因自身信用風險導致的指定為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債的公允價值變動不重大。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

#### 45. 一年內到期的長期債券

於 2022 年 6 月 30 日

| 名稱                  | 面值<br>原幣      | 起息日        | 到期日        | 發行金額<br>原幣    | 票面利率        |
|---------------------|---------------|------------|------------|---------------|-------------|
| 13 華泰 02            | 人民幣 6,000,000 | 05/06/2013 | 05/06/2023 | 人民幣 6,000,000 | 5.10%       |
| 19 華泰 G1            | 人民幣 7,000,000 | 19/03/2019 | 19/03/2022 | 人民幣 7,000,000 | 3.68%       |
| 19 華泰 G3            | 人民幣 5,000,000 | 22/04/2019 | 22/04/2022 | 人民幣 5,000,000 | 3.80%       |
| 19 華泰 02            | 人民幣 5,000,000 | 27/05/2019 | 27/05/2022 | 人民幣 5,000,000 | 3.94%       |
| 19 華泰 03            | 人民幣 4,000,000 | 24/10/2019 | 24/10/2022 | 人民幣 4,000,000 | 3.68%       |
| 20 華泰 G1            | 人民幣 8,000,000 | 26/03/2020 | 26/03/2023 | 人民幣 8,000,000 | 2.99%       |
| 20 華泰 G6            | 人民幣 3,200,000 | 18/06/2020 | 18/06/2023 | 人民幣 3,200,000 | 3.10%       |
| 20 華泰 G8            | 人民幣 4,000,000 | 09/12/2020 | 09/12/2022 | 人民幣 4,000,000 | 3.67%       |
| 19 金融債 01           | 人民幣 6,000,000 | 21/08/2019 | 21/08/2022 | 人民幣 6,000,000 | 3.40%       |
| 華泰 B2205c           | 美元 500,000    | 23/05/2019 | 23/05/2022 | 美元 500,000    | 3.38%       |
| 華泰 B2302c           | 美元 400,000    | 12/02/2020 | 12/02/2023 | 美元 400,000    | LIBOR+0.95% |
| 收益憑證 <sup>(1)</sup> | 人民幣 767,947   | 註釋(1)      | 註釋(1)      | 人民幣 767,947   | 註釋(1)       |

| 名稱                  | 2022 年<br>1 月 1 日 |             |              | 2022 年<br>6 月 30 日 |  |
|---------------------|-------------------|-------------|--------------|--------------------|--|
|                     | 賬面價值<br>等值人民幣     | 增加<br>等值人民幣 | 減少<br>等值人民幣  | 賬面價值<br>等值人民幣      |  |
| 13 華泰 02            | -                 | 6,330,013   | (306,000)    | 6,024,013          |  |
| 19 華泰 G1            | 7,201,826         | 55,774      | (7,257,600)  | -                  |  |
| 19 華泰 G3            | 5,130,878         | 59,122      | (5,190,000)  | -                  |  |
| 19 華泰 02            | 5,116,891         | 80,109      | (5,197,000)  | -                  |  |
| 19 華泰 03            | 4,026,648         | 74,246      | -            | 4,100,894          |  |
| 20 華泰 G1            | -                 | 8,300,996   | (239,200)    | 8,061,796          |  |
| 20 華泰 G6            | -                 | 3,300,955   | (99,200)     | 3,201,755          |  |
| 20 華泰 G8            | 4,008,705         | 73,618      | -            | 4,082,323          |  |
| 19 金融債 01           | 6,073,407         | 102,487     | -            | 6,175,894          |  |
| 華泰 B2205c           | 3,198,594         | 213,733     | (3,412,327)  | -                  |  |
| 華泰 B2302c           | -                 | 2,730,804   | (43,490)     | 2,687,314          |  |
| 收益憑證 <sup>(1)</sup> | 615,359           | 165,131     | (8,000)      | 772,490            |  |
| 總計                  | 35,372,308        | 21,486,988  | (21,752,817) | 35,106,479         |  |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

45. 一年內到期的長期債券 - 續

於 2021 年 12 月 31 日

| 名稱               | 面值<br>原幣                  | 起息日                 | 到期日                 | 發行金額<br>原幣                | 票面利率           |
|------------------|---------------------------|---------------------|---------------------|---------------------------|----------------|
| 16 華泰 G2         | 人民幣 2,500,000             | 06/12/2016          | 06/12/2021          | 人民幣 2,500,000             | 3.78%          |
| 16 華泰 G4         | 人民幣 3,000,000             | 14/12/2016          | 14/12/2021          | 人民幣 3,000,000             | 3.97%          |
| 18 華泰 C2         | 人民幣 2,800,000             | 10/05/2018          | 10/05/2021          | 人民幣 2,800,000             | 5.20%          |
| 18 華泰 G1         | 人民幣 3,000,000             | 26/11/2018          | 26/11/2021          | 人民幣 3,000,000             | 3.88%          |
| 19 華泰 G1         | 人民幣 7,000,000             | 19/03/2019          | 19/03/2022          | 人民幣 7,000,000             | 3.68%          |
| 19 華泰 G3         | 人民幣 5,000,000             | 22/04/2019          | 22/04/2022          | 人民幣 5,000,000             | 3.80%          |
| 19 華泰 02         | 人民幣 5,000,000             | 27/05/2019          | 27/05/2022          | 人民幣 5,000,000             | 3.94%          |
| 19 華泰 03         | 人民幣 4,000,000             | 24/10/2019          | 24/10/2022          | 人民幣 4,000,000             | 3.68%          |
| 19 金融債 01        | 人民幣 6,000,000             | 21/08/2019          | 21/08/2022          | 人民幣 6,000,000             | 3.40%          |
| 20 華泰 G8         | 人民幣 4,000,000             | 09/12/2020          | 09/12/2022          | 人民幣 4,000,000             | 3.67%          |
| 華泰 B2205<br>收益憑證 | 美元 500,000<br>人民幣 613,940 | 16/05/2019<br>註釋(1) | 16/05/2022<br>註釋(1) | 美元 500,000<br>人民幣 613,940 | 3.38%<br>註釋(1) |

| 名稱               | 2021 年<br>1 月 1 日<br>賬面價值<br>等值人民幣 | 增加<br>等值人民幣 | 減少<br>等值人民幣  | 2021 年<br>12 月 31 日<br>賬面價值<br>等值人民幣 |
|------------------|------------------------------------|-------------|--------------|--------------------------------------|
| 16 華泰 G2         | 2,508,601                          | 84,497      | (2,593,098)  | -                                    |
| 16 華泰 G4         | 3,006,354                          | 108,368     | (3,114,722)  | -                                    |
| 18 華泰 C2         | 2,893,742                          | 48,335      | (2,942,077)  | -                                    |
| 18 華泰 G1         | 3,010,179                          | 98,057      | (3,108,236)  | -                                    |
| 19 華泰 G1         | -                                  | 7,459,426   | (257,600)    | 7,201,826                            |
| 19 華泰 G3         | -                                  | 5,320,878   | (190,000)    | 5,130,878                            |
| 19 華泰 02         | -                                  | 5,313,891   | (197,000)    | 5,116,891                            |
| 19 華泰 03         | -                                  | 4,173,848   | (147,200)    | 4,026,648                            |
| 19 金融債 01        | -                                  | 6,277,407   | (204,000)    | 6,073,407                            |
| 20 華泰 G8         | -                                  | 4,155,505   | (146,800)    | 4,008,705                            |
| 華泰 B2205<br>收益憑證 | -                                  | 3,285,482   | (86,888)     | 3,198,594                            |
|                  | 10,017                             | 615,686     | (10,344)     | 615,359                              |
| 總計               | 11,428,893                         | 36,941,380  | (12,997,965) | 35,372,308                           |

(1) 截止 2022 年 6 月 30 日，面值為人民幣 772.49 百萬元收益憑證將在一年內到期（於 2021 年 12 月 31 日：人民幣 615.36 百萬元）。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

#### 46. 長期債券

於 2022 年 6 月 30 日

| 名稱                  | 面值<br>原幣      | 起息日        | 到期日        | 發行金額<br>原幣    | 票面利率        |
|---------------------|---------------|------------|------------|---------------|-------------|
| 13 華泰 02            | 人民幣 6,000,000 | 05/06/2013 | 05/06/2023 | 人民幣 6,000,000 | 5.10%       |
| 18 華泰 G2            | 人民幣 1,000,000 | 26/11/2018 | 26/11/2023 | 人民幣 1,000,000 | 4.17%       |
| 20 華泰 G1            | 人民幣 8,000,000 | 26/03/2020 | 26/03/2023 | 人民幣 8,000,000 | 2.99%       |
| 20 華泰 G3            | 人民幣 3,500,000 | 29/04/2020 | 29/04/2025 | 人民幣 3,500,000 | 2.90%       |
| 20 華泰 G4            | 人民幣 3,000,000 | 21/05/2020 | 21/05/2025 | 人民幣 3,000,000 | 3.20%       |
| 20 華泰 G6            | 人民幣 3,200,000 | 18/06/2020 | 18/06/2023 | 人民幣 3,200,000 | 3.10%       |
| 20 華泰 G7            | 人民幣 3,500,000 | 24/11/2020 | 24/11/2023 | 人民幣 3,500,000 | 3.90%       |
| 20 華泰 G9            | 人民幣 4,000,000 | 09/12/2020 | 09/12/2023 | 人民幣 4,000,000 | 3.79%       |
| 20 華泰 C1            | 人民幣 5,000,000 | 13/11/2020 | 13/11/2025 | 人民幣 5,000,000 | 4.48%       |
| 21 華泰 G1            | 人民幣 4,000,000 | 20/01/2021 | 20/01/2024 | 人民幣 4,000,000 | 3.58%       |
| 21 華泰 G3            | 人民幣 5,000,000 | 26/04/2021 | 26/04/2024 | 人民幣 5,000,000 | 3.42%       |
| 21 華泰 G4            | 人民幣 6,000,000 | 17/05/2021 | 17/05/2026 | 人民幣 6,000,000 | 3.71%       |
| 21 華泰 G5            | 人民幣 4,000,000 | 24/05/2021 | 24/05/2024 | 人民幣 4,000,000 | 3.28%       |
| 21 華泰 G6            | 人民幣 2,000,000 | 24/05/2021 | 24/05/2026 | 人民幣 2,000,000 | 3.63%       |
| 21 華泰 G7            | 人民幣 2,000,000 | 15/06/2021 | 15/06/2024 | 人民幣 2,000,000 | 3.40%       |
| 21 華泰 09            | 人民幣 2,500,000 | 21/06/2021 | 21/06/2024 | 人民幣 2,500,000 | 3.45%       |
| 21 華泰 C1            | 人民幣 9,000,000 | 29/01/2021 | 29/01/2026 | 人民幣 9,000,000 | 4.50%       |
| 21 華泰 11            | 人民幣 1,500,000 | 07/09/2021 | 07/09/2024 | 人民幣 1,500,000 | 3.03%       |
| 21 華泰 12            | 人民幣 2,700,000 | 07/09/2021 | 07/09/2031 | 人民幣 2,700,000 | 3.78%       |
| 21 華泰 13            | 人民幣 2,100,000 | 18/10/2021 | 18/10/2024 | 人民幣 2,100,000 | 3.25%       |
| 21 華泰 14            | 人民幣 3,400,000 | 18/10/2021 | 18/10/2031 | 人民幣 3,400,000 | 3.99%       |
| 21 華泰 15            | 人民幣 2,200,000 | 25/10/2021 | 25/10/2024 | 人民幣 2,200,000 | 3.22%       |
| 21 華泰 16            | 人民幣 1,100,000 | 25/10/2021 | 25/10/2031 | 人民幣 1,100,000 | 3.94%       |
| 22 華泰 G1            | 人民幣 5,000,000 | 14/02/2022 | 14/02/2025 | 人民幣 5,000,000 | 2.79%       |
| 華泰 B2302c           | 美元 400,000    | 12/02/2020 | 12/02/2023 | 美元 400,000    | LIBOR+0.95% |
| 華泰 B2404            | 美元 900,000    | 09/04/2021 | 09/04/2024 | 美元 900,000    | 1.30%       |
| 華泰 B2604            | 美元 500,000    | 09/04/2021 | 09/04/2026 | 美元 500,000    | 2.00%       |
| 華泰 B2503            | 美元 1,000,000  | 03/03/2022 | 03/03/2025 | 美元 1,000,000  | 2.38%       |
| 收益憑證 <sup>(1)</sup> | 人民幣 117,600   | 註釋(1)      | 註釋(1)      | 人民幣 117,600   | 註釋(1)       |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

46. 長期債券 - 續

於 2022 年 6 月 30 日 - 續

| 名稱                  | 2022 年<br>1 月 1 日<br>賬面價值<br>等值人民幣 | 增加<br>等值人民幣 | 減少<br>等值人民幣  | 2022 年<br>6 月 30 日<br>賬面價值<br>等值人民幣 |
|---------------------|------------------------------------|-------------|--------------|-------------------------------------|
| 13 華泰 02            | 6,176,275                          | -           | (6,176,275)  | -                                   |
| 18 華泰 G2            | 1,003,674                          | 20,947      | -            | 1,024,621                           |
| 20 華泰 G1            | 8,180,110                          | -           | (8,180,110)  | -                                   |
| 20 華泰 G3            | 3,566,005                          | 51,070      | (101,500)    | 3,515,575                           |
| 20 華泰 G4            | 3,056,894                          | 48,273      | (96,000)     | 3,009,167                           |
| 20 華泰 G6            | 3,251,065                          | -           | (3,251,065)  | -                                   |
| 20 華泰 G7            | 3,513,326                          | 68,492      | -            | 3,581,818                           |
| 20 華泰 G9            | 4,008,862                          | 75,929      | -            | 4,084,791                           |
| 20 華泰 C1            | 5,026,991                          | 112,305     | -            | 5,139,296                           |
| 21 華泰 G1            | 4,133,205                          | 72,247      | (143,200)    | 4,062,252                           |
| 21 華泰 G3            | 5,112,607                          | 86,286      | (171,000)    | 5,027,893                           |
| 21 華泰 G4            | 6,133,706                          | 111,841     | (222,600)    | 6,022,947                           |
| 21 華泰 G5            | 4,076,248                          | 66,226      | (131,200)    | 4,011,274                           |
| 21 華泰 G6            | 2,042,198                          | 36,481      | (72,600)     | 2,006,079                           |
| 21 華泰 G7            | 2,035,430                          | 34,311      | (68,000)     | 2,001,741                           |
| 21 華泰 09            | 2,543,518                          | 43,513      | (86,250)     | 2,500,781                           |
| 21 華泰 C1            | 9,367,298                          | 203,323     | (405,000)    | 9,165,621                           |
| 21 華泰 11            | 1,513,470                          | 22,902      | -            | 1,536,372                           |
| 21 華泰 12            | 2,730,519                          | 51,108      | -            | 2,781,627                           |
| 21 華泰 13            | 2,113,536                          | 34,223      | -            | 2,147,759                           |
| 21 華泰 14            | 3,427,022                          | 67,859      | -            | 3,494,881                           |
| 21 華泰 15            | 2,212,710                          | 35,494      | -            | 2,248,204                           |
| 21 華泰 16            | 1,107,814                          | 21,680      | -            | 1,129,494                           |
| 22 華泰 G1            | -                                  | 5,048,277   | -            | 5,048,277                           |
| 華泰 B2302c           | 2,552,586                          | -           | (2,552,586)  | -                                   |
| 華泰 B2404            | 5,743,247                          | 342,666     | (39,262)     | 6,046,651                           |
| 華泰 B2604            | 3,194,403                          | 201,658     | (33,557)     | 3,362,504                           |
| 華泰 B2503            | -                                  | 6,738,437   | -            | 6,738,437                           |
| 收益憑證 <sup>(1)</sup> | 143,400                            | -           | (25,800)     | 117,600                             |
| 總計                  | 97,966,119                         | 13,595,548  | (21,756,005) | 89,805,662                          |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

#### 46. 長期債券 - 續

於 2021 年 12 月 31 日

| 名稱        | 面值<br>原幣       | 起息日        | 到期日        | 發行金額<br>原幣     | 票面利率        |
|-----------|----------------|------------|------------|----------------|-------------|
| 13 華泰 02  | 人民幣 6,000,000  | 05/06/2013 | 05/06/2023 | 人民幣 6,000,000  | 5.10%       |
| 18 華泰 G2  | 人民幣 1,000,000  | 26/11/2018 | 26/11/2023 | 人民幣 1,000,000  | 4.17%       |
| 19 華泰 G1  | 人民幣 7,000,000  | 19/03/2019 | 19/03/2022 | 人民幣 7,000,000  | 3.68%       |
| 19 華泰 G3  | 人民幣 5,000,000  | 22/04/2019 | 22/04/2022 | 人民幣 5,000,000  | 3.80%       |
| 19 華泰 02  | 人民幣 5,000,000  | 27/05/2019 | 27/05/2022 | 人民幣 5,000,000  | 3.94%       |
| 19 華泰 03  | 人民幣 4,000,000  | 24/10/2019 | 24/10/2022 | 人民幣 4,000,000  | 3.68%       |
| 19 金融債 01 | 人民幣 6,000,000  | 21/08/2019 | 21/08/2022 | 人民幣 6,000,000  | 3.40%       |
| 20 華泰 G1  | 人民幣 8,000,000  | 26/03/2020 | 26/03/2023 | 人民幣 8,000,000  | 2.99%       |
| 20 華泰 G3  | 人民幣 3,500,000  | 29/04/2020 | 29/04/2025 | 人民幣 3,500,000  | 2.90%       |
| 20 華泰 G4  | 人民幣 3,000,000  | 21/05/2020 | 21/05/2025 | 人民幣 3,000,000  | 3.20%       |
| 20 華泰 G6  | 人民幣 3,200,000  | 18/06/2020 | 18/06/2023 | 人民幣 3,200,000  | 3.10%       |
| 20 華泰 G7  | 人民幣 3,500,000  | 24/11/2020 | 24/11/2023 | 人民幣 3,500,000  | 3.90%       |
| 20 華泰 G8  | 人民幣 4,000,000  | 09/12/2020 | 09/12/2022 | 人民幣 4,000,000  | 3.67%       |
| 20 華泰 G9  | 人民幣 4,000,000  | 09/12/2020 | 09/12/2023 | 人民幣 4,000,000  | 3.79%       |
| 20 華泰 02  | 人民幣 10,000,000 | 24/07/2020 | 24/07/2022 | 人民幣 10,000,000 | 3.20%       |
| 20 華泰 C1  | 人民幣 5,000,000  | 13/11/2020 | 13/11/2025 | 人民幣 5,000,000  | 4.48%       |
| 21 華泰 G1  | 人民幣 4,000,000  | 20/01/2021 | 20/01/2024 | 人民幣 4,000,000  | 3.58%       |
| 21 華泰 G3  | 人民幣 5,000,000  | 26/04/2021 | 26/04/2024 | 人民幣 5,000,000  | 3.42%       |
| 21 華泰 G4  | 人民幣 6,000,000  | 17/05/2021 | 17/05/2026 | 人民幣 6,000,000  | 3.71%       |
| 21 華泰 G5  | 人民幣 4,000,000  | 24/05/2021 | 24/05/2024 | 人民幣 4,000,000  | 3.28%       |
| 21 華泰 G6  | 人民幣 2,000,000  | 24/05/2021 | 24/05/2026 | 人民幣 2,000,000  | 3.63%       |
| 21 華泰 G7  | 人民幣 2,000,000  | 15/06/2021 | 15/06/2024 | 人民幣 2,000,000  | 3.40%       |
| 21 華泰 09  | 人民幣 2,500,000  | 21/06/2021 | 21/06/2024 | 人民幣 2,500,000  | 3.45%       |
| 21 華泰 C1  | 人民幣 9,000,000  | 29/01/2021 | 29/01/2026 | 人民幣 9,000,000  | 4.50%       |
| 21 華泰 11  | 人民幣 1,500,000  | 07/09/2021 | 07/09/2024 | 人民幣 1,500,000  | 3.03%       |
| 21 華泰 12  | 人民幣 2,700,000  | 07/09/2021 | 07/09/2031 | 人民幣 2,700,000  | 3.78%       |
| 21 華泰 13  | 人民幣 2,100,000  | 18/10/2021 | 18/10/2024 | 人民幣 2,100,000  | 3.25%       |
| 21 華泰 14  | 人民幣 3,400,000  | 18/10/2021 | 18/10/2031 | 人民幣 3,400,000  | 3.99%       |
| 21 華泰 15  | 人民幣 2,200,000  | 25/10/2021 | 25/10/2024 | 人民幣 2,200,000  | 3.22%       |
| 21 華泰 16  | 人民幣 1,100,000  | 25/10/2021 | 25/10/2031 | 人民幣 1,100,000  | 3.94%       |
| 華泰 B2205  | 美元 500,000     | 16/05/2019 | 16/05/2022 | 美元 500,000     | 3.38%       |
| 華泰 B2302  | 美元 400,000     | 12/02/2020 | 12/02/2023 | 美元 400,000     | LIBOR+0.95% |
| 華泰 B2404  | 美元 900,000     | 09/04/2021 | 09/04/2024 | 美元 900,000     | 1.30%       |
| 華泰 B2604  | 美元 500,000     | 09/04/2021 | 09/04/2026 | 美元 500,000     | 2.00%       |
| 收益憑證      | 人民幣 143,400    | 註釋(1)      | 註釋(1)      | 人民幣 143,400    | 註釋(1)       |



簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

46. 長期債券 - 續

於 2021 年 12 月 31 日 - 續

| 名稱        | 2021 年<br>1 月 1 日<br>賬面價值<br>等值人民幣 | 增加<br>等值人民幣 | 減少<br>等值人民幣  | 2021 年<br>12 月 31 日<br>賬面價值<br>等值人民幣 |
|-----------|------------------------------------|-------------|--------------|--------------------------------------|
| 13 華泰 02  | 6,171,490                          | 310,785     | (306,000)    | 6,176,275                            |
| 18 華泰 G2  | 1,003,413                          | 41,961      | (41,700)     | 1,003,674                            |
| 19 華泰 G1  | 7,199,048                          | -           | (7,199,048)  | -                                    |
| 19 華泰 G3  | 5,129,536                          | -           | (5,129,536)  | -                                    |
| 19 華泰 02  | 5,115,539                          | -           | (5,115,539)  | -                                    |
| 19 華泰 03  | 4,025,007                          | -           | (4,025,007)  | -                                    |
| 19 金融債 01 | 6,072,453                          | -           | (6,072,453)  | -                                    |
| 20 華泰 G1  | 8,177,637                          | 241,673     | (239,200)    | 8,180,110                            |
| 20 華泰 G3  | 3,565,376                          | 102,129     | (101,500)    | 3,566,005                            |
| 20 華泰 G4  | 3,056,359                          | 96,611      | (96,076)     | 3,056,894                            |
| 20 華泰 G6  | 3,250,725                          | 99,540      | (99,200)     | 3,251,065                            |
| 20 華泰 G7  | 3,512,736                          | 137,090     | (136,500)    | 3,513,326                            |
| 20 華泰 G8  | 4,008,066                          | -           | (4,008,066)  | -                                    |
| 20 華泰 G9  | 4,008,443                          | 152,019     | (151,600)    | 4,008,862                            |
| 20 華泰 02  | 10,132,432                         | 160,618     | (10,293,050) | -                                    |
| 20 華泰 C1  | 5,025,058                          | 225,933     | (224,000)    | 5,026,991                            |
| 21 華泰 G1  | -                                  | 4,137,065   | (3,860)      | 4,133,205                            |
| 21 華泰 G3  | -                                  | 5,117,432   | (4,825)      | 5,112,607                            |
| 21 華泰 G4  | -                                  | 6,139,497   | (5,791)      | 6,133,706                            |
| 21 華泰 G5  | -                                  | 4,080,108   | (3,860)      | 4,076,248                            |
| 21 華泰 G6  | -                                  | 2,044,128   | (1,930)      | 2,042,198                            |
| 21 華泰 G7  | -                                  | 2,037,360   | (1,930)      | 2,035,430                            |
| 21 華泰 09  | -                                  | 2,545,931   | (2,413)      | 2,543,518                            |
| 21 華泰 C1  | -                                  | 9,376,680   | (9,382)      | 9,367,298                            |
| 21 華泰 11  | -                                  | 1,514,497   | (1,027)      | 1,513,470                            |
| 21 華泰 12  | -                                  | 2,732,368   | (1,849)      | 2,730,519                            |
| 21 華泰 13  | -                                  | 2,113,972   | (436)        | 2,113,536                            |
| 21 華泰 14  | -                                  | 3,427,728   | (706)        | 3,427,022                            |
| 21 華泰 15  | -                                  | 2,213,167   | (457)        | 2,212,710                            |
| 21 華泰 16  | -                                  | 1,108,042   | (228)        | 1,107,814                            |
| 華泰 B2205  | 3,274,424                          | -           | (3,274,424)  | -                                    |
| 華泰 B2302  | 2,611,554                          | 4,635       | (63,603)     | 2,552,586                            |
| 華泰 B2404  | -                                  | 5,780,545   | (37,298)     | 5,743,247                            |
| 華泰 B2604  | -                                  | 3,226,282   | (31,879)     | 3,194,403                            |
| 收益憑證      | 284,999                            | 140,401     | (282,000)    | 143,400                              |
| 總計        | 85,624,295                         | 59,308,197  | (46,966,373) | 97,966,119                           |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

#### 46. 長期債券 - 續

- (1) 截至 2022 年 6 月 30 日止期間，本公司共發行 5 期長期收益憑證 (截至 2021 年 12 月 31 日的年度：30 期)。於 2022 年 6 月 30 日，28 期長期收益憑證將於一年內兌付，因此將其分類至“一年內到期的長期債券”(於 2021 年 12 月 31 日：14 期)，詳見附註 45。

#### 47. 長期銀行借款

|                  | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|------------------|--------------------|---------------------|
| 信用銀行借款           | 793,650            | 722,816             |
| 減：一年內到期的長期信用銀行借款 | -                  | -                   |
| 總計               | <u>793,650</u>     | <u>722,816</u>      |

#### 48. 股本

本公司發行的全部股份為已全部繳款普通股。每股面值為人民幣 1 元。本公司發行的股份數目與其賬面值如下：

|                | 2022 年 6 月 30 日  |                  | 2021 年 12 月 31 日 |                  |
|----------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
|                | 數量(千股)           | 面值               | 數量(千股)           | 面值               |
| 註冊、發行及已繳足股款：   |                  |                  |                  |                  |
| A 股(每股人民幣 1 元) | 7,357,604        | 7,357,604        | 7,357,604        | 7,357,604        |
| H 股(每股人民幣 1 元) | 1,719,046        | 1,719,046        | 1,719,046        | 1,719,046        |
| 總計             | <u>9,076,650</u> | <u>9,076,650</u> | <u>9,076,650</u> | <u>9,076,650</u> |

於 2015 年 6 月 1 日，本公司完成首次公開發售 1,400,000,000 股 H 股，H 股於香港聯交所主機板上市。於 2015 年 6 月 19 日，本公司部分行使超額配售選擇權超額配售 162,768,800 股 H 股股票。

根據中國法規相關規定，本公司的現有國有股股東將合計 156,276,880 股本公司國有股轉讓予中國全國社會保障基金理事會，該等股份其後按每股股份轉換為一股 H 股的基準轉換為 H 股。

於 2018 年 7 月，本公司完成非公開發行 A 股股票 1,088,731,200 股。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

#### 48. 股本 - 續

於 2019 年 6 月 20 日，本公司完成發售 75,013,636 份全球存托憑證並在倫敦證券交易所上市，本次發行的全球存托憑證代表的基礎證券為 750,136,360 股 A 股股票。於 2019 年 6 月 27 日，本公司行使超額配售選擇權超額配售 7,501,364 份全球存托憑證，對應基礎 A 股股票上市數量為 75,013,640 股。綜上所述，本公司已發售 82,515,000 份全球存托憑證，代表的基礎證券為 825,150,000 股新增 A 股股票，每股面值為人民幣 1.00 元。發行後累計實收股本人民幣 9,076,650,000 元。

所有人民幣普通股(A 股)、全球存托憑證 GDRs (代表新發行 A 股) 與境外上市外資股 (H 股) 在宣派、派付或作出的一切股息或分派將享有同等地位。

#### 49. 其他權益工具

|       | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|-------|--------------------|---------------------|
| 永續次級債 | <u>12,694,871</u>  | <u>9,996,425</u>    |

經中國證監會批准，本公司於 2021 年 9 月 15 日、2021 年 10 月 26 日、2021 年 11 月 16 日及 2022 年 1 月 24 日發行了四期永續次級債券，即「21 華泰 Y1」、「21 華泰 Y2」、「21 華泰 Y3」及「22 華泰 Y1」，債券面值均為人民幣 100 元，票面利率分別為 3.85%、4.00%、3.80% 及 3.49%。永續債均無到期日，但本公司有權於永續債第 5 個和其後每個付息日按面值加應付利息（包括所有遞延支付的利息及其孳息）贖回該債券。

永續債票面利率在前 5 個計息年度內保持不變。如本公司未行使贖回權，自第 6 個計息年度起，永續債每 5 年重置一次票面利率，重置票面利率以當期基準利率加上初始利差再加上 300 個基點確定。當期基準利率為票面利率重置日前 5 個工作日中國債券信息網公佈的中債銀行間固定利率國債收益率曲線中，待償期為 5 年的國債收益率算術平均值。

除非發生強制付息事件，債券的每個付息日，本公司可自行選擇將當期利息以及已經遞延的所有利息及其孳息推遲到下一個付息日支付，且不受任何遞延支付利息次數的限制。強制付息事件僅限於本公司普通股分紅或減少註冊資本。由於 2022 年 6 月 22 日的股東大會決議案批准向本公司普通股股東分派現金紅利，本公司已在應付股利中確認應付永續債利息人民幣 485,730 千元。

本公司發行的永續次級債券屬於權益性工具，在本集團財務狀況表列示於權益中。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

## 50. 庫存股

|             | 期初賬面<br>餘額       | 本期增加額    | 本期減少額           | 期末賬面<br>餘額       |
|-------------|------------------|----------|-----------------|------------------|
| 回購股份        | 835,802          | -        | -               | 835,802          |
| 限制性股票股權激勵計劃 | 395,745          | -        | (19,992)        | 375,753          |
| 總計          | <u>1,231,547</u> | <u>-</u> | <u>(19,992)</u> | <u>1,211,555</u> |

於 2020 年 3 月 30 日，本公司第五屆董事會第五次會議審議通過了《關於以集中競價交易方式回購公司 A 股股份方案的議案》，擬在自董事會審議通過回購 A 股股份方案之日起不超過 12 個月以自有資金回購不少於 45,383,250 股且不超過 90,766,500 股 A 股股份。於 2021 年 1 月 8 日，本公司完成回購。回購期限內，本公司累計實際回購本公司 A 股股份 90,766,495 股。

2021 年 3 月 23 日，本公司召開第五屆董事會第十四次會議，會議通過了《關於向激勵對象授予 A 股限制性股票的議案》，確定以 2021 年 3 月 29 日為授予日，向符合條件的 810 名激勵對象授予 45,488,000 股 A 股限制性股票，授予價格為人民幣 9.10 元 / 股。於 2021 年 3 月 30 日，華泰證券共收到 810 名激勵對象繳納的認購資金人民幣 414 百萬元，該資金已經會計師事務所審驗並出具了驗資報告。

2021 年 6 月 22 日，經 2020 年度股東大會審議通過，以公司總股本 9,076,650,000 股扣除存放於公司回購專用證券帳戶且暫不用於股權激勵計畫的 A 股股份為基數，每 10 股派發現金紅利人民幣 4.00 元 (含稅)。公司限制性股票股權激勵計畫 810 名激勵對象共計分配現金紅利人民幣 18 百萬元。根據《A 股限制性股票股權激勵計畫》，在解除限售前，公司進行現金分紅時，激勵對象就其獲授的限制性股票應取得的現金分紅在代扣代繳個人所得稅後由激勵對象享有；若該部分限制性股票未能解除限售，公司回購該部分限制性股票時應扣除激勵對象已享有的該部分現金分紅。因此，公司確認減少股票回購義務人民幣 18 百萬元。

2022 年 6 月 22 日，經 2021 年度股東大會審議通過，以公司總股本 9,076,650,000 股扣除存放於公司回購專用證券帳戶的 45,278,495 股和擬回購註銷的 1,060,973 股 A 股股份為基數，每 10 股派發現金紅利人民幣 4.50 元 (含稅)。根據《A 股限制性股票股權激勵計畫》，公司確認減少股票回購義務人民幣 20 百萬元。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

## 51. 儲備

### (a) 資本公積

資本公積主要包括發行新股時，超過股票面值的資本溢價以及本集團已付非控股權益持有人之對價與相關非控股權益之賬面值之差額。

### (b) 盈餘公積

根據中國公司法，本公司須按淨利潤的 10% 提取法定盈餘公積直至法定盈餘公積累計達至本公司註冊資本的 50% 。

經股東批准，法定公積可用於彌補累計損失或轉增本公司的資本，惟將法定盈餘公積轉增資本時，留存的法定盈餘儲備不得少於本公司轉增前當時註冊資本的 25% 。

### (c) 一般儲備

一般儲備包括一般風險儲備及交易風險儲備。

根據 2007 年 12 月 18 日中國證監會頒布的《關於證券公司 2007 年年度報告工作的通知》(證監機構字 [2007] 320 號文)的規定，本公司按年度淨利潤的 10% 提取一般風險儲備金。

根據 2007 年 12 月 18 日中國證監會頒布的《關於證券公司 2007 年年度報告工作的通知》(證監機構字 [2007] 320 號文)的規定及《證券法》的要求，本公司按年度淨利潤的 10% 提取交易風險儲備金，以彌補證券交易的損失。

根據《公開募集證券投資基金風險準備金監督管理暫行辦法》(證監會令[第 94 號])的規定，本公司按照當期基金託管費收入的 2.5% 提取一般交易風險準備。

本公司的子公司根據適用的當地法規規定，按其盈利提取一般儲備。

### (d) 公允價值儲備

公允價值儲備包括：

持有的指定為以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的權益性證券的累計公允價值變動淨額及；

持有的以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的債務工具的累計公允價值變動淨額除非該資產被處置或重分類。該部分變動考慮了減值準備的影響。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

**51. 儲備 - 續**

**(e) 現金流量套期儲備**

現金流量套期儲備為套期工具利得或損失中屬於有效套期的部分。

**(f) 外幣報表折算差額**

外幣報表折算差額主要包括換算外幣財務報表產生之外幣匯兌差額。

**52. 未分配利潤**

根據 2022 年 6 月 22 日的股東大會決議案，本公司以公司總股本 9,076,650,000 股扣除存放於公司回購專用證券賬戶及擬回購註銷的 A 股股份為基數，每 10 股派發現金紅利人民幣 4.50 元(含稅)，共計人民幣 4,064 百萬元。本公司現金紅利已於 2022 年 8 月 5 日發放完畢。

**53. 承諾**

**(a) 資本承諾**

於 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日尚未撥備至財務報表之資本承諾如下：

|         | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|---------|--------------------|---------------------|
| 已訂約但未支付 | <u>4,886,800</u>   | <u>2,469,201</u>    |

上述資本承諾主要指本集團的證券包銷承諾。

**54. 於結構實體的權益**

**(a) 本集團在納入合併範圍的結構實體中享有的權益**

本集團合併入賬的結構實體主要指本集團作為管理人和/或投資者的資產管理計劃。本集團綜合評估本集團因持有的份額而享有的回報以及作為資產管理計劃管理人的報酬是否將使本集團面臨可變回報的影響重大，併據此判斷本集團是否為資產管理計劃的主要責任人。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

**54. 於結構實體的權益 - 續**

**(a) 本集團在納入合併範圍的結構實體中享有的權益 - 續**

於 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，本集團合併結構實體數量分別為 46 個及 34 個，主要為資產管理計劃。於 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，合併結構實體的總資產分別為人民幣 47,274 百萬元以及人民幣 29,375 百萬元，本集團於合併的結構實體中所持權益賬面價值分別為人民幣 41,455 百萬元及人民幣 28,329 百萬元。

**(b) 於本集團發起設立但並未合併的結構化實體中的權益**

本集團作為結構實體的普通合夥人或管理者，在報告期間對資產管理計劃擁有管理權。除了附註 54(a)所列本集團已合併的結構實體外，本集團因其在剩餘結構實體中擁有的權益而享有可變回報並不重大，因此本集團並未合併該等結構實體。

於 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，上述由本集團管理的未合併結構實體的資產總額分別為人民幣 557,431 百萬元和人民幣 521,972 百萬元。於 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，本集團於上述未合併結構實體中所持權益賬面價值分別為人民幣 9,612 百萬元及人民幣 3,403 百萬元。

截至 2022 年 6 月 30 日六個月及 2021 年 6 月 30 日六個月，本集團在上述結構實體獲得的收益分別為人民幣 47 百萬元及人民幣 376 百萬元。

**(c) 於第三方機構發起設立的結構化實體中的權益**

本集團通過直接持有投資而在第三方機構發起設立的結構實體中享有權益，這些結構實體未納入本集團的合併範圍，主要包括基金、資產管理計劃、信託計劃及銀行或其他金融機構發行的理財產品。這些結構實體的性質和目的主要是管理投資者的資產並賺取管理費，其融資方式是向投資者發行投資產品。

於 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，合併財務狀況表中相關賬目的賬面價值等於本集團於未合併入賬且由第三方機構發起設立的結構實體中所持權益的最高損失風險，載列如下：

|      | 2022 年 6 月 30 日                    |             |
|------|------------------------------------|-------------|
|      | 以公允價值計量<br>且其變動計入<br>當期損益的<br>金融資產 |             |
|      |                                    | 總計          |
| 基金   | 94,039,717                         | 94,039,717  |
| 理財產品 | 14,068,007                         | 14,068,007  |
| 總計   | 108,107,724                        | 108,107,724 |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

54. 於結構實體的權益 - 續

(c) 於第三方機構發起設立的結構化實體中的權益 - 續

|      | 2021 年 12 月 31 日                   |                                      | 總計         |
|------|------------------------------------|--------------------------------------|------------|
|      | 以公允價值計量<br>且其變動計入<br>當期損益的<br>金融資產 | 以公允價值計量<br>且其變動計入<br>其他綜合收益的<br>金融資產 |            |
| 基金   | 49,197,876                         | -                                    | 49,197,876 |
| 理財產品 | 16,478,377                         | 74,532                               | 16,552,909 |
| 總計   | 65,676,253                         | 74,532                               | 65,750,785 |

55. 未決訴訟

本集團在日常經營中會涉及索賠、法律訴訟或監管機構調查。於 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 12 月 31 日，根據法庭裁決及管理層的判斷，未對本集團作為被告方的法律或仲裁案件產生的索賠金額計提任何預計負債。本集團認為法院的最終裁決對本集團的財務狀況或經營不會造成重大影響。

截至 2022 年 6 月 30 日，本集團作為被告方的重大法律訴訟列示如下：

- (1) 本公司於 2022 年 3 月收到法院發送的《應訴通知書》等相關訴訟材料。原告湖北稻花香酒業有限公司因投資《吳聲·春雨純債 2 號私募證券投資基金基金合同》未得到全額兌付，訴至法院要求吳聲資產管理(廣州)有限公司（被告一）和華泰證券（被告二）承擔連帶賠償責任，案件標的合計人民幣 127 百萬元。截止本報告出具日，本案尚在審理過程中。結合該案情目前的進展，本集團未對該索賠金額計提任何預計負債。
- (2) 本公司於 2021 年收到上海國際經濟貿易仲裁委員會的仲裁檔，光大證券股份有限公司因於 2018 年 12 月與海航集團財務有限公司（以下簡稱“海航財務”）開展的 4 筆債券質押式協定回購交易在 2019 年 6 月到期後海航財務未履行回購義務申請仲裁，要求債券質押式協定回購的交易商華泰證券（即本公司）償還相關融資款、利息及違約金，案件標的合計人民幣 217.96 百萬元。本案於 2021 年 10 月 29 日開庭審理，截至本報告出具日內尚未收到仲裁裁決。結合該案情目前的進展，本集團未對該索賠金額計提任何預計負債。



簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

**55. 未決訴訟 - 續**

- (3) 本集團子公司華泰聯合於 2020 年收到上海金融法院發送的《應訴通知書》等相關訴訟材料，原告中國郵政儲蓄銀行股份有限公司因投資“華泰美吉特燈都資產支持專項計畫”未得到全額兌付，訴至法院要求該專項計畫管理人（被告一）、法律顧問（被告二）、評級機構（被告三）、原始權益人（被告四）及財務顧問華泰聯合（被告五）承擔連帶賠償責任，案件標的人民幣 598 百萬元。截止本報告日，本案尚在審理過程中。結合該案情目前的進展，本集團未對該索賠金額計提任何預計負債。

**56. 以權益結算的股份支付情況**

|              | 注釋  | 期初賬面餘額           | 本期增加額          | 本期減少額    | 期末賬面餘額           |
|--------------|-----|------------------|----------------|----------|------------------|
| A 股限制性股票股份支付 | (a) | 98,209           | 63,910         | -        | 162,119          |
| 海外子公司股份支付    | (b) | 1,150,320        | 57,561         | -        | 1,207,881        |
| 總計           |     | <u>1,248,529</u> | <u>121,471</u> | <u>-</u> | <u>1,370,000</u> |

**(a) A 股限制性股票股份支付**

本公司實施一項 A 股限制性股票激勵計劃用於授予激勵對象以換取授予對象服務。於 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 6 月 30 日授出及未歸屬的獎勵股份的詳情載列如下：

| 股數      | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>6 月 30 日 |
|---------|--------------------|--------------------|
| 期初數量    | 44,463,027         | -                  |
| 本期授予    | -                  | 45,488,000         |
| 本期行權    | -                  | -                  |
| 本期失效    | (36,000)           | -                  |
| 本期到期    | -                  | -                  |
| 期末數量    | <u>44,427,027</u>  | <u>45,488,000</u>  |
| 期末可行權數量 | <u>44,427,027</u>  | <u>45,488,000</u>  |

截止 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 12 月 31 日，本公司資本公積中確認以權益結算的股份支付的累計金額分別為人民幣 162.12 百萬元和人民幣 98.21 百萬元。截至 2022 年 6 月 30 日止六個月及 2021 年 6 月 30 日止六個月，以權益結算的股份支付確認的費用總額分別為人民幣 63.91 百萬元及人民幣 33.71 百萬元。

以股份支付換取的職工服務公允價值參照授予的限制性股票公允價值。本公司授予的限制性股票公允價值為授予日當天的收盤價，為人民幣 17.24 元每股。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

**56. 以權益結算的股份支付情況 - 續**

**(b) 海外子公司股份支付**

於 2019 年 7 月 3 日，AssetMark 通過了 2019 年股權激勵計劃（“2019 年股權激勵計劃”），該計劃於 2019 年 7 月 17 日生效，即 AssetMark 首次公開發售登記表 S-1 的生效日期。

**(i) 限制性股票激勵(RSAs)**

於 2019 年 7 月 17 日，AssetMark 將總數等同於 6,309,049 股 AssetMark 股份的限制性股票激勵授予原 AssetMark Holdings, LLC 的 C 級普通股持有人。

**(ii) 股票期權**

AssetMark 於首次公開發售時授予部分管理人員股票期權，該等股票期權可獲得總數為 918,981 股普通股，行權價格為每股 22 美元。自 2019 年 7 月 18 日起三年間，上述股票期權計劃以大致相等的分期方式於每一年間行權。AssetMark 使用布萊克-斯科爾斯(Black-Scholes)期權定價模型估算股票期權的公允價值。

**(iii) 限制性股票單位(RSUs)**

AssetMark 同樣於首次公開發售時授予部分管理人員限制性股票單位(RSUs)，總數為 85,737 股普通股。自 2019 年 7 月 18 日起三年間，上述限制性股票單位計劃以大致相等的分期方式於每一年間行權。AssetMark 後續於 2020 年及 2021 年授予高級管理人員、特定員工及獨立董事限制性股票單位 (RSUs)，上述限制性股票單位在授予日起的四年內大致相等的分期方式於每一年間行權。AssetMark 於 2022 年上半年授予管理人員、特定員工及獨立董事共計 438,835 份限制性股票單位 (RSUs)。上述 RSUs 大部分在將在授予日起的四年內大致相等的分期方式於每一年間行權。

**(iv) 股票增值權(SARs)**

於 2020 年 6 月 9 日，AssetMark 就 2019 年股權激勵計劃項下的 831,902 股公司普通股向部分高管發行了股票增值權。股票增值權的執行價等於授予日公司普通股的公平市價，並計劃在 2020 年 6 月 9 日起四年內大致相等的分期方式於每一年間行權。行權後，每一個 SARs 將以公司普通股股份結算，其價值等於行權日公司普通股的公平市價超過執行價的部分(如有)。於 2021 年 7 月，AssetMark 再次向部分高管授予股票增值權 (SARs)，並计划在授予日起四年內大致相等的分期方式于每一年間行權。行權后，每一个 SARs 将以公司普通股股份结算，其价值等于行权日公司普通股的公允价值超过执行价的部分(如有)。AssetMark 于 2022 年上半年向部分高管授予共計 1,030,037 份股票增值權 (SARs)，並計畫在授予日起四年內大致相等的分期方式於每一年間行權。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

## 57. 關聯方關係及交易

### (a) 關聯方關係

#### (i) 主要股東

| <u>股東名稱</u>  | <u>註冊地</u> | <u>註冊資本</u> | <u>持股比例 (%)</u> | <u>表決權比例 (%)</u> |
|--------------|------------|-------------|-----------------|------------------|
| 江蘇國信投資集團有限公司 | 南京         | 人民幣 300 億元  | 15.13           | 15.13            |
| 江蘇交通控股有限公司   | 南京         | 人民幣 168 億元  | 5.39            | 5.39             |

本集團與主要股東的交易與結餘詳細資料載於附註 57(b)(i)。

#### (ii) 本集團聯營企業

本集團聯營企業詳細資料載於附註 20。

#### (iii) 本集團合營企業

本集團合營企業詳細資料載於附註 21。

#### (iv) 其他關聯方

其他關聯方為個人，包括董事會、監事會及高級管理層成員及該等人士的密切家族成員。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

**57. 關聯方關係及交易 - 續**

**(b) 關聯方交易及結餘**

**(i) 本集團與主要股東的交易及結餘：**

|                        | 2022 年<br>6 月 30 日     | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|------------------------|------------------------|---------------------|
| 期末 / 年末結餘：             |                        |                     |
| 以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產 | -                      | 72,975              |
| 應付經紀客戶賬款               | 53,107                 | 50,018              |
| 其他應付款項及應計費用            | 3,211                  | 3,211               |
| 應收款項                   | -                      | 598                 |
|                        | <u>截至 6 月 30 日止六個月</u> | <u>2021 年</u>       |
| 期間內交易：                 |                        |                     |
| 投資收益淨額                 | 2,377                  | 14,284              |
| 傭金及手續費收入               | 6,804                  | 9,920               |
| 利息收入                   | -                      | 780                 |

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月及 2021 年 6 月 30 日止六個月，本集團贖回主要股東債券分別為人民幣 70 百萬元和人民幣 160 百萬元。

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月及 2021 年 6 月 30 日止六個月，本集團購買主要股東債券分別為人民幣零元和人民幣 200 百萬元。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

57. 關聯方關係及交易 - 續

(b) 關聯方交易及結餘 - 續

(ii) 本集團與聯營企業的交易及結餘：

|                        | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|------------------------|--------------------|---------------------|
| 期末 / 年末結餘：             |                    |                     |
| 現金及銀行結餘                | 1,756,050          | 467,782             |
| 應收款項                   | 190,495            | 271,617             |
| 租賃負債                   | 84,906             | 103,195             |
| 使用權資產                  | 74,698             | 92,992              |
| 應付經紀客戶賬款               | 5,601              | 49,609              |
| 其他應付款及應計款項             | 98                 | -                   |
| 以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產 | 10,054             | 9,523               |
| 其他應收款及預付款項             | 1,276              | 1,053               |
| 拆入資金                   | 1,700,382          | 1,500,330           |
|                        | 截至 6 月 30 日止六個月    | 2021 年              |
|                        | 2022 年             | 2021 年              |
| 期間內交易：                 |                    |                     |
| 傭金及手續費收入               | 187,517            | 151,965             |
| 其他收入及收益                | 1,619              | 1,619               |
| 利息收入                   | 3,820              | 3,562               |
| 利息支出                   | (9,997)            | (7,995)             |
| 投資收益 (損失) 淨額           | (8,938)            | (12,427)            |

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月及 2021 年 6 月 30 日止六個月，聯營企業購買本集團企業債分別為人民幣 284 百萬元和人民幣 519 百萬元。

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月及 2021 年 6 月 30 日止六個月，聯營企業贖回本集團短期債務工具分別為人民幣零元和人民幣 1,151 百萬元。

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月及 2021 年 6 月 30 日止六個月，聯營企業贖回本集團結構化票據分別為人民幣 103 百萬元和人民幣零元。

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月及 2021 年 6 月 30 日止六個月，本集團向聯營企業注資金額分別為人民幣 81 百萬元和人民幣 147 百萬元；本集團對聯營企業撤資金額分別為人民幣 88 百萬元和人民幣 522 百萬元。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

**57. 關聯方關係及交易 - 續**

**(b) 關聯方交易及結餘 - 續**

**(ii) 本集團與聯營企業的交易及結餘： - 續**

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月及 2021 年 6 月 30 日止六個月，本集團與聯營企業簽訂回購協議分別為人民幣 67,979 百萬元和人民幣 31,078 百萬元。

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月及 2021 年 6 月 30 日止六個月，本集團對聯營企業開展拆入資金業務金額分別為人民幣 49,350 百萬元和人民幣 56,000 百萬元。

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月及 2021 年 6 月 30 日止六個月，本集團從聯營企業收到的股利金額分別為人民幣 1,005 百萬元和人民幣 757 百萬元。

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月及 2021 年 6 月 30 日止六個月，本集團對聯營企業租金支出金額分別為人民幣 26 百萬元和人民幣 18 百萬元。

**(iii) 本集團與合營企業的交易及結餘：**

|            | 2022 年<br>6 月 30 日     | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|------------|------------------------|---------------------|
| 期末 / 年末結餘： |                        |                     |
| 應收賬款       | 8,745                  | 24,000              |
| 其他應收款及預付款項 | -                      | 1,514               |
|            | <u>截至 6 月 30 日止六個月</u> | <u>2021 年</u>       |
|            | <u>2022 年</u>          | <u>2021 年</u>       |
| 本期內交易：     |                        |                     |
| 傭金及手續費收入   | 8,250                  | 9,824               |

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月及 2021 年 6 月 30 日止六個月，本集團收回對合營企業的投资分別為人民幣 10 百萬元和人民幣零元。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

**57. 關聯方關係及交易 - 續**

**(b) 關聯方交易及結餘 - 續**

**(iv) 本集團與其他關聯方的交易及結餘**

|            | 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年<br>12 月 31 日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 期末 / 年末結餘： |                    |                     |
| 應付經紀客戶賬款   | 26,679             | 41,311              |
|            | 截至 6 月 30 日止六個月    |                     |
|            | <u>2022 年</u>      | <u>2021 年</u>       |
| 本期內交易：     |                    |                     |
| 傭金及手續費收入   | 62                 | 36                  |

**(c) 主要管理人員酬金**

本集團關鍵管理人員酬金如下：

|               | 截至 6 月 30 日止六個月 |               |
|---------------|-----------------|---------------|
|               | <u>2022 年</u>   | <u>2021 年</u> |
| 職工薪酬          |                 |               |
| - 費用、工資、津貼及獎金 | 38,497          | 38,830        |
| 離職後福利         |                 |               |
| - 退休金計劃供款     | 322             | 253           |
| 股份支付          | 7,960           | 3,868         |
| 總計            | <u>46,779</u>   | <u>42,951</u> |

薪酬總額計入「僱員成本」(見附註 11)。

## 58. 分部報告

管理層根據業務性質和提供的服務按照下列分部管理業務經營，選用的業績評價指標為所得稅稅前利潤：

- 財富管理分部代理客戶買賣股票、基金、債券及期貨，向客戶提供各種金融產品銷售服務和資產配置服務，此外，本分部亦提供融資融券、股票質押式回購及銷售金融產品。
- 機構服務分部主要向客戶提供投資銀行業務，研究業務與機構銷售業務，權益證券投資及交易、固定收益投資及交易、OTC 金融產品與交易等業務。
- 投資管理分部主要包括資產管理，私募股權投資，另類投資及商品交易與套利。
- 國際業務分部主要包括境外子公司的海外業務。
- 其他分部業務主要包括總部的其他運營，主要包括利息收入，參股聯營及合營公司折算權益，運營資金利息支出以及中後臺的成本和費用。

### (a) 業務分部

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

|                   | 財富管理          | 機構服務          | 投資管理         | 國際業務          | 其他           | 總計            |
|-------------------|---------------|---------------|--------------|---------------|--------------|---------------|
| 收入                |               |               |              |               |              |               |
| - 外部              | 10,362,922    | 3,666,417     | 849,727      | 3,861,204     | 1,703,759    | 20,444,029    |
| - 分部間             | 28,800        | 2,514         | -            | -             | 46,016       | 77,330        |
| 其他收入及收益           | 2,003,904     | 117,162       | 43,590       | 323,381       | 569,197      | 3,057,234     |
| 分部收入、其他收入及收益      | 12,395,626    | 3,786,093     | 893,317      | 4,184,585     | 2,318,972    | 23,578,593    |
| 分部支出              | (8,007,493)   | (2,977,089)   | (549,527)    | (2,926,501)   | (2,822,819)  | (17,283,429)  |
| 分部經營利潤/(損失)       | 4,388,133     | 809,004       | 343,790      | 1,258,084     | (503,847)    | 6,295,164     |
| 分佔聯營企業及合營企業利潤     | -             | -             | (687,163)    | -             | 1,150,636    | 463,473       |
| 所得稅稅前利潤/(損失)      | 4,388,133     | 809,004       | (343,373)    | 1,258,084     | 646,789      | 6,758,637     |
| 利息收入              | 5,292,864     | 305,476       | 80,340       | 214,688       | 909,185      | 6,802,553     |
| 利息支出              | (2,172,894)   | (1,236,734)   | (141,990)    | (477,525)     | (1,398,442)  | (5,427,585)   |
| 折舊和攤銷費用           | (270,151)     | (85,066)      | (36,809)     | (172,389)     | (181,474)    | (745,889)     |
| 其他資產減值轉回          | -             | -             | -            | -             | -            | -             |
| 信用減值轉回/(損失)       | 283,915       | (488)         | 1,257        | 48,433        | 4,507        | 337,624       |
| 本期非流動資產添置         | 66,800        | 10,989        | 1,468        | 176,425       | 190,068      | 445,750       |
| 於 2022 年 6 月 30 日 |               |               |              |               |              |               |
| 分部資產              | 284,014,987   | 306,108,752   | 41,505,787   | 152,689,265   | 152,252,561  | 936,571,352   |
| 分部負債              | (275,696,845) | (299,037,075) | (16,461,715) | (137,699,106) | (51,284,063) | (780,178,804) |



簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

58. 分部報告 - 續

(a) 業務分部 - 續

截至 2021 年 6 月 30 日止六個月

|                    | 財富管理          | 機構服務          | 投資管理         | 國際業務          | 其他           | 總計            |
|--------------------|---------------|---------------|--------------|---------------|--------------|---------------|
| 收入                 |               |               |              |               |              |               |
| - 外部               | 10,858,247    | 6,477,642     | 2,446,412    | 3,583,671     | 808,455      | 24,174,427    |
| - 分部間              | 65,505        | 1,656         | -            | -             | 21,647       | 88,808        |
| 其他收入及收益            | 476,908       | 26,622        | 57,320       | (42,812)      | (46,814)     | 471,224       |
| 分部收入、其他收入及收益       | 11,400,660    | 6,505,920     | 2,503,732    | 3,540,859     | 783,288      | 24,734,459    |
| 分部支出               | (7,389,581)   | (3,436,685)   | (594,697)    | (2,483,668)   | (2,385,489)  | (16,290,120)  |
| 分部經營利潤/(損失)        | 4,011,079     | 3,069,235     | 1,909,035    | 1,057,191     | (1,602,201)  | 8,444,339     |
| 分佔聯營企業及合營企業利潤      | -             | -             | 601,147      | 674           | 982,035      | 1,583,856     |
| 所得稅稅前利潤/(損失)       | 4,011,079     | 3,069,235     | 2,510,182    | 1,057,865     | (620,166)    | 10,028,195    |
| 利息收入               | 5,612,803     | 270,418       | 239,390      | 296,650       | 744,502      | 7,163,763     |
| 利息支出               | (2,559,768)   | (1,458,797)   | (143,816)    | (269,791)     | (831,496)    | (5,263,668)   |
| 折舊和攤銷費用            | (205,765)     | (58,767)      | (35,424)     | (185,043)     | (225,737)    | (710,736)     |
| 其他資產減值轉回           | -             | -             | -            | -             | -            | -             |
| 信用減值轉回/(損失)        | 194,934       | (491)         | (2,532)      | (16,127)      | 17,243       | 193,027       |
| 本期非流動資產添置          | 82,774        | 20,583        | 2,192        | 122,535       | 358,030      | 586,114       |
| 於 2021 年 12 月 31 日 |               |               |              |               |              |               |
| 分部資產               | 288,840,978   | 302,178,205   | 34,903,726   | 141,457,908   | 138,156,490  | 905,537,307   |
| 分部負債               | (285,063,892) | (301,729,678) | (14,441,230) | (128,171,610) | (24,095,113) | (753,501,523) |

分部收入、損益、資產及負債對賬：

|                | 截至 6 月 30 日止六個月 |            |
|----------------|-----------------|------------|
|                | 2022 年          | 2021 年     |
| 收入             |                 |            |
| 分部收入、其他收入及收益總額 | 23,578,593      | 24,734,459 |
| 分部間收入抵銷        | (99,571)        | (118,930)  |
| 合併收入、其他收入及收益總額 | 23,479,022      | 24,615,529 |
| 利潤             |                 |            |
| 分部所得稅稅前利潤總額    | 6,758,637       | 10,028,195 |
| 分部間利潤抵銷        | 15,359          | 8,706      |
| 合併所得稅稅前利潤      | 6,773,996       | 10,036,901 |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

58. 分部報告 - 續

(a) 業務分部 - 續

分部收入、損益、資產及負債對賬： - 續

|           | 2022 年<br>6 月 30 日   | 2021 年<br>12 月 31 日  |
|-----------|----------------------|----------------------|
| <b>資產</b> |                      |                      |
| 分部總資產     | 936,571,352          | 905,537,307          |
| 分部間資產對銷   | <u>(87,248,647)</u>  | <u>(98,886,474)</u>  |
| 合併總資產     | <u>849,322,705</u>   | <u>806,650,833</u>   |
| <b>負債</b> |                      |                      |
| 分部總負債     | (780,178,804)        | (753,501,523)        |
| 分部間負債對銷   | <u>87,248,647</u>    | <u>98,886,474</u>    |
| 合併總負債     | <u>(692,930,157)</u> | <u>(654,615,049)</u> |

截至 2022 年 6 月 30 日及 2021 年 6 月 30 日止六個月，本集團客戶基礎多樣，且概無客戶涉及本集團收入 10% 以上的交易。

(b) 地區信息

下表載列以下各項地區位置的資料：(i)本集團來自外部客戶的收入及(ii)本集團的物業及設備、投資物業、商譽、其他無形資產、於聯營企業與合營企業的權益及其他非流動資產(「指定非流動資產」)。客戶地理位置乃基於獲得服務位置劃分。對於指定非流動資產，如屬物業及設備和其他非流動資產，則按該資產所處的地理位置劃分；如屬商譽和其他無形資產，則按分配至的營運位置劃分；如屬於聯營企業和合營企業權益，則按其營運地劃分。

|           | 截至 2022 年 6 月 30 日止六個月 |                  |                   | 截至 2021 年 6 月 30 日止六個月 |                  |                   |
|-----------|------------------------|------------------|-------------------|------------------------|------------------|-------------------|
|           | 中國大陸                   | 海外               | 總計                | 中國大陸                   | 海外               | 總計                |
| 來自外部客戶的收入 | 16,582,825             | 3,861,204        | 20,444,029        | 20,590,756             | 3,583,671        | 24,174,427        |
| 其他收入及收益   | 2,711,612              | 323,381          | 3,034,993         | 483,914                | (42,812)         | 441,102           |
| 總計        | <u>19,294,437</u>      | <u>4,184,585</u> | <u>23,479,022</u> | <u>21,074,670</u>      | <u>3,540,859</u> | <u>24,615,529</u> |
|           | 2022 年 6 月 30 日        |                  |                   | 2021 年 12 月 31 日       |                  |                   |
|           | 中國大陸                   | 海外               | 總計                | 中國大陸                   | 海外               | 總計                |
| 指定非流動資產   | <u>26,597,651</u>      | <u>9,443,437</u> | <u>36,041,088</u> | <u>26,426,848</u>      | <u>8,973,237</u> | <u>35,400,085</u> |

## 59. 金融工具及風險管理

### (a) 風險管理政策及組織架構

#### (i) 風險管理政策

為了提高集團管理和運營的科學性、規範性和有效性，增強對金融風險的防範能力，保障集團各項業務持續、穩定、快速發展，根據《中華人民共和國證券法》、《證券公司監督管理條例》、《證券公司內部控制指引》、《證券公司全面風險管理規範》等有關規定並結合業務和管理實際情況，本集團制定了《風險管理基本制度》並經董事會審議通過，明確了風險管理目標、原則、公司總體及各風險類型的風險偏好及容忍度、風險管理流程、相關資源保障及考核機制。經營管理方面，制定並發佈了各類專業風險管理指引，明確了各類風險的管理流程及措施、風險指標及限額；此外，經營層面還制定了《風險控制指標管理辦法》、《子公司風險管理辦法(試行)》、《壓力測試機制實施方案》、《壓力測試實施細則》等政策。具體業務層面，集團根據各業務和管理條線自身的風險點，建立了業務風險管理制度或風險管理手冊。

本集團在日常經營活動中涉及的風險主要包括信用風險、流動性風險、市場風險、操作風險、聲譽風險、信息技術風險、合規風險和模型風險。本集團制定了相應的政策和程式來識別和分析這些風險，並結合實際設定適當的風險指標、風險限額、風險內部控制流程，通過資訊系統支援和有效的機制持續管理上述各類風險。

風險管理是本集團所有員工的共同責任，本集團通過培訓和考核的方式，促進全體員工不斷增強風險管理意識和風險敏感度以培養良好的風險管理文化。

#### (ii) 風險治理組織架構

本公司風險管理組織架構包括五個主要部分：董事會及合規與風險管理委員會，監事會，經營管理層及風險控制委員會，風險管理部及各類專業風險管理部門，其他各部門、分支機構及子公司。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

## 59. 金融工具及風險管理 - 續

### (a) 風險管理政策及組織架構 - 續

#### (ii) 風險治理組織架構 - 續

董事會是風險管理的最高決策機構，並對公司全面風險管理體系的有效性承擔最終責任。董事會設合規與風險管理委員會，對風險管理的總體目標、基本政策、風險評估報告進行審議並提出意見；對需董事會審議的重大決策的風險和重大風險的解決方案進行評估並提出意見。監事會承擔全面風險管理的監督責任，負責監督檢查董事會和經營管理層在風險管理方面的履職盡責情況並督促整改。經營管理層根據董事會的授權和批准，結合公司經營目標，具體負責實施風險管理工作，並下設風險控制委員會。公司設首席風險官，負責分管領導全面風險管理工作。風險管理部履行全面風險管理職責，對經營管理層和公司整體風險負責，牽頭管理市場風險、信用風險和操作風險。公司相關職能部門根據職責定位分別負責牽頭管理其他類型風險；公司其他各部門、分支機構及子公司對各自條線的風險管理工作負責，落實公司及各類風險牽頭管理部門制定的各項政策、流程和措施，接受各類風險牽頭管理部門的指導以及風險牽頭管理部門對各類風險管理、執行責任的分解。稽查部負責對公司風險管理流程的有效性與執行情況進行稽核檢查，並牽頭對公司全面風險管理體系進行評估。

### (b) 信用風險管理

信用風險是指由於產品或債券發行人違約、交易對手(客戶)違約導致公司資產受損失的風險。公司建立了覆蓋自有資金出資及受託資金業務的信用風險管理體系，將境內外所有子公司，以及比照子公司管理的各類孫公司納入進行統一管理，實現信用風險管理全覆蓋。

報告期內，本集團面臨的信用風險主要包括四類：一是在融資類業務中，客戶違約致使借出資券及息費遭受損失的風險；二是在債券投資業務中，發債主體違約造成的風險；三是在交易類業務中，對手方出現違約，導致資產遭受損失的風險；四是在擔保交收類業務中，客戶資金出現缺口，集團代客戶墊資從而可能給本集團造成損失的風險。

對於融資類業務，本集團執行嚴格的客戶及標的管理、持續動態監控、及時風險化解等全流程管控措施，把控業務信用風險。公司亦執行嚴格的風控流程和措施，對兩融業務進行專項風險檢查，加強業務逆周期管理機制，完善差異化客戶管控標準，兩融業務待追索金額保持在較低水平。

對於債券投資類業務，公司建立發行人統一管理體系，報告期內，公司修訂並重構重點行業和區域信用債底線管控方案，持續推進發行人信用風險管理模塊系統化建設，增強風險管控的效率和針對性。同時持續推進掛鉤 CAMS 評級結果的業務准入和限額規則落地執行，健全統一內評體系，提升集團整體風險的識別和管控能力。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

**59. 金融工具及風險管理 - 續**

**(b) 信用風險管理 - 續**

對於交易類業務，公司推進交易對手統一管理體系建設，拓展集團層面交易對手授信額度統一管理的覆蓋範圍，形成集團全量範圍交易對手名單制管理方案，嚴控業務風險敞口。同時，公司持續推進交易對手信用風險管理模塊系統化建設，逐步實現交易對手管理及相關流程的平臺化。

對於擔保交收類業務，本集團將其納入交易對手體系進行統一管理，同時探索增強客戶資質管理體系及准入標準，持續完善風險指標設計的前端管控並推進系統化建設，強化風險事件處理和風險傳導的管控能力。

同時，公司推進集團統一的客戶穿透管理體系系統化建設，全面梳理發佈《業務信用風險管控重點參考指引》，強化重點信用業務管控底線措施，並根據外部環境變化持續細化提升客戶 ESG 盡職調查風險管理機制，鞏固信用風險統一管理體系，提升應對外部複雜信用環境的能力及為各類信用業務發展提供強有力風控保障支撐的水準。

針對買入返售金融資產中的股票質押式回購業務，本集團綜合債務人持續還款情況、還款能力及履約保障比例，分析交易面臨的減持風險因素，劃分三個階段，確定減值準備，具體如下：

| 描述                         | 預期信用損失階段               |      |
|----------------------------|------------------------|------|
| 履約比高於平倉綫且未發生逾期             | 未來 12 個月預期信用損失         | 第一階段 |
| 履約比高於平倉綫、逾期天數不超過 90 天      | 整個存續期預期信用損失<br>未發生信用減值 | 第二階段 |
| 履約比處於平倉區但未逾期               |                        |      |
| 履約比處於平倉區、逾期天數不超過 90 天      | 整個存續期預期信用損失<br>已發生信用減值 | 第三階段 |
| 履約比低於 100%                 |                        |      |
| 履約比不低於 100%、逾期天數超過 90 天    |                        |      |
| 已進入場內違約處置或場外司法訴訟環節         |                        |      |
| 跟蹤到債務人出現重大財務困難、很可能破產或重組等情形 |                        |      |

本集團為不同融資主體及合約設置不同的平倉綫，平倉綫一般不低於 130%。

針對第一階段、第二階段風險合約，本集團根據履約保障比例及逾期天數，按照相應的損失率計提減值準備。于 2022 年 6 月 30 日，第一階段及第二階段風險合約減值損失率分別為 0.24% 及 1.01% (于 2021 年 12 月 31 日，第一階段風險合約減值損失率為 0.24%，無納入第二階段的風險合約)。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

59. 金融工具及風險管理 - 續

(b) 信用風險管理 - 續

針對第三階段風險合約，本集團從每筆合約的標的券及融資人兩個維度進行綜合評估，評估時考慮的因素包括但不限於標的券的版塊、市值、日均成交額、商譽佔比、重大風險指標等，以及融資人是否控股股東、是否受減持新規限制、是否黑名單或違約客戶、質押比例、擔保情況、增信措施等，併結合履約保障比例及逾期天數等指標，對合約進行減值測算，計提相應的減值準備，減值損失率為 10% - 100% 不等。

本集團納入預期信用損失減值評估範圍的金融工具的信用風險敞口按損失所處階段劃分如下：

| 預期信用損失                                       | 2022 年 6 月 30 日    |                              |                              | 合計        |
|--|--------------------|------------------------------|------------------------------|-----------|
|  | 未來 12 個月<br>預期信用損失 | 整個存續期<br>預期信用損失<br>(未發生信用減值) | 整個存續期<br>預期信用損失<br>(已發生信用減值) |           |
| 銀行結餘   | 565                | -                            | -                            | 565       |
| 融出資金   | 545,730            | 932,058                      | 95,267                       | 1,573,055 |
| 買入返售金融資產                                     | 12,180             | 546                          | 1,162,214                    | 1,174,940 |
| 應收款項   | 17,650             | 41,602                       | 36,691                       | 95,943    |
| 以攤余成本計量的債權投資<br>以公允價值計量且其變動計入<br>其他綜合收益的債務工具 | 4,047              | 11,635                       | -                            | 15,682    |
| 其他應收款項及預付款項                                  | 39,725             | -                            | -                            | 39,725    |
| 其他應收款項及預付款項                                  | 651                | 28,915                       | 778,868                      | 808,434   |
| 合計   | 620,548            | 1,014,756                    | 2,073,040                    | 3,708,344 |

| 預期信用損失                                       | 2021 年 12 月 31 日   |                              |                              | 合計        |
|--|--------------------|------------------------------|------------------------------|-----------|
|  | 未來 12 個月<br>預期信用損失 | 整個存續期<br>預期信用損失<br>(未發生信用減值) | 整個存續期<br>預期信用損失<br>(已發生信用減值) |           |
| 銀行結餘   | 1,157              | -                            | -                            | 1,157     |
| 融出資金   | 780,028            | 1,042,276                    | 92,007                       | 1,914,311 |
| 買入返售金融資產                                     | 12,440             | -                            | 1,106,337                    | 1,118,777 |
| 應收款項   | -                  | 97,739                       | -                            | 97,739    |
| 以攤余成本計量的債權投資<br>以公允價值計量且其變動計入<br>其他綜合收益的債務工具 | 3,480              | 11,635                       | -                            | 15,115    |
| 其他應收款項及預付款項                                  | 47,736             | -                            | 49,374                       | 97,110    |
| 其他應收款項及預付款項                                  | -                  | 24,565                       | 777,490                      | 802,055   |
| 合計   | 844,841            | 1,176,215                    | 2,025,208                    | 4,046,264 |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

**59. 金融工具及風險管理 - 續**

**(b) 信用風險管理 - 續**

**(i) 金融資產的信用評級分析**

對於債券投資類業務，公司建立發行人統一管理體系，通過系統實現集團各業務單位同一發行人投資總額的匯總監測，並對重點行業的信用債投資實行底線管控。同時持續推進掛鉤 CAMS 評級結果的業務准入和限額規則的落地執行，健全統一內評體系，提升集團整體風險的識別和管控能力。

**(c) 流動性風險管理**

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。本公司已建立了一套完整的流動性風險管理體系，對本公司整體的流動性風險實施識別、計量、監測、控制和報告，並不斷提高流動性風險管理的資訊化水準，以提高流動性風險識別、計量和監測的能力，以強化本公司應對流動性風險的能力。此外，本公司根據風險偏好建立規模適當的流動性資產儲備，持有充足的優質流動性資產，確保在壓力情景下能夠及時滿足流動性需求。

**(d) 市場風險管理**

市場風險指市場價格變動，如外匯匯率、利率和證券價格的變動等，影響本集團收入或持有的金融工具的價值而形成的風險。市場風險管理的目標是在可接受範圍內管理和控制市場風險，並使風險報酬率最大化。

**(i) 利率風險**

利率風險是指公司的財務狀況和現金流量受市場利率變動而發生波動的風險。本公司的生息資產主要為銀行結餘、結算備付金、融出資金、買入返售金融資產、存出保證金及債券投資等，付息負債主要為短期銀行借款、已發行的短期債務工具、拆入資金、賣出回購金融資產款、應付經紀客戶賬款、長期銀行借款、應付債券等。

對於資產負債表日持有的使本集團面臨公允價值利率風險的金融工具，本集團利用敏感性分析作為監控利率風險的主要方法。採用敏感性分析衡量在其他變數不變的假設下，利率發生合理、可能的變動時，將對淨利潤和股東權益產生的影響。

**59. 金融工具及風險管理 - 續**

**(d) 市場風險管理 - 續**

**(ii) 匯率風險**

匯率風險是指本集團進行的外幣業務因外匯匯率變動所產生的風險。本集團除了境外子公司持有以港幣或美元為記帳本位幣的資產及負債外，其他外幣資產及負債主要為境內公司持有的外幣貨幣資金、跨境業務中產生的外幣金融資產及負債以及子公司所購買外幣金融資產。對於不是以記帳本位幣計價的現金及銀行結餘、結算備付金、存出保證金、應收款項、代經濟客戶持有的現金、應付款項、長期債券等外幣資產和負債，如果出現短期的失衡情況，本集團會在必要時按市場匯率買賣外幣，以確保將淨風險敞口維持在可接受的水準。

**(iii) 價格風險**

本集團面臨以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融工具及以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產的權益投資產生之權益價格變動風險。本集團所面臨價格風險主要與本集團所持以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融工具價格波動而產生的相應淨利潤波動以及本集團所持以公允價值計量的金融工具價格波動而產生的相應權益波動有關。

**(e) 操作風險管理**

操作風險是指由不完善或有問題的內部程式、人員、系統或外部事件所造成公司損失的風險。風險管理部是本公司操作風險的牽頭管理部門，各專業風險管理部門、各業務部門、支持部門等按照職能分工，分別執行本業務及管理領域的操作風險管控。公司利用技術手段防範各項業務及管理流程、關鍵環節的操作風險，並加強流程管控，以保證操作風險管理的政策、制度能夠有效落實。公司運用風險與控制自我評估、關鍵風險指標監測、損失資料收集作為輔助工具加強對操作風險的管理。

本公司根據財政部、證監會、審計署、銀保監會聯合發佈的《企業內部控制基本規範》及其配套指引以及監管部門和公司相關工作要求，開展了以風險為導向的內部控制規範建設工作，並開展持續優化，將操作風險自我評估與內控自評相結合，對各業務流程中的固有風險、控制活動等進行了全面梳理、評估，對控制設計及執行的有效性進行了測試，對內控缺陷落實整改，全面梳理優化了公司各業務環節和制度流程，同時補充完善了風險控制矩陣及內控手冊，記錄了風險點、關鍵控制活動及業務主要流程圖，以保障公司內控措施的到位以及風險管理的有效性。此外，公司在日常工作中將操作風險管理及內部控制工作前移，全程參與新業務的制度流程及方案設計，充分識別和全面評估操作風險，通過設置前端控制、規範業務流程、建立發現型指標、開展培訓與檢查等前中後管理機制，以落實關鍵風險點的內部控制措施。



簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

## 59. 金融工具及風險管理 - 續

### (f) 資本管理

本集團資本管理目標：

- (i) 保證本集團持續經營能力，持續為股東創造回報，併為其他利益相關者創造利益；
- (ii) 支持本集團的穩定性及增長；
- (iii) 維持雄厚資本基礎支持業務發展；及
- (iv) 符合中國、中國香港及美國法規的資本規定。

證監會分別於 2020 年 1 月 23 日和 2020 年 3 月 20 日頒佈了經修訂的《證券公司風險控制指標計算標準規定》及《證券公司風險控制指標管理辦法》，對證券公司必須持續符合的風險控制指標體系及標準進行了修改，並要求於 2020 年 6 月 1 日起施行，本公司須就風險控制指標持續達到下列標準：

- (i) 淨資本與各項風險資本準備之和的比率不得低於 100%；
- (ii) 淨資本與淨資產的比率不得低於 20%；
- (iii) 淨資本與負債的比率不得低於 8%；
- (iv) 淨資產與負債的比率不得低於 10%；
- (v) 自營權益類證券及證券衍生品與淨資本的比率不得超過 100%；
- (vi) 自營非權益類證券及證券衍生品與淨資本的比率不得超過 500%；
- (vii) 核心淨資本與表內外資產總額的比率不得少於 8%；
- (viii) 優質流動性資產與未來 30 天現金淨流出量的比率不得少於 100%；
- (ix) 可用穩定資金與所需穩定資金的比率不得少於 100%；及
- (x) 融資(含融券)的金額與淨資本的比率不得超過 400%。

淨資本指資產淨值扣除管理辦法所指若干類別資產的風險調整。

在此期間，公司密切監測上述比率以確保其符合相關的資本要求。

本集團若干子公司與本公司一同須分別遵守中國大陸、香港和美國監管要求的資本規定。截至 2022 年 6 月 30 日止期間及 2021 年 12 月 31 日止年度，該等子公司均遵守資本規定。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

59. 金融工具及風險管理 - 續

(g) 金融資產轉讓

在日常業務中，本集團通過回購協議及融出證券將已確認的金融資產轉讓給對手方。本集團尚保留該部分已轉讓證券的風險與回報，因此並未於資產負債表終止確認此類金融資產。

本集團與客戶訂立賣出回購協議，借出分類為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產的債務證券、以攤余成本計量的債權投資。賣出回購協定是指如下交易，將證券出售並同時達成回購協議，在未來某時間以約定價格購回。即使回購價格是約定的，本集團仍面臨著顯著的信用風險、市場風險和出售這些證券獲取回報的風險。本集團尚保留該部分已轉讓債務證券的風險與回報，因此並未於資產負債表終止確認此類金融資產。

本集團與客戶訂立融出證券協定，借出分類為以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產的股票及交易所交易基金。根據融出證券協議規定，股票及交易所交易基金的法定所有權轉讓給客戶。儘管客戶可於協定期間出售相關證券，但有責任於未來指定日期向本集團歸還該等證券。由於本集團尚保留該部分已轉讓證券的風險與回報，因此並未於資產負債表終止確認此類金融資產。

以下表格概述了關於被轉讓卻未完全終止確認的金融資產及相關負債的賬面價值和公允價值：

2022 年 6 月 30 日

|           | 以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產 |                  | 以攤余成本計量的債權投資  | 合計               |
|-----------|------------------------|------------------|---------------|------------------|
|           | 賣出回購協議                 | 融出證券             | 賣出回購協議        |                  |
| 轉讓資產的賬面金額 | 4,617,710              | 4,144,350        | 519,300       | 9,281,360        |
| 相關負債的賬面金額 | (3,961,139)            | -                | (475,265)     | (4,436,404)      |
| 淨頭寸       | <u>656,571</u>         | <u>4,144,350</u> | <u>44,035</u> | <u>4,844,956</u> |

2021 年 12 月 31 日

|           | 以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產 |                  | 以攤余成本計量的債權投資  | 合計               |
|-----------|------------------------|------------------|---------------|------------------|
|           | 賣出回購協議                 | 融出證券             | 賣出回購協議        |                  |
| 轉讓資產的賬面金額 | 5,014,218              | 5,156,319        | 1,097,169     | 11,267,706       |
| 相關負債的賬面金額 | (4,635,158)            | -                | (1,019,936)   | (5,655,094)      |
| 淨頭寸       | <u>379,060</u>         | <u>5,156,319</u> | <u>77,233</u> | <u>5,612,612</u> |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

## 60. 公允價值資料

### (a) 金融工具公允價值

公允價值是指市場參與者之間在計量日進行的有序交易中出售一項資產所收取的價格或轉移一項負債所支付的價格。

#### (i) 第一層級金融工具

於活躍市場交易的金融工具的公允價值乃根據財務狀況表日的市場報價釐定。倘可從交易所、經銷商、經紀商定期即時獲得報價，且該價格來自實際定期進行的以公平磋商為基準的市場交易，則此等市場應視作活躍市場。本集團所持金融資產的市場報價乃買賣差價區間的收盤價。此等工具應納入第一層級。

#### (ii) 第二層級金融工具

非於活躍市場買賣之金融工具，其公允價值採用估值技術釐定。該等估值技術充分利用所得的可觀察市場數據，並盡量不依賴具體實體估計。倘按公允價值計量一項工具所需的所主要輸入數據均可觀察獲得，則該工具納入第二層級。

#### (iii) 第三層級金融工具

倘一個或多項主要輸入數據並非基於可觀察市場數據釐定，則該工具納入第三層級。

### (b) 非按公允價值列賬的金融工具之公允價值

并非按公允價值計量的金融資產及金融負債運用活躍市場報價估算或現金流量折現法進行評估。

本集团对持有的并非按公允價值計量的金融工具運用現金流折現法計量時使用的主要參數包括債券利率、匯率和交易對手信用利差。

並非按公允價值列賬的以攤余成本計量的債權投資、已發行的短期債務工具及長期債券的賬面價值及公允價值載列如下：

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

60. 公允價值資料 - 續

(b) 非按公允價值列賬的金融工具之公允價值 - 續

賬面價值

|                | 2022 年<br>6 月 30 日   | 2021 年<br>12 月 31 日  |
|----------------|----------------------|----------------------|
| 金融資產           |                      |                      |
| - 以攤余成本計量的債權投資 | 39,627,670           | 32,421,516           |
| 金融負債           |                      |                      |
| - 已發行的短期債務工具   | (48,840,031)         | (53,598,658)         |
| - 長期債券         | (124,912,141)        | (133,338,427)        |
| 總計             | <u>(173,752,172)</u> | <u>(186,937,085)</u> |

公允價值

|                | 2022 年 6 月 30 日    |                  |                   |                    |
|----------------|--------------------|------------------|-------------------|--------------------|
|                | 第一層級               | 第二層級             | 第三層級              | 總計                 |
| 金融資產           |                    |                  |                   |                    |
| - 以攤余成本計量的債權投資 | -                  | 40,030,699       | -                 | 40,030,699         |
| 金融負債           |                    |                  |                   |                    |
| - 已發行的短期債務工具   | 23,120,336         | -                | 25,728,939        | 48,849,275         |
| - 長期債券         | 100,711,565        | 6,185,934        | 19,724,997        | 126,622,496        |
| 總計             | <u>123,831,901</u> | <u>6,185,934</u> | <u>45,453,936</u> | <u>175,471,771</u> |
|                | 2021 年 12 月 31 日   |                  |                   |                    |
|                | 第一層次               | 第二層次             | 第三層次              | 總計                 |
| 金融資產           |                    |                  |                   |                    |
| - 以攤余成本計量的債權投資 | -                  | 32,781,490       | -                 | 32,781,490         |
| 金融負債           |                    |                  |                   |                    |
| - 已發行的短期債務工具   | 37,277,709         | -                | 16,325,123        | 53,602,832         |
| - 長期債券         | 112,667,024        | 6,100,632        | 15,447,590        | 134,215,246        |
| 總計             | <u>149,944,733</u> | <u>6,100,632</u> | <u>31,772,713</u> | <u>187,818,078</u> |

上述計入第二層級及第三層級的金融資產及金融負債的公允價值乃根據公認定價模式按貼現現金流量分析釐定，主要輸入數據為反映交易對手信用風險的貼現率。

除上文所述外，本公司董事認為合併財務狀況表中的金融資產及金融負債的賬面價值與其公允價值相若。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

60. 公允價值資料 - 續

(c) 公允價值層級

下表以按公允價值計量所屬的層級分類，呈列了在報告期末按公允價值計量的公允價值計量的金融工具。下表不包括非按公允價值計量的金融資產及金融負債（倘其賬面價值與其公允價值合理相若）之公允價值資料。

|                | 2022 年 6 月 30 日 |              |             | 總計           |
|----------------|-----------------|--------------|-------------|--------------|
|                | 第一層級            | 第二層級         | 第三層級        |              |
| 資產             |                 |              |             |              |
| 以公允價值計量且其變動計入  |                 |              |             |              |
| 當期損益的金融資產      |                 |              |             |              |
| - 債務證券         | 1,917,827       | 172,430,064  | 214,941     | 174,562,832  |
| - 權益類證券        | 86,932,382      | 9,263        | 11,187,259  | 98,128,904   |
| - 基金           | 93,619,353      | 1,258,359    | -           | 94,877,712   |
| - 理財產品         | -               | 15,827,471   | -           | 15,827,471   |
| - 貸款及墊款        | -               | -            | 3,019,536   | 3,019,536    |
| 以公允價值計量且其變動計入  |                 |              |             |              |
| 其他綜合收益的債務工具    | -               | 6,253,999    | 726,720     | 6,980,719    |
| 以公允價值計量且其變動計入  |                 |              |             |              |
| 其他綜合收益的權益工具    | -               | 35,984       | 87,794      | 123,778      |
| 其他投資           |                 |              |             |              |
| - 於非上市合營企業的投資  | -               | -            | 865,809     | 865,809      |
| 衍生金融資產         | 128,899         | 18,001,347   | 4,750,364   | 22,880,610   |
| 總計             | 182,598,461     | 213,816,487  | 20,852,423  | 417,267,371  |
| 負債             |                 |              |             |              |
| 以公允價值計量且其變動計入  |                 |              |             |              |
| 當期損益的金融負債      |                 |              |             |              |
| - 交易性金融負債      | (1,091,097)     | (35,016,262) | -           | (36,107,359) |
| - 指定為以公允價值計量且其 |                 |              |             |              |
| 變動計入當期損益的金融負債  | (1,065,473)     | (80,875)     | (3,620,902) | (4,767,250)  |
| 衍生金融負債         | (59,744)        | (8,892,712)  | (2,595,503) | (11,547,959) |
| 總計             | (2,216,314)     | (43,989,849) | (6,216,405) | (52,422,568) |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

60. 公允價值資料 - 續

(c) 公允價值層級 - 續

|                                 | 2021 年 12 月 31 日   |                     |                    | 總計                  |
|---------------------------------|--------------------|---------------------|--------------------|---------------------|
|                                 | 第一層次               | 第二層次                | 第三層次               |                     |
| 資產                              |                    |                     |                    |                     |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>當期損益的金融資產      |                    |                     |                    |                     |
| - 債務證券                          | 1,478,884          | 158,618,052         | 499,955            | 160,596,891         |
| - 權益類證券                         | 111,833,214        | 6,166,907           | 4,122,063          | 122,122,184         |
| - 基金                            | 48,717,822         | 916,923             | -                  | 49,634,745          |
| - 理財產品                          | -                  | 19,294,123          | -                  | 19,294,123          |
| - 貸款及墊款                         | -                  | -                   | 3,611,229          | 3,611,229           |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>其他綜合收益的金融資產    |                    |                     |                    |                     |
| - 債務證券                          | -                  | 8,405,174           | 909,525            | 9,314,699           |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>其他綜合收益的權益工具    | -                  | 74,532              | 88,606             | 163,138             |
| 其他投資                            |                    |                     |                    |                     |
| - 於非上市合營企業的投资                   | -                  | -                   | 823,289            | 823,289             |
| 衍生金融資產                          | 72,207             | 12,495,885          | 2,679,713          | 15,247,805          |
| 總計                              | <u>162,102,127</u> | <u>205,971,596</u>  | <u>12,734,380</u>  | <u>380,808,103</u>  |
| 負債                              |                    |                     |                    |                     |
| 以公允價值計量且其變動計入<br>當期損益的金融負債      |                    |                     |                    |                     |
| - 交易性金融負債                       | (523,841)          | (26,647,350)        | -                  | (27,171,191)        |
| - 指定為以公允價值計量且其<br>變動計入當期損益的金融負債 | (249,712)          | (95,161)            | (3,606,854)        | (3,951,727)         |
| 衍生金融負債                          | (79,678)           | (8,411,922)         | (2,151,622)        | (10,643,222)        |
| 總計                              | <u>(853,231)</u>   | <u>(35,154,433)</u> | <u>(5,758,476)</u> | <u>(41,766,140)</u> |

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月期間，本集團无由第二層次轉入第一層次的以公允價值計量的金融資產（截至 2021 年 12 月 31 日止年度：人民幣 2,509 百萬元）。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

60. 公允價值資料 - 續

(c) 公允價值層級 - 續

(i) 第二層級金融工具的估值方法

| 金融資產/負債                    | 公允價值層級 | 估值技術及主要輸入參數  |
|----------------------------|--------|--|
| - 以公允價值計量且其變動計入損益的債券       | 第二層級   | 現金流量折現法，基於合約金額和票面利率估算未來現金流，並按反映債券信用風險的利率折現。            |
| - 以公允價值計量且其變動計入損益的權益類證券    | 第二層級   | 最近市場成交價。   |
| - 以公允價值計量且其變動計入損益的投資基金     | 第二層級   | 基金管理人披露的淨值。  |
| - 以公允價值計量且其變動計入損益的理財產品     | 第二層級   | 產品管理人披露的淨值。  |
| - 以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的債務工具 | 第二層級   | 現金流量折現法，基於合約金額和票面利率估算未來現金流，並按反映債券信用風險的利率折現。            |
| - 以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的權益工具 | 第二層級   | 最近市場成交價。   |
| - 衍生金融資產/負債                | 第二層級   | 現金流量折現法，未來現金流根據期末可觀察到的遠期匯率及合同利率估計並按反映各交易對手信用風險折現率進行折現。 |
| - 交易性金融負債                  | 第二層級   | 現金流量折現法，基於合同條款估算未來現金流，並按反映信用風險的折現率折現。                  |
| - 指定為以公允價值計量且變動計入當期損益的金融負債 | 第二層級   | 根據相關投資的公允價值計算，該等投資是各投資組合中的債務證券和公開交易的股權投資。              |

(ii) 第三層級金融工具

| 金融資產/負債                    | 公允價值層級 | 估值技術及主要輸入數據                  | 重大不可觀察輸入數據                    | 不可觀察輸入數據與公允價值的關係                     |
|----------------------------|--------|------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| - 以公允價值計量且其變動計入損益的貸款、墊款及債券 | 第三層級   | 貼現現金流量模型                     | 經風險調整的貼現率和預計現金流               | 經風險調整的貼現率越高，公允價值越低<br>預計現金流越高，公允價值越高 |
| - 以公允價值計量且其變動計入損益的非上市股權投資  | 第三層級   | 使用市場法計算，並就缺乏市場流通性折扣作調整       | 財務指征如可比上市公司的市盈率或市淨率等指標及流動性折扣率 | 折扣率越高，公允價值越低<br>市場乘數越高，公允價值越高        |
| - 以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的債務工具 | 第三層級   | 貼現現金流量模型                     | 經風險調整的貼現率和預計現金流               | 經風險調整的貼現率越高，公允價值越低<br>預計現金流越高，公允價值越高 |
| - 以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的權益工具 | 第三層級   | 使用市場法計算，並就缺乏市場流通性折扣作調整       | 財務指征如可比上市公司的市盈率或市淨率等指標及流動性折扣率 | 折扣率越高，公允價值越低<br>市場乘數越高，公允價值越高        |
| - 非上市合營企業投資                | 第三層級   | 貼現現金流量模型                     | 經風險調整的貼現率和預計現金流               | 經風險調整的貼現率越高，公允價值越低<br>預計現金流越高，公允價值越高 |
| - 衍生金融資產/負債                | 第三層級   | 布萊克-斯科爾斯期權定價模型<br>蒙特卡洛期權定價模型 | 標的資產的價格波動率                    | 價格波動率越高，對公允價值影響越大                    |
| - 指定為以公允價值計量且變動計入當期損益的金融負債 | 第三層級   | 使用市場法計算，並就缺乏市場流通性折扣作調整       | 財務指征如可比上市公司的市盈率或市淨率等指標及流動性折扣率 | 折扣率越高，公允價值越低<br>市場乘數越高，公允價值越高        |

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

60. 公允價值資料 - 續

(c) 公允價值層級 - 續

(ii) 第三層級金融工具 - 續

下表呈列公允價值層級中第三層級公允價值計量的期初結餘及期末結餘的對賬：

|                                 | 以公允價值計量<br>且其變動計入<br>當期損益<br>的金融資產 | 其他投資           | 以公允價值計量<br>且其變動計入<br>其他綜合收益<br>的債務工具 | 以公允價值計<br>量且其變動計<br>入其他綜合收<br>益的權益工具 | 衍生金融資產           | 總計                | 以公允價值計量<br>且其變動計入<br>當期損益<br>的金融負債 | 衍生金融負債             | 總計                 |
|---------------------------------|------------------------------------|----------------|--------------------------------------|--------------------------------------|------------------|-------------------|------------------------------------|--------------------|--------------------|
| 2022 年 1 月 1 日                  | 8,233,247                          | 823,289        | 909,525                              | 88,606                               | 2,679,713        | 12,734,380        | (3,606,854)                        | (2,151,622)        | (5,758,476)        |
| 轉入                              | 141,164                            | -              | -                                    | -                                    | -                | 141,164           | -                                  | -                  | -                  |
| 轉出                              | -                                  | -              | -                                    | -                                    | -                | -                 | -                                  | -                  | -                  |
| 當期收益或損失                         | (489,436)                          | 42,520         | 65,874                               | -                                    | 2,171,546        | 1,790,504         | (130,878)                          | (516,980)          | (647,858)          |
| 於其他綜合收益確認的<br>公允價值變動            | -                                  | -              | (18,757)                             | (812)                                | -                | (19,569)          | -                                  | 24,820             | 24,820             |
| 增加                              | 7,703,249                          | -              | 268,456                              | -                                    | 100              | 7,971,805         | -                                  | (40,364)           | (40,364)           |
| 出售                              | (278,106)                          | -              | -                                    | -                                    | (12)             | (278,118)         | -                                  | 50,200             | 50,200             |
| 結算                              | (888,382)                          | -              | (498,378)                            | -                                    | (100,983)        | (1,487,743)       | 116,830                            | 38,443             | 155,273            |
| 2022 年 6 月 30 日                 | <u>14,421,736</u>                  | <u>865,809</u> | <u>726,720</u>                       | <u>87,794</u>                        | <u>4,750,364</u> | <u>20,852,423</u> | <u>(3,620,902)</u>                 | <u>(2,595,503)</u> | <u>(6,216,405)</u> |
| 計入報告期末所持資產 /<br>負債本期收益或損失<br>總額 | <u>(579,438)</u>                   | <u>42,520</u>  | <u>-</u>                             | <u>-</u>                             | <u>1,699,640</u> | <u>1,162,722</u>  | <u>(120,320)</u>                   | <u>(774,820)</u>   | <u>(895,140)</u>   |



簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

60. 公允價值資料 - 續

(c) 公允價值層級 - 續

(ii) 第三層級金融工具 - 續

下表呈列公允價值層級中第三層級公允價值計量的期初結餘及期末結餘的對賬： - 續

|                                 | 以公允價值計量<br>且其變動計入<br>當期損益<br>的金融資產 | 其他投資     | 以公允價值計量<br>且其變動計入<br>其他綜合收益<br>的債務工具 | 以公允價值計量<br>且其變動計入<br>其他綜合收益<br>的權益工具 | 衍生金融資產    | 總計          | 以公允價值計量<br>且其變動計入<br>當期損益<br>的金融負債 | 衍生金融負<br>債  | 總計          |
|---------------------------------|------------------------------------|----------|--------------------------------------|--------------------------------------|-----------|-------------|------------------------------------|-------------|-------------|
| 2021 年 1 月 1 日                  | 12,343,592                         | 888,195  | 877,244                              | 91,551                               | 402,155   | 14,602,737  | (3,184,018)                        | (1,508,593) | (4,692,611) |
| 轉入                              | 761,515                            | -        | -                                    | -                                    | -         | 761,515     | -                                  | -           | -           |
| 轉出                              | (1,192,728)                        | -        | -                                    | -                                    | -         | (1,192,728) | -                                  | -           | -           |
| 年度收益或損失                         | (1,537,609)                        | (64,906) | 10,357                               | -                                    | 756,736   | (835,422)   | (563,382)                          | (2,026,714) | (2,590,096) |
| 於其他綜合收益確認的<br>公允價值變動            | -                                  | -        | (6,812)                              | (2,945)                              | -         | (9,757)     | -                                  | 20,164      | 20,164      |
| 增加                              | 5,867,410                          | -        | 566,508                              | -                                    | 294,056   | 6,727,974   | -                                  | (344,153)   | (344,153)   |
| 出售                              | (613,010)                          | -        | -                                    | -                                    | (263,616) | (876,626)   | 1,282                              | 402,951     | 404,233     |
| 結算                              | (7,395,923)                        | -        | (537,772)                            | -                                    | 1,490,382 | (6,443,313) | 139,264                            | 1,304,723   | 1,443,987   |
| 2021 年 12 月 31 日                | 8,233,247                          | 823,289  | 909,525                              | 88,606                               | 2,679,713 | 12,734,380  | (3,606,854)                        | (2,151,622) | (5,758,476) |
| 計入報告期末所持資產 /<br>負債本期收益或損失<br>總額 | (1,809,940)                        | (64,906) | -                                    | -                                    | 2,182,267 | 307,421     | (165,692)                          | (882,112)   | (1,047,804) |

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月期間，轉入或轉出第三層次是由於部分金融工具的公允價值計量估值技術及輸入值發生改變（截至 2021 年 12 月 31 日止年度：一致）。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

## 61. 通過購買子公司收購資產

於 2022 年 6 月，本集團以人民幣 673,523 千元的交易價格收購上海盛鉅資產經營管理有限公司（"盛鉅"）100% 的股權，以實際購置上海保利廣場 C 棟房產用於日常辦公。本集團認為所收購房產不構成業務。

上述收購事項的交易價款已于 2021 年全額支付。于 2022 年 6 月 30 日止 6 個月，收購盛鉅產生淨現金流入人民幣 16,309 千元。

盛鉅在收購日可辨認資產和負債的價值如下：

|             | <u>於收購日</u>    |
|-------------|----------------|
| 現金及銀行結餘     | 16,309         |
| 物業及設備       | 656,616        |
| 其他應收款項及預付款項 | 190            |
| 其他资产        | 408            |
|             | <u>673,523</u> |

## 62. 報告日期後事項

### (a) 發行公司債券

於 2022 年 8 月 9 日，本公司已完成 2022 年度第一期短期公司債券公開發行工作，該債券面向專業投資者發行，規模為人民幣 50 億元。該短期公司債券的年利率為 1.65%，期限為 92 天。

於 2022 年 8 月 10 日，本集團境外全資子公司華泰國際金融控股有限公司旗下附屬公司華泰國際財務有限公司完成 3 筆中期票據發行工作，發行金額分別為 3 億港幣、0.75 億美元及 0.15 億美元，發行期限為 3 個月至 1 年，發行年利率為 2.00% 至 3.00%。

於 2022 年 8 月 15 日，本公司已完成 2022 年度第二期公司債券公開發行工作，該債券面向專業投資者發行，規模為人民幣 20 億元。該公司債券的年利率為 2.43%，期限為 2 年。

於 2022 年 8 月 19 日，本公司已完成 2022 年度第二期短期公司債券公開發行工作，該債券面向專業投資者發行，規模為人民幣 50 億元。該短期公司債券的年利率為 1.78%，期限為 182 天。

於 2022 年 8 月 26 日，本公司已完成 2022 年度第三期公司債券公開發行工作，該債券面向專業投資者發行，規模為人民幣 30 億元。該公司債券的年利率為 2.33%，期限為 2 年。

簡明合併財務報表附註

截至 2022 年 6 月 30 日止六個月

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

**62. 報告日期後事項 - 續**

**(b) 發行永續次級債**

於 2022 年 7 月 11 日，本公司已完成 2022 年度第二期永續次級債券的公開發行工作，本次發行規模為人民幣 30 億元。債券面值為人民幣 100 元，票面利率為 3.59%。永續債無到期日，但本公司有權于永續債第 5 個和其後每個付息日按面值加應付利息 (包括所有遞延支付的利息及其孳息) 贖回該債券。

該永續債票面利率在前 5 個計息年度內保持不變。如本公司未行使贖回權，自第 6 個計息年度起，永續債每 5 年重置一次票面利率，重置票面利率以當期基準利率加上初始利差再加上 300 個基點確定。當期基準利率為票面利率重置日前 5 個工作日中國債券資訊網公佈的中債銀行間固定利率國債收益率曲線中，待償期為 5 年的國債收益率算術平均值。

除非發生強制付息事件，債券的每個付息日，本公司可自行選擇將當期利息以及已經遞延的所有利息及其孳息推遲到下一個付息日支付，且不受任何遞延支付利息次數的限制。強制付息事件是指付息日前 12 個月，本公司向普通股股東分紅或減少註冊資本。當發生強制付息事件時，本公司不得遞延當期利息及已經遞延的所有利息及其孳息。

**(c) 收購子公司的少數股東權益**

2022 年 7 月，本公司完成了對 Deluxe Family Co.,Ltd.持有的華泰期貨有限公司 40% 股權的收購。於 2022 年 7 月 7 日，華泰期貨有限公司完成了股權的工商變更登記，至此，本公司對華泰期貨有限公司的持股比例變更為 100%，華泰期貨成為本集團的全資子公司。

本次收購事項的對價為人民幣 1,590 百萬元，由本公司以現金支付。