

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，  
中文公司名稱為华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2023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2023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2023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2023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，2023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、胡曉女士及張金鑫先生；以及獨立非執行董事王建文先生、王全勝先生、彭冰先生、王兵先生及謝湧海先生。

## 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.....	94
環境與社會責任 .....	107
重要事項.....	111
股份變動及股東情況 .....	131
債券相關情況 .....	139
備查文件目錄 .....	150
證券公司信息披露 .....	150
附錄： 信息披露索引 .....	151
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	胡曉	公務原因	張偉
獨立董事	彭冰	公務原因	王建文

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

國內外宏觀經濟及貨幣政策、金融及證券行業的法律法規、商業及金融行業的變化趨勢等因素，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；因公司或工作人員的經營管理或執業行為違反法律、法規或準則而使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合規風險；公司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；由於市場價格（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；因融資方、發行人或交易對手等違約導致公司損失的信用風險；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流動性風險；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，從而造成損失的信息技術風險；由於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；由於公司行為或外部事件，及其工作人員違反廉潔規定、職業道德、業務規範、行規行約等相關行為，導致投資者、發行人、監管機構、自律組織、社會公眾、媒體等對公司形成負面評價，從而損害其品牌價值，不利其正常經營，甚至影響到市場穩定和社會穩定的聲譽風險；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；公司員工利用職權謀取私利給公司帶來危害性或負面影響可能性的廉潔風險；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	華泰國際全資子公司AssetMark Financial Holdings, Inc.
江蘇銀行	指	江蘇銀行股份有限公司
北交所	指	北京證券交易所
董事會	指	本公司董事會
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）
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
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、港幣	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、 公司、母公司	指	於中國以华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日由前身华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
華泰期貨	指	華泰證券全資子公司華泰期貨有限公司
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 《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》

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
QFII	指	合格境外機構投資者
報告期	指	2023年1月1日至2023年6月30日止六個月期間
《證券法》	指	《中華人民共和國證券法》(經不時修訂)
《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
上交所	指	上海證券交易所
深交所	指	深圳證券交易所
新加坡子公司	指	華泰國際全資子公司Huatai Securities (Singapore) Pte. Limited
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，一家中國內地金融資料、信息和軟件服務企業
%	指	百分比

2023年中期報告中，部份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	9,075,589,027.00	9,075,589,027.00
淨資本	93,158,894,331.82	92,975,958,998.68

### 公司的各單項業務資格情況

報告期內，根據公司收到的《關於华泰證券股份有限公司自營參與碳排放權交易的無異議函》，中國證監會對公司在境內合法交易場所自營參與碳排放權交易無異議。

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：許可項目：證券業務；證券投資諮詢；公募證券投資基金銷售；證券投資基金託管（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，具體經營項目以審批結果為準）一般項目：證券公司為期貨公司提供中間介紹業務（除依法須經批准的項目外，憑營業執照依法自主開展經營活動）

## 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  
張金鑫先生

#### 獨立非執行董事

王建文先生  
王全勝先生  
彭冰先生  
王兵先生  
謝涌海先生

### 專門委員會名單

#### 發展戰略委員會

張偉先生(主任委員)  
周易先生  
陳仲揚先生  
胡曉女士  
張金鑫先生

#### 合規與風險管理委員會

周易先生(主任委員)  
柯翔先生  
王建文先生

#### 審計委員會

王兵先生(主任委員)  
丁鋒先生  
謝涌海先生

#### 提名委員會

王全勝先生(主任委員)  
尹立鴻女士  
彭冰先生

#### 薪酬與考核委員會

王全勝先生(主任委員)  
彭冰先生  
王兵先生

## 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

姓名	鄺燕萍
聯繫地址	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62樓
公司網址	<a href="http://www.htsc.com.cn">http://www.htsc.com.cn</a>
電子信箱	<a href="mailto:boardoffice@htsc.com">boardoffice@htsc.com</a>
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
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地點(A股)	中國江蘇省南京市江東中路228號
公司中期報告備置地地點(H股)	中國江蘇省南京市江東中路228號； 中國香港皇后大道中99號中環中心62樓
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

有關公司通訊語言版本及備索取渠道的安排，H股股東可隨時致電熱線+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	德勤華永會計師事務所(特殊普通合夥)
	辦公地址	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	德勤•關黃陳方會計師行
		於香港《財務匯報局條例》下的註冊公眾利益實體核數師
	辦公地址	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	德勤華永會計師事務所(特殊普通合夥)
	辦公地址	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	北京市金杜律師事務所
	辦公地址	中國北京市朝陽區東三環中路1號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	高偉紳律師行
	辦公地址	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
		調整後	調整前	比上年同期 增減(%)
收入、其他收入及收益總計	25,952,554	23,479,022	23,479,022	10.54
所得稅前利潤	7,997,428	6,773,996	6,773,996	18.06
本期利潤－歸屬於本公司股東	6,555,640	5,375,963	5,375,208	21.94
經營活動(所用)／所得現金淨額	(13,683,077)	26,018,313	26,018,313	不適用
本期稅後其他綜合收益總額	733,051	515,614	515,614	42.17

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
		調整後	調整前	比上年度末 增減(%)
資產總額	887,070,258	846,570,990	846,567,016	4.78
負債總額	716,556,908	678,714,380	678,718,307	5.58
本公司股東應佔總權益	167,504,156	165,095,102	165,087,201	1.46
股東權益合計	170,513,350	167,856,610	167,848,709	1.58
總股本(股)	9,075,589,027	9,075,589,027	9,075,589,027	—

## (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
		調整後	調整前	比上年同期 增減(%)
基本每股收益(人民幣元/股)	0.70	0.58	0.58	20.69
稀釋每股收益(人民幣元/股)	0.68	0.56	0.56	21.43
加權平均淨資產收益率(%)	4.23	3.69	3.69	增加0.54個 百分點
資產負債率(%) <sup>註1</sup>	76.57	77.35	77.35	減少0.78個 百分點
歸屬於本公司普通股股東每股 淨資產(人民幣元/股) <sup>註2</sup>	16.34	15.40	15.40	6.10

註1：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)。

註2：歸屬於本公司普通股股東每股淨資產已扣除永續債影響。

公司主要會計數據和財務指標的說明：

自2023年1月1日起，本集團應用國際會計準則第12號(修訂本)，並追溯調整以前年度會計報表。於本中期期間，應用其他新國際財務報告準則及國際財務報告準則修訂本不會對本集團本期及前期的財務狀況及業績產生重大影響。詳情請參閱本報告財務報告附註3「主要會計政策」。



### (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	93,158,894,331.82	92,975,958,998.68
淨資產	145,041,485,952.12	143,638,401,461.64
風險覆蓋率(%)	246.50	240.14
淨資本／淨資產(%)	64.23	64.73
淨資本／負債(%)	22.80	23.14
淨資產／負債(%)	35.49	35.76
自營權益類證券及其衍生品／淨資本(%)	31.92	45.73
自營非權益類證券及其衍生品／淨資本(%)	357.77	316.80
核心淨資本	64,158,894,331.82	61,983,972,665.79
附屬淨資本	29,000,000,000.00	30,991,986,332.89
各項風險資本準備之和	37,793,273,517.11	38,717,728,473.17
表內外資產總額	490,513,862,767.84	483,308,624,857.94
資本槓桿率(%)	14.24	14.10
流動性覆蓋率(%)	196.93	166.57
淨穩定資金率(%)	131.64	129.33

### 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2023年1-6月及2022年1-6月的歸屬於上市公司股東的淨利潤、2023年6月30日及2022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，具有較強的周期性與波動性特點。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。

本集團是一家行業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境內外股權融資業務、債券融資業務、財務顧問業務、場外業務等。股權融資業務方面，為客戶提供境內外首次公開發行股票、股權再融資、存托憑證等發行承銷服務。債券融資業務方面，為客戶提供境內外各類債券融資、資產證券化等服務。財務顧問業務方面，為客戶提供包括國企改革、產業併購、股份收購、融資顧問、企業重整以及公募REITs財務顧問等服務。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、財務顧問費等。
- (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等。
- (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，並從事科創板股票、金融衍生品及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，並從事銀行間市場、交易所市場做市服務，以及碳排放權交易等。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、業務收入等。

### 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。此外，華泰國際於2022年9月在新加坡設立全資子公司，報告期內，相關業務牌照申請已獲新加坡金融管理局原則性批覆。

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、財富管理平台、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。財富管理平台方面，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托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。2022年，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；獲得深交所予以的互聯互通全球存托憑證境外跨境轉換機構備案，成為2022年滬倫通規則修訂並雙向拓寬適用範圍後，首批獲深交所備案開展跨境轉換業務的機構。2023年，華泰金控(香港)成為盧森堡證券交易所上市和交易會員，並成為香港交易所認股證「窩輪」發行商。

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的收購，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。2022年12月，AssetMark完成對Adhesion Wealth的收購，持續打造領先的業務模式和先進的技術平台。

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「2022年度十佳期權經紀商」等獎項

深圳證券交易所：  
公司榮獲「2022年度期權優秀經紀商獎」「2022年度期權新品種推廣獎」等獎項

香港交易所：  
公司榮獲「2022年港股通卓越券商獎」

《中國證券報》舉辦的「第一屆基金投顧金牛獎」評選：  
公司榮獲「基金投顧機構金牛獎」

易觀智庫統計數據：

「漲樂財富通」2023年上半年末月活數排名第一

《證券時報》舉辦的「首屆中國證券業數字化轉型君鼎獎」評選：

「漲樂財富通」榮獲「中國證券業十大品牌APP」「中國證券業投顧服務APP」

《財資》雜誌：

「漲樂全球通」榮獲「香港地區最佳手機券商APP」

### 機構服務業務

上海證券交易所：  
華泰聯合證券榮獲「2022年度公司債券優秀承銷商」「2022年度產業債券優秀承銷商」「2022年度服務國家戰略優秀承銷商」

深圳證券交易所：  
華泰聯合證券榮獲「2022年度優秀公司債券承銷商」「2022年度優秀固定收益產品存續期管理機構」等獎項

《新財富》舉辦的「第十六屆最佳投行」評選：

華泰聯合證券榮獲「本土最佳投行」「最佳踐行ESG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：  
公司榮獲「2022年度優秀科創板股票做市商」等獎項

華泰資管公司榮獲「2022年度資產證券化業務優秀管理人」「2022年度優秀基礎設施公募REITs參與人」  
南方基金榮獲「2022年度優秀債券投資機構(其他資管類)」  
華泰柏瑞榮獲「十佳ETF管理人」

深圳證券交易所：  
華泰資管公司榮獲「2022年度優秀資產支持專項計劃管理人」

香港中資基金業協會和彭博舉辦的「2022年度離岸中資基金大獎」評選：

華泰資管公司榮獲「年度最佳跨境業務獎」「年度最佳創新產品獎」等獎項

投資中國舉辦的「投中2022年度榜」評選：

華泰紫金投資榮獲「中國最佳回報私募股權投資機構TOP10」「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TOP30」「中國最佳券商私募基金子公司TOP5」「中國醫療及健康服務產業最佳醫療器械領域投資機構TOP20」「中國醫療及健康服務產業最佳醫療服務領域投資機構TOP10」等獎項

《中國證券報》：

南方基金榮獲「基金投顧顧問服務金牛獎」

《證券時報》：

南方基金榮獲「三年被動投資明星基金公司獎」

華泰柏瑞榮獲「十大明星基金公司獎」「三年被動投資明星基金公司獎」

## 國際業務

《彭博商業周刊》舉辦的「金融機構大獎」評選：

華泰國際榮獲「年度科技證券公司卓越大獎」「年度金融衍生產品機構卓越大獎」「優端客戶級別產品及服務卓越大獎」「風險管理卓越大獎」「數碼創新卓越大獎」「首次公開招股項目卓越大獎」「企業融資卓越大獎(中國大灣區)」

國際知名金融雜誌《亞洲貨幣》舉辦的「2023獎項榜單」評選：

華泰國際榮獲「香港地區最佳券商」「大灣區最具創新性投資銀行」

國際知名私募債行業雜誌《PDI(Private Debt Investor)》舉辦的「2022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)」「最佳優先級私募債投資機構(亞太區)」

《財資》雜誌舉辦的「2022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」

Cerulli Associates及其他公開信息：

截至2023年第一季度末，AssetMark在美國TAMP行業中的市場佔有率為11.9%，排名第二



### 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

本集團致力將科技打造成為最核心的競爭力之一，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，積極運用數字化思維和手段改造業務與管理模式，着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。在財富管理領域，依託「漲樂財富通8.0」，通過多元內容的個性化、精細化運營，持續打造千人千面的財富管理平台；在機構服務領域，自主研發的機構客戶服務數字化平台「行知3.0」助力企業和機構投資者有效提升生產力，探索全新開放生態模式。持續賦能一線員工，依託「聊TA」、青雲、投行雲等展業工作平台，有效提升員工效能，推動客戶規模增長。加速向業務深度平台化目標邁進，持續推進FICC大象交易平台、分布式極速交易平台的建設，核心交易平台效能顯著提升；依託信用分析管理系統(CAMS系統)、融券通4.0等平台，持續賦能業務模式創新；着力打造、升級數智中台3.0以及睿思投研平台，構建集團一體化中台支撐能力。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、體系化的競爭優勢奠定了堅實基礎。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安全等前沿領域，構築面向未來的科技能力儲備。

## (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。本集團致力打造「人+平台」的一體化運營體系，建立總部驅動、總分聯動、一體運營的財富管理運營體系，打造專業化、開放化的平台發展生態，不斷匯聚專業的金融服務能力和專業的金融服務資訊，不斷做大客戶規模、生態夥伴規模，積極擴大品牌影響力。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、精準賦能投資顧問。截至報告期末，「漲樂財富通」累計下載量7,223.69萬。根據易觀智庫統計數據，2023年6月底，「漲樂財富通」月活數位居證券公司類APP第一名。自2014年以來，本集團股票基金交易量一直排名行業第一。深入推進買方投資顧問業務發展，構建覆蓋資產、策略、產品的一體化投研模式和數字化平台，以及以客戶盈利體驗為核心的陪伴服務體系，打造「省心系列」買方投資顧問品牌。報告期內，本集團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2023年第二季度的統計，本公司股票及混合公募基金保有規模、非貨幣市場公募基金保有規模均排名證券行業第二。

### (三) 全鏈條服務實體經濟與客戶成長的一流投資銀行業務

本集團緊抓全面註冊制不斷推進落實的重大機遇，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。報告期內，本集團投資銀行業務進一步鞏固市場頭部地位，業務實力進一步提升。本集團境內股權主承銷規模、全品種債券主承銷規模進一步提升，主承銷規模均排名行業第三。本集團併購重組業務重點推進標桿性大型項目、創新項目，並積極拓展客戶持續服務，始終處於行業前列，自2012年以來許可類併購重組項目累計交易數量位居市場第一。本集團不斷加大行業深耕力度，在重點行業領域服務龍頭客戶，擁有高質量的客戶基礎，完成多單具有市場影響力的項目。

### (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，截至報告期末資產管理規模人民幣4,570.01億元。聚焦券商特色，以基於券商全業務鏈的投資資管和投行資管服務為抓手，一站式提供一流的投資產品、資產配置及整體金融服務解決方案，賦能客戶的資產管理服務旅程。強化與集團雙向驅動，立足投行基因優勢，發揮數字化應用能力，不斷提升主動管理能力，培育差異化的核心競爭力。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、流動性以及風險收益的不同需求。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，並在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。報告期內，本集團企業ABS發行數量與發行規模均排名行業第三。ATOMS系統釋放業務支撐能力，基本形成集團ABS分析體系和專業標準，成為國內首個ABS產品創設和專業分析及評價平台。

## (五) 加快全球佈局與打造跨境服務生態推動國際化發展邁上新台階

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，國際評級機構標準普爾對本公司及子公司華泰國際的長期發行人評級維持「BBB+」，展望穩定，為中資券商最高水平。華泰國際依託集團境內資源，以跨境為抓手，回歸券商本源，聚焦發展資本市場中介業務，通過跨境聯動、業務協同、強化風控和平台運營，深耕以客戶為中心的一體化、平台化跨境服務生態體系。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，華泰國際積極拓展熊貓債、自貿債、點心債等人民幣債券業務，並參與香港交易所推出的港幣－人民幣雙櫃台模式，助力人民幣國際化。香港業務由股權業務平台、固收業務平台、財富管理平台、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，通過不斷拓展新產品、新市場，持續鞏固和提升差異化競爭優勢。報告期內，華泰金控(香港)完成2單港股IPO保薦項目，保薦數量位居市場第三，並以全球協調人身份完成4單GDR發行項目，發行數量和發行規模均位居市場第一，保持了在GDR業務方面的龍頭優勢。華泰金控(香港)成為盧森堡證券交易所上市和交易會員，並成為香港交易所認股證「窩輪」發行商。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實現平台資產規模穩步增長，行業領先地位持續穩固，業務收入不斷提升。新加坡子公司相關業務牌照申請已獲新加坡金融管理局原則性批覆。

## (六) 兼具專業和平台優勢的全面風險管理體系

本集團秉承穩健的風險管理文化，以控風險、增質效、促發展為風險管理目標，堅持全員、覆蓋、穿透的核心風險管理理念，持續以集團化、專業化、平台化思路提升風險管理核心競爭能力。集團建立健全與公司全業務鏈一體化、國際化發展自適應的全面風險管理體系，不斷完善風險治理架構，持續加強風險管理機制和管控措施，大力研發和迭代風險管理工具，高度重視信息科技在風險管理中的應用。報告期內，本集團緊跟市場情況變化，在穩固集團境內外一體化風險管理體系的基礎上，持續提升風險預判能力，主動防範重點業務風險和強化高風險領域管控，同時繼續深入推進風險管理系統建設，平台化賦能風險管理提質增效，助力本集團專業化、國際化發展的戰略進階。

## (七) 打造持續賦能一流人才全面成長的發展平台

本集團秉持「開放、包容、創新、奮鬥、擔當」的文化內涵，持續激發華泰人「向新、向上」的活力和動力，不斷升維人才價值，賦能人才成長。報告期內，本集團積極打造基於平台的專業化人才發展模式，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。突出聚才集智，把人才工作放在公司改革發展和戰略轉型大局中同謀劃、同推進，做好行業領軍型人才、核心業務高端人才及優秀年輕人才的引進工作，不斷增強人才厚度。在實戰中推進優秀年輕人才培養，打造面向未來的管理後備人才梯隊。始終把基層實踐作為優秀年輕員工成長成才的主陣地，推進交流、掛職、輪崗等實踐鍛煉，在實戰中培養和選拔，並以綜合能力和業績貢獻為基礎，拓寬職業發展空間，提升人才隊伍創造力。持續完善激勵體系，組織開展榮譽表彰，強化榜樣力量，激發並凝聚人才奮鬥熱情。始終專注於打造與平台共進共贏的人才發展新模式，促進公司持續長期穩健發展。

#### 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、		分部業績	分部 利潤率(%)	分部收入、	分部支出比 上年同期 增減(%)	分部利潤率 比上年同期增減
	其他收入 及收益	分部支出			其他收入及 收益比上年 同期增減(%)		
財富管理業務	10,741,998	(6,877,949)	3,864,049	35.97	(13.34)	(14.11)	增長0.57個百分點
機構服務業務	5,948,069	(4,014,967)	1,933,102	32.50	57.10	34.86	增長11.13個百分點
投資管理業務	1,973,923	(781,979)	1,002,036	50.76	120.97	42.30	增長89.20個百分點
國際業務	6,092,327	(5,286,316)	806,011	13.23	45.59	80.64	下降16.83個百分點
其他(含抵銷)	1,196,237	(2,241,828)	392,230	32.79	(46.10)	(17.21)	增長2.95個百分點
分部總計	25,952,554	(19,203,039)	7,997,428	30.82	10.54	11.85	增長1.96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，財富管理服務能力需要不斷增強

隨着我國經濟社會全面恢復常態化運行、多層次資本市場持續發展完善以及居民財富配置需求不斷躍遷升級，我國財富管理市場處於長期變革和快速發展的新階段，以規範發展、專業化管理和客戶體驗升級為發展方向，服務於經濟高質量發展和共同富裕成為新時代財富管理行業的新使命。深耕財富管理服務的專業性、精準度和智能化，專注洞察和理解客戶需求，基於專業化配置理念滿足客戶多樣化資產配置需求，以專業陪伴服務提升客戶獲得感，將成為證券公司財富管理業務強化核心競爭優勢的關鍵。在雙循環新發展格局持續構建、中國特色現代資本市場建設不斷推進、財富管理行業滲透率不斷提升、專業化業務需求日趨增加等背景下，我國財富管理市場正轉向覆蓋客戶全生命周期的綜合金融服務模式，一站式投資顧問服務和陪伴式客戶服務體驗將成為證券公司財富管理業務的發展趨勢。財富管理機構應注重構建創新驅動的財富管理業務生態，加強客戶導向的立體式客群經營，強化投資研究能力和財富管理能力建設，着力提供全方位、高質量、多層次的投資理財產品和綜合解決方案，積極打造可持續發展的財富管理業務模式。

(2) 客戶資產配置需求與市場競爭態勢的變化持續推動業務發展，財富管理業務進入專業化經營新階段

隨着資本市場結構性變革深入推進、公募基金費率改革逐步落實、財富管理業務交易品種不斷豐富、業務規則日趨複雜、客戶財富配置結構更趨多樣化，我國財富管理市場呈現普惠化、多元化、個性化、專業化特點，高質量的財富管理服務成為機構的核心競爭力。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，不斷提升財富管理業務整體運營管理能力，為客戶提供覆蓋全生命周期的綜合金融服務將成為證券公司戰略轉型的重要方向。報告期內，國內股票市場結構分化，萬得全A上漲3.06%、上證綜指上漲3.65%、創業板指下跌5.61%；國際主要指數方面，標普500上漲15.91%、納斯達克指數上漲31.73%、道瓊斯工業指數上漲3.80%。在內外部市場環境日益複雜以及以全面註冊制為核心牽引的資本市場改革開放措施持續推進的背景下，財富管理市場深層次的價值挖掘需求不斷升級，行業競爭愈發激烈，財富管理機構的核心專業能力與陪伴客戶的價值創造能力面臨更大的挑戰與更高的要求。構建數字化服務展業、平台式業務支撐、立體化需求洞察的全方位運營體系，充分發揮業務協同優勢，實現客戶服務全方位覆蓋，提供一站式、全資產、全周期服務生態的財富管理機構將獲得廣泛發展空間。



(3) 金融科技賦能重塑運營管理模式，全面推進財富管理行業數字化轉型與高質量發展

近年來，證券行業金融科技發展走向深水區，證券業務向數字化、智能化、敏捷化和生態化持續發展，證券行業步入科技賦能業務深層次變革及數字化轉型發展全面鋪開的新時期，以業務價值提升為導向佈局金融科技、推動業務模式和管理模式革新升級，已成為證券行業高質量發展的下一個戰略高地。以領先的金融科技提升數字化財富管理服務能力，實現金融科技與業務發展的深度融合共創，構建面向未來的線上化、平台化、智能化金融科技生態圈，為客戶提供覆蓋全生命周期的多方位、旅程式財富管理服務，將成為證券公司打造綜合金融服務優勢並形成創新模式增長點的核心驅動力。依託先進的金融科技，加快數字化轉型，充分發揮數字化的能力沉澱、客戶沉澱、資源整合、業務協同、風險管控和效能提升等方面作用，將對證券公司業務模式和經營效率帶來全方位影響。構建共建、共治、共享的數字化財富管理生態，打造融合數字化優勢和專業投研能力的、基於生態化和一體化專業服務的財富管理業務體系，全面升級財富管理服務效能，將成為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，本集團以客戶為中心完善一體化經營體系，圍繞數字化、平台化、生態化理念，搭建全生命周期財富客戶交易體系與成長體系，堅持精細化運營與精準化營銷，以優質的平台和服務不斷優化用戶體驗，打造具有差異化競爭優勢的財富管理平台，持續提升財富管理服務的覆蓋率和滿意度。構建完善總部驅動、總分聯動、一體運營的財富管理運營體系，打造專業化、開放化的平台發展生態，持續迭代升級「漲樂財富通」平台與「聊TA」平台功能，不斷打磨優化雙平台閉環運營模式，切實提升運營效率。積極推動客戶服務模式升級和用戶運營模式創新，以智能化、平台化方式不斷提升服務承載能力、服務效率與服務體驗，深度挖掘客戶服務場景與業務機會，不斷增強客戶服務黏性。持續深化財富管理隊伍運營的賦能支持，積極打造專業化分工、體系化培育的分層分級財富管理隊伍體系，全面提升業務能力與服務效能，滿足客戶多元化財富管理需求。

本集團持續推進「漲樂財富通」平台產品與服務創新，不斷優化內容運營模式，增強特色交易工具和策略服務的運營效能及場景化滲透力，持續升級理財及交易服務體系，有效提升客戶黏性。報告期內，「漲樂財富通」下載量217.68萬，自上線以來累計下載量7,223.69萬；96.24%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885.23萬，截至報告期末月活數為890.64萬，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提升用戶黏性，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205.14萬。

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19.59萬億元，行業排名第一。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5.19萬億元。

## 代理交易金額數據

幣種：人民幣

證券品種	2023年1-6月	證券品種	2022年1-6月
	代理交易金額(億元)		代理交易金額(億元)
股票	160,298.23	股票	166,698.49
基金	35,590.70	基金	30,478.02
債券	<u>245,681.69</u>	債券	<u>204,382.31</u>
合計	<u><u>441,570.62</u></u>	合計	<u><u>401,558.82</u></u>

註：代理交易金額數據引自滬深交易所會員統計數據，其中，基金數據包含上交所ETF、貨幣ETF、LOF、公募REITs交易量。

報告期內，股票期權經紀業務不斷提升交易技術支持能力，持續培育合格投資者，深化專業投資者服務，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，截至報告期末，華泰期貨共有9家期貨分公司、42家期貨營業部，遍及國內4個直轄市和17個省份，代理交易品種116個。報告期內，華泰期貨實現代理成交量34,646.91萬手，成交金額人民幣263,675.36億元。證期業務進一步深度融合，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237家、期貨IB業務總客戶數5.79萬戶。

## (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，以資產配置和金融產品投研為核心業務驅動，以平台化與專業化為牽引，積極構建基於買方視角的一體化資產配置服務體系，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，持續優化客戶體驗。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) 10,342隻，金融產品銷售規模(除現金管理產品「天天發」外) 人民幣2,082.84億元。根據中國證券投資基金業協會2023年第二季度的統計，本公司股票及混合公募基金保有規模人民幣1,297億元、非貨幣市場公募基金保有規模人民幣1,517億元，均排名證券行業第二。

報告期內，本集團圍繞分層分級客戶的差異化需求，以買方投資顧問業務為核心，持續豐富和完善金融產品供給體系，基於多重維度構建供給矩陣，積極打造覆蓋資產、策略、產品的一體化投研模式，加強各類資產和策略趨勢的研究判斷，不斷完善「省心家族」配置服務體系，提供從單產品優選到策略配置的多維度解決方案，滿足客戶多層次、差異化的資產配置需求。持續加強財富管理顧問服務體系建設，不斷優化客戶服務場景和客戶服務方案，通過客戶需求深度挖掘和持續客戶運營，為客戶提供全生命周期的立體式陪伴服務。強化數字化平台能力建設，持續升級迭代投研平台，不斷優

化因子研究體系，積極構建投研聯動模式，提升投資研究效能，有效支持基金投資顧問策略投資生產和運營，增強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，深化全業務鏈合作與聯動，深入挖掘客戶需求，及時響應客戶反饋，積極構建多層次、差異化的客戶服務體系，依託業務生態化建設和開放式融券通平台持續迭代的系統優勢，不斷增強差異化與專業化服務能力，業務發展態勢良好。持續完善融券業務運營管理體系，不斷豐富與持牌金融機構的合作模式，積極挖掘機構客戶券源出借潛力，夯實券源開發基礎，拓展券池規模，增強策略和服務供給效率，切實滿足客戶多層次的業務需求。加強數字化與平台化建設，不斷迭代更新融券通平台，構建完善覆蓋出借與融券業務全鏈路的證券借貸業務模式，提供智能、實時的交易體驗及數字化、人性化的運營服務，為打造開放生態、創新業務場景、服務客戶需求持續賦能。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1,155.61億元，市場份額達7.27%，整體維持擔保比例為270.72%，其中，融券業務餘額為人民幣164.79億元，市場份額達17.72%；股票質押式回購業務待購回餘額為人民幣274.47億元、平均履約保障比例為228.81%，其中，表內業務待購回餘額為人民幣68.23億元、平均履約保障比例為226.26%，表外業務待購回餘額為人民幣206.24億元。

### 3、 財富管理業務2023年下半年展望

財富管理業務承載着本集團規模化聚集、沉澱客戶資源和客戶資產的戰略職能。2023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，通過總部驅動、總分聯動、線上線下一體的財富管理運營體系，不斷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周期服務模式轉型，持續打造面向未來的全新競爭優勢。

財富管理業務將圍繞數字化、平台化、生態化理念，不斷優化全業務鏈協同機制，做深做實平台運營和客戶運營，構建新型客戶增長與服務運營體系，打造財富管理業務新生態。優化完善分層分級的客戶服務體系，迭代升級客戶服務一體化運營模式，有效賦能財富管理隊伍專業化服務能力培育與優質服務輸出，持續創新運營方式，提高服務覆蓋，創造長期服務價值。基於客戶分層與多元化業務需求，構建完善專業化分工、體系化培育的分層分級財富管理隊伍體系，不斷提升財富管理服務效能，持續優化基於專業金融能力和運營能力的伴隨客戶全生命周期的增長體系。持續完善數字化、智能化平台底座，不斷推進平台產品創新和服務能力升級，強化專業場景賦能和平台運營支撐，切實提升服務質量，優化客戶體驗。

金融產品銷售與基金投資顧問業務將整合全業務鏈資源，繼續加強數字化平台集群建設，不斷提升平台化賦能水平，積極推進業務品牌建設及業務體系構建，持續豐富策略類型，優化服務場景，迭代升級配置模型，加強投資顧問和客戶賦能工具建設，完善投顧一體化服務機制，增強投資研究專業能力，為客戶提供綜合金融解決方案。

資本中介業務將繼續以客戶需求為導向，不斷深化產品服務內涵，積極創新業務運營模式，着眼於券源獲取能力、客戶服務能力和金融科技運用的差異化競爭點，為客戶提供資券一體化、服務一站式的綜合解決方案。繼續深化全業務鏈合作，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，打造開放、高效的證券借貸行業生態，積極構建專業化、智能化、數字化的業務體系，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) 實體經濟轉型升級和資本市場全面深化改革為機構服務業務發展打開了更廣闊空間

隨着資本市場全面註冊制改革穩步落地以及市場基礎制度體系持續完善，資本市場戰略定位不斷提升，市場結構進一步機構化，機構服務業務迎來縱深發展的契機，圍繞國家戰略發展方向、經濟結構升級需要及客戶日益複雜的金融需求，貫徹以客戶為中心的業務模式，注重業務協同並提供一體化綜合金融服務和專業化金融產品的證券公司將更具有業務發展優勢。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，資本市場生態不斷優化、多層次資本市場體系不斷完善、資本市場服務實體經濟高質量發展功能不斷提升，證券公司投資銀行業務面臨高階轉型的重大戰略機遇，同時也對其資產價值甄別和發現能力、定價承銷能力、高質量項目執行能力、客戶服務能力、合規風控能力等提出更高要求，善於發現和服務代表經濟轉型和高質量發展方向的企業，積極推進全業務鏈體系建設，持續優化全生命周期綜合金融服務模式，圍繞客戶多元化需求提供全方位、多層次、精準化綜合金融服務的證券公司將獲得更顯著的競爭優勢。證券公司應積極拓展業務和服務的深度和廣度，構建體系化和平台化的專業實力，提升優質資產獲取和價值發現能力，充分發揮全產品和高效率服務實體經濟高質量發展和活躍資本市場的作用。

- (2) 資本市場機構化發展趨勢重構市場新生態，對證券公司機構服務業務提出更高要求

近年來，我國資本市場市場化程度不斷加強，投融資便利性持續提升，機構投資者持股佔比和市場影響力顯著提高，機構投資者作為市場參與主體是大勢所趨，市場結構的深層次變化將重構資本市場

新生態，證券公司機構服務業務發展潛力和提升空間可觀，同時，也對證券公司專業能力、內部協同和資本實力提出更高要求。伴隨個人養老金投資公募基金業務落地實施等資本市場改革的縱深推進，公募基金等專業機構投資者力量穩步增強，資本市場中長期資金來源持續擴大，居民財富配置向金融資產遷移的趨勢持續強化，資本市場機構化進程進一步加快，機構服務業務將成為推動證券公司業績增長的重要動力。此外，伴隨着註冊制改革持續推進下的市場擴容及制度優化、資本市場雙向開放程度的不斷加深、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，以數字科技和平台運營為依託、多市場和全業務領域協同發展、打造一站式機構服務業務生態圈的證券公司將迎來更大的發展空間。證券公司應積極打造平台化、一體化、生態化的機構投資者服務體系，以更強的綜合實力以及全業務鏈資源整合能力，為機構投資者提供全產品、全鏈條、全周期的一站式綜合金融服務。

(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

在內外部環境錯綜複雜、資本市場監管日趨嚴格、證券行業業務體系不斷擴展、客戶數量持續增長、信息傳播方式不斷變化的背景下，風險傳播的隱蔽性和不可控性持續增加，證券公司的風險管理面臨全新挑戰。加強重點領域精準風險管控，壘實築牢集團化風險管理體系基礎，着力打造與自身發展戰略及業務發展相匹配的風險管理能力，將成為證券公司提升跨業務全生命周期風險管控能力的關鍵。證券公司需要持續完善跨市場、跨行業、跨境風險監測、預警、防範和化解的長效機制，提檔升級一體化風險管理體系，不斷提升風險治理能力。有效管理金融風險需要證券公司不斷完善風險管理框架及體系，積極打造境內外一體化風險態勢感知與管控平台，實現數字化賦能和專業化風險管控；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，不斷提升風險應對綜合效能。近年來，隨着市場風險對沖和風險管理工具的持續豐富，證券行業對維護金融市場和資本市場平穩運行、健康發展的作用更為重要，證券公司應積極完善全方位的風控管理體系，以平台化技術為支撐，構建集團化風險管理模式和智能化風險管理工具，持續為資本市場提供有效的風險管理及資產配置工具，打造風險管理核心競爭力。

## 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，本集團將服務實體經濟作為自身的使命擔當，秉持以優質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，投資銀行業務持續保持市場頭部地位，業務實力進一步提升。

### 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	10	262	990,084.34	22,654,748.50	66,329.46	1,132,408.00
增發新股	16	300	2,167,061.38	47,992,218.84	19,134.98	360,113.75
配股	1	37	-	2,280,547.65	-	23,109.07
債券發行	1,165	6,860	22,883,607.87	270,513,302.35	47,723.89	683,816.53
合計	<u>1,192</u>	<u>7,459</u>	<u>26,040,753.59</u>	<u>343,440,817.34</u>	<u>133,188.33</u>	<u>2,199,447.35</u>

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、金融債、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 股權融資業務

報告期內，股權融資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、全周期、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724.28億元，行業排名第三。

### ② 債券融資業務

報告期內，債券融資業務在嚴格控制風險的基礎上，充分發揮全業務鏈優勢，不斷完善客戶分層管理，積極培養核心客戶群體，行業地位進一步鞏固。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5,649.02億元，行業排名第三。根據中國證券業協會統計數據，本集團主承銷科技創新公司債券金額人民幣101.77億元，行業排名第四。

### ③ 財務顧問業務

報告期內，併購重組財務顧問業務充分發揮業務創新優勢，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，併購重組業務品牌優勢持續穩固。本集團擔任獨立財務顧問的經監管審核通過的併購重組交易家數2家，行業排名第二；交易金額人民幣103.20億元，行業排名第三。

#### 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，持續為科技創新型成長性企業提供完善的資本市場服務。報告期內，本集團完成新三板掛牌項目3單、掛牌在審項目1單，完成掛牌企業股票定向發行項目2單，股票定向發行獲准項目1單及在審項目2單。控股子公司江蘇股權交易中心不斷完善存續產品管理並持續探索業務模式創新，積極推動制度與業務創新試點方案申報，深化數字化轉型，有效推進區塊鏈平台功能的擴充和完善，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15,395家，純託管企業146家，會員單位230家，各類投資者79,975戶，報告期內為企業新增融資人民幣45.10億元。

#### (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，圍繞客戶全生命周期的綜合金融服務需求，充分發揮數字化賦能與全業務鏈服務體系優勢，打造具有核心競爭力的一體化服務平台，為專業機構投資者提供跨場內外、境內外的一站式綜合主經紀商交易及服務。截至報告期末，基金託管業務累計上線產品11,627隻，託管業務規模人民幣4,609.40億元；基金服務業務累計上線產品15,482隻（含資管子公司產品827隻），服務業務規模人民幣10,077.28億元（含資管子公司業務規模人民幣3,630.74億元）。根據中國證券投資基金業協會截至2023年第二季度的統計，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，積極踐行全業務鏈戰略，不斷深化業務協同效能，持續完善跨境研究服務體系，打造研究業務競爭優勢。持續升級迭代數字服務平台「行知」和智能研究平台「RIS」，不斷夯實投研底座，沉澱投研數據資產，優化完善產品生產和管理流程，不斷提升平台生產效率和服務質量，有效拓展研究成果觸達範圍和深度。聚焦頭部機構客戶，通過加強多行業研究聯動、深入研究價值挖掘，着力發揮研究業務支撐和牽引作用，多渠道、多平台、多方式開展研究服務活動，滿足客戶專業化的研究業務需求。機構銷售業務以客戶為中心，依託全業務鏈優勢，推進「行知」服務平台及機構投資者工作平台建設和功能迭代，做實全面覆蓋、分層分級的機構客戶池，構建以交易和產品為中心的機構服務生態圈，重塑機構業務一體化服務體系，深入對接機構投資者多樣化需求，提供一站式交易及服務解決方案。報告期內，本集團積極開展多種形式的研究服務活動，發佈研究報告4,650篇，組織研究路演服務16,890場、專題電話會議392場，通過線上或線上線下相結合方式舉辦投資峰會、研討會等專題會議13場。報告期內，公募基金分倉交易量人民幣6,478.09億元。

#### (4) 投資交易業務

##### ① 權益交易業務

報告期內，本集團不斷完善策略交易體系，持續提升宏觀策略交易能力，深度挖掘重點投資交易品種，積極把握市場投資交易機會，優化加強以大數據交易業務、宏觀基本面業務和創新投資業務為核心的絕對收益一體化投資體系，持續拓展權益基礎研究的廣度、深度和力度，擴充交易模式，豐富業務場景，控制回撤風險，持續完善聯動發展的多市場、多層次、立體式的多元業務模式，積極打造投資交易核心能力。全面落實數字化和平台化建設，持續推進平台的迭代升級，不斷提升關鍵節點性能，強化業務運營監控能力，全面提升系統平台業務效能。科創板股票做市交易業務方面，本集團持續加強人才體系建設，不斷完善交易系統，迭代做市策略，完備風控體系，業務運營穩健，業務規模有序擴張，截至報告期末累計報備做市股票45隻。

##### ② FICC交易業務

報告期內，本集團繼續堅定推進FICC量化交易戰略轉型，持續構建以客戶需求為導向、以交易為核心的FICC業務模式。固定收益自營投資業務積極開展模型、策略和產品等多層次的量化創新實踐，不斷提升量化策略豐富度，充分發揮市場前瞻和風險控制優勢，打磨穩健盈利能力。FICC代客業務以客戶需求引領業務創新，持續擴充產品類型，業務佈局不斷完善，產品規模不斷提升。做市業務實現跨市場、跨品種延展，量化做市報價戰略轉型成效顯著，做市交易量、品種覆蓋等維度實現突破。大宗商品和外匯業務持續推進業務創新，落地首單碳排放權交易，業務多元化發展基礎不斷夯實，客戶服務能力穩步提

升。積極推進業務數字化轉型，不斷擴充HEADS大象平台應用場景，持續優化CAMS信用分析管理系統標準化產品服務形態，體系化、平台化提升投資交易能力和風險管理能力。根據中國證券業協會統計數據，本集團創設信用保護工具規模人民幣11.87億元，行業排名第三。

### ③ 場外衍生品交易業務

報告期內，本集團着力構建以客戶為導向的場外衍生品業務體系，不斷提升業務創新能力和交易定價能力，積極擴展客戶覆蓋的深度和廣度，以更加多元化的投資與風險管理工具為客戶提供全方位的衍生品交易服務。憑藉交易驅動、平台賦能的核心競爭力，持續完善業務模式並不斷開拓創新，充分發揮金融科技優勢，推動實現核心業務能力的沉澱、升級與轉化，積極打造持續驅動業務高質量發展的強力引擎，全面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7,536筆，存續規模人民幣1,120.74億元；場外期權業務存續合約筆數1,861筆，存續規模人民幣1,185.66億元。報告期內，本集團通過中證機構間報價系統和櫃台市場發行私募產品1,899隻，合計規模人民幣144.29億元。

### 3、機構服務業務2023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。2023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。

投資銀行業務將持續推進平台化展業和數字化轉型，深入貫徹以優質客戶為中心的經營理念，圍繞客戶全生命周期，積極打造滿足客戶一體化需求的全業務鏈服務體系，切實發揮好資本市場與實體經濟的橋樑作用。股權融資業務將繼續踐行重點行業聚焦和區域深耕戰略，輸送更多優質企業登陸資本市場；債券融資業務將在保持發行規模和行業地位的基礎上，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，更好服務國家戰略導向；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項目。

主經紀商業務將不斷強化以客戶為中心的經營理念，加大力度推進業務開拓，持續推動數字化轉型與運營效能提升，有效聯通內外部業務生態賦能客戶，以平台化、數字化、一體化模式為客戶提供綜合金融服務，實現業務價值多元變現。

研究與機構銷售業務將持續健全境內外一體化的機構客戶服務體系，着力打造具備綜合服務能力的專業隊伍，積極推進數字化平台系統建設，充分發揮全業務鏈協同效能，圍繞機構投資者需求打造全方位、一站式金融服務生態圈，持續增強市場競爭力和行業地位。

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力，推動盈利模式多元化。權益交易業務將不斷增強系統平台效能，持續提升大數據交易業務、宏觀基本面業務和創新投資業務專業化投資能力，在控制回撤的基礎上穩步擴大業務規模，打造規模化穩定盈利的權益投資與交易業務體系；FICC交易業務將繼續加強業務系統化建設與開發，不斷提升HEADS大象平台和CAMS信用分析管理系統的客戶服務能力，積極打造核心定價能力，持續豐富量化交易策略，創新業

務增長模式，加快驅動業務轉型；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建設以及領先的創新能力、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，鞏固核心競爭優勢。

### (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，行業進入高質量發展的新階段

隨着我國金融改革持續深化、多層次資本市場體系不斷完善、金融市場創新更趨活躍、資管業務制度體系不斷健全以及個人養老金實施辦法和相關配套政策陸續出台，資產管理業務生態向高質量發展轉型，深度競合的資產管理業務新格局加速形成，各類資產管理機構應持續加強投資研究體系建設，充分發揮價值發現與資產定價功能，鍛造提升資管業務核心競爭力。在資產管理市場專業化、多元化、高質量發展的背景下，資產管理業務規範轉型穩步推進，行業結構深刻調整，客戶服務需求日益多元化與綜合化，金融科技的發展和充分應用或將成為資管大時代的新變量，資產管理機構也將迎來更多的機遇與挑戰。根據中國證券投資基金業協會統計數據，截至2023年一季度末，基金管理公司及其子公司、證券公司及其子公司、期貨公司及其資管子公司、私募基金管理人管理的資產管理業務總規模約人民幣67.28萬億元，其中，證券公司及其子公司私募資產管理業務規模人民幣6.45萬億元。面對註冊制改革持續推進下的新市場生態，資產管理機構應持續加強投研核心能力和投研團隊建設，打造專業化分工、協同共享的投研平台，豐富完善全資產類別產品線，構建多層次、多元化的資管業務生態，穩步提高產品創新能力、全面風險管理能力和戰略機遇把握能力，切實為實體經濟的投融資需求和居民資產保值增值提供專業服務。



(2) 我國股權投資市場整體延續放緩態勢，行業競爭激烈，集聚效應凸顯

在國際形勢錯綜複雜、行業監管環境日益趨嚴等背景下，我國股權投資市場面臨嚴峻考驗，募資市場整體體量收縮，投資市場節奏延續減緩，退出市場交易數量減少，市場整體趨於平緩。同時，優質項目競爭激烈，優秀人才和增量資金向具有強大專業能力、資源整合能力的投資管理機構集聚的效應更加凸顯。根據清科研究中心私募通統計數據，2023年上半年，中國股權投資市場新募基金數量3,289支，新募基金規模人民幣7,341.45億元，較2022年同期減少23.5%；中國股權投資市場投資案例數3,638起，投資總金額人民幣2,929.65億元，較2022年同期減少42.0%。隨着實體經濟的恢復發展、金融服務基礎設施的不斷優化、全面註冊制改革的落地實施、私募基金法規體系等行業監管機制的日趨完善，多層次資本市場融資和資源配置效率不斷增強，我國股權投資市場迎來新的發展機遇，同時也對股權投資機構的管理能力提出更高要求。長期來看，我國股權投資市場在服務實體經濟高質量發展，打造全生命周期、全鏈條企業服務生態，滿足居民資產配置需求的同時，在推動要素資源向科技創新領域聚集，實現科技自立自強、創新驅動發展等方面發揮着日益重要的基礎性、戰略性作用。股權投資機構應依託科學的投資決策、專業的投後管理以及優質的增值服務，積極打造股權投資全產業鏈服務能力，以全方位的綜合金融服務為企業提供全生命周期的資本運作方案。

## 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，本集團全資子公司華泰資管公司主動適應市場及監管環境變化，堅持以客戶為中心，以投資資管和投行資管服務為抓手，一站式提供一流的投資產品、資產配置及整體金融服務解決方案，賦能客戶的資產管理服務旅程，培育差異化的核心競爭力。依託集團全業務鏈資源，強化與集團雙向驅動，立足投行基因優勢，充分發揮數字化應用能力，不斷夯實主動管理能力，持續完善合規化、便利化、一體化、多樣化、高效化的綜合資產管理服務體系。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4,570.01億元。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）發行數量58單、發行規模人民幣530.75億元，均排名行業第三。

報告期內，證券公司資產管理業務繼續向主動管理方向轉型，持續打磨平台運營、一體聯動的核心競爭力，充分發揮資產發現、風險定價與產品設計能力，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。集合資產管理業務合計管理集合資管計劃184隻，合計管理規模人民幣566.47億元。單一資產管理業務加快探索淨值型委外業務，合計管理單一資管計劃429隻，合計管理規模人民幣1,134.69億元。專項資產管理業務持續推進產品創新，不斷提升全鏈條服務能力，合計管理專項資管計劃214隻，合計管理規模人民幣1,929.57億元。公募基金管理業務積極打造針對投資者不同需求的淨值化理財解決方案，合計管理公募基金產品38隻，合計管理規模人民幣939.28億元。

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	2023年1-6月		2022年1-6月	
	受託規模 (億元)	淨收入 (萬元)	受託規模 (億元)	淨收入 (萬元)
集合資產管理業務	566.47	5,689.56	701.96	9,595.17
單一資產管理業務	1,134.69	14,200.17	1,480.75	11,161.15
專項資產管理業務	1,929.57	6,623.30	1,861.06	6,478.05
公募基金管理業務	939.28	43,080.13	972.36	37,900.88

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圍繞自身優勢賽道，專注行業研究，深入佈局重點行業，鞏固行業影響力，積極推動已投企業藉助全面註冊制改革契機實現上市退出，同時加強與大型國有企業、行業龍頭企業、上市公司等開展合作，推進專注於母基金、醫療健康基金、TMT基金等各類基金的募集設立，擴大基金管理規模，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27隻，合計認繳規模人民幣606.29億元，合計實繳規模人民幣454.27億元。報告期內，上述私募股權投資基金實施投資項目合計22個，投資金額合計人民幣6.73億元，均為股權投資類項目。根據中國證券投資基金業協會截至2023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三。

### (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，積極推動產品創新，不斷拓寬業務領域與產品線佈局，着力完善智能化系統建設，不斷研發多元投資模型，多類別、跨周期的綜合資產管理能力進一步提升，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18,832.37億元，其中，公募業務管理基金數量合計337個，管理資產規模合計人民幣11,389.00億元；非公募業務管理資產規模合計人民幣7,443.37億元。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3,559.02億元，其中，公募業務管理基金數量合計136個，管理資產規模合計人民幣3,348.66億元；非公募業務管理資產規模合計人民幣210.36億元。（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，本集團全資子公司華泰期貨不斷強化內部資源整合與業務協同，積極推進科技引領的數字化轉型及創新引領的業務轉型，多元化穩步拓展以FOF為主、主動管理為輔的產品線，不斷提升專業化服務水平並積極打造核心競爭優勢，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35隻，資產管理總規模人民幣145,470.48萬元，期貨端權益規模人民幣69,103.64萬元。

### (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，根據監管要求及集團業務佈局，華泰創新投資充分發揮業務協同效能，着力發展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和北交所戰略配售業務。截至報告期末，存續投資項目40個，投資規模人民幣200,829.58萬元，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2023年下半年展望

投資管理業務承載着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。2023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立足全業務鏈平台，發揮券商資管特色資源優勢，強化差異化的發展稟賦，夯實平台化的基礎設施能力底座，不斷將全業務場景、內外部資源深度融入平台，以差異化展業構建競爭壁壘、以平台化運營推動業務破局和轉型超越。發揮大平台優勢，緊扣市場需求做大客戶規模、傳承投行基因做強優勢資產、立足券商優勢領域做精特色賽道，踐行差異化發展思路，樹立良好品牌效應。

私募股權基金管理業務將繼續堅持以行業研究為先，在重點行業深耕細作、深度佈局，積極挖掘優質項目，同時圍繞基金打造的生態圈，鏈接產業鏈上下游，推動項目協同合作，做好投後管理及相關增值服務；發揮集團全業務鏈優勢，持續開拓探索新業務，積極開展基金募集工作，不斷擴大基金管理規模，推動業務結構與盈利模式多元化。

基金公司資產管理業務將持續加強合規風控管理和人才梯隊建設，繼續保持新業務探索與新產品開發，着力構建多層次、有特色、差異化的產品線，不斷夯實跨資產、多策略的核心能力，持續打造全流程、精細化的客戶陪伴體系，積極構建數智化系統平台，全面賦能業務發展。

期貨公司資產管理業務將積極把握獲批投資場外期權等衍生品業務的發展機遇，不斷完善產品供應體系，構建以科技創新驅動業務發展的新模式，加強基於大平台的全資產、全策略線、全投資工具的投資團隊配備，優化投資決策與管理機制，推動業務質量提升和規模增長。

另類投資業務將不斷完善制度機制及業務操作流程，深化金融科技生態建設，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) 資本市場制度型雙向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

隨着我國資本市場高水平制度型和系統性開放舉措的漸次落地，境內外資本市場互聯互通機制不斷優化，基礎交易制度不斷完善，國際化產品體系不斷豐富，跨境投融資渠道不斷拓寬，境內外資本市場的相互融合和協同持續深化，資本市場全球資源配置和服務實體經濟的能力不斷增強。當前，全球財富管理多元化資產配置的重要性日益凸顯，在以國內大循環為主體、國內國際雙循環相互促進的新發展格局加快構建的戰略背景下，資本市場樞紐地位日益提升，我國證券行業迎來新一輪發展機遇，國際業務也已經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高水平開放新格局加快形成的重大機遇，不斷優化國際業務佈局並持續加強跨境生態圈建設，積極打造精細化、專業化、全面高效的境內外一體化客戶運營體系，實現全渠道交互融合、多層次協同聯動，不斷提升國際化運營

能力、跨市場服務能力和跨境風險管理能力，增強全球產業鏈資源與重要資本配置能力，更好地為國內及全球客戶提供多市場、全方位、多層次、高質量的全產業鏈投融資綜合金融解決方案。

(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。根據麥肯錫統計數據，獨立註冊投資顧問渠道在2022年的淨流入份額與其他渠道相比更具有絕對優勢，佔行業總淨流入的22%，同時也高於其在2021年16%的份額。隨着佣金收入大幅下降和企業持續專注於整體財務規劃，收取管理費的賬戶數得到了迅速增長。根據Cerulli統計數據，目前，管理費模式的賬戶所覆蓋資產規模佔所有投資顧問管理資產規模的一半以上。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19.1%，顯著高於同期整體投資顧問市場11.6%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，夯實資本市場中介定位，深耕以客戶為中心的一體化、平台化跨境服務生態，嚴格控制風險、豐富產品種類、拓展市場渠道、優化客戶體驗，滿足客戶全球資產配置需求，實現業績穩步向上和國際化業務佈局持續深化，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。此外，華泰國際於2022年9月在新加坡設立全資子公司，報告期內，相關業務牌照申請已獲新加坡金融管理局原則性批覆。

### (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持續升級的平台實力和風險管控能力，保持業務規模及收入正向增長，報告期內包括股權業務平台、固收業務平台、財富管理平台、基金平台和旗艦投行業務的業務平台體系持續深化，差異化競爭優勢鞏固提升。股權衍生品業務充分發揮集團平台優勢，不斷豐富產品類別，跨境業務規模穩中有進，同業領先地位持續鞏固；股票銷售交易業務專注「現券+跨境主經紀商+QFII」一站式跨境綜合金融服務，以高頻度及全業務鏈多觸角式服務提升客戶黏性，持續擴大差異化競爭優勢；FICC業務前瞻性佈局多元化業務，嚴格把控風險底線，完善以客需為導向的跨境銷售交易體系，業務保持穩健發展態勢；財富管理業務持續提升線上線下平台化、一體化運營，不斷優化「漲樂全球通」平台功能和運營能力，通過強化產品實力、深化業務聯動、完善銷售管理體系，大幅提升財富產品銷量；基金業務嚴格防控風險，持續深化研究能力，積極拓展新市場，推進新產品落地，首個



主動管理型基金產品正式投資運營；投資銀行業務切實加強跨市場執行和服務能力，充分發揮多產品線佈局優勢，持續完善以客戶為中心的全能跨境投行服務平台體系。根據內外部統計數據，報告期內，華泰金控(香港)完成2單港股IPO保薦項目，保薦數量位居市場第三，並以全球協調人身份完成4單GDR發行項目，發行數量和發行規模均位居市場第一。

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859.92億元、股票交易總量港幣1,265.49億元；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、再融資及GDR項目12個，債券發行項目59個，總交易發行規模港幣146.79億元；提供證券保證金融資方面，累計授信金額港幣35.31億元。報告期內，華泰金控(香港)成為盧森堡證券交易所上市和交易會員，並成為香港交易所認股證「窩輪」發行商。

## (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，找准服務客戶的關鍵並促使AssetMark在TAMP行業中脫穎而出。截至2023年第一季度末，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11.9%，排名第二。

報告期內，AssetMark通過領先的業務模式和先進的技術平台實現平台資產規模穩步增長，行業領先地位持續穩固，業務收入不斷提升。截至報告期末，AssetMark平台資產總規模1,007.62億美元，較2022年年末增長10.16%；AssetMark平台總計服務9,323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3,032名，較2022年年末增長5.20%；AssetMark平台總計服務的終端賬戶覆蓋了近24.8萬個家庭，較2022年年末增長2.85%。報告期內，新增354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；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；並於2022年獲得歐洲主要證券交易所的市場准入。報告期內，華泰證券(美國)繼續完善系統平台和基礎設施建設，不斷拓展交易產品種類和市場通道，積極推進FICC業務佈局，不斷優化美國本土業務與境內及香港業務跨境聯動協同機制，為全球投資者提供一體化服務。報告期內，華泰證券(美國)作為承銷商積極參與中國企業美股上市交易和國際化知名企業大宗交易業務。

### 3、國際業務2023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。2023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，着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。

華泰國際將堅持以客戶需求為導向，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，持續增強全業務鏈平台化內在合力。

香港業務將持續完善客戶服務體系，通過境內境外貫通、股權債權結合、機構財富互補、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不斷完善產品線，持續維護和加深客戶關係，夯實主經紀商業服務基礎，不斷提高市場份額；FICC業務將不斷提升數字化水平，藉助平台升級迭代強化銷售和交易一體化能力，匹配客戶多層次的境內外投資和交易需求；財富管理業務將以提升客戶核心體驗為導向夯實平台交易功能和資產配置功能，通過深度挖掘存量客戶和吸收引入第三方合作機構的模式，進一步提高服務水平；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賦能客戶，同時積極開拓離岸人民幣類融資，提供人民幣產品方案；投資銀行業務將充分發揮境內外一體化優勢，積極開發優質客戶，打造標桿項目，提升項目儲備，為客戶提供全產業鏈的一站式綜合金融服務。

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)將積極把握跨境業務機會，不斷提升中國內地、香港和美國三地的業務協同能力，擴大全球機構投資者覆蓋的深度和廣度。持續完善跨境FICC交易平台，不斷拓展產品與業務種類，積極拓寬服務輻射渠道，為滿足全球投資者資產配置及風險對沖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，公司持續開展業務創新活動，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，公司持續完善新業務風險管理機制，優化新業務評估流程，以系統支持並驅動新業務質控、台賬管理、定期回溯等管理機制的有效執行；組織開展新業務專項回溯自查工作，保障新業務風險管控措施及相關制度的有效執行，確保風險可測、可控、可承受。

報告期內，公司新增滬深交易所債券做市業務、北交所股票做市業務、碳排放權投資業務，新增科創50ETF期權做市資格，及鄭州商品交易所、上海期貨交易所、大連商品交易所部分商品期貨／期權品種的做市資格，為市場提供流動性。公司結合業務特點制定各類策略級和公司級風控指標，對風險敞口、持倉限額等進行統一管控，並進一步完善做市業務配套的系統建設與管控機制，將新增業務納入風險管理體系，保障業務平穩運行。

#### **(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	25,952,554	23,479,022	10.54
支出合計	(19,203,039)	(17,168,499)	11.85
所得稅前利潤	7,997,428	6,773,996	18.06
歸屬於本公司股東的本期利潤	6,555,640	5,375,963	21.94
經營活動(所用)／所得現金淨額	(13,683,077)	26,018,313	不適用
投資活動(所用)現金淨額	(6,228,242)	(3,913,007)	不適用
融資活動所得／(所用)現金淨額	5,981,043	(16,368,358)	不適用
現金及現金等價物增加淨額	(13,930,276)	5,736,948	不適用

## 2、收入、其他收入及收益

截至2023年6月30日，本集團實現收入、其他收入及收益總計人民幣259.53億元，同比增長10.54%。其中：

- (1) 佣金及手續費收入人民幣97.26億元，佔37.47%，同比下降2.07%，主要是由於證券經紀及諮詢業務收入下降。
- (2) 利息收入人民幣72.63億元，佔27.99%，同比增長7.46%，主要是由於金融機構利息收入和以攤餘成本計量的債權投資利息收入增長。
- (3) 投資收益淨額人民幣58.18億元，佔22.42%，同比增長54.98%，主要是因為本集團投資業務收益增長。
- (4) 其他收入及收益人民幣31.46億元，佔12.12%，同比增長3.64%，主要是本集團匯兌收益增加。

單位：千元 幣種：人民幣

科目	2023年1月1日至 6月30日		2022年1月1日至 6月30日		增減情況	
	金額	結構	金額	結構	金額	結構
佣金及手續費收入	9,725,697	37.47%	9,931,122	42.30%	(205,425)	(2.07)%
利息收入	7,262,841	27.99%	6,758,476	28.79%	504,365	7.46%
投資收益淨額	5,818,466	22.42%	3,754,431	15.99%	2,064,035	54.98%
其他收入及收益	3,145,550	12.12%	3,034,993	12.92%	110,557	3.64%
收入、其他收入及 收益總計	<u>25,952,554</u>	<u>100.00%</u>	<u>23,479,022</u>	<u>100.00%</u>	<u>2,473,532</u>	<u>10.54%</u>

### 3、支出合計

截至2023年6月30日，本集團支出總額人民幣192.03億元，同比增長11.85%，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21.78億元，同比下降9.34%，主要是由於證券經紀業務、期貨經紀業務支出下降。
- (2) 利息支出人民幣66.22億元，同比增長23.24%，主要是由於債務融資利息支出增長。
- (3) 僱員成本人民幣49.48億元，同比增長6.90%，主要是由於本集團因收入上升計提的員工成本有所上升。
- (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(轉回)及其他營業支出等。

單位：千元 幣種：人民幣

科目	2023年1月1日至 6月30日		2022年1月1日至 6月30日		增減情況	
	金額	結構	金額	結構	金額	結構
佣金及手續費支出	(2,177,899)	11.34%	(2,402,224)	13.99%	224,325	(9.34)%
利息支出	(6,621,612)	34.49%	(5,373,126)	31.30%	(1,248,486)	23.24%
僱員成本	(4,947,559)	25.76%	(4,628,022)	26.96%	(319,537)	6.90%
折舊和攤銷費用	(910,885)	4.74%	(727,809)	4.24%	(183,076)	25.15%
稅金及附加	(97,440)	0.51%	(105,128)	0.61%	7,688	(7.31)%
其他營業支出	(4,865,656)	25.34%	(4,269,814)	24.87%	(595,842)	13.95%
金融資產減值轉回/ (損失)	<u>418,012</u>	<u>(2.18)%</u>	<u>337,624</u>	<u>(1.97)%</u>	<u>80,388</u>	<u>23.81%</u>
支出合計	<u>(19,203,039)</u>	<u>100.00%</u>	<u>(17,168,499)</u>	<u>100.00%</u>	<u>(2,034,540)</u>	<u>11.85%</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	分部收入、 其他收入 及收益 本期數	估分部	分部 收入、其他 收入及收益 上年同期數	估分部	估分部收入、 其他收入及收益 總計的比例較 上年同期增減
		收入、其他 收入及收益 本期數 總計比例(%)		收入、其他 收入及收益 上年同期數 總計比例(%)	
財富管理業務	10,741,998	41.39	12,395,626	52.79	下降11.40個百分點
機構服務業務	5,948,069	22.92	3,786,093	16.13	增長6.79個百分點
投資管理業務	1,973,923	7.61	893,317	3.80	增長3.81個百分點
國際業務	6,092,327	23.47	4,184,585	17.82	增長5.65個百分點
其他(含抵銷)	1,196,237	4.61	2,219,401	9.46	下降4.85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259.53億元，同比增長10.54%，主要業務分部中，受市場影響，本集團財富管理業務分部收入較上年同期下降人民幣16.54億元，機構服務業務和投資管理業務分部收入較上年同期增長人民幣21.62億元、人民幣10.81億元，國際業務分部增長態勢良好，收入較上年同期增長人民幣19.08億元。



## (2) 分部支出分析

單位：千元 幣種：人民幣

業務分部	分部支出 本期數	佔分部支出		佔分部	
		本期數 總計比例(%)	分部支出 上年同期數	支出上年 同期數總計 比例(%)	分部支出 佔本期比例 較上年同期增減
財富管理業務	(6,877,949)	35.82	(8,007,493)	46.64	下降10.82個百分點
機構服務業務	(4,014,967)	20.91	(2,977,089)	17.34	增長3.57個百分點
投資管理業務	(781,979)	4.07	(549,527)	3.20	增長0.87個百分點
國際業務	(5,286,316)	27.53	(2,926,501)	17.05	增長10.48個百分點
其他(含抵銷)	(2,241,828)	11.67	(2,707,889)	15.77	下降4.10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，財富管理業務分部支出佔比下降10.82個百分點，機構服務業務、投資管理業務、國際業務分部支出佔比分別增長3.57個百分點、0.87個百分點、10.48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(所用)／所得現金淨額	(13,683,077)	26,018,313	(39,701,390)	不適用
投資活動(所用)現金淨額	(6,228,242)	(3,913,007)	(2,315,235)	不適用
融資活動所得／(所用)現金淨額	5,981,043	(16,368,358)	22,349,401	不適用
現金及現金等價物增加淨額	(13,930,276)	5,736,948	(19,667,224)	不適用

報告期內，本集團現金及現金等價物減少淨額為人民幣139.30億元。其中：

- (1) 經營活動所用現金淨額為人民幣136.83億元，較上年同期減少人民幣397.01億元，主要是本期融出資金增加和拆入資金現金流入減少所致。
- (2) 投資活動所用現金淨額為人民幣62.28億元，較上年同期減少人民幣23.15億元，主要是本期購買以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產所用款所致。
- (3) 融資活動所得現金淨額為人民幣59.81億元，較上年同期增加人民幣223.49億元，主要是本期償付已發行債務工具支付的現金減少所致。

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、其他收入及收益總計	25,952,554	23,479,022	10.54	投資收益淨額增長
支出合計	(19,203,039)	(17,168,499)	11.85	利息支出增長
經營利潤	6,749,515	6,310,523	6.96	收入、其他收入及 收益總計增長
所得稅前利潤	7,997,428	6,773,996	18.06	收入、其他收入及 收益總計增長
本期利潤	6,662,478	5,552,894	19.98	收入、其他收入及 收益總計增長
其中：歸屬於本公司股東的 本期利潤	6,555,640	5,375,963	21.94	收入、其他收入及 收益總計增長

項目	期末餘額	期初餘額	同比變動	
			(%)	主要影響因素
資產總額	887,070,258	846,570,990	4.78	金融資產規模增長
負債總額	716,556,908	678,714,380	5.58	其他應付款項及應 計費用、債務融 資規模增長
股東權益合計	170,513,350	167,856,610	1.58	當年利潤實現

## (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	2023年6月30日		2022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	6,420,996	0.72%	6,287,383	0.74%	133,613	2.13%
投資物業	210,527	0.02%	217,586	0.03%	(7,059)	(3.24)%
商譽	3,489,002	0.39%	3,352,219	0.40%	136,783	4.08%
土地使用權及其他無形資產	7,581,158	0.85%	7,439,816	0.88%	141,342	1.90%
聯營企業權益	19,376,905	2.18%	18,276,443	2.16%	1,100,462	6.02%
合營企業權益	1,311,491	0.15%	1,706,184	0.20%	(394,693)	(23.13)%
以攤餘成本計量的債權投資	41,525,244	4.68%	36,586,707	4.32%	4,938,537	13.50%
以公允價值計量且其變動計入其他綜合 收益的債務工具	14,209,041	1.60%	7,900,595	0.93%	6,308,446	79.85%
以公允價值計量且其變動計入其他綜合 收益的權益工具	270,778	0.03%	241,587	0.03%	29,191	12.08%
以公允價值計量且其變動計入當期損益 的金融資產	9,219,709	1.04%	10,142,583	1.20%	(922,874)	(9.10)%
存出保證金	40,195,074	4.53%	42,706,777	5.04%	(2,511,703)	(5.88)%
遞延所得稅資產	787,070	0.09%	600,473	0.07%	186,597	31.08%
其他非流動資產	271,388	0.03%	300,664	0.04%	(29,276)	(9.74)%
<b>非流動資產總額</b>	<b>144,868,383</b>	<b>16.33%</b>	<b>135,759,017</b>	<b>16.04%</b>	<b>9,109,366</b>	<b>6.71%</b>

項目	2023年6月30日		2022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	9,961,847	1.12%	7,804,341	0.92%	2,157,506	27.64%
其他應收款項、預付款項及 其他流動資產	1,966,679	0.22%	2,157,529	0.25%	(190,850)	(8.85)%
融出資金	105,412,167	11.88%	100,648,375	11.89%	4,763,792	4.73%
以攤餘成本計量的債權投資	8,797,116	0.99%	11,965,863	1.41%	(3,168,747)	(26.48)%
買入返售金融資產	17,389,635	1.96%	34,824,221	4.11%	(17,434,586)	(50.06)%
以公允價值計量且其變動計入其他 綜合收益的債務工具	1,185,184	0.13%	2,603,784	0.31%	(1,418,600)	(54.48)%
以公允價值計量且其變動計入當期損益 的金融資產	379,460,813	42.78%	340,661,962	40.24%	38,798,851	11.39%
衍生金融資產	15,039,940	1.70%	15,788,301	1.86%	(748,361)	(4.74)%
結算備付金	6,793,643	0.77%	8,716,506	1.03%	(1,922,863)	(22.06)%
代經紀客戶持有的現金	148,683,704	16.76%	140,460,346	16.59%	8,223,358	5.85%
現金及銀行結餘	47,511,147	5.36%	45,180,745	5.34%	2,330,402	5.16%
<b>流動資產總額</b>	<b>742,201,875</b>	<b>83.67%</b>	<b>710,811,973</b>	<b>83.96%</b>	<b>31,389,902</b>	<b>4.42%</b>
<b>資產總額</b>	<b>887,070,258</b>	<b>100.00%</b>	<b>846,570,990</b>	<b>100.00%</b>	<b>40,499,268</b>	<b>4.78%</b>
<b>流動負債</b>						
短期銀行借款	13,664,407	1.91%	7,997,434	1.18%	5,666,973	70.86%
已發行的短期債務工具	26,762,350	3.73%	25,772,604	3.80%	989,746	3.84%
拆入資金	34,690,064	4.84%	25,877,713	3.81%	8,812,351	34.05%
應付經紀客戶賬款	159,354,314	22.24%	152,551,723	22.48%	6,802,591	4.46%
應付職工薪酬	3,799,251	0.53%	5,304,177	0.78%	(1,504,926)	(28.37)%
其他應付款項及應計費用	121,130,382	16.90%	108,096,572	15.93%	13,033,810	12.06%
合同負債	276,677	0.04%	218,943	0.03%	57,734	26.37%
即期稅項負債	667,727	0.09%	524,997	0.08%	142,730	27.19%
賣出回購金融資產款	145,964,883	20.37%	144,117,998	21.23%	1,846,885	1.28%
以公允價值計量且其變動計入當期損益 的金融負債	37,156,594	5.19%	43,005,621	6.34%	(5,849,027)	(13.60)%
衍生金融負債	13,863,810	1.93%	9,638,125	1.42%	4,225,685	43.84%
一年內到期的長期債券	33,240,562	4.64%	29,062,749	4.28%	4,177,813	14.38%
<b>流動負債總額</b>	<b>590,571,021</b>	<b>82.42%</b>	<b>552,168,656</b>	<b>81.36%</b>	<b>38,402,365</b>	<b>6.95%</b>

項目	2023年6月30日		2022年12月31日		增減情況	
	金額	結構	金額	結構	金額	結構
流動資產淨值	151,630,854	—	158,643,317	—	(7,012,463)	(4.42)%
總資產減流動負債	<u>296,499,237</u>	<u>—</u>	<u>294,402,334</u>	<u>—</u>	<u>2,096,903</u>	<u>0.71%</u>
<b>非流動負債</b>						
衍生金融負債	60,040	0.01%	—	—	60,040	—
長期債券	109,403,273	15.27%	110,356,589	16.26%	(953,316)	(0.86)%
長期銀行借款	657,558	0.09%	804,903	0.12%	(147,345)	(18.31)%
長期應付職工薪酬	6,795,934	0.95%	6,588,448	0.97%	207,486	3.15%
遞延所得稅負債	2,458,361	0.34%	2,199,928	0.32%	258,433	11.75%
以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融負債	5,565,830	0.78%	5,569,938	0.82%	(4,108)	(0.07)%
其他應付款項及應計費用	<u>1,044,891</u>	<u>0.15%</u>	<u>1,025,918</u>	<u>0.15%</u>	<u>18,973</u>	<u>1.85%</u>
非流動負債總額	<u>125,985,887</u>	<u>17.58%</u>	<u>126,545,724</u>	<u>18.64%</u>	<u>(559,837)</u>	<u>(0.44)%</u>
淨資產	<u>170,513,350</u>	<u>—</u>	<u>167,856,610</u>	<u>—</u>	<u>2,656,740</u>	<u>1.58%</u>
<b>股東權益</b>						
股本	9,075,589	5.32%	9,075,589	5.41%	—	—
其他權益工具	19,200,000	11.26%	19,200,000	11.44%	—	—
庫存股	(1,071,810)	(0.63)%	(1,202,324)	(0.72)%	130,514	(10.86)%
儲備	100,628,476	59.02%	100,092,751	59.63%	535,725	0.54%
未分配利潤	39,671,901	23.27%	37,929,086	22.60%	1,742,815	4.59%
本公司股東應佔總權益	167,504,156	98.24%	165,095,102	98.35%	2,409,054	1.46%
非控制權益	<u>3,009,194</u>	<u>1.76%</u>	<u>2,761,508</u>	<u>1.65%</u>	<u>247,686</u>	<u>8.97%</u>
股東權益合計	<u>170,513,350</u>	<u>100.00%</u>	<u>167,856,610</u>	<u>100.00%</u>	<u>2,656,740</u>	<u>1.58%</u>

截至2023年6月30日，本集團非流動資產總額為人民幣1,448.68億元，較年初增加人民幣91.09億元，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他綜合收益的債務工具分別增加人民幣49.39億元、人民幣63.08億元。

截至2023年6月30日，本集團非流動負債總額為人民幣1,259.86億元，較年初減少人民幣5.60億元，主要是由於長期債券下降人民幣9.53億元。

截至2023年6月30日，本集團流動資產總額為人民幣7,422.02億元，較年初增加人民幣313.90億元，主要是由於以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產增加人民幣387.99億元。

截至2023年6月30日，本集團流動負債總額為人民幣5,905.71億元，較年初增加人民幣384.02億元，主要是由於拆入資金、其他應付款項及應計費用分別增加人民幣88.12億元、人民幣130.34億元。

## 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和聯營企業權益，合計人民幣187,486,832千元。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；不存在主要資產被佔用、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2023年6月30日，本集團的股東權益合計為人民幣1,705.13億元，較2022年年末增加人民幣26.57億元，增幅為1.58%，主要是因為報告期內本集團實現利潤留存。

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2023年6月30日，本集團資產總額為人民幣8,870.70億元，較年初增加人民幣404.99億元，增幅為4.78%。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2,029.88億元，佔資產總額的比率為22.88%；應收融出資金為人民幣1,054.12億元，佔資產總額的比率為11.88%；以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產為人民幣3,886.81億元，佔資產總額的比率為43.82%；以攤餘成本計量的債權債務工具、以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產合計數為人民幣659.87億元，佔資產總額的比率為7.44%；物業及設備、投資物業和其他無形資產佔資產總額的比率為1.60%，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2023年6月30日，本集團負債為人民幣7,165.57億元，較年初增加人民幣378.43億元，增幅為5.58%，剔除客戶資金後的資產負債率為76.57%，較年初增加0.76個百分點。

截至2023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，本集團融入資金本金總額為人民幣2,184.18億元，具體明細表列示如下：

單位：千元 幣種：人民幣

	截至2023年 6月30日
<b>借款及債務融資方案</b>	
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	34,690,064
短期借款	13,664,407
應付短期融資款	26,762,350
長期借款	657,558
應付債券	<u>142,643,835</u>
<b>本金金額合計</b>	<u><u>218,418,214</u></u>

融資期限在一年以上的為人民幣1,456.85億元，佔比66.70%，其中一年至兩年為人民幣28.02億元，兩年至五年為人民幣903.39億元，五年以上為人民幣525.44億元。融資期限在一年以下的為人民幣727.33億元，佔比33.30%。

截至2023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2,174.83億元，其中短期借款餘額為人民幣134.47億元，長期借款餘額為人民幣6.58億元，拆入資金餘額為人民幣346.90億元，固定息率收益憑證餘額為人民幣104.67億元，公司債餘額為人民幣1,143.86億元，次級債餘額為人民幣143.07億元，境外債餘額為人民幣295.28億元。

截至2023年6月30日，本集團現金及現金等價物為人民幣626.07億元，其中人民幣現金及現金等價物佔73.21%。

截至2023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124.66億元，抵押借款餘額為人民幣11.99億元。

截至2023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

2023年上半年，本集團堅定踐行科技賦能下的財富管理和機構服務「雙輪驅動」的核心戰略，不斷提升數字化運營能力，經營業績同比大幅提升，綜合實力穩居行業前列。

#### 5、 報表合併範圍變更的說明

##### (1) 設立子公司導致的合併範圍變更

報告期內，華泰國際於香港設立全資子公司HS Carbon Neutrality & Energy Transition Investment Limited，納入集團合併範圍。Adhesion Wealth Advisor Solutions,Inc. 合併至Atria Investment,Inc.後被註銷。

##### (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7個、減少7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。境內，公司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，發行短期公司債券，通過機構間私募產品報價與服務系統和自建櫃台市場發行收益憑證，向證金公司進行轉融資等；中長期融資渠道包括發行公司債券、非公開公司債券、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，融入境外資金，支持公司業務的發展。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：一是持續完善資金計劃體系，建立流動性日監控體系，並通過平台實現資金頭寸管理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，增強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。

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。

## 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約人民幣5,700億元，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。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。

### (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193.77億元，較期初人民幣182.76億元增加人民幣11.01億元，增幅為6.02%；對合營企業的投資為人民幣13.11億元，較期初人民幣17.06億元減少人民幣3.95億元，降幅為23.15%。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) 本公司重大的股權投資

本公司重大的股權投資情況請參閱本報告「管理層討論與分析」「報告期內主要經營情況」「投資狀況分析」「主要控股參股公司分析」。

#### (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	上期末餘額	本期末餘額	報告期	報告期
			投資收益	公允價值 變動金額
以公允價值計量且其變動計入 其他綜合收益的債務工具	10,504,379	15,394,225	29,814	79,184
以公允價值計量且其變動計入 其他綜合收益的權益工具	241,587	270,778	-	19,511
以公允價值計量且其變動計入 當期損益的金融資產	350,804,545	388,680,522	16,926,140	4,330,627
衍生金融工具	6,150,176	1,116,090	(8,370,087)	(6,616,690)

#### (4) 報告期內，本公司不存在重大資產重組整合情況

## 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募集資金美元16.74億元(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 總額	本報告期		尚未使用 募集資金總額	尚未使用募集 資金用途及去向
			已使用募集 資金總額	已累計使用 募集資金總額		
2019年	GDR發行 非公開發行	1,131,303.69	-	1,158,666.14	-	-
2018年	(A股) 首次發行	1,420,794.22	-	1,418,421.26	-	-
2015年	(H股) 首次發行	3,058,768.96	-	3,066,604.63	-	-
2010年	(A股)	1,556,122.55	-	1,568,103.37	-	-
合計	-	7,166,989.42	-	7,211,795.40	-	-

(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	920,615.66	817,495.43	99,370.96	71,715.87	54,917.11
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
主營業務：控股公司。									
華紫金投資有限公司	100%	中國江蘇省南京市漢中路180號	2008/8/12	600,000.00	1,371,919.09	999,227.18	18,253.83	10,447.94	7,185.27
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、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)。									
華泰創新投資有限公司	100%	中國上海市長寧區武夷路234號	2013/11/21	350,000.00	433,166.52	389,902.98	18,157.67	10,676.47	8,594.97
主營業務：一般項目：以自有資金從事投資活動；投資管理；金屬鏈條及其他金屬製品銷售；酒店管理；健身休閒活動分支機構經營；打字複印分支機構經營；停車場服務分支機構經營；會議及展覽服務分支機構經營；旅遊開發項目策劃諮詢分支機構經營；票務代理服務分支機構經營。(除依法須經批准的項目外，憑營業執照依法自主開展經營活動)。許可項目：住宿服務分支機構經營；餐飲服務分支機構經營；食品銷售分支機構經營；高危險性體育運動(游泳)分支機構經營。(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，具體經營項目以相關部門批准文件或許可證件為準)。									

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
華泰期貨有限公司	100%	中國廣州市南沙區橫瀝鎮明珠三街1號 10層1001-1004、1011-1016房	1995/7/10	393,900.00	7,627,357.44	480,679.90	148,812.58	19,870.37	14,473.49
		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)。							
華泰聯合證券有限責任公司	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	695,201.27	459,219.51	149,054.81	8,043.82	6,260.67
		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。							
江蘇股權交易中心有限責任公司	52%	中國江蘇省南京市建鄴區江東中路 377號金融城10號樓3層	2013/7/4	20,000.00	51,343.31	45,344.05	1,705.16	630.51	471.61
		主營業務：為非上市公司股權、債券、債權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)。							
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號基金大廈32-42樓	1998/3/6	36,172.00	1,368,605.53	931,595.10	352,131.39	130,082.49	98,480.85
		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。							

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弄上海證大五道口廣場1號17層	2004/11/18	20,000.00	246,480.25	159,669.36	81,635.64	30,993.38	23,747.93
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。									
江蘇銀行股份有限公司	5.59%	中國江蘇省南京市中華路26號	2007/11/22	1,154,445.00	329,458,271.00	23,830,223.50	3,884,287.10	2,243,365.90	1,762,596.40
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；辦理委託存貸款業務；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：

- 2023年8月，公司通過北京產權交易所摘牌方式受讓了華泰聯合證券另一股東中國東方航空集團有限公司所持有的華泰聯合證券0.0812%股權。目前，華泰聯合證券正在辦理股權變更涉及的工商變更登記等手續。
- 2023年7月6日，江蘇銀行發佈《關於變更註冊資本獲監管機構核准的公告》，江蘇銀保監局同意其註冊資本因配股、可轉債轉股由人民幣11,544,450,000元變更為人民幣14,769,656,700元。同月，江蘇銀行根據《江蘇銀行變更註冊資本的批覆》完成了相關變更手續的辦理。
- 2023年2月22日，江蘇銀行召開2023年第一次臨時股東大會，審議通過《關於修訂江蘇銀行股份有限公司章程的議案》，其中涉及經營範圍修訂，該事項尚需國家金融監督管理總局江蘇監管局核准。

## 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「管理層討論與分析」「報告期內主要經營情況」「綜合財務狀況表主要項目分析」「報表合併範圍變更的說明」。

## 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，並據此判斷本集團是否為資產管理計劃的主要責任人。於2023年6月30日，本集團共合併61個結構化主體，合併結構化主體的總資產為人民幣83,093,634,934.18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76,808,656,261.05元。

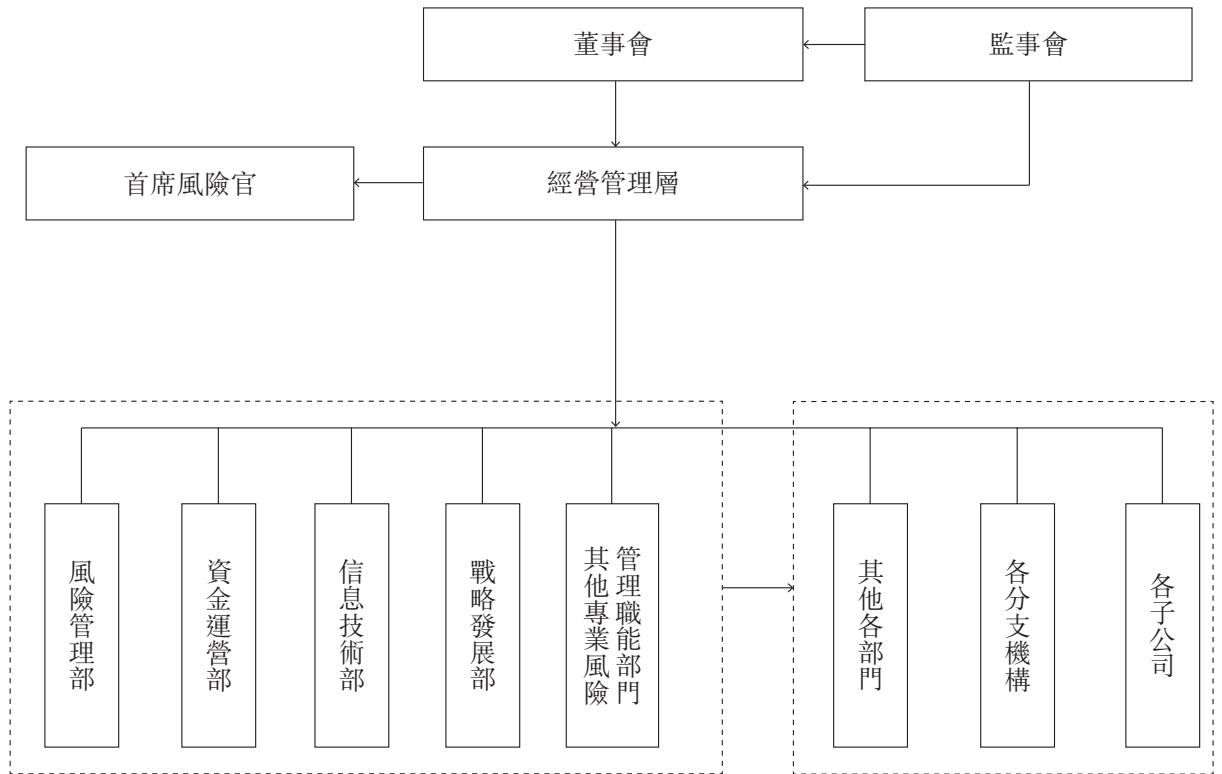
## 六、 可能面對的風險及風險防範措施

### 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，公司持續深入重點業務和風險領域強化管控，提升風險管理體系有效性，平台化賦能風險管理提質增效。公司強化業務風險前瞻識別，提升重點業務領域風險監測和管控能力，打造深入業務全生命周期的風險管理能力。公司進一步夯實跨境一體化的風險管理體系和能力，持續升級與業務發展相匹配的專業風險管理體系，提升管理精細度，深化管理穿透度。公司持續推動跨區域、多市場、多品種、一體化的風險管理平台建設，重點升級風險分析評估和監測預警等核心功能模塊，加大風險計量引擎建設力度，平台化賦能風險管理價值創造職能，保障業務平穩健康發展。

## 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條線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，受硅谷銀行破產危機、美聯儲加息預期變化等因素影響，全球資本市場波動顯著。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。公司持續優化統一的風險限額體系，及時評估新業務風險，並從市場風險價值(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，定期計量各類極端風險影響，及時發現並評估尾部風險承受能力。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	
	2023年 中期末	2022年 中期末	2023年 中期末	2022年 中期末
權益敏感性金融工具	7,453	8,637	13,009	15,251
利率敏感性金融工具	5,106	3,998	5,124	4,300
商品敏感性金融工具	200	282	127	396
整體組合風險價值	9,246	9,308	13,401	15,994

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	14,378	13,401	21,022	8,452
本公司	7,849	9,246	14,115	6,243

數據來源：公司內部統計。

### 4、信用風險

信用風險是指因融資方、發行人或交易對手等違約導致損失的風險。

融資類業務信用風險管理方面，公司執行嚴格的風險客戶與風險資產持續監控、及時化解的管理措施，強化動態的逆周期調節機制，建立市場系統性風險監測及應對機制，以控制業務常規風險、防範底線風險、靈活調節業務結構。發行人信用風險管理方面，公司建立信用債發行人統一監控平台，實現集團各業務信用債標的的統一監控，同時公司深化信用債全流程風險管控，建立常態化的風險券篩查處置機制，持續強化持倉債券監控預警機制，提升集團發行人信用風險防控成效。交易對手信用風險管理方面，公司持續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，對於擔保交收類業務，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管控能力。公司持續優化完善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。報告期內，公司未發生重大信用風險事件，各項業務平穩運行。

## 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常規和應急融資能力。公司建立了流動性風險應急預案並定期開展演練，根據公司情況持續優化流動性應急處置機制。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。

報告期內，公司以制度及流程管控為基礎，持續強化操作風險識別梳理精細度，多途徑提升集團操作風險管控質效。公司以高剩餘風險領域飛行測試及專項檢查為抓手，通過強化對重點業務、重點環節以及新業務開展情況的回溯自查和檢查，保障風險管控措施的有效落地；以過程管控為手段，實現貫穿風險感知、識別評估、應對處置、整改跟蹤的閉環管控鏈路；以操作風險管理工具為基礎，深化與子公司的溝通及分析機制，加大待優化作事項分析及跟蹤力度，督辦整改進展，力抓落實；以風險文化宣導為路徑，輸入輸出相結合，多措並舉強化操作風險文化宣導力度，賦能業務發展，推動操作風險管理文化在集團入腦入心。

## 7、合規風險

合規風險是指因公司或工作人員的經營管理或執業行為違反法律、法規或準則而使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、方式等維度不斷提升。進一步加強數字合規體系能力建設，搭建專業、高效的數字合規能力基座，持續豐富數字合規工具；持續完善業務合規管理機制，加大對重點業務的管控和支持力度，加強對業務實質的深刻理解，促進新業務、新模式穩妥落地；強化合規人員能力建設和合規協同，多措並舉強化員工合規執業意識。

## 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，公司持續推進信息技術管理制度建設，加強信息技術重點領域風險管控，不斷完善管理技術和手段，完善風險監測預警機制，並通過專項檢查、考核評價、風險文化宣導等措施，進一步提升信息技術風險管理能力和有效性。公司持續加強信息系統安全建設，制定了完備的網絡和信息安全事件應急預案，定期或不定期開展應急預案評估與應急演練。報告期內，公司重要信息系統安全平穩運行，未發生重大信息技術風險事件。

## 9、 聲譽風險

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

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，為公司發展營造良好的媒體環境。同時，持續強化集團化管理、事前管理、快速響應機制，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周期，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，持續加強模型風險管控。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
2022年度 股東大會	2023年 6月30日	1、審議公司2022年度董事會工作報告； 2、審議公司2022年度監事會工作報告； 3、審議公司2022年度財務決算報告； 4、審議關於公司2022年度報告的議案； 5、審議關於公司2022年度利潤分配方案的議案； 6、審議關於預計公司2023年日常關聯交易的議案； 7、審議關於預計公司2023年自營投資額度的議案； 8、審議關於公司續聘2023年度會計師事務所的議案； 9、審議公司獨立非執行董事2022年度履職報告； 10、審議關於公司回購註銷部分A股限制性股票的議案； 11、審議關於延長公司境內外債務融資工具一般性授權決議有效期的議案； 12、聽取關於公司董事2022年度績效考核和薪酬情況的報告； 13、聽取關於公司監事2022年度績效考核和薪酬情況的報告； 14、聽取關於公司高級管理人員2022年度履行職責、績效考核和薪酬情況的報告。	<a href="http://www.sse.com.cn/">http://www.sse.com.cn/</a> <a href="http://www.hkexnews.hk/">http://www.hkexnews.hk/</a> <a href="http://www.londonstockexchange.com/">http://www.londonstockexchange.com/</a> <a href="http://www.htsc.com.cn/">http://www.htsc.com.cn/</a>	2023年 7月1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	披露日期	會議決議
2023年第二次 A股類別 股東會	2023年 6月30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> <a href="http://www.hkexnews.hk/">http://www.hkexnews.hk/</a> <a href="http://www.londonstockexchange.com/">http://www.londonstockexchange.com/</a> <a href="http://www.htsc.com.cn/">http://www.htsc.com.cn/</a>	2023年 7月1日	議案審議通過
2023年第二次 H股類別 股東會	2023年 6月30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> <a href="http://www.hkexnews.hk/">http://www.hkexnews.hk/</a> <a href="http://www.londonstockexchange.com/">http://www.londonstockexchange.com/</a> <a href="http://www.htsc.com.cn/">http://www.htsc.com.cn/</a>	2023年 7月1日	議案審議通過

## 股東大會情況說明

公司於2023年2月6日發佈公告，原計劃於2023年2月10日召開的公司2023年第一次臨時股東大會、2023年第一次A股類別股東會、2023年第一次H股類別股東會將延期召開。

## 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
第六屆董事會 第二次會議	2023年 3月30日	現場及視頻會議方式。 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、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 司仿真視頻北京會議室。	1、審議公司2022年度經營管理層工作報 告； 2、審議公司2022年度財務決算報告； 3、審議公司2023年度財務預算報告； 4、審議關於公司A股限制性股票股權激 勵計劃第一個限售期解除限售條件成 就的議案； 5、審議關於公司回購註銷部分A股限制 性股票的議案； 6、審議關於公司2022年度利潤分配的預 案； 7、審議公司2022年度董事會工作報告； 8、審議關於公司2022年度報告的議案； 9、審議關於公司2022年度合規報告的議 案； 10、審議關於公司2022年度風險管理報告 的議案； 11、審議關於公司2022年度內部控制評價 報告的議案； 12、審議關於公司2022年度信息技術管理 專項報告的議案； 13、審議關於公司2022年度社會責任報告 的議案； 14、審議關於預計公司2023年日常關聯交 易的預案； 15、審議關於預計公司2023年自營投資額 度的預案；	所有議案均審議 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
			16、審議公司2023年度內部審計工作計劃；	
			17、審議關於公司續聘會計師事務所的議案；	
			18、審議關於延長公司境內外債務融資工具一般性授權決議有效期的議案；	
			19、審議關於《公司對標世界一流企業價值創造行動實施方案》的議案；	
			20、審議關於公司董事2022年度績效考核和薪酬情況的報告；	
			21、審議關於公司高級管理人員2022年度履行職責、績效考核和薪酬情況的報告；	
			22、審議公司獨立董事2022年度履職報告；	
			23、審議關於召開公司年度股東大會、A股類別股東會及H股類別股東會的議案；	
			24、聽取公司董事會審計委員會2022年度履職情況報告；	
			25、聽取公司2022年度合規總監工作報告；	
			26、聽取公司2022年度反洗錢工作報告；	
			27、聽取關於公司2022年度內部審計工作情況的報告；	
			28、審查關於公司2022年度淨資本等風險控制指標具體情況的報告。	

會議屆次	召開日期	會議形式及地點	會議議案	會議決議
第六屆董事會 第三次會議	2023年 4月28日	現場及視頻會議方式。 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、香港皇后大道中99號中環中心62樓華泰金融控股(香港)有限公司仿真視頻北京會議室。	1、審議關於變更公司會計政策的議案； 2、審議關於公司2023年第一季度報告的議案。	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
第六屆監事會 第二次會議	2023年 3月30日	現場方式。 地點：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。	1、審議公司2022年度監事會工作報告； 2、審議關於公司A股限制性股票股權激勵計劃第一個限售期解除限售條件成就的議案； 3、審議關於公司回購註銷部分A股限制性股票的議案； 4、審議關於公司2022年度利潤分配的預案； 5、審議關於公司2022年度報告的議案； 6、審議關於公司2022年度內部控制評價報告的議案； 7、審議關於公司監事2022年度績效考核和薪酬情況的報告； 8、聽取關於公司2022年度內部審計工作情況的報告； 9、聽取公司2023年度內部審計工作計劃。	所有議案均審議通過
第六屆監事會 第三次會議	2023年 4月28日	現場及視頻會議方式。 地點：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。	1、關於變更公司會計政策的議案； 2、關於公司2023年第一季度報告的議案。	所有議案均審議通過

## 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《上市規則》的規定。公司第六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，成員包括王兵先生、丁鋒先生、謝涌海先生，其中王兵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、公司第六屆董事會審計委員會2023年第一次會議於2023年1月17日以現場及視頻會議方式召開，會議聽取了德勤事務所相關人員關於公司2022年A+H+G股年度審計工作安排及預審工作情況的匯報等。
- 2、公司第六屆董事會審計委員會2023年第二次會議於2023年2月24日以通訊方式召開，會議審議通過了《關於公司2022年度審計計劃的議案》。
- 3、公司第六屆董事會審計委員會2023年第三次會議於2023年3月28日以現場及視頻會議方式召開，會議審議通過了《公司2022年度財務決算報告》《公司2023年度財務預算報告》《關於公司2022年度利潤分配的預案》《關於公司2022年度財務報表的議案》《關於公司2022年度報告的預案》《關於公司2022年度內部控制評價報告的議案》《關於預計公司2023年日常關聯交易的預案》《關於公司續聘會計師事務所的預案》《公司董事會審計委員會2022年度履職情況報告》《公司2022年度關聯交易專項審計報告》《關於公司2022年度募集資金使用、提供擔保、關聯交易等重大事項的專項審計報告》《公司2023年度內部審計工作計劃》，審閱了公司2022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2022年度反洗錢內部審計的報告》《關於公司2022年度內部審計工作情況的報告》。
- 4、公司第六屆董事會審計委員會2023年第四次會議於2023年4月27日以通訊方式召開，會議審議通過了《關於變更公司會計政策的議案》《關於公司2023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2023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2023年8月29日，審計委員會已審閱並確認本集團截至2023年6月30日止六個月的中期業績公告、2023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2023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

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

1、公司A股限制性股票股權激勵計劃第一個限售期解除限售並上市

公告編號：臨2023-022

公告編號：臨2023-023

2023年3月30日，公司第六屆董事會第二次會議及第六屆監事會第二次會議分別審議通過了《關於公司A股限制性股票股權激勵計劃第一個限售期解除限售條件成就的議案》。公司按照相關規定為770名激勵對象合計持有的14,222,943股限制性股票辦理了解除限售相關手續，上述股份於2023年4月24日解除限售上市流通。

公告編號：臨2023-025

公告編號：臨2023-029

2、將回購註銷部分A股限制性股票

公告編號：臨2023-022

報告期內，公司第六屆董事會第二次會議、第六屆監事會第二次會議以及公司2022年年度股東大會、2023年第二次A股類別股東會、2023年第二次H股類別股東會分別審議通過了《關於公司回購註銷部分A股限制性股票的議案》。公司將回購並註銷激勵對象中因存在個人績效條件未完全達標、與公司解除或終止勞動關係等情況的137人已獲授但尚未解除限售的部分或全部限制性股票，共計925,692股，回購價格為人民幣8.25元／股，本次回購的資金總額為人民幣7,636,959.00元。

公告編號：臨2023-023

公告編號：臨2023-026

公告編號：臨2023-055

## (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（並非本公司於《香港上市規則》定義下的主要附屬公司）採用的員工激勵措施請參見本報告「財務報表附註56(b）」「附屬公司股份支付」。

## 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」的行業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，公司培訓工作圍繞戰略文化、綜合素質、專業能力、職業操守、科技賦能、國際視野等方面開展，年度培訓計劃有序實施。公司開展行業文化、發展戰略、企業文化價值觀培訓，促進文化建設與業務發展相融合；組織實施針對管理者的「BAL星戰營」項目、針對成熟員工的「HIPO」項目、針對新員工的「華泰星」項目等職業發展類培訓，支持員工職業生涯發展；聯合業務部門舉辦財富管理、機構業務、金融科技、合規風控等業務類培訓，提升員工專業能力，強化員工職業操守；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264場，平台學習人次46.3萬人次，學習時長13.3萬學時，人均13.9學時。

## (三) 員工人數

截至2023年6月底，集團員工人數為16,644人（含勞務派遣、經紀人等），其中母公司11,561人（含勞務派遣、經紀人等）。

## 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，董事會2次，監事會2次，審計委員會4次，合規與風險管理委員會1次，發展戰略委員會2次，薪酬與考核委員會1次，共計15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。2022年12月30日，公司第六屆董事會第一次會議選舉張偉先生為公司第六屆董事會董事長，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。



根據《企業管治守則》第C.1.6條的規定，獨立非執行董事以及其他非執行董事應出席股東大會。本公司部分獨立非執行董事及部分非執行董事因公務原因未能出席本公司於2023年6月30日召開的2022年度股東大會、2023年第二次A股類別股東會、2023年第二次H股類別股東會。

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。2022年10月28日，為加強對公司董事、監事和高級管理人員所持本公司股份及其變動的管理，公司對該《管理制度》進行了修訂，並經公司第五屆董事會第二十七次會議審議通過。《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。本公司於報告期內也沒有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，分別為王建文先生、王全勝先生、彭冰先生、王兵先生、謝涌海先生。

#### **(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

#### (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

公司積極響應《南京市生活垃圾管理條例》，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。

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。

公司在營業及辦公用房裝修改造中，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。

2023年3月，華泰聯合證券作為獨家保薦機構及主承銷商，助力江蘇聯合水務科技股份有限公司正式登陸上交所主板，積極推動供水、污水處理和水生態修復等項目能力提升，更好地服務國家環境治理政策方針。華泰聯合證券將繼續踐行金融企業的社會責任，為更多節能環保領域企業搭建資本橋樑，為持續深入打好藍天、碧水、淨土保衛戰貢獻力量。

2023年8月，華泰證券深入踐行ESG理念，制定並對外披露了《华泰證券股份有限公司信息及數據保護聲明》和《华泰證券股份有限公司檢舉及檢舉者保護相關制度》兩份治理文件，分別闡述了公司數據安全與個人信息保護的工作要求，以及公司在檢舉控告、檢舉者保護等方面的舉措，旨在著力提升員工信息安全意識，更好地守護客戶的隱私安全及合法權益，同時，進一步構建合規、誠信、廉潔的企業文化氛圍。

#### (四) 在報告期內為減少其碳排放所採取的措施及效果

公司深入貫徹習近平生態文明思想，緊扣碳達峰碳中和目標任務，實施全面節約戰略，通過節能宣傳週、低碳日活動、「地球一小時」等活動廣泛開展節能降碳宣傳教育，積極營造節能降碳濃厚氛圍，進一步推進形成勤儉節約、合理用能的社會風尚。

公司總部園區裝配有光伏發電系統，2023年上半年通過該系統節約電量達46,084千瓦時，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，通過中央綠化、垂直綠化、屋頂花園等多層次的景觀打造，不斷擴大綠植種植面積，減少碳排放，助力碳中和。

公司在裝修改造建設項目中積極落實綠建指標，並推進利舊措施，合理把握改造的「量」和「度」，在為員工打造優美和舒適辦公空間的同時，選擇更環保裝修材料並減少原有裝飾裝修材料的拆除以及新裝飾裝修材料的生產、運輸、安裝所產生的溫室氣體排放。

2023年2月，華泰證券自營參與碳排放權交易資格申請獲得中國證監會批覆。此次獲批，是公司參與國內碳市場交易，助力綠色低碳發展，支持國家雙碳目標實現邁出的重要一步。公司將全面構建面向國內綠色產業客戶和投資機構的碳市場產品與服務能力，為可持續發展貢獻更大力量。

2023年2月，華泰－吉利曹操出行3期資產支持專項計劃(碳中和)於上交所成功發行。本期專項計劃基礎資產涉及項目將全部屬於「綠色交通」類綠色低碳產業項目。本期專項計劃的發行將有效促進新能源汽車的生產、消費與推廣，帶來良好的環境效益與社會效益。

2023年3月，華泰證券聯合北京市企業家環保基金會、金陵圖書館共同主辦《從城市到荒野：生物多樣性主題展》「地球一小時」特別沙龍活動，通過創意手工和觀影等趣味形式傳遞環保理念，提高員工、公眾對氣候變化及生物多樣性保護等議題的關注。同時，華泰證券以「推廣合作夥伴」的身份加入「地球一小時」活動，以實際行動減少企業碳足跡。

2023年6月，華泰聯合證券作為獨家保薦人及主承銷商，助力常州時創能源股份有限公司登陸上交所科創板，進一步推動光伏行業發展，服務國家現代能源體系建設。基於對能源與環保產業鏈的多年耕耘和深刻理解，華泰聯合證券積極響應國家「雙碳」政策，以光伏、鋰電池等新能源及節能環保領域為支點，已為多家優質實體企業搭建資本市場橋樑，為「雙碳」目標的實現貢獻金融力量。

## 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，公司持續深化「一司一縣」結對幫扶，組織精幹力量，赴金寨縣開展調研，全方位推進結對幫扶工作；積極參與江蘇省「五方掛鉤」定點幫扶，推進高效農業設施項目落地見效；扎實推進與蘇中蘇北地區的「村企聯建」，以鄉村文旅研學項目促進集體增收；全力支持「東西部協作幫扶」，繼續實施消費幫扶、支持對口支援助地區2022至2023兩年行動計劃，採購江蘇省對口支援助地區的消費幫扶產品。堅持以人為本，2023年上半年累計走訪慰問幫扶地區困難家庭235戶。堅持定期跟蹤督導，最大限度調動各方參與鄉村振興工作的積極性、主動性、創造性，引導分支機構、子公司發揮專業優勢服務鄉村振興，積極參與雲南瀾滄縣、河南桐柏縣、貴州玉屏縣等地的鄉村振興工作，通過「保險+期貨」、開展專業培訓、帶動就業等形式服務鄉村振興。

## 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;到期日:長期	否	是

### 二、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情況

### 三、報告期內,公司無違規擔保情況

### 四、公司半年報未經審計

## 五、公司上年年度報告不存在非標準審計意見

## 六、報告期內，公司無破產重整相關事項

## 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年至2022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2022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2022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2022年年報中查詢
華泰資管公司集合資產管理計劃項下債券違約合同糾紛案件	可在2021年至2022年年報中查詢
華泰資管公司資本創新招商3號定向資產管理計劃股票質押式回購合同糾紛案	可在2022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至2022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、 公司與程曦股權轉讓糾紛案

2016年，公司取得漳州三利達環保科技股份有限公司(證券代碼：833329，以下簡稱「利達股份」)股票用於做市。2018年7月，利達股份稱計劃從全國股轉系統摘牌赴海外發展，其股東程曦同意在摘牌後受讓公司所持有的利達股份的全部股票。利達股份及其股東程曦向公司出具了《承諾函》，承諾在利達股份終止掛牌後通過支付現金方式受讓公司持有的利達股份全部股票1,407,000股，轉讓總金額不低於人民幣63,315,000元。利達股份終止掛牌後，程曦未支付股票轉讓價款。公司於2022年11月14日向廈門市中級人民法院提交訴狀材料，請求被告程曦支付股權轉讓款、違約金、逾期利息共計人民幣108,363,622.50元(截至2022年10月20日)。法院於2022年11月15日立案，2023年6月5日，廈門市中級人民法院一審判決程曦向華泰證券分別支付股份轉讓款人民幣63,315,000元、違約金人民幣12,663,000元、保全費人民幣5,000元。

## 2、 質押式證券回購糾紛案

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案	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。判決生效後公司向法院申請執行，報告期內共執行回款人民幣323,225,614.19元。2023年3月6日，南京市棲霞區人民法院裁定終結本次執行情序。

## 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案

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。判決生效後公司向法院申請執行，報告期內共執行回款人民幣107,410,774.17元。2023年1月5日，南京市棲霞區人民法院裁定終結執行程序。

## 事項

## 詳情

- 公司與韓華、楊立軍質押式證券回購糾紛案 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。判決生效後公司向法院申請執行，2022年執行回款人民幣24,007,579.91元。報告期內新增執行回款人民幣46,357,909.33元。2023年3月31日，南京市建鄴區人民法院裁定終結執行程序。
- 公司與楊立軍、韓華質押式證券回購糾紛案 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。判決生效後公司向法院申請執行，共執行回款人民幣4,153,182.67元。2022年11月30日，南京市建鄴區人民法院裁定終結執行程序。

### 3、華泰聯合證券與郵儲銀行關於美吉特項目糾紛案

「華泰美吉特燈都資產支持專項計劃」(以下簡稱「美吉特ABS」)由上海富誠海富通資產管理有限公司擔任計劃管理人，華泰聯合證券擔任財務顧問。2020年9月21日，上海金融法院下發《應訴通知書》，並於2020年9月25日送達華泰聯合證券。原告中國郵政儲蓄銀行因投資「美吉特ABS」未得到全額兌付，訴至法院要求判令五被告連帶賠償原告投資損失人民幣5.27億元及相關利息，判令訴訟費用由五被告承擔，華泰聯合證券被列為第五被告。上海金融法院於2023年4月14日一審判決華泰聯合證券承擔連帶賠償責任，華泰聯合證券已提交上訴申請，一審判決尚未生效。

### 4、華泰聯合證券與16億陽債投資者糾紛案

億陽集團股份有限公司2015年獲准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。

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，2022年8月，本案在北京市高級人民法院二審裁定駁回上訴，維持原裁定。2023年3月6日，哈爾濱市中級人民法院作出(2023)黑01民初527號民事裁定書，本案按上海仟富來資產管理有限公司撤回起訴處理。

5、 華泰資管公司關於華泰慧澤1號集合產品合同糾紛案

2021年6月，華泰慧澤1號集合資產管理計劃某投資者以金融委託理財合同糾紛為由向上海金融法院起訴管理人華泰資管公司並要求承擔賠償責任，訴訟賠償金額為人民幣8,631萬元。2021年11月，原告方變更訴訟請求，將訴訟賠償金額調整為人民幣14,416萬元。2022年9月，一審法院判決駁回原告方全部訴訟請求。2023年2月，上海高院作出二審判決，駁回該投資者上訴請求，維持原判。

6、 華泰紫金投資旗下伊犁基金因投資河南義騰項目與德爾集團及其實控人汝繼勇的履約糾紛案

華泰紫金投資旗下伊犁蘇新投資基金合夥企業(有限合夥)(簡稱「伊犁基金」)於2020年6月向南京仲裁委員會申請仲裁，要求德爾集團有限公司(簡稱「德爾集團」)實控人汝繼勇履行股權回購義務。南京仲裁委員會於2022年8月19日、2023年2月24日分別開庭審理，目前尚未作出裁決。2022年11月11日，伊犁基金向南京市建鄴區人民法院對德爾集團提起訴訟，要求其對伊犁基金因德爾未來股票質押擔保無效而產生的損失承擔賠償責任(賠償損失人民幣275,966,101元，其中投資本金損失為人民幣142,372,881元，利息損失為人民幣133,593,220元)。2022年11月28日，根據伊犁基金的申請，南京市建鄴區人民法院凍結德爾集團所持有54,919,622股德爾未來股票。2023年2月2日，因管轄權問題，南京市建鄴區人民法院作出民事判決，裁定將該案件移送至新疆維吾爾自治區高級人民法院伊犁哈薩克自治州分院處理。現該案已報最高人民法院，請示最高人民法院指定法院管轄。

### (三) 公司本報告期被處罰和公開譴責的情況

- 1、 2023年2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責令改正措施的決定》([2023]25號)，對公司研究所制度建設及執行不規範的相關問題採取責令改正的行政監管措施。針對存在的問題，公司組織排查研報製作及審查流程，梳理完善管控措施，加大員工業務培訓，並通過科技賦能強化審核機制，促進整改落到實處。
- 2、 2023年6月，河南證監局對公司河南分公司出具《關於對華泰證券股份有限公司河南分公司採取出具警示函的行政監管措施》([2023]33號)，認定河南分公司經紀業務管理存在以下問題：一是證券經紀人登記執業地域與委託合同約定執業地域不一致；二是未將證券經紀人執業行為的合規性納入考核範圍；三是部份經紀關係確認單缺失，證券經紀人執業留痕不完整；四是個別客戶業務辦理資料留存不完整，決定對該分公司採取出具警示函的行政監管措施。公司已督促河南分公司及時整改、按監管要求提交書面整改報告，河南分公司針對函件反映的問題採取相關措施進一步加強經紀人執業行為等環節的管理、提升規範運作水平。

- 3、2023年2月2日及2023年3月23日，華泰聯合證券分別收到江蘇證監局下發的《關於對華泰聯合證券有限責任公司、孫聖虎、董雪松採取出具警示函措施的決定》和上交所下發的《關於對江蘇浩歐博生物醫藥股份有限公司持續督導機構及保薦代表人予以監管警示的決定》。2021年7月，江蘇浩歐博生物醫藥股份有限公司（以下簡稱「浩歐博」）發生關聯方非經營性資金佔用事項，涉及關聯交易未按規定披露，浩歐博於2022年2月披露該資金佔用相關情況。江蘇證監局對浩歐博進行了立案調查，並對華泰聯合證券負責的浩歐博持續督導工作進行了延伸檢查。江蘇證監局認定華泰聯合證券在履行持續督導職責中未能盡到勤勉盡責義務，包括：未能及時發現浩歐博資金佔用違規行為；在知曉資金佔用事項後未能及時向中國證監會報告；所出具的報告存在相關描述與事實不符，未能真實、準確的反映浩歐博違規問題等，根據《證券發行上市保薦業務管理辦法》第六十五條的規定，對華泰聯合證券及相關人員採取出具警示函的監督監管措施。上交所根據上述警示函及《科創板股票上市規則》等相關規定，對華泰聯合證券及相關人員採取出具予以監管警示的自律監管措施。華泰聯合證券對照公司制度進行了相應的內部問責，要求責任部門對保薦業務項目持續督導、人員安排等情況進行全面梳理、自查自糾，華泰聯合證券將進一步加強項目持續督導管理，避免類似事件再次發生。



## 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、報告期內公司及其控股股東、實際控制人誠信狀況的說明

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況

### 1 託管、承包、租賃事項

報告期內，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	-
報告期末對子公司擔保餘額合計(B)	371.05
公司擔保總額情況(包括對子公司的擔保)	
擔保總額(A+B)	371.05
擔保總額佔公司淨資產的比例(%)	22.16
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)	322.05
擔保總額超過淨資產50%部份的金額(E)	-
上述三項擔保金額合計(C+D+E)	322.05

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、 本公司擔保事項

- (1) 2017年，經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。
- (2) 2018年，經本公司第四屆董事會第十六次會議審議通過，公司為控股子公司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，中國證監會深圳監管局批准公司於2022年6月21日起將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10億元。報告期末，公司合計為華泰聯合證券提供10億元的淨資本擔保。
- (3) 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。
- (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，債券已於2023年2月到期兌付全部本息，擔保自然終止。

- (5) 2021年，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，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1億美元債券提供無條件及不可撤銷的保證擔保。
- (6) 2022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，為華泰國際旗下附屬公司Pioneer Reward Limited發行的10億美元債券以及50億元人民幣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371.05億元。

- 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322.05億元，包括：1) 公司為華泰國際下屬公司Pioneer Reward Limited發行的24億美元債券及50億人民幣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2號－年度報告的內容與格式(2021年修訂)》，報告期內本集團未簽署重大合同。
- 2、 已披露的有關重要合同在報告期內進展如下：

報告期內《華泰證券廣場室內裝飾裝修二標段工程施工合同》正常履行，公司已按約支付內裝飾裝修二標段工程施工合同價人民幣73.91萬元。截至報告期末，公司已按約累計支付內裝飾裝修二標段工程施工合同價款人民幣14,038.89萬元(不含承諾扣除的財政覆審扣減金額人民幣67.15萬元和稅率調整費用)，本合同已履約完畢。

### 十二、其他重大事項的說明

- 1、 報告期內，公司完成了經營範圍工商變更登記，並取得了江蘇省市場監督管理局換發的《營業執照》，變更後的經營範圍為：許可項目：證券業務；證券投資諮詢；公募證券投資基金銷售；證券投資基金託管(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，具體經營項目以審批結果為準)一般項目：證券公司為期貨公司提供中間介紹業務(除依法須經批准的項目外，憑營業執照依法自主開展經營活動)
- 2、 **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	江西分公司	江西分公司	中國江西省南昌市紅谷灘區 麗景路95號出版中心裙樓 一層101號商舖-3#以及寫字樓 第16層1603、1604、1605、 1606、1607號	2023年1月30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	南京魚市街證 券營業部	南京中山東路 證券營業部	中國南京市玄武區中山 東路301號801室	2023年2月15日
2	北京蘇州街證 券營業部	北京蘇州街證 券營業部	中國北京市海淀區蘇州街 29號維亞大廈9層901、902、 903、911、912室	2023年4月7日
3	深圳龍崗大道 證券營業部	深圳龍崗大道 證券營業部	中國深圳市龍崗區龍城街道 尚景社區萬科時代廣場 2棟101S、102S(龍崗大道 與龍城大道交匯處)	2023年4月17日
4	深圳竹子林四 路證券營業 部	深圳平安金融 中心證券營 業部	中國深圳市福田區福田街道 福安社區益田路5033號 平安金融中心70層04、05單 元	2023年4月23日
5	昆山黑龍江北 路證券營業 部	昆山黑龍江北 路證券營業 部	中國昆山開發區黑龍江北路 8號御景苑3號樓1樓3室-1、 3樓20室	2023年5月5日
6	南京中央路第 三證券營業 部	南京江寧蘇源 大道證券營 業部	中國南京市江寧經濟技術 開發區蘇源大道19號 江寧九龍湖國際企業總部園 A1幢1層南側	2023年5月5日

7	泰州高港金港 南路證券營 業部	泰州永定東路 證券營業部	中國泰州市永定東路288號 3號樓2層	2023年6月6日
8	瀋陽青年大街 證券營業部	瀋陽青年大街 證券營業部	中國瀋陽市和平區青年大街 318號(1門)、320號 (群樓201)	2023年6月12日
9	武漢首義路證 券營業部	武漢高新大道 證券營業部	中國武漢市東湖新技術開發區 高新大道768號慧谷大廈A座 1層A103-A111、 2層A205-A208	2023年6月12日

### 3、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了南京華泰金斯瑞生物醫藥創業投資合夥企業(有限合夥)。截至報告期末，總認繳規模為人民幣100,000萬元，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人民幣16,000萬元。

#### (2) 華泰國際

報告期內，華泰國際於香港新設全資子公司HS Carbon Neutrality & Energy Transition Investment Limited。

報告期內，華泰國際子公司Huatai HK Investment (Cayman) Limited更名為Huatai International Private Equity Investment Management Limited。

#### (3) 華泰創新投資

報告期內，華泰創新投資註冊地址由「中國北京市西城區豐盛胡同28號樓7層701-8至701-11」變更為「中國上海市長寧區武夷路234號」。

4、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)上披露的其他重大事項見附錄。

#### 5、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；報告期內共接待境內外多家券商和基金公司等機構共19批次約213名研究員和投資人員的現場調研或電話訪談；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。報告期內共參加3場策略報告會與投資論壇與39名投資者和研究員就行業發展趨勢、公司經營業績及業務發展戰略等問題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。



2023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	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	2023年1月2日	投資者／ 分析師調研	電話訪談	摩根大通、摩根士丹利、 中信證券、國泰君安、 復興國際、申萬宏源、 華創證券等 (139人次)	
2	2023年1月4日	投資者／ 分析師調研	電話訪談	星展銀行 (1人次)	
3	2023年2月21日	投資者／ 分析師調研	電話訪談	BlackRock Investment (4 人次)	
4	2023年3月31日	華泰證券2022 年度業績發佈會	電話訪談	摩根士丹利、摩根大通、 瑞銀證券、花旗銀行、 滙豐銀行、中信證券、 中金公司、中信建投、 國泰君安、申萬宏源等 (超1,000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
5	2023年4月3日	投資者／ 分析師調研	電話訪談	仁橋資產 (1人次)	
6	2023年4月11日	投資者／ 分析師調研	現場訪談	Citadel International Equities (1人次)	
7	2023年4月13日	投資者／ 分析師調研	電話訪談	威靈頓資管 (2人次)	
8	2023年4月17日	投資者／ 分析師調研	電話訪談	景林資產 (2人次)	
9	2023年4月20日	投資者／ 分析師調研	電話訪談	摩根大通 (1人次)	
10	2023年4月21日	投資者／ 分析師調研	電話訪談	星展銀行 (1人次)	
11	2023年4月25日	投資者／ 分析師調研	現場訪談	興業證券、路博邁、泰康 資產、國泰基金、西部 利得、寧泉資產、富國 基金等 (8人次)	
12	2023年5月8日	投資者／ 分析師調研	電話訪談	申萬宏源、中銀基金、財 通證券、廣發證券、南 京證券、景林資產等 (24人次)	

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
13	2023年5月9日	投資者／分析師調研	現場訪談	中金公司(3人次)	
14	2023年5月12日	投資者／分析師調研	現場訪談	睿遠基金(1人次)	
15	2023年5月15日	投資者／分析師調研	現場訪談	長城證券等(7人次)	
16	2023年5月17日	天風證券 2023年 中期策略會	電話訪談	天風證券、中信證券、景林資產、興業銀行、匯添富基金、工銀瑞信、平安理財等(28人次)	
17	2023年5月18日	投資者／分析師調研	現場訪談	長江證券、旌安投資(3人次)	
18	2023年5月25日	廣發證券 策略會	現場訪談	廣發證券、寧銀理財、德匯投資、太保資產(5人次)	
19	2023年6月1日	中信證券 2023年資本 市場論壇	現場訪談	中信證券、長江養老、雙安資產、果實資本、淡水泉投資(6人次)	
20	2023年6月12日	投資者／分析師調研	現場訪談	瑞銀證券、國泰君安、申萬宏源(5人次)	
21	2023年6月14日	投資者／分析師調研	現場訪談	華創證券(5人次)	
22	2023年6月15日	投資者／分析師調研	現場訪談	廣發證券(4人次)	
23	2023年6月16日	投資者／分析師調研	現場訪談	太平洋證券(1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

單位：股

	本次變動前		本次變動增減(+、-)					本次變動後	
	數量	比例 (%)	發行 新股	送股	公積金 轉股	其他	小計	數量	比例 (%)
一、有限售條件股份	44,427,027	0.49	-	-	-	-14,222,943	-14,222,943	30,204,084	0.33
1、國家持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2、國有法人持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3、其他內資持股	44,427,027	0.49	-	-	-	-14,222,943	-14,222,943	30,204,084	0.33
其中：境內非國有法人持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
境內自然人持股	44,427,027	0.49	-	-	-	-14,222,943	-14,222,943	30,204,084	0.33
4、外資持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其中：境外法人持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
境外自然人持股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
二、無限售條件流通股份	9,031,162,000	99.51	-	-	-	14,222,943	14,222,943	9,045,384,943	99.67
1、人民幣普通股	7,312,116,320	80.57	-	-	-	14,222,943	14,222,943	7,326,339,263	80.73
2、境內上市的外資股	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3、境外上市的外資股	1,719,045,680	18.94	-	-	-	-	-	1,719,045,680	18.94
4、其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-
三、股份總數	9,075,589,027	100.00	-	-	-	-	-	9,075,589,027	100.00

## 2、 股份變動情況說明

2023年4月，公司A股限制性股票激勵計劃首次授予部份第一個限售期解除限售條件成就，共計14,222,943股限制性股票解除限售為無限售條件流通股份。

### (二) 限售股份變動情況

單位：股

股東名稱	期初限售股數	報告期解除 限售股數	報告期增加 限售股數	報告期末 限售股數	限售原因	解除限售日期
A股限制性股票 激勵對象	44,427,027	14,222,943	-	30,204,084	A股限制性 股票激勵 計劃	2023年 4月24日
合計	44,427,027	14,222,943	-	30,204,084	/	/

註：

根據2021年2月9日公司披露的《华泰證券股份有限公司A股限制性股票股權激勵計劃》的規定，激勵計劃授予的限制性股票自相應授予部份股票登記完成之日起滿24個月後，滿足解除限售條件的，激勵對象可以在未來36個月內按33%、33%、34%的比例分三期解除限售。

本激勵計劃中限制性股票的登記日為2021年4月6日，第一個限售期於2023年4月5日屆滿。本次解鎖股票數量為14,222,943股，本次解鎖股票上市流通日期為2023年4月24日。

## 二、股東情況

### (一) 股東總數：

截至報告期末普通股股東總數(戶) 256,953  
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249,914戶，H股登記股東7,039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)	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		股東性質
	報告期內增減	期末持股數量	比例(%)		股份狀態	數量	
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	-8,407,409	1,266,027,718	13.95	-	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	100,000	356,183,206	3.92	-	無	-	國有法人
江蘇省蘇豪控股集團有限公司	27,038,803	283,264,288	3.12	-	無	-	國有法人
香港中央結算有限公司	96,564,475	269,638,900	2.97	-	無	-	境外法人
阿里巴巴(中國)網絡技術有限公司	-	268,199,233	2.96	-	無	-	境內非國有法人
中國證券金融股份有限公司	-	152,906,738	1.68	-	無	-	未知
江蘇蘇豪國際集團股份有限公司	1,979,200	137,838,367	1.52	-	無	-	國有法人
江蘇宏圖科技股份有限公司	-	123,169,146	1.36	-	未知	123,169,146	境內非國有法人

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		股份種類及數量	
	流通股的數量	種類	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	1,266,027,718	境外上市外資股		1,266,027,718
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	356,183,206	人民幣普通股		341,978,006
		境外上市外資股		14,205,200
江蘇省蘇豪控股集團有限公司	283,264,288	人民幣普通股		81,851,288
		境外上市外資股		201,413,000
香港中央結算有限公司	269,638,900	人民幣普通股		269,638,900
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
中國證券金融股份有限公司	152,906,738	人民幣普通股		152,906,738
江蘇蘇豪國際集團股份有限公司	137,838,367	人民幣普通股		43,132,567
		境外上市外資股		94,705,800
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

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。江蘇省蘇豪控股集團有限公司是江蘇蘇豪國際集團股份有限公司的控股股東。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、江蘇省蘇豪控股集團有限公司和江蘇蘇豪國際集團股份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、201,413,000股和94,705,800股，此部份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，特將此部份股份單獨列出，若將此部份股份包含在內，香港中央結算(代理人)有限公司實際代為持有股份為1,715,760,518股，佔公司總股本的18.91%。
- 3、 截至報告期末，江蘇高投持有的50,000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3.93%。

- 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、 Citibank, National Association為公司GDR存託人，GDR對應的境內基礎A股股票依法登記在其名下。根據存託人統計，截至報告期末公司GDR存續數量為134,745份，佔中國證監會核准發行數量的0.16%。

#### 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 有限售條件 股份數量	有限售條件股份 可上市交易情況		限售條件
			可上市 交易時間	新增 可上市 交易股份 數量	
1	周易	482,400	詳見附註	—	詳見附註
2	韓臻聰	402,000	詳見附註	—	詳見附註
3	李世謙	402,000	詳見附註	—	詳見附註
4	孫含林	402,000	詳見附註	—	詳見附註
5	姜健	402,000	詳見附註	—	詳見附註
6	張輝	402,000	詳見附註	—	詳見附註
7	陳天翔	402,000	詳見附註	—	詳見附註
8	焦曉寧	335,000	詳見附註	—	詳見附註
9	焦凱	335,000	詳見附註	—	詳見附註
10	王翀	335,000	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》相關公告。

### (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、董事、監事和高級管理人員情況

(一) 現任及報告期內離任董事、監事和高級管理人員持股情況無變動

(二) 董事、監事、高級管理人員報告期內未被授予股權激勵

### 四、控股股東或實際控制人變更情況

報告期內，公司控股股東或實際控制人未變更。

### 五、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2023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 股份數目(股)	佔本公司 已發行股份 總數的 比例(%)	佔本公司 已發行A股/ H股總數的 比例(%)	好倉/ 淡倉/ 可供借出 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	14.01	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	6.15	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	81,851,288	0.90	1.11	好倉
			受控法團權益	43,132,567	0.48	0.59	好倉
		H股(港股通)	實益擁有人	201,413,000	2.22	11.72	好倉
			受控法團權益	94,705,800	1.04	5.51	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81,851,288股A股好倉及201,413,000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43,132,567股A股好倉及94,705,800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。

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2023年6月30日，本公司並不知悉任何其他人士（本公司董事、監事及最高行政人員除外）於本公司股份或相關股份中擁有根據《證券及期貨條例》第336條規定須記錄於登記冊內之權益或淡倉。

## 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，本公司董事持有的股票情況如下：

序號	姓名	股份類別	權益性質	持有的 股份數目 (股)	佔本公司 已發行 股份總數 的比例(%)	佔本公司	
						已發行 A股/H股 總數的 比例(%)	好倉/ 淡倉/ 可供借出 的股份
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2023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

公司於2022年1月13日非公開發行含回售選擇權的公司債券，簡稱「22華泰F1」，發行規模人民幣40億元，票面利率2.75%，並於上交所掛牌。2022年12月26日，公司對22華泰F1行使發行人調整票面利率選擇權，投資人選擇全額回售，公司對回售債券不進行轉售，於2023年1月17日全額支付了人民幣40億元回售資金，並支付了人民幣1.10億元期間利息（含稅）。

除上述披露外，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，公司未發行企業債券。

#### (二) 公司債券

##### 1. 公司債券基本情況

單位：億元 幣種：人民幣

債券名稱	簡稱	代碼	發行日	起息日	到期日	債券餘額	利率(%)	還本 付息方式	交易場所	是否 存在終止 上市交易 的風險
华泰證券股份有限公司2018年面向合格投資者公開發行公司債券(第一期)(品種二)	18華泰G2	155048	2018-11-22	2018-11-26	2023-11-26	10	4.17	到期還本， 按年付息	上交所	否
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(第二期)	20華泰G3	163482	2020-04-27	2020-04-29	2025-04-29	35	2.90	到期還本， 按年付息	上交所	否
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(第三期)	20華泰G4	163558	2020-05-19	2020-05-21	2025-05-21	30	3.20	到期還本， 按年付息	上交所	否
华泰證券股份有限公司2020年面向專業投資者公開發行次級債券(第一期)	20華泰C1	175409	2020-11-11	2020-11-13	2025-11-13	50	4.48	到期還本， 按年付息	上交所	否
华泰證券股份有限公司2020年面向專業投資者公開發行公司債券(第五期)	20華泰G7	175473	2020-11-20	2020-11-24	2023-11-24	35	3.90	到期還本， 按年付息	上交所	否
华泰證券股份有限公司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	2020-12-07	2020-12-09	2023-12-09	40	3.79	到期還本， 按年付息	上交所	否
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)	21華泰G1	175648	2021-01-18	2021-01-20	2024-01-20	40	3.58	到期還本， 按年付息	上交所	否
华泰證券股份有限公司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	2021-01-27	2021-01-29	2026-01-29	90	4.50	到期還本， 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	債券餘額	利率(%)	還本 付息方式	交易場所	是否 存在終止 上市交易 的風險
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(第二期)	21華泰G3	188047	2021-04-22	2021-04-26	2024-04-26	50	3.42	到期還本， 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	2021-05-13	2021-05-17	2026-05-17	60	3.71	到期還本， 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	2021-05-20	2021-05-24	2024-05-24	40	3.28	到期還本， 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	2021-05-20	2021-05-24	2026-05-24	20	3.63	到期還本， 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	2021-06-10	2021-06-15	2024-06-15	20	3.40	到期還本， 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	2021-06-17	2021-06-21	2024-06-21	25	3.45	到期還本， 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	2021-09-03	2021-09-07	2024-09-07	15	3.03	到期還本， 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	2021-09-03	2021-09-07	2031-09-07	27	3.78	到期還本， 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	2021-09-15	2021-09-17	-	30	3.85	在發行人不 行使遞延 支付利息 權的情況 下，每年 付息一次	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) (品種一)	21華泰13	188874	2021-10-14	2021-10-18	2024-10-18	21	3.25	到期還本， 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	2021-10-14	2021-10-18	2031-10-18	34	3.99	到期還本， 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	2021-10-21	2021-10-25	2024-10-25	22	3.22	到期還本， 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	2021-10-21	2021-10-25	2031-10-25	11	3.94	到期還本， 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	債券餘額	利率(%)	還本 付息方式	交易場所	是否 存在終止 上市交易 的風險
华泰证券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行永續次級債券(第二期)	21華泰Y2	188942	2021-10-26	2021-10-28	-	50	4.00	在發行人不行使遞延支付利息權的情況下,每年付息一次	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	2021-11-16	2021-11-18	-	20	3.80	在發行人不行使遞延支付利息權的情況下,每年付息一次	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	2022-01-24	2022-01-26	-	27	3.49	在發行人不行使遞延支付利息權的情況下,每年付息一次	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	2022-02-10	2022-02-14	2025-02-14	50	2.79	到期還本,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	2022-07-07	2022-07-11	-	30	3.59	在發行人不行使遞延支付利息權的情況下,每年付息一次	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(第二期)	22華泰G2	137666	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(第三期)	22華泰G3	137732	2022-08-24	2022-08-26	2024-08-26	30	2.33	到期還本,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(第四期)	22華泰G4	137780	2022-09-01	2022-09-05	2025-09-05	20	2.52	到期還本,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(第五期)	22華泰G5	137814	2022-09-08	2022-09-13	2025-09-13	30	2.50	到期還本,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(第三期)	22華泰Y3	137604	2022-10-19	2022-10-21	-	35	3.20	在發行人不行使遞延支付利息權的情況下,每年付息一次	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(第六期)(品種一)	22華泰G6	138597	2022-11-17	2022-11-21	2024-11-21	36	2.87	到期還本,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	債券餘額	利率(%)	還本 付息方式	交易場所	是否 存在終止 上市交易 的風險
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(第六期)(品種二)	22華泰G7	138598	2022-11-17	2022-11-21	2027-11-21	14	3.18	到期還本， 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(第七期)(品種一)	22華泰G8	138679	2022-12-01	2022-12-05	2024-12-05	15	2.87	到期還本， 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(第八期)(品種一)	22華泰10	138709	2022-12-08	2022-12-12	2025-12-12	20	3.35	到期還本， 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(第八期)(品種二)	22華泰11	138710	2022-12-08	2022-12-12	2027-12-12	5	3.49	到期還本， 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(第九期)(品種一)	22華泰12	138737	2022-12-20	2022-12-22	2024-12-22	40	3.24	到期還本， 按年付息	上交所	否
华泰证券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行公司債券(第一期)	23華泰G1	138816	2023-01-06	2023-01-10	2025-01-10	40	2.92	到期還本， 按年付息	上交所	否
华泰证券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行公司債券(第二期)(品種一)	23華泰G2	138844	2023-01-12	2023-01-16	2025-01-16	8	3.00	到期還本， 按年付息	上交所	否
华泰证券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行公司債券(第二期)(品種二)	23華泰G3	138845	2023-01-12	2023-01-16	2028-01-16	20	3.48	到期還本， 按年付息	上交所	否
华泰证券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行公司債券(第三期)	23華泰G4	138857	2023-02-02	2023-02-06	2026-02-06	45	3.23	到期還本， 按年付息	上交所	否
华泰证券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行公司債券(第四期)	23華泰G5	138886	2023-02-09	2023-02-13	2028-02-13	40	3.39	到期還本， 按年付息	上交所	否
华泰证券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行公司債券(第五期)(品種一)	23華泰G6	138915	2023-02-23	2023-02-27	2026-02-27	15	3.14	到期還本， 按年付息	上交所	否
华泰证券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行公司債券(第五期)(品種二)	23華泰G7	138916	2023-02-23	2023-02-27	2028-02-27	22	3.36	到期還本， 按年付息	上交所	否
华泰证券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行短期公司債券(第一期)	23華泰S1	115083	2023-03-15	2023-03-17	2023-09-15	50	2.65	到期一次 還本付息	上交所	否
华泰证券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行短期公司債券(第二期)	23華泰S2	115117	2023-03-21	2023-03-23	2023-10-25	50	2.65	到期一次 還本付息	上交所	否

債券名稱	簡稱	代碼	發行日	起息日	到期日	債券餘額	利率(%)	還本付息方式	交易場所	是否 存在終止 上市交易 的風險
华泰證券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行公司債券(第六期)(品種一)	23華泰G8	115346	2023-05-08	2023-05-10	2025-07-10	17	2.82	到期還本， 按年付息	上交所	否
华泰證券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行公司債券(第六期)(品種二)	23華泰G9	115347	2023-05-08	2023-05-10	2028-05-10	7	3.07	到期還本， 按年付息	上交所	否
华泰證券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行公司債券(第七期)	23華泰10	115367	2023-08-22	2023-08-24	2026-08-24	20	2.64	到期還本， 按年付息	上交所	否

註：

- 1、上述公司債券面向專業投資者公開發行，專業投資者應當具備相應的風險識別和承擔能力，知悉並自行承擔公司債券的投資風險，並符合《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》及相關法律法規的規定（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。投資者認購上述公司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。
- 2、上述公司債券在上交所上市，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、協商成交的交易方式。
- 3、上述公司債券的主承銷商、受託管理人等信息參見債券募集說明書。
- 4、21華泰Y1、21華泰Y2、21華泰Y3、22華泰Y1、22華泰Y2、22華泰Y3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、22華泰Y3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、設發行人遞延支付利息權，截至本報告披露日均未觸發。

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
18華泰G2	10	10	—
20華泰G3	35	35	—
20華泰G4	30	30	—
20華泰C1	50	50	—
20華泰G7	35	35	—
20華泰G9	40	40	—
21華泰G1	40	40	—
21華泰C1	90	90	—
21華泰G3	50	50	—
21華泰G4	60	60	—
21華泰G5	40	40	—
21華泰G6	20	20	—
21華泰G7	20	20	—
21華泰09	25	25	—
21華泰11	15	15	—
21華泰12	27	27	—
21華泰Y1	30	30	—
21華泰14	34	34	—
21華泰13	21	21	—
21華泰16	11	11	—
21華泰15	22	22	—
21華泰Y2	50	50	—
21華泰Y3	20	20	—
22華泰Y1	27	27	—
22華泰G1	50	50	—
22華泰Y2	30	30	—
22華泰G2	20	20	—
22華泰G3	30	30	—
22華泰G4	20	20	—
22華泰G5	30	30	—
22華泰Y3	35	35	—
22華泰G6	36	36	—
22華泰G7	14	14	—
22華泰G8	15	15	—
22華泰10	20	20	—
22華泰11	5	5	—
22華泰12	40	40	—
23華泰G1	40	40	—
23華泰G2	8	8	—
23華泰G3	20	20	—

債券名稱	募集資金總金額	已使用金額	未使用金額
23華泰G4	45	45	—
23華泰G5	40	40	—
23華泰G6	15	15	—
23華泰G7	22	22	—
23華泰S1	50	50	—
23華泰S2	50	50	—
23華泰G8	17	17	—
23華泰G9	7	7	—

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. 信用評級結果調整情況

報告期內，評級機構未對評級結果做出調整。各期債券的評級信息見公告的評級報告。

## 5. 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和／或本金，及時披露公司相關信息，以保障投資者的合法權益。	否

## 6. 公司債券其他情況的說明

### (1) 報告期末有息負債金額及種類

單位：億元 幣種：人民幣

項目	本公司		本集團	
	金額	佔比	金額	佔比
短期借款	—	—	136.64	3.75%
應付短期融資款	169.61	5.89%	267.62	7.34%
拆入資金	336.06	11.68%	346.90	9.52%
賣出回購金融資產款	1,150.03	39.97%	1,459.65	40.06%
應付債券	1,221.85	42.46%	1,426.44	39.15%
長期借款	—	—	6.58	0.18%
合計	<u>2,877.55</u>	<u>100.00%</u>	<u>3,643.83</u>	<u>100.00%</u>

註：報告期末，公司永續次級債券本金人民幣192億元，已計入權益工具，未包含在有息負債中，集團發行的一筆境外債本金人民幣19.75億元計入交易性金融負債，未包含在上述有息負債中。

(2) 報告期末有息負債剩餘期限結構

單位：億元 幣種：人民幣

項目	本公司		本集團	
	一年以內 (含一年)	一年以上	一年以內 (含一年)	一年以上
短期借款	—	—	136.64	—
應付短期融資款	169.61	—	267.62	—
拆入資金	336.06	—	346.90	—
賣出回購金融資產款	1,150.03	—	1,459.65	—
應付債券	267.24	954.61	332.41	1,094.03
長期借款	—	—	—	6.58
合計	<u>1,922.94</u>	<u>954.61</u>	<u>2,543.22</u>	<u>1,100.61</u>

註： 報告期末，公司永續次級債券本金人民幣192億元，剩餘期限均為1年以上。集團發行的一筆境外債本金人民幣19.75億元計入交易性金融負債，剩餘期限為1年以上，未包含在上述有息負債中。

(三) 銀行間債券市場非金融企業債務融資工具

報告期內，公司未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) 截至報告期末公司近2年的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 比上年度末	
			增減(%)	變動原因
流動比率	1.35	1.40	-3.57	
速動比率	1.35	1.40	-3.57	
資產負債率(%)	76.57	75.81	增加0.76個 百分點	

主要指標	本報告期 (1-6月)	上年同期	本報告期 比上年同期	
			增減(%)	變動原因
扣除非經常損益後淨利潤	7,016,617	5,307,511	32.20	收入增長所致
EBITDA全部債務比(%)	3.71	3.18	增加0.53個 百分點	
利息保障倍數	2.29	2.32	-1.29	
現金利息保障倍數	-1.26	3.94	不適用	
EBITDA利息保障倍數	2.44	2.46	-0.81	
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，公司未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:2023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

2023年1月30日，《關於华泰證券股份有限公司自營參與碳排放權交易的無異議函》（機構部函[2023]102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	2023-01-07	華泰證券H股公告(截至2022年12月31日股份發行人的證券變動月報表)
2	2023-01-16	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
3	2023-01-19	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
4	2023-01-20	华泰证券股份有限公司關於完成經營範圍工商變更登記的公告、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
5	2023-02-06	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、华泰证券股份有限公司關於自營參與碳排放權交易收到中國證監會無異議函的公告
6	2023-02-07	华泰证券股份有限公司關於2023年第一次臨時股東大會、2023年第一次A股類別股東會的延期公告、華泰證券H股公告(截至2023年1月31日股份發行人的證券變動月報表)
7	2023-02-08	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
8	2023-02-09	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	2023-02-11	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

序號	日期	公告事項
10	2023-02-13	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
11	2023-02-18	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
12	2023-02-23	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全資子公司華泰創新投資有限公司註冊地址變更的公告
13	2023-02-24	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
14	2023-03-04	華泰證券H股公告(截至2023年2月28日股份發行人的證券變動月報表)
15	2023-03-07	华泰证券股份有限公司關於向專業投資者公開發行短期公司債券獲得中國證監會註冊批覆的公告
16	2023-03-10	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
17	2023-03-13	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
18	2023-03-21	華泰證券H股公告(董事會召開日期)
19	2023-03-23	华泰证券股份有限公司關於召開2022年度業績說明會的公告
20	2023-03-29	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
21	2023-03-31	<p>华泰证券股份有限公司2022年年度報告、华泰证券股份有限公司2022年年度報告摘要、华泰证券股份有限公司2022年度財務報表及審計報告、华泰证券股份有限公司2022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、华泰证券股份有限公司2022年度內部控制評價報告、华泰证券股份有限公司2022年度內部控制審計報告、华泰证券股份有限公司2022年度社會責任報告、华泰证券股份有限公司董事會審計委員會2022年度履職情況報告、华泰证券股份有限公司獨立董事2022年度履職報告、华泰证券股份有限公司獨立董事關於第六屆董事會第二次會議相關事項的事前認可意見、华泰证券股份有限公司獨立董事關於第六屆董事會第二次會議相關事項的獨立意見、华泰证券股份有限公司第六屆董事會第二次會議決議公告、华泰证券股份有限公司第六屆監事會第二次會議決議公告、华泰证券股份有限公司關於續聘會計師事務所的公告、华泰证券股份有限公司關於A股限制性股票股權激勵計劃第一個限售期解除限售條件成就的公告、北京市金杜（南京）律師事務所關於华泰证券股份有限公司A股限制性股票股權激勵計劃第一個解除限售期解除限售條件成就及回購註銷部份限制性股票事宜的法律意見書、华泰证券股份有限公司關於回購註銷部份A股限制性股票的公告、华泰证券股份有限公司2022年年度利潤分配方案公告、华泰证券股份有限公司關於預計2023年度日常關聯交易的公告</p>
22	2023-04-07	<p>華泰證券H股公告（截至2023年3月31日股份發行人的證券變動月報表）</p>
23	2023-04-18	<p>华泰证券股份有限公司關於A股限制性股票股權激勵計劃第一個限售期解除限售暨上市公告</p>
24	2023-04-19	<p>華泰證券H股公告（董事會召開日期）</p>
25	2023-04-21	<p>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</p>
26	2023-04-22	<p>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</p>

序號	日期	公告事項
27	2023-04-26	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
28	2023-04-29	华泰证券股份有限公司2023年第一季度報告、华泰证券股份有限公司第六屆董事會第三次會議決議公告、华泰证券股份有限公司獨立董事關於第六屆董事會第三次會議相關事項的獨立意見、华泰证券股份有限公司第六屆監事會第三次會議決議公告、华泰证券股份有限公司關於會計政策變更的公告
29	2023-05-06	華泰證券H股公告(截至2023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
30	2023-05-08	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
31	2023-05-09	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
32	2023-05-10	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
33	2023-05-12	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
34	2023-05-17	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
35	2023-05-23	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
36	2023-05-24	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
37	2023-05-31	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召開2022年年度股東大會、2023年第二次A股類別股東會的通知、华泰证券股份有限公司2022年度股東大會、2023年第二次A股類別股東會、2023年第二次H股類別股東會會議文件
38	2023-06-06	華泰證券H股公告(截至2023年5月31日股份發行人的證券變動月報表)
39	2023-06-07	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
40	2023-06-15	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
41	2023-06-16	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
42	2023-06-17	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
43	2023-06-26	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
44	2023-06-28	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
45	2023-06-29	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

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

序號	日期	公告事項
1	2023-01-02	海外監管公告－华泰證券股份有限公司關於公司符合配股條件的說明、华泰證券股份有限公司配股公開發行證券預案、华泰證券股份有限公司配股募集資金使用可行性分析報告、华泰證券股份有限公司前次募集資金使用情況報告、华泰證券股份有限公司前次募集資金使用情況報告及鑑證報告、华泰證券股份有限公司中期股東回報規劃（2023-2025年）、华泰證券股份有限公司關於向原股東配售股份攤薄即期回報的風險提示及填補措施與相關主體承諾的公告、华泰證券股份有限公司關於召開2023年第一次臨時股東大會、2023年第一次A股類別股東會的通知
2	2023-01-06	截至二零二二年十二月三十一日止股份發行人的證券變動月報表
3	2023-01-09	海外監管公告－华泰證券股份有限公司2023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
4	2023-01-11	海外監管公告－华泰證券股份有限公司2023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
5	2023-01-13	海外監管公告－华泰證券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行公司債券（第二期）票面利率公告
6	2023-01-15	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
7	2023-01-16	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）2023年付息公告、华泰證券股份有限公司2021年面向專業投資者公開發行次級債券（第一期）2023年付息公告、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）2023年付息公告、华泰證券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行公司債券（第二期）發行結果公告

序號	日期	公告事項
8	2023-01-18	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
9	2023-01-19	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關於完成經營範圍工商變更登記的公告
10	2023-02-02	海外監管公告－华泰證券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行公司債券(第三期)票面利率公告
11	2023-02-05	海外監管公告－华泰證券股份有限公司關於自營參與碳排放權交易收到中國證監會無異議函的公告、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
12	2023-02-06	截至二零二三年一月三十一日止股份發行人的證券變動月報表、關於2023年第一次臨時股東大會、2023年第一次H股類別股東會的延期公告、海外監管公告－华泰證券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行公司債券(第三期)發行結果公告
13	2023-02-07	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
14	2023-02-08	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(第九期)(品種一)2023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
15	2023-02-10	海外監管公告－华泰證券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行公司債券(第四期)票面利率公告、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
16	2023-02-12	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
17	2023-02-17	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
18	2023-02-22	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關於全資子公司華泰創新投資有限公司註冊地址變更的公告
19	2023-02-23	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
20	2023-02-24	海外監管公告－华泰證券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行公司債券(第五期)票面利率公告
21	2023-02-28	海外監管公告－华泰證券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行公司債券(第五期)發行結果公告
22	2023-03-03	截至二零二三年二月二十八日止股份發行人的證券變動月報表
23	2023-03-06	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短期公司債券獲得中國證監會註冊批覆的公告
24	2023-03-09	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
25	2023-03-12	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
26	2023-03-16	海外監管公告－华泰證券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行短期公司債券(第一期)票面利率公告

序號	日期	公告事項
27	2023-03-17	海外監管公告－华泰證券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行短期公司債券(第一期)發行結果公告
28	2023-03-20	董事會召開日期
29	2023-03-22	海外監管公告－华泰證券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行短期公司債券(第二期)票面利率公告、华泰證券股份有限公司關於召開2022年度業績說明會的公告
30	2023-03-23	海外監管公告－华泰證券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行短期公司債券(第二期)發行結果公告
31	2023-03-28	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
32	2023-03-30	關於回購註銷部份A股限制性股票的公告、2022社會責任報告、截至2022年12月31日止年度之業績公告、截至2022年12月31日止年度之末期股息、海外監管公告－华泰證券股份有限公司2022年年度報告、华泰證券股份有限公司2022年年度報告摘要、华泰證券股份有限公司2022年度財務報表及審計報告、华泰證券股份有限公司2022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2022年度內部控制評價報告、华泰證券股份有限公司2022年度內部控制審計報告、华泰證券股份有限公司董事會審計委員會2022年度履職情況報告、华泰證券股份有限公司獨立董事2022年度履職報告、华泰證券股份有限公司獨立董事關於第六屆董事會第二次會議相關事項的事前認可意見、华泰證券股份有限公司獨立董事關於第六屆董事會第二次會議相關事項的獨立意見、华泰證券股份有限公司第六屆董事會第二次會議決議公告、华泰證券股份有限公司第六屆監事會第二次會議決議公告、华泰證券股份有限公司關於續聘會計師事務所的公告、华泰證券股份有限公司關於A股限制性股票股權激勵計劃第一個限售期解除限售條件成就的公告、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第一個解除限售期解除限售條件成就及回購註銷部份限制性股票事宜的法律意見書、华泰證券股份有限公司2022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2023年度日常關聯交易的公告

序號	日期	公告事項
33	2023-04-06	截至二零二三年三月三十一日止股份發行人的證券變動月報表
34	2023-04-17	海外監管公告－华泰證券股份有限公司關於A股限制性股票股權激勵計劃第一個限售期解除限售暨上市公告
35	2023-04-18	董事會召開日期
36	2023-04-19	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(第二期)2023年付息公告
37	2023-04-20	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
38	2023-04-21	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
39	2023-04-24	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(第二期)2023年付息公告
40	2023-04-25	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
41	2023-04-26	2022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
42	2023-04-28	2023年第一季度報告，海外監管公告－华泰證券股份有限公司關於會計政策變更的公告、华泰證券股份有限公司獨立董事關於第六屆董事會第三次會議相關事項的獨立意見、华泰證券股份有限公司第六屆監事會第三次會議決議公告、华泰證券股份有限公司第六屆董事會第三次會議決議公告
43	2023-05-05	截至二零二三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
44	2023-05-08	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
45	2023-05-09	海外監管公告－华泰證券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行公司債券(第六期)票面利率公告、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
46	2023-05-10	海外監管公告－华泰證券股份有限公司2023年面向專業投資者公開發行公司債券(第六期)發行結果公告
47	2023-05-11	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(第三期)2023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
48	2023-05-15	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(第三期)2023年付息公告
49	2023-05-16	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
50	2023-05-17	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(第四期)(品種一)2023年付息公告、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(第四期)(品種二)2023年付息公告
51	2023-05-22	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
52	2023-05-23	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
53	2023-05-30	2022年度股東大會通函、2022年度股東大會通告、2023年第二次H股類別股東會通告、2023年6月30日舉行的年度股東大會H股股東代表委任表格、2023年6月30日舉行的2023年第二次H股類別股東會H股股東代表委任表格、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、截至2022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2013年公司債券(10年期)2023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
54	2023-06-05	截至二零二三年五月三十一日止股份發行人的證券變動月報表
55	2023-06-06	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
56	2023-06-08	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)2023年付息公告
57	2023-06-12	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(第四期)(品種二)2023年本息兌付及摘牌公告
58	2023-06-14	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(第六期)(品種一)2023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
59	2023-06-15	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
60	2023-06-16	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
61	2023-06-25	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
62	2023-06-27	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
63	2023-06-28	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
64	2023-06-30	2022年度股東大會、2023年第二次A股類別股東會及2023年第二次H股類別股東會之投票表決結果；及派付末期股息，海外監管公告－华泰證券股份有限公司關於回購註銷部份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、北京市金杜律師事務所關於华泰證券股份有限公司2022年年度股東大會、2023年第二次A股類別股東會、2023年第二次H股類別股東會之法律意見書

3、報告期內，公司在倫交所網站([www.londonstockexchange.com](http://www.londonstockexchange.com))上披露的信息如下：

序號	日期	公告事項
1	2023-01-03	POLL RESULTS OF THE EGM (臨時股東大會之投票表決結果)、ARTICLES OF ASSOCIATION (公司章程)
2	2023-02-06	EXTENSION ANNOUNCEMENT ON THE GENERAL MEETINGS (股東大會延期公告)
3	2023-03-30	2022 CORPORATE SOCIAL RESPONSIBILITY REPORT (2022年度社會責任報告)、REPURCHASE AND CANCELLATION OF PART OF SHARES (回購註銷部份股票)、2022 ANNUAL FINANCIAL REPORT (2022年度財務報告)
4	2023-04-26	2022 ANNUAL REPORT (2022年度報告)
5	2023-04-28	FIRST QUARTERLY REPORT OF 2023 (2023年第一季度報告)
6	2023-05-30	NOTICE OF AGM AND A SHARE CLASS MEETING (年度股東大會及A股類別股東會通知)
7	2023-06-30	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 2023 年 6 月 30 日止六個月

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 2023 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 - 102

## 中期審閱報告

致华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 102 頁的华泰證券股份有限公司(「貴公司」)及其附屬公司(統稱「貴集團」)簡明合併財務報表,包括於 2023 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承擔任何責任。

### **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

致华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簡明合併財務報表在所有重大方面未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

2023 年 8 月 30 日

华泰证券股份有限公司

簡明合并收益表

截至 2023 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	
		2023 (未經審計)	2022 (未經審計,經重述)
<b>收入</b>			
備金及手續費收入	5	9,725,697	9,931,122
利息收入	6	7,262,841	6,758,476
投資收益淨額	7	5,818,466	3,754,431
		<u>22,807,004</u>	<u>20,444,029</u>
其他收入及收益	8	3,145,550	3,034,993
<b>收入、其他收入及收益總計</b>		<u>25,952,554</u>	<u>23,479,022</u>
備金及手續費開支	9	(2,177,899)	(2,402,224)
利息開支	10	(6,621,612)	(5,373,126)
僱員成本	11	(4,947,559)	(4,628,022)
折舊和攤銷費用	12	(910,885)	(727,809)
稅金及附加		(97,440)	(105,128)
其他營業開支	13	(4,865,656)	(4,269,814)
預期信用虧損模型下的減值虧損 (扣除減值撥回後的淨額)	14	418,012	337,624
<b>開支合計</b>		<u>(19,203,039)</u>	<u>(17,168,499)</u>
<b>經營利潤</b>		6,749,515	6,310,523
分佔聯營公司及合營企業利潤		<u>1,247,913</u>	<u>463,473</u>
<b>所得稅前利潤</b>		7,997,428	6,773,996
所得稅費用	15	(1,334,950)	(1,221,102)
<b>本期利潤</b>		<u>6,662,478</u>	<u>5,552,894</u>
歸屬於：			
本公司股東		6,555,640	5,375,963
非控制性權益		106,838	176,931
		<u>6,662,478</u>	<u>5,552,894</u>
每股盈利(每股人民幣元)	16		
-基本		0.70	0.58
-攤薄		0.68	0.56

刊載於第 13 至 102 頁的財務報表附註為本簡明合并財務報表的組成部分。



华泰证券股份有限公司

簡明合併損益及其他綜合收益表

截至 2023 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	
		2023 (未經審計)	2022 (未經審計,經重述)
<b>本期利潤</b>		<b>6,662,478</b>	<b>5,552,894</b>
<b>本期其他綜合收益/(開支):</b>			
<b>之後不能重新分類至損益的項目:</b>			
以公允價值計量且其變動計入他綜合收益 /(開支)的權益工具			
-公允價值變動淨額		19,511	(35,494)
-所得稅影響		(4,808)	5,925
<b>之後將重新分類至損益的項目:</b>			
以公允價值計量且其變動計入其他綜合收 益的債務工具淨收益/(開支)		93,450	(187,376)
指定為現金流量套期的套期工具公允價值 變動收益		41,750	24,820
分佔聯營公司及合營企業其他綜合開支		(5,665)	(2,439)
外幣報表折算差額		610,133	682,828
所得稅影響		(21,320)	27,350
<b>本期稅後其他綜合收益</b>		<b>733,051</b>	<b>515,614</b>
<b>本期綜合收益總額</b>		<b>7,395,529</b>	<b>6,068,508</b>
<b>歸屬於:</b>			
本公司股東		7,193,396	5,789,351
非控制性權益		202,133	279,157
<b>總計</b>		<b>7,395,529</b>	<b>6,068,508</b>

刊載於第 13 至 102 頁的財務報表附註為本簡明合併財務報表的組成部分。

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務狀況表

於 2023 年 6 月 30 日

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

	附註	2023 年 6 月 30 日 (未經審計)	2022 年 12 月 31 日 (經審計,經重述)
<b>非流動資產</b>			
物業及設備	17	6,420,996	6,287,383
投資物業		210,527	217,586
商譽	18	3,489,002	3,352,219
土地使用權及其他無形資產	19	7,581,158	7,439,816
聯營公司權益	20	19,376,905	18,276,443
合營企業權益	21	1,311,491	1,706,184
以攤銷成本計量的債務工具	22	41,525,244	36,586,707
以公允價值計量且其變動計入其他綜合收 益的債務工具	23	14,209,041	7,900,595
以公允價值計量且其變動計入其他綜合收 益的權益工具	24	270,778	241,587
以公允價值計量且其變動計入當期損益的 金融資產	25	9,219,709	10,142,583
存出保證金	26	40,195,074	42,706,777
遞延稅項資產	27	787,070	600,473
其他非流動資產	28	271,388	300,664
<b>非流動資產總額</b>		<b>144,868,383</b>	<b>135,759,017</b>
<b>流動資產</b>			
應收款項	29	9,961,847	7,804,341
其他應收款、預付款項及其他流動資產	30	1,966,679	2,157,529
融出資金	31	105,412,167	100,648,375
以攤銷成本計量的債務工具	22	8,797,116	11,965,863
買入返售金融資產	32	17,389,635	34,824,221
以公允價值計量且其變動計入其他綜合收 益的債務工具	23	1,185,184	2,603,784
以公允價值計量且其變動計入當期損益的 金融資產	25	379,460,813	340,661,962
衍生金融資產	33	15,039,940	15,788,301
結算備付金	34	6,793,643	8,716,506
代經紀客戶持有的現金	35	148,683,704	140,460,346
現金及銀行結餘	36	47,511,147	45,180,745
<b>流動資產總額</b>		<b>742,201,875</b>	<b>710,811,973</b>
<b>資產總額</b>		<b>887,070,258</b>	<b>846,570,990</b>

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務狀況表 - 續

於 2023 年 6 月 30 日

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

	附註	2023 年 6 月 30 日 (未經審計)	2022 年 12 月 31 日 (經審計,經重述)
<b>流動負債</b>			
短期銀行借款	38	13,664,407	7,997,434
已發行的短期債務工具	39	26,762,350	25,772,604
拆入資金	40	34,690,064	25,877,713
應付經紀客戶賬款	41	159,354,314	152,551,723
應付職工薪酬		3,799,251	5,304,177
其他應付款項及應計費用	42	121,130,382	108,096,572
合約負債		276,677	218,943
当期稅項負債		667,727	524,997
賣出回購金融資產款	43	145,964,883	144,117,998
以公允價值計量且其變動計入當期損益的 金融負債	44	37,156,594	43,005,621
衍生金融負債	33	13,863,810	9,638,125
一年內到期的長期債券	45	33,240,562	29,062,749
<b>流動負債總額</b>		<b>590,571,021</b>	<b>552,168,656</b>
<b>流動資產淨額</b>		<b>151,630,854</b>	<b>158,643,317</b>
<b>總資產減流動負債</b>		<b>296,499,237</b>	<b>294,402,334</b>
<b>非流動負債</b>			
衍生金融負債	33	60,040	-
長期債券	46	109,403,273	110,356,589
長期銀行借款	47	657,558	804,903
長期應付職工薪酬		6,795,934	6,588,448
遞延稅項負債	27	2,458,361	2,199,928
以公允價值計量且其變動計入當期損益的 金融負債	44	5,565,830	5,569,938
其他應付款項及應計費用	42	1,044,891	1,025,918
<b>非流動負債總額</b>		<b>125,985,887</b>	<b>126,545,724</b>
<b>淨資產</b>		<b>170,513,350</b>	<b>167,856,610</b>

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務狀況表 - 續

於 2023 年 6 月 30 日

(除另有說明外，金額以人民幣千元列示)

	附註	2023 年 6 月 30 日 (未經審計)	2022 年 12 月 31 日 (經審計,經重述)
<b>股東權益</b>			
股本	48	9,075,589	9,075,589
其他權益工具	49	19,200,000	19,200,000
庫存股	50	(1,071,810)	(1,202,324)
儲備	51	100,628,476	100,092,751
未分配利潤	52	39,671,901	37,929,086
本公司股東應佔總權益		167,504,156	165,095,102
非控制性權益		3,009,194	2,761,508
<b>股東權益合計</b>		<b>170,513,350</b>	<b>167,856,610</b>

刊載於第 13 至 102 頁的財務報表附註為本簡明合併財務報表的組成部分。

本財務報表獲本公司董事會於 2023 年 8 月 30 日批准。

張偉  
董事長

王兵  
董事

华泰证券股份有限公司

简明合并权益变动表

截至2023年6月30日止六個月

(除另有说明外, 金额以人民币千元列示)

	歸屬於本公司股東權益												
	股本 (附註 48)	其他權益工具 (附註 49)	庫存股 (附註 50)	資本公積 (附註 51)	盈餘公積 (附註 51)	一般儲備 (附註 51)	公允價值儲備 (附註 51)	現金流量 套期工具 (附註 51)	外幣報表 折算差額 (附註 51)	未分配利潤 (附註 52)	總計	非控制性權益	權益合計
於 2023 年 1 月 1 日(經審計)	9,075,589	19,200,000	(1,202,324)	70,482,059	7,790,909	21,024,438	84,554	42,643	666,033	37,923,300	165,087,201	2,761,508	167,848,709
調整(附註 3)	-	-	-	-	419	1,696	-	-	-	5,786	7,901	-	7,901
於 2023 年 1 月 1 日(經重述)	9,075,589	19,200,000	(1,202,324)	70,482,059	7,791,328	21,026,134	84,554	42,643	666,033	37,929,086	165,095,102	2,761,508	167,856,610
本期權益變動	-	-	-	-	-	-	-	-	-	6,555,640	6,555,640	106,838	6,662,478
本期利潤	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
本期其他綜合收益(開支)	-	-	-	-	-	-	81,168	41,750	514,838	-	637,756	95,295	733,051
本期綜合收益(開支)總額	-	-	-	-	-	-	81,168	41,750	514,838	6,555,640	7,193,396	202,133	7,395,829
以權益結算的股份支付	-	-	130,514	95,053	-	44,172	-	-	-	(44,172)	-	-	-
提取一般儲備	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(40,632,223)	(40,632,223)	(810)	(40,634,033)
本期向普通股股東宣派股息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(705,430)	(705,430)	-	(705,430)
應付永續次級債股息	-	-	-	(241,256)	-	-	-	-	-	(241,256)	(241,256)	24,741	(216,515)
其他	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
於 2023 年 6 月 30 日(未經審計)	9,075,589	19,200,000	(1,071,810)	70,335,856	7,791,328	21,070,306	165,722	84,393	1,180,871	39,671,901	167,504,156	3,009,194	170,513,350

	歸屬於本公司股東權益												
	股本 (附註 48)	其他權益工具 (附註 49)	庫存股 (附註 50)	資本公積 (附註 51)	盈餘公積 (附註 51)	一般儲備 (附註 51)	公允價值儲備 (附註 51)	現金流量 套期工具 (附註 51)	外幣報表 折算差額 (附註 51)	未分配利潤 (附註 52)	總計	非控制性權益	權益合計
於 2022 年 1 月 1 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
調整(附註 3)	-	-	-	-	466	1,446	-	-	-	4,698	6,610	-	6,610
於 2022 年 1 月 1 日(經重述)	9,076,650	9,996,425	(1,231,547)	70,562,359	6,570,388	18,107,490	223,143	(14,184)	(425,781)	35,564,477	148,429,420	3,612,974	152,042,394
本期權益變動	-	-	-	-	-	-	-	-	-	5,375,963	5,375,963	176,931	5,552,894
本期利潤	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
本期其他綜合收益(開支)	-	-	-	-	-	-	(173,053)	24,820	561,621	-	413,388	102,226	515,614
本期綜合收益(開支)總額	-	-	-	-	-	-	(173,053)	24,820	561,621	5,375,963	5,789,351	279,157	6,068,508
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)	-	-	-
本期向普通股股東宣派股息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(4,063,640)	(4,063,640)	-	(4,063,640)
應付永續次級債股息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(485,730)	(485,730)	-	(485,730)
於 2022 年 6 月 30 日(未經審計)	9,076,650	12,694,871	(1,211,555)	70,651,482	6,570,388	18,150,441	50,090	10,636	135,840	36,348,119	152,476,962	3,922,951	156,399,913

华泰证券股份有限公司

簡明合併權益變動表 - 續

截至 2023 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												
	股本 (附註 48)	其他權益工具 (附註 49)	庫存股 (附註 50)	資本公積 (附註 51)	盈餘公積 (附註 51)	一般儲備 (附註 51)	公允價值儲備 (附註 51)	現金流量 套期工具 (附註 51)	外幣報表 折算差額 (附註 51)	未分配利潤 (附註 52)	總計	非控制性權益	權益合計
於 2022 年 1 月 1 日(經審計) 調整(附註 3)	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
於 2022 年 1 月 1 日(經重述)	9,076,650	9,996,425	(1,231,547)	70,562,359	466	1,446	-	-	(425,781)	4,698	6,610	-	6,610
本年權益變動	-	-	-	-	6,570,388	18,107,490	223,143	(14,184)	(425,781)	35,564,477	148,429,420	3,612,974	152,042,394
本年利潤	-	-	-	-	-	-	-	-	-	11,053,987	11,053,987	312,634	11,366,621
本年其他綜合收益(開支)	-	-	-	-	-	-	(139,013)	56,827	1,091,814	-	1,009,628	186,321	1,195,949
本年綜合收益(開支)總額	-	-	-	-	-	-	(139,013)	56,827	1,091,814	11,053,987	12,063,615	498,955	12,562,570
發行永續債	-	9,200,000	-	(2,627)	-	-	-	-	-	-	9,197,373	-	9,197,373
收購非控制性權益	-	-	-	(182,476)	-	-	-	-	-	-	(182,476)	(1,407,524)	(1,590,000)
以權益結算的股份支付	-	-	19,992	208,953	-	-	-	-	-	-	228,945	37,706	266,651
提取盈餘公積	-	-	-	-	1,220,940	2,918,644	-	-	-	(1,220,940)	-	-	-
本年向普通股股東宣派股息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(2,918,644)	-	-	(4,063,640)
應付永續次級股股息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(4,063,640)	(4,063,640)	-	(4,063,640)
其他綜合收益結轉留存收益	-	-	-	-	-	-	424	-	-	(485,730)	(485,730)	-	(485,730)
其他	(1,061)	3,575	9,231	(104,150)	-	-	-	-	-	(424)	(92,405)	19,397	(73,008)
於 2022 年 12 月 31 日(經審計)	9,075,589	19,200,000	(1,202,324)	70,482,059	7,791,328	21,026,134	84,554	42,643	666,033	37,929,086	165,095,102	2,761,508	167,856,610

刊載於第 13 至 102 頁的財務報表附註為本簡明合併財務報表的組成部分。

华泰证券股份有限公司

簡明合併現金流量表

截至 2023 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	2023 年 (未經審計)	2022 年 (未經審計)
<b>經營活動的現金流量：</b>			
所得稅前利潤		7,997,428	6,773,996
經調整：			
利息開支		6,621,612	5,373,126
分佔聯營公司及合營企業利潤		(1,247,913)	(463,473)
折舊和攤銷開支		910,885	727,809
預期信用虧損模型下的減值虧損 (扣除減值撥回後的淨額)		(418,012)	(337,624)
權益結算的股份支付確認的費用		116,675	121,471
出售物業及設備收益		(255)	(189)
外匯 (收益)/虧損		(396,149)	(881,435)
以公允價值計量且其變動計入其他綜合收 益的金融資產及以攤銷成本計量的債務 工具的股息收入及利息收入		(893,249)	(635,732)
終止確認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 虧損/(收益) 淨額		(29,814)	139,444
債券轉換為聯營公司權益的收益		(652)	
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		(4,330,627)	3,768,736
衍生金融工具未實現公允價值變動		6,270,410	(6,052,899)
營運資金變動前經營活動現金流量		14,600,339	8,533,230
存出保證金增加		2,511,703	(4,763,430)
融出資金減少/(增加)		(4,744,070)	13,937,116
應收賬款、其他應收款項及預付款項增加		(2,030,591)	(23,815)
買入返售金融資產減少/(增加)		2,688,555	2,349,832
以公允價值計量且其變動計入當期損益的 金融工具增加		(38,637,828)	(26,204,796)
受限制銀行存款減少/(增加)		166,458	685,513
代經紀客戶持有的現金增加		(8,223,358)	(3,663,831)
應付經紀客戶賬款增加		6,802,591	11,275,701
其他應付款項及應計費用 (減少)/增加		8,536,331	(1,388,351)
應付職工薪酬減少		(1,297,440)	(2,026,599)
賣出回購金融資產款增加/(減少)		1,846,885	2,579,381
拆入資金增加		8,813,117	29,310,555
經營活動所用現金		(8,967,308)	30,600,506
已付所得稅		(1,146,512)	(1,800,493)
已付利息		(3,569,257)	(2,781,700)
經營活動所得/(所用) 現金淨額		(13,683,077)	26,018,313

华泰证券股份有限公司

簡明合併現金流量表 - 續

截至 2023 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	
		2023 年 (未經審計)	2022 年 (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		7,890	17,573
聯營公司分紅所得款項		668,485	1,004,552
以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產及以攤銷成本計量的債務工具的股息收入及利息收入		842,397	635,732
處置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所得款項		4,326,020	3,382,111
處置以攤余成本計量的債務工具的所得款項		6,692,000	2,880,377
收回對聯營公司及合營企業的投資		236,690	96,051
收購附屬公司產生的現金流入淨額		-	16,309
購買以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的金融資產		(9,064,477)	(1,330,000)
購買以攤余成本計量的債務工具		(8,493,042)	(10,087,098)
購買物業及設備、投資物業、其他無形資產及其他非流動資產		(656,914)	(447,514)
收購聯營公司權益		(787,291)	(81,100)
投資活動(所用)/所得現金淨額		<u>(6,228,242)</u>	<u>(3,913,007)</u>



华泰证券股份有限公司

簡明合併現金流量表 - 續

截至 2023 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	
		2023 年 (未經審計)	2022 年 (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		21,027,377	31,616,903
發行長期債券所得款項		22,813,243	12,679,939
發行永續債所得款項		-	2,698,446
銀行借款所得款項		13,657,463	6,457,459
銀行借款償付款項		(8,126,101)	(9,210,439)
償付已發行債務工具支付的現金		(39,408,493)	(56,916,128)
已付短期債務工具利息		(946,686)	(397,679)
已付短期銀行借款利息		(250,229)	(37,233)
已付長期銀行借款利息		(6,576)	(9,236)
已付長期債券利息		(2,329,370)	(2,967,286)
已付股利		(93,609)	-
已付租賃負債的現金		(355,976)	(283,104)
融資活動 (所用)/所得現金淨額		5,981,043	(16,368,358)
現金及現金等價物增加淨額		(13,930,276)	5,736,948
期初現金及現金等價物		75,549,060	45,901,362
匯率變動的影響		987,807	1,223,020
期末現金及現金等價物	37	62,606,591	52,861,330

刊載於第 13 至 102 頁的財務報表附註為本簡明合併財務報表的組成部分。

## 华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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華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，並於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，並於香港聯合交易所有限公司(「香港聯交所」)掛牌上市。

2018 年 8 月，本公司以“向特定投資者非公開發行股票”的方式完成非公開發行人民幣普通股(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。

2022 年 9 月，本公司完成回購註銷 1,060,973 股 A 股限制性股票。截至 2023 年 6 月 30 日，本公司註冊資本為人民幣 9,075,589,027 元，累計發行 9,075,589,027 股每股面值人民幣 1 元的股份。

截至 2023 年 6 月 30 日，本公司擁有 28 家分公司和 243 家證券營業部。

本公司及附屬公司(以下統稱「本集團」)主要經營範圍：證券業務，證券承銷保薦業務，證券投資諮詢，證券資產管理業務，證券公司為期貨公司提供中間介紹業務，公募證券投資基金銷售，證券投資基金託管，公開募集證券投資基金管理業務，直接投資業務，創新投資業務，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. 編製基礎

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 2023 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製，但某些金融工具則酌情以公允價值計量。

除因採用新國際財務報告準則及國際財務報告準則修訂本所致變動外，本截至 2023 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 2022 年度合併財務報告一致。

#### 應用新《國際財務報告準則》及《國際財務報告準則》(修訂本)

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新《國際財務報告準則》及《國際財務報告準則》(修訂本)。該等新國際財務報告準則及國際財務報告準則修訂本應用於 2023 年 1 月 1 日及之後編製的簡明合併財務報表：

國際財務報告準則第 17 號(包括 2020 年 6 月及 2021 年 12 月 之國際財務報告 準則第 17 號(修訂本)	保險合約
國際會計準則第 8 號(修訂本)	會計估計定義
國際會計準則第 12 號(修訂本)	與單筆交易產生的資產和負債 有關的遞延稅項
國際會計準則第 12 號(修訂本)	國際稅收改革-支柱二立法模板
國際會計準則第 1 號及國際財務報告 準則實務公告第 2 號(修訂本)	會計政策披露

#### 3.1 應用國際會計準則第12號(修訂本) -與單筆交易產生的資產和負債有關的遞延稅項產生的會計政策變更及影響

##### 3.1.1 會計政策

遞延稅項基於合併財務報表中資產和負債的賬面價值與用於計算應納稅所得額時相應計稅基礎之間的暫時性差異進行確認。一般情況下，所有應納稅暫時性差異產生的遞延稅項負債均予確認。遞延稅項資產只在很可能取得能利用該可抵扣暫時性差異來抵扣的應納稅所得額的限度內予以確認。如果在交易中初始確認(企業合併除外)資產和負債產生的暫時性差異既不影響應納稅利潤，亦不影響會計利潤，並且在交易時不產生等額的應納稅和可抵扣暫時性差異，則此類遞延稅項資產和負債不予確認。此外，如果暫時性差異產生於商譽的初始確認，則遞延稅項負債不予確認。

### 3. 主要會計政策 - 續

#### 應用新《國際財務報告準則》及《國際財務報告準則》(修訂本) - 續

#### 3.1 應用國際會計準則第12號(修訂本) - 與單筆交易產生的資產和負債有關的遞延稅項產生的會計政策變更及影響 - 續

##### 3.1.1 會計政策 - 續

對於稅額扣減由租賃負債產生的租賃交易，本集團對租賃負債及相關資產分別應用國際會計準則第 12 號所得稅的要求。本集團確認與租賃負債相關的遞延稅項資產，但以有可能獲得應納稅利潤以利用可抵扣暫時性差異為限，並確認所有應納稅暫時性差異的遞延稅項負債。

##### 3.1.2 過度條款及影響概述

本集團過往將國際會計準則第 12 號的要求應用於單筆交易產生的資產和負債，由於適用初始確認豁免，未初始確認相關資產和負債的暫時性差異。根據過度條款：

- (i) 本集團已將新會計政策追溯應用於 2022 年 1 月 1 日或之後發生的租賃交易；
- (ii) 截至 2022 年 1 月 1 日，本集團亦確認了遞延稅項資產(以有可能獲得可抵扣暫時性差異的應納稅利潤為限)及與使用權資產和租賃負債相關的所有可抵扣和應納稅暫時性差異的遞延稅項負債。

應用國際會計準則第 12 號(修訂本) - 與單筆交易產生的資產和負債有關的遞延稅項產生的會計政策變更對簡明合併收益表的影響如下，應用該修訂本對本集團的其他綜合收益並無影響每股盈利未變化。

	截至 6 月 30 日止六個月	
	2023 年	2022 年
<b>對本期利潤的影響</b>		
所得稅費用增加/(減少)	2,161	(755)
本期(虧損)/利潤淨額	<u>(2,161)</u>	<u>755</u>
本期(虧損)/利潤歸因於：		
本公司股東	(2,161)	755
非控制性權益	-	-
	<u>(2,161)</u>	<u>755</u>

3. 主要會計政策 - 續

應用新《國際財務報告準則》及《國際財務報告準則》(修訂本) - 續

3.1 應用國際會計準則第12號(修訂本) - 與單筆交易產生的資產和負債有關的遞延稅項產生的會計政策變更及影響 - 續

3.1.2 過度條款及影響概述 - 續

應用國際會計準則第 12 號(修訂本) - 與單筆交易產生的資產和負債有關的遞延稅項產生的會計政策變更對截至上一財政年度末(即 2022 年 12 月 31 日)的簡明合併財務狀況報表的影響如下：

	2022 年 12 月 31 日 (最初)	調整	2022 年 12 月 31 日 (經重述)
遞延稅項資產	596,499	3,974	600,473
遞延稅項負債	2,203,855	(3,927)	2,199,928
對淨資產的影響總額	<u>(1,607,356)</u>	<u>7,901</u>	<u>(1,599,455)</u>
	2022 年 12 月 31 日 (最初)	調整	2022 年 12 月 31 日 (經重述)
儲備	100,090,636	2,115	100,092,751
未分配利潤	37,923,300	5,786	37,929,086
對權益的影響總額	<u>138,013,936</u>	<u>7,901</u>	<u>138,021,837</u>

3. 主要會計政策 - 續

應用新《國際財務報告準則》及《國際財務報告準則》(修訂本) - 續

3.1 應用國際會計準則第12號(修訂本) - 與單筆交易產生的資產和負債有關的遞延稅項產生的會計政策變更及影響 - 續

3.1.2 過度條款及影響概述 - 續

應用國際會計準則第 12 號(修訂本) - 與單筆交易產生的資產和負債有關的遞延稅項產生的會計政策變更對比較期初(即 2022 年 1 月 1 日)的簡明合併財務狀況表的影響如下:

	2022 年 1月1日 (最初)	調整	2022 年 1月1日 (經重述)
遞延稅項資產	654,651	6,689	661,340
遞延稅項負債	2,619,161	79	2,619,240
對淨資產的影響總額	<u>(1,964,510)</u>	<u>6,610</u>	<u>(1,957,900)</u>
	2022 年 1月1日 (最初)	調整	2022 年 1月1日 (經重述)
儲備	95,021,503	1,912	95,023,415
未分配利潤	35,559,779	4,698	35,564,477
對權益的影響總額	<u>130,581,282</u>	<u>6,610</u>	<u>130,587,892</u>

除上述影響外，於本中期應用新國際財務報告準則及國際財務報告準則修訂本不會對本集團本期及前期的財務狀況及業績和/或簡明合併財務報表所載之披露產生重大影響。

本簡明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 2022 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。

本簡明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 2023 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和估計，這些判斷和估計會影響會計政策的應用以及資產、負債、收入及開支的呈報金額。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 2022 年 12 月 31 日止年度的合併財務報表時相同。

#### 5. 備金及手續費收入

	截至 6 月 30 日止六個月	
	2023 年	2022 年
證券經紀及諮詢業務收入	4,201,543	4,699,482
資產管理業務收入	3,237,064	2,660,549
承銷及保薦業務收入	1,544,751	1,580,415
期貨經紀業務收入	540,051	751,103
財務顧問業務收入	92,953	142,979
其他備金收入	109,335	96,594
總計	<u>9,725,697</u>	<u>9,931,122</u>

#### 6. 利息收入

	截至 6 月 30 日止六個月	
	2023 年	2022 年
融資融券利息收入	3,953,585	3,930,960
金融機構利息收入	2,148,206	1,914,084
以攤銷成本計量的債務工具利息收入	704,012	486,456
以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益 的債務工具利息收入	189,237	149,276
股票質押式回購利息收入	150,532	134,769
其他買入返售金融資產利息收入	112,087	134,593
其他	5,182	8,338
總計	<u>7,262,841</u>	<u>6,758,476</u>

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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	
	2023 年	2022 年
以公允價值計量且其變動計入當期損益的 金融工具的股息收入及利息收入	3,800,489	4,330,578
處置聯營公司的已實現虧損淨額	-	(504)
出售以公允價值計量且其變動計入當期損益的 金融工具的已實現收益 / (虧損)	12,644,313	(11,052,860)
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收益 / (虧損)	29,814	(139,444)
出售衍生金融工具的已實現(虧損) / 收益淨額	(8,370,087)	7,139,552
衍生金融工具未實現公允價值變動	(6,616,690)	7,245,845
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	4,330,627	(3,768,736)
總計	5,818,466	3,754,431

8. 其他收入及收益

	截至 6 月 30 日止六個月	
	2023 年	2022 年
商品銷售收入	1,302,492	1,942,967
政府補助 <sup>(i)</sup>	90,571	113,650
租賃收入	16,368	38,370
出售物業及設備的收益	10	189
匯兌收益	1,609,504	881,435
其他	126,605	58,382
總計	3,145,550	3,034,993

(i) 本集團從所在當地政府收取無附帶條件的政府補助。



华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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. 備金及手續費開支

	截至 6 月 30 日止六個月	
	2023 年	2022 年
證券經紀及諮詢業務開支	1,275,255	1,379,549
資產管理業務開支	637,826	538,763
期貨經紀業務開支	236,450	450,155
承銷與保薦業務開支	27,514	31,400
財務顧問業務開支	146	1,416
其他備金開支	708	941
總計	<u>2,177,899</u>	<u>2,402,224</u>

10. 利息開支

	截至 6 月 30 日止六個月	
	2023 年	2022 年
長期債券利息開支	2,640,701	2,322,531
賣出回購金融資產款利息開支	2,094,972	1,265,259
拆入資金利息開支	980,130	944,405
已發行的短期債務工具利息開支	159,409	476,806
應付經紀客戶賬款利息開支	424,807	222,246
租賃負債利息開支	34,713	39,455
短期銀行借款利息開支	208,460	37,484
長期銀行借款利息開支	9,837	9,236
其他	68,583	55,704
總計	<u>6,621,612</u>	<u>5,373,126</u>

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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	
	2023 年	2022 年
工資、獎金及津貼	3,822,604	3,542,926
退休金計劃供款	549,205	442,099
股份支付費用	117,261	121,471
其他社會福利	458,489	521,526
總計	<u>4,947,559</u>	<u>4,628,022</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	
	2023 年	2022 年
土地使用權和其他無形資產攤銷	266,986	199,475
物業及設備折舊		
- 使用權資產	309,164	245,316
- 其他物業及設備	261,613	221,455
租賃物業改良和長期遞延開支攤銷	67,874	55,003
投資物業折舊	5,248	6,560
總計	<u>910,885</u>	<u>727,809</u>

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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. 其他營業開支

	截至 6 月 30 日止六個月	
	2023 年	2022 年
商品銷售成本	1,330,494	1,957,805
信息技術費	1,118,742	949,388
訴訟及監管事項(附註 55)	711,773	1,000
交易所費用	256,622	231,527
諮詢費	213,362	169,860
業務宣傳費	205,997	184,146
郵電及通訊開支	144,282	117,484
證券投資者保護基金	64,014	52,538
產品代銷開支	21,529	33,901
水電費	20,020	25,893
租賃開支	18,512	21,469
核數師薪酬	11,071	10,813
其他	749,238	513,990
總計	<u>4,865,656</u>	<u>4,269,814</u>

14. 預期信用虧損模型下的減值虧損(扣除減值撥回後的淨額)

	截至 6 月 30 日止六個月	
	2023 年	2022 年
買入返售金融資產減值虧損(撥回)/ 撥備	(468,976)	56,015
其他應收款項及預付款項減值虧損撥備	22,891	6,755
以公允價值計量且其變動計入其他綜合收益的 金融資產減值虧損撥備/(撥回)	44,049	(57,345)
應收賬款減值虧損撥備/(撥回)	6,182	(1,768)
融出資金減值虧損撥回	(21,744)	(341,256)
現金及銀行結餘減值虧損(撥回)/ 撥備	(421)	(592)
以攤銷成本計量的債務工具減值虧損撥備	7	567
總計	<u>(418,012)</u>	<u>(337,624)</u>

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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) 簡明合併收益表所列稅項指：

	截至 6 月 30 日止六個月	
	2023 年	2022 年 (經重述)
当期所得稅項		
- 大陸	1,070,214	1,303,574
- 香港	118,039	54,899
- 境外	131,667	96,608
	<u>1,319,920</u>	<u>1,455,081</u>
就過往年度調整		
- 大陸	(30,678)	26,077
遞延稅項	45,708	(260,056)
總計	<u>1,334,950</u>	<u>1,221,102</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附屬公司須按法定稅率 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。美國附屬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	
	2023 年	2022 年 (經重述)
所得稅前利潤	7,997,428	6,773,996
按中國法定稅率計算的稅項	1,999,357	1,693,499
附屬公司稅率差別的影响	(74,786)	(210,725)
不可抵扣開支的稅務影响	127,591	132,161
動用前期未確認遞延稅項資產的稅務虧損的影响	(610)	(30,905)
非應課稅收入的稅務影响	(686,557)	(388,480)
就以前年度調整	(30,678)	26,077
其他	633	(525)
本期所得稅費用	<u>1,334,950</u>	<u>1,221,102</u>

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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. 基本及攤薄每股盈利

(1) 基本每股盈利

基本每股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	
		2023 年	2022 年 (經重述)
本公司普通股股東應佔淨利潤(調節後) (人民幣千元)	(a)	6,280,103	5,180,354
普通股加權平均數 (千股)	(b)	8,992,563	8,985,884
普通股股東應佔基本每股盈利 (每股人民幣元)		0.70	0.58

(a) 本公司普通股股東應佔合併淨利潤(調節後)(人民幣千元)

	截至 6 月 30 日止六個月	
	2023 年	2022 年 (經重述)
本公司權益股東應佔合併淨利潤	6,555,640	5,375,963
A 股限制性股票激勵計劃股息	(13,175)	(19,992)
歸屬於本公司永續次級債持有人的利潤 <sup>(i)</sup>	(262,362)	(175,617)
本公司權益股東應佔合併淨利潤(調節後)	6,280,103	5,180,354

(i) 本公司在計算截至 2023 年 6 月 30 日止六個月期間基本每股盈利時，將歸屬於永續次級債持有人的股息共計人民幣 262 百萬元從本公司股東應佔利潤中予以扣除(截至 2022 年 6 月 30 日止六個月期間：人民幣 176 百萬元)。

(b) 普通股加權平均數(千股)

	截至 6 月 30 日止六個月	
	2023 年	2022 年
期初普通股股數	9,075,589	9,076,650
普通股加權平均數減少	(83,026)	(90,766)
普通股加權平均數	8,992,563	8,985,884

16. 基本及攤薄每股盈利 - 續

(2) 攤薄每股盈利

攤薄每股盈利以本公司普通股股東應佔合併淨利潤(攤薄)除以已發行普通股加權平均數(攤薄)計算:

	附註	截至 6 月 30 日止六個月	
		2023 年	2022 年 (經重述)
本公司普通股股東應佔合併淨利潤(攤薄)	(a)	6,132,829	5,069,158
已發行普通股加權平均數(千股)		8,992,563	8,985,884
普通股股東應佔攤薄每股盈利(每股人民幣元)		0.68	0.56

(a) 本公司普通股股東應佔合併淨利潤(攤薄)計算:

	截至 6 月 30 日止六個月	
	2023 年	2022 年 (經重述)
本公司普通股股東應佔合併淨利潤(調節後) 攤薄調整:		
聯營公司可轉換公司債券的影響 <sup>(ii)</sup>	(146,052)	(111,054)
假定歸屬授予附屬公司僱員的股份 <sup>(iii)</sup>	(1,222)	(142)
本公司普通股股東應佔合併淨利潤(攤薄)	6,132,829	5,069,158

(i) 於 2021 年，本集團授予了部分員工 A 股限制性股票激勵計劃。攤薄每股盈利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息的影響和預計將解禁的限售股數量。鑒於上述影響，限制性股票激勵計劃具有抗攤薄效應，並將其排除在截至 2022 年 6 月 30 日及 2023 年 6 月 30 日期間的攤薄每股盈利計算之外。

(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。攤薄每股盈利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) 此為 AssetMark Financial Holdings, Inc.(「AssetMark」)股份支付計劃產生的攤薄效應。

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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 固定裝置	在建工程	使用權 資產	總計
<b>成本</b>							
2023 年 1 月 1 日	4,689,613	161,582	1,917,816	424,009	195,750	2,515,403	9,904,173
添置	1,567	2,839	60,536	29,055	258,651	386,276	738,924
本期轉出	-	-	445	2,854	(34,774)	-	(31,475)
自投資物業轉入	3,721	-	-	-	-	-	3,721
處置	-	(8,463)	(14,723)	(1,799)	-	(262,205)	(287,190)
2023 年 6 月 30 日	<u>4,694,901</u>	<u>155,958</u>	<u>1,964,074</u>	<u>454,119</u>	<u>419,627</u>	<u>2,639,474</u>	<u>10,328,153</u>
<b>累計折舊</b>							
2023 年 1 月 1 日	(1,202,470)	(92,247)	(945,500)	(271,132)	-	(1,105,441)	(3,616,790)
本期計提	(67,176)	(6,069)	(158,052)	(30,316)	-	(309,164)	(570,777)
自投資物業轉入	(1,910)	-	-	-	-	-	(1,910)
處置	-	6,553	12,062	1,579	-	262,126	282,320
2023 年 6 月 30 日	<u>(1,271,556)</u>	<u>(91,763)</u>	<u>(1,091,490)</u>	<u>(299,869)</u>	<u>-</u>	<u>(1,152,479)</u>	<u>(3,907,157)</u>
<b>賬面價值</b>							
2023 年 6 月 30 日	<u>3,423,345</u>	<u>64,195</u>	<u>872,584</u>	<u>154,250</u>	<u>419,627</u>	<u>1,486,995</u>	<u>6,420,996</u>
<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	-	43,818	366,134	76,964	212,731	816,869	1,516,516
年內轉出	798	-	22	2,156	(113,040)	-	(110,064)
自投資物業轉入	122,515	-	-	-	-	-	122,515
收購附屬公司	656,612	-	251	208	-	-	657,071
處置	(196)	(33,438)	(159,628)	(3,835)	-	(356,056)	(553,153)
轉入投資物業	(565)	-	-	-	-	-	(565)
2022 年 12 月 31 日	<u>4,689,613</u>	<u>161,582</u>	<u>1,917,816</u>	<u>424,009</u>	<u>195,750</u>	<u>2,515,403</u>	<u>9,904,173</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)
年內計提	(128,479)	(12,393)	(285,399)	(31,118)	-	(525,031)	(982,420)
自投資物業轉入	(59,961)	-	-	-	-	-	(59,961)
處置	11	30,344	143,667	3,092	-	341,739	518,853
轉入投資物業	369	-	-	-	-	-	369
2022 年 12 月 31 日	<u>(1,202,470)</u>	<u>(92,247)</u>	<u>(945,500)</u>	<u>(271,132)</u>	<u>-</u>	<u>(1,105,441)</u>	<u>(3,616,790)</u>
<b>賬面價值</b>							
2022 年 12 月 31 日	<u>3,487,143</u>	<u>69,335</u>	<u>972,316</u>	<u>152,877</u>	<u>195,750</u>	<u>1,409,962</u>	<u>6,287,383</u>

於 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日，本集團樓宇中賬面價值為人民幣 39.21 百萬元和人民幣 40.57 百萬元的土地或房產權證有待取得。

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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

2023 年 1 月 1 日	3,352,219
商業合併取得	-
匯率變動的影響	136,783
2023 年 6 月 30 日	<u>3,489,002</u>

減值虧損

2023 年 1 月 1 日	-
減值虧損	-
2023 年 6 月 30 日	<u>-</u>

賬面價值

2023 年 1 月 1 日	<u>3,352,219</u>
2023 年 6 月 30 日	<u>3,489,002</u>

成本

2022 年 1 月 1 日	2,836,429
商業合併取得	271,374
匯率變動的影響	244,416
2022 年 12 月 31 日	<u>3,352,219</u>

減值虧損

2022 年 1 月 1 日	-
減值虧損	-
2022 年 12 月 31 日	<u>-</u>

賬面價值

2022 年 1 月 1 日	<u>2,836,429</u>
2022 年 12 月 31 日	<u>3,352,219</u>



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	企業分銷 渠道 客戶關係	商標	軟件 及其他	總計
<b>成本</b>						
2023 年 1 月 1 日	1,768,330	3,931,667	242,226	348,720	4,087,137	10,378,080
添置	-	-	-	-	240,089	240,089
處置	-	-	-	-	(1,400)	(1,400)
外幣報表折算差額	-	124,713	8,301	10,756	70,146	213,916
2023 年 6 月 30 日	<u>1,768,330</u>	<u>4,056,380</u>	<u>250,527</u>	<u>359,476</u>	<u>4,395,972</u>	<u>10,830,685</u>
<b>累計攤銷</b>						
2023 年 1 月 1 日	(158,886)	-	-	(178,508)	(2,600,870)	(2,938,264)
本期計提	(20,317)	-	-	(22,143)	(227,372)	(269,832)
處置	-	-	-	-	-	-
外幣報表折算差額	-	-	-	(6,251)	(35,180)	(41,431)
2023 年 6 月 30 日	<u>(179,203)</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>(206,902)</u>	<u>(2,863,422)</u>	<u>(3,249,527)</u>
<b>賬面價值</b>						
2023 年 6 月 30 日	<u>1,589,127</u>	<u>4,056,380</u>	<u>250,527</u>	<u>152,574</u>	<u>1,532,550</u>	<u>7,581,158</u>
<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
收購附屬公司	-	-	23,427	10,981	26,355	60,763
添置	-	-	-	-	565,955	565,955
處置	-	-	-	-	(86)	(86)
外幣報表折算差額	-	295,470	16,790	24,915	196,426	533,601
2022 年 12 月 31 日	<u>1,768,330</u>	<u>3,931,667</u>	<u>242,226</u>	<u>348,720</u>	<u>4,087,137</u>	<u>10,378,080</u>
<b>累計攤銷</b>						
2022 年 1 月 1 日	(117,114)	-	-	(131,462)	(2,178,598)	(2,427,174)
年內計提	(41,772)	-	-	(37,409)	(351,288)	(430,469)
處置	-	-	-	-	86	86
外幣報表折算差額	-	-	-	(9,637)	(71,070)	(80,707)
2022 年 12 月 31 日	<u>(158,886)</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>(178,508)</u>	<u>(2,600,870)</u>	<u>(2,938,264)</u>
<b>賬面價值</b>						
2022 年 12 月 31 日	<u>1,609,444</u>	<u>3,931,667</u>	<u>242,226</u>	<u>170,212</u>	<u>1,486,267</u>	<u>7,439,816</u>

本集團無法預見與現有經紀商及企業分銷渠道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。

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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. 聯營公司權益

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
分佔資產淨值	<u>19,376,905</u>	<u>18,276,443</u>

於 2023 年 6 月 30 日及 2022 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 4,986 百萬元和人民幣 4,649 百萬元的聯營公司權益以進行轉融通業務。

下表僅載列重大聯營公司詳情，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。

聯營公司名稱	註冊地點	所有權權益百分比								主要業務
		註冊資本		本集團實際利率		本公司所持權益		附屬公司所持權益		
		30/06/2023	31/12/2022	30/06/2023	31/12/2022	30/06/2023	31/12/2022	30/06/2023	31/12/2022	
江蘇銀行 <sup>(i)</sup>	南京	15,519,094	14,769,657	5.59%	5.88%	5.59%	5.88%	-	-	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%	41.16%	41.16%	-	-	基金管理
— 南京 華泰瑞聯並 購基金(有限 合夥) <sup>(ii)</sup>	南京	5,442,000	5,442,000	48.27%	48.27%	-	-	48.27%	48.27%	股權投資

所有上述聯營公司均使用權益法於合併財務報表列賬。

- (i) 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，從而實施對江蘇銀行的重大影響，因此聯營公司權益按權益法核算。截至 2023 年 6 月 30 日，江蘇銀行已將人民幣 4,475,006 千元可轉換債券轉為 749,559,864 股普通股，佔轉股前江蘇銀行已發行普通股總數的 6.4928%。於 2023 年 6 月 30 日止六個月期間，江蘇銀行發行的蘇銀轉債轉股導致本公司對江蘇銀行的持股比例從 5.88%減少至 5.59%。
- (ii) 截至 2023 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公司核算。

## 21. 合營企業權益

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
以公允價值計量且其變動計入當期損益的		
非上市合營企業投資 <sup>(i)</sup>	539,353	741,464
非上市合營企業投資	772,138	964,720
總計	<u>1,311,491</u>	<u>1,706,184</u>

- (i) 截至 2023 年 6 月 30 日，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(本集團的全資附屬公司)持有的 Huatai International Greater Bay Area Investment Fund, L.P. 的投資人民幣 539 百萬元，原因是管理層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簡明合併財務報表列賬的合營企業詳情，截至 2023 年 6 月 30 日和 2022 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 實際利率	本公司 所持權益	附屬公司 所持權益	
華泰招商(江蘇)資本市場投資母基金 (有限合夥)	南京	10,001,000	10.00%	-	10.00%	股權投資

截至 2023 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，本集團董事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. 以攤銷成本計量的債務工具

(a) 按性質分析：

非流動

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
債務證券	41,529,558	36,590,612
減：減值虧損	(4,314)	(3,905)
總計	<u>41,525,244</u>	<u>36,586,707</u>
分析如下：		
於香港以外地區上市	14,690,420	15,935,425
於香港上市	122,976	134,246
未上市	26,711,848	20,517,036
總計	<u>41,525,244</u>	<u>36,586,707</u>

流動

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
債務證券	8,797,941	11,967,090
減：減值虧損	(825)	(1,227)
總計	<u>8,797,116</u>	<u>11,965,863</u>
分析如下：		
於香港以外地區上市	5,436,649	8,840,419
於香港上市	15,429	-
未上市	3,345,038	3,125,444
總計	<u>8,797,116</u>	<u>11,965,863</u>

於 2023 年 6 月 30 日，本集團質押公允價值總值為人民幣 27,466 百萬元及賬面價值為人民幣 27,103 百萬元的以攤銷成本計量的債務工具進行賣出回購業務及衍生品業務。(於 2022 年 12 月 31 日：公允價值總值人民幣 48,206 百萬元，賬面價值人民幣 47,753 百萬元)。

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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. 以攤銷成本計量的債務工具 - 續

(b) 減值虧損撥備變動分析:

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
期 / 年初	5,132	15,115
期 / 年內計提 / (撥回) 淨額	7	(9,969)
核銷	-	(14)
期 / 年末	<u>5,139</u>	<u>5,132</u>

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

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
債權證券	13,932,470	7,695,974
貸款及墊款	276,571	204,621
總計	<u>14,209,041</u>	<u>7,900,595</u>
分析如下:		
於香港以外地區上市	1,557,031	1,629,903
於香港上市	1,909,254	972,819
未上市	10,742,756	5,297,873
總計	<u>14,209,041</u>	<u>7,900,595</u>

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

流動

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
債務證券	981,485	2,202,643
貸款及墊款	203,699	401,141
總計	<u>1,185,184</u>	<u>2,603,784</u>
分析如下：		
於香港以外地區上市	516,816	1,506,397
於香港上市	464,669	696,246
未上市	203,699	401,141
總計	<u>1,185,184</u>	<u>2,603,784</u>

於 2023 年 6 月 30 日和 2022 年 12 月 31 日，本集團未向證金公司質押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 2023 年 6 月 30 日，本集團質押公允價值總值為人民幣 10,067 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 2022 年 12 月 31 日：人民幣 3,466 百萬元)。

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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)

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

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
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證券 -非上市權益證券	270,778	241,587
總計	<u>270,778</u>	<u>241,587</u>
分析如下：		
未上市	<u>270,778</u>	<u>241,587</u>

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：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
權益證券	6,565,052	6,525,458
基金	483,647	761,065
貸款及墊款	2,171,010	2,856,060
總計	<u>9,219,709</u>	<u>10,142,583</u>

(b) 分析如下：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
於香港以外地區上市	237,096	524,533
未上市	8,982,613	9,618,050
總計	<u>9,219,709</u>	<u>10,142,583</u>

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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

(a) 按類型分析：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
債務證券	174,716,830	174,205,450
權益證券	114,867,880	100,851,313
基金	68,539,493	44,782,298
理財產品	20,782,563	20,575,405
貸款及墊款	554,047	247,496
總計	<u>379,460,813</u>	<u>340,661,962</u>

(b) 分析如下：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
於香港以外地區上市	160,321,059	155,242,430
於香港上市	42,248,074	43,464,008
未上市	176,891,680	141,955,524
總計	<u>379,460,813</u>	<u>340,661,962</u>

於 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日，本集團所持禁售期基金投資分別為人民幣 650 百萬元和人民幣 735 百萬元。

於 2023 年 6 月 30 日及 2022 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 8,189 百萬元和人民幣 10,529 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。



## 25. 以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產 - 續

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。

以公允價值計量且其變動計入當期損益的非流動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 2023 年 6 月 30 日及 2022 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 2,326 百萬元和人民幣 2,902 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 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日，本集團向證金公司質押公允價值總值分別為人民幣 16,563 百萬元和人民幣 16,119 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。

於 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日，本集團質押公允價值總值分別為人民幣 116,424 百萬元和人民幣 109,936 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 2023 年 6 月 30 日及 2022 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 67 百萬元和人民幣 140 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。

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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)

26. 存出保證金

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
於證券交易所的保證金		
- 香港中央結算有限公司	4,224,081	5,286,738
- 中國證券登記結算有限責任公司	1,669,198	1,665,965
- 香港聯合交易所	24,933	65,987
- 香港交易及結算所有限公司	60,124	94,329
	<u>5,978,336</u>	<u>7,113,019</u>
於期貨及商品交易所的保證金		
- 中國金融期貨交易所	13,103,065	14,761,044
- 上海期貨交易所	5,573,722	5,954,846
- 大連商品交易所	4,989,779	4,402,818
- 鄭州商品交易所	4,025,524	2,932,216
- 上海國際能源交易中心	1,309,805	1,039,029
- 境外期貨交易所	92,081	3,689
	<u>29,093,976</u>	<u>29,093,642</u>
於其他機構的保證金		
- 中國證券金融股份有限公司	308,630	1,768,557
- 上海清算所	1,079,430	881,981
- 上海黃金交易所	400	400
- 其他	3,734,302	3,849,178
	<u>5,122,762</u>	<u>6,500,116</u>
總計	<u>40,195,074</u>	<u>42,706,777</u>

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至2023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) 於簡明合併財務狀況表確認的遞延稅項資產/(負債)組成及變動如下:

遞延稅項來自:	減值虧損撥備	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工具公允價值變動	與收購中確認的無形資產	其他	總計
2023年1月1日(經重述)	840,595	1,737,046	(31,402)	(562,460)	(4,853)	(1,267,508)	(2,310,873)	(1,599,455)
於損益確認	(116,974)	31,259	(662,551)	325,611	-	552	376,395	(45,708)
於儲備確認	(7,274)	-	-	-	(18,854)	-	-	(26,128)
2023年6月30日	716,347	1,768,305	(693,953)	(236,849)	(23,707)	(1,266,956)	(1,934,478)	(1,671,291)
2022年1月1日(經重述)	981,491	1,811,033	(1,181,623)	240,379	(34,248)	(1,181,118)	(2,593,814)	(1,957,900)
於損益確認	(136,261)	(73,987)	1,150,221	(802,839)	-	(97,092)	284,469	324,511
收購附屬公司	298	-	-	-	-	10,702	-	11,000
於儲備確認	(4,933)	-	-	-	29,395	-	(1,528)	22,934
2022年12月31日	840,595	1,737,046	(31,402)	(562,460)	(4,853)	(1,267,508)	(2,310,873)	(1,599,455)

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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) 簡明合併財務狀況表對賬

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日 (經重述)
於簡明合併財務狀況表確認的遞延稅項資產淨額	787,070	600,473
於簡明合併財務狀況表確認的遞延稅項負債淨額	(2,458,361)	(2,199,928)
總計	<u>(1,671,291)</u>	<u>(1,599,455)</u>

(c) 未確認遞延稅項資產

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 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日金額分別為人民幣 976 百萬元及人民幣 978 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，大部分稅務虧損不會到期。

28. 其他非流動資產

(a) 按性質分析：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
租賃物業改良及長期遞延開支	<u>271,388</u>	<u>300,664</u>

(b) 租賃物業改良及長期遞延開支變動如下：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
期 / 年初結餘	300,664	282,227
添置	8,564	35,416
自物業及設備轉入	31,475	110,064
攤銷	(67,874)	(127,043)
其他減少	(1,441)	-
期 / 年末結餘	<u>271,388</u>	<u>300,664</u>

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
應收款項：		
- 收益互換及場外期權	2,192,409	1,813,190
- 經紀，交易商及結算所	3,226,605	2,085,396
- 手續費及傭金	1,700,861	2,023,176
- 結算款	771,618	1,072,692
- 開放式基金贖回款	1,012,789	821,210
- 申購款	1,000,295	246
- 其他	133,014	56,962
減：減值虧損	(75,744)	(68,531)
總計	<u>9,961,847</u>	<u>7,804,341</u>

(b) 按賬齡分析：

於報告期末，基於交易日期的應收賬款賬齡分析如下：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
1 個月內	7,558,901	5,374,289
1 至 3 個月	671,329	607,064
3 個月以上	1,731,617	1,822,988
總計	<u>9,961,847</u>	<u>7,804,341</u>

(c) 減值虧損撥備變動分析：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
期 / 年初	68,531	97,739
期 / 年內計提 / (撥回) 淨額	6,182	(32,659)
其他	1,031	3,451
期 / 年末	<u>75,744</u>	<u>68,531</u>

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
其他應收款項 <sup>(1)</sup>	317,475	549,635
預付賬款	732,422	609,055
應收利息 <sup>(2)</sup>	82,502	82,063
應收股息	19,210	11,326
可抵扣增值稅	53,781	57,657
遞延開支	12,045	31,150
其他	749,244	816,643
總計	<u>1,966,679</u>	<u>2,157,529</u>

其他結餘主要指一般業務過程中產生的大宗商品以及其他預付款等。

(1) 其他應收款項：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
其他應收款	1,096,872	1,313,373
減：減值虧損	(779,397)	(763,738)
總計	<u>317,475</u>	<u>549,635</u>

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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

其他應收款項減值虧損撥備變動分析：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
期 / 年初	763,738	765,109
期 / 年內計提 / (撥回) 淨額	15,659	(2,296)
核銷	-	(105)
其他	-	1,030
期 / 年末	<u>779,397</u>	<u>763,738</u>

(2) 應收利息：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
應收利息	127,909	120,238
減：減值虧損	<u>(45,407)</u>	<u>(38,175)</u>
總計	<u>82,502</u>	<u>82,063</u>

應收利息減值虧損撥備變動分析：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
期 / 年初	38,175	36,946
期 / 年內計提淨額	7,232	1,576
其他	-	(347)
期 / 年末	<u>45,407</u>	<u>38,175</u>

**31. 融出資金**

**(a) 按性質分析：**

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
個人	92,603,168	89,173,576
機構	14,315,633	13,001,155
減：減值虧損	(1,506,634)	(1,526,356)
總計	<u>105,412,167</u>	<u>100,648,375</u>

**(b) 減值虧損撥備變動分析：**

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
期 / 年初	1,526,356	1,914,311
期 / 年內撥回淨額	(21,744)	(387,636)
其他	2,022	(319)
期 / 年末	<u>1,506,634</u>	<u>1,526,356</u>

**(c) 融資融券業務抵押品公允價值分析如下：**

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
抵押品公允價值：		
權益證券	298,079,424	283,187,260
基金	30,934,306	28,829,001
現金	9,882,004	11,097,378
債務證券	1,399,507	942,066
總計	<u>340,295,241</u>	<u>324,055,705</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。



华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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) 按抵押品類型分析：

流動

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
債務證券	11,577,580	28,257,793
權益證券	6,484,640	7,704,841
減：減值虧損	(672,585)	(1,138,413)
總計	<u>17,389,635</u>	<u>34,824,221</u>

(b) 按市場分析：

流動

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
上海證券交易所	4,756,547	8,912,172
深圳證券交易所	4,002,105	11,631,529
銀行同業市場	7,723,893	13,366,714
其他	1,579,675	2,052,219
減：減值虧損	(672,585)	(1,138,413)
總計	<u>17,389,635</u>	<u>34,824,221</u>

(c) 減值虧損撥備變動分析：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
期 / 年初	1,138,413	1,118,777
期 / 年內(撥回) / 計提淨額	(468,976)	15,392
其他增加	3,148	4,244
期 / 年末	<u>672,585</u>	<u>1,138,413</u>

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分析：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
1 個月內	715,057	1,632,472
1 個月至 3 個月	2,342,558	528,129
3 個月至 1 年	3,427,025	5,544,240
減：減值虧損	(541,553)	(1,014,020)
總計	<u>5,943,087</u>	<u>6,690,821</u>

(e) 股票質押式回購按預期信用虧損階段分析：

	2023 年 6 月 30 日			總計
	未來 12 個月 預期信用虧損	整個存續期 預期信用虧損 (未發生信用減值)	整個存續期 預期信用虧損 (已發生信用減值)	
攤銷成本	5,913,467	-	571,173	6,484,640
減值虧損	(22,049)	-	(519,504)	(541,553)
賬面價值	<u>5,891,418</u>	<u>-</u>	<u>51,669</u>	<u>5,943,087</u>
抵押品	<u>15,870,767</u>	<u>-</u>	<u>598,568</u>	<u>16,469,335</u>
	2022 年 12 月 31 日			總計
	未來 12 個月 預期信用虧損	整個存續期 預期信用虧損 (未發生信用減值)	整個存續期 預期信用虧損 (已發生信用減值)	
攤銷成本	6,696,552	-	1,008,289	7,704,841
減值虧損	(28,128)	-	(985,892)	(1,014,020)
賬面價值	<u>6,668,424</u>	<u>-</u>	<u>22,397</u>	<u>6,690,821</u>
抵押品	<u>18,262,203</u>	<u>-</u>	<u>972,957</u>	<u>19,235,160</u>

於 2023 年 6 月 30 日，本集團買入返售金融資產抵押品的公允價值為人民幣 26,620 百萬元 (2022 年 12 月 31 日：人民幣 36,337 百萬元)。

33. 衍生金融工具

	2023 年 6 月 30 日		
	名義金額	公允價值	
		資產	負債
利率衍生工具	1,859,429,230	1,393,309	(1,015,993)
貨幣衍生工具	190,356,717	1,326,819	(1,162,981)
權益衍生工具	555,833,288	10,776,789	(9,750,666)
信用衍生工具	5,435,787	24,350	(5,808)
其他	318,793,842	2,538,309	(3,143,216)
總計	<u>2,929,848,864</u>	<u>16,059,576</u>	<u>(15,078,664)</u>
減：結算		<u>(1,019,636)</u>	<u>1,154,814</u>
淨頭寸		<u>15,039,940</u>	<u>(13,923,850)</u>

	2022 年 12 月 31 日		
	名義金額	公允價值	
		資產	負債
利率衍生工具	2,049,415,232	1,210,893	(1,014,318)
貨幣衍生工具	130,689,441	368,568	(1,298,573)
權益衍生工具	573,466,284	14,176,581	(6,478,834)
信用衍生工具	3,485,135	20,452	(3,023)
其他	549,318,616	1,350,559	(1,971,027)
總計	<u>3,306,374,708</u>	<u>17,127,053</u>	<u>(10,765,775)</u>
減：結算		<u>(1,338,752)</u>	<u>1,127,650</u>
淨頭寸		<u>15,788,301</u>	<u>(9,638,125)</u>

根據按日計價結算安排，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 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日，上述合約的淨頭寸為人民幣零元。

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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和交叉貨幣掉期合約，主要用於對現金流波動進行套期，以應對未來現金流波動風險。

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：

2023 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	
貨幣衍生工具	-	-	3,025,000	-	3,025,000	-	(60,040)

2022 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	1,392,920	-	-	-	1,392,920	11,522	-
貨幣衍生工具	-	-	3,025,000	-	3,025,000	31,121	-
總計	1,392,920	-	3,025,000	-	4,417,920	42,643	-

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信息列示如下：

2023 年 6 月 30 日					
被套期項目賬面價值		套期工具本期對其他綜合收益影響的金額	套期工具累計計入其他綜合收益的金額	財務狀況表項目	
資產	負債				
債券	-	(3,043,120)	41,750	84,393	長期債券

2022 年 12 月 31 日					
被套期項目賬面價值		套期工具本期對其他綜合收益影響的金額	套期工具累計計入其他綜合收益的金額	財務狀況表項目	
資產	負債				
債券	-	(5,844,230)	56,827	42,643	長期債券

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 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	6,542,591	5,168,695
- 香港中央結算有限公司	13,442	55,527
於其他機構的備付金	237,610	3,492,284
總計	<u>6,793,643</u>	<u>8,716,506</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，並在對任何虧損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：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
現金	207	203
銀行結餘	47,511,352	45,181,375
減：減值虧損	(412)	(833)
總計	<u>47,511,147</u>	<u>45,180,745</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)。

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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) 減值虧損撥備變動分析:

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
期 / 年初	833	1,157
期 / 年內減值撥回淨額	(421)	(351)
其他變動	-	27
期 / 年末	<u>412</u>	<u>833</u>

37. 現金及現金等價物

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
現金	207	203
銀行結餘	47,398,521	45,102,385
結算備付金	6,793,640	8,716,492
原定到期日三個月內的買入返售金融資產	11,423,205	26,635,065
原定到期日三個月內的債券投資	1,832,514	79,878
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>(4,841,496)</u>	<u>(4,984,963)</u>
總計	<u>62,606,591</u>	<u>75,549,060</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

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
信用借款	12,465,832	7,711,588
質押借款	<u>1,198,575</u>	<u>285,846</u>
總計	<u>13,664,407</u>	<u>7,997,434</u>

於 2023 年 6 月 30 日，短期借款年利率在 5.80%-6.40%之間(2022 年 12 月 31 日：年利率 4.60%-5.83%)。

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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

2023 年 6 月 30 日

名稱	面值 原幣	起息日	到期日	發行金額 原幣	票面利率
22 華泰 F1	人民幣 4,000,000	17/1/2022	17/1/2024	人民幣 4,000,000	2.75%
22 華泰 S2	人民幣 5,000,000	19/8/2022	17/2/2023	人民幣 5,000,000	1.78%
23 華泰 S1	人民幣 5,000,000	17/3/2023	15/9/2023	人民幣 5,000,000	2.65%
23 華泰 S2	人民幣 5,000,000	23/3/2023	25/10/2023	人民幣 5,000,000	2.65%
華泰 B2304a	美元 100,000	7/4/2022	6/4/2023	美元 100,000	1.50%
華泰 B2304b	美元 100,000	7/4/2022	6/4/2023	美元 100,000	1.50%
華泰 B2304c	美元 100,000	7/4/2022	6/4/2023	美元 100,000	1.50%
華泰 B2305a	美元 50,000	27/5/2022	25/5/2023	美元 50,000	2.85%
華泰 B2302a	美元 50,000	27/5/2022	28/2/2023	美元 50,000	2.81%
華泰 B2306	美元 100,000	10/6/2022	8/6/2023	美元 100,000	2.86%
華泰 B2302b	港幣 300,000	13/5/2022	13/2/2023	港幣 300,000	2.15%
華泰 B2308	美元 15,000	10/8/2022	9/8/2023	美元 15,000	3.00%
華泰 B2302d	美元 18,000	14/11/2022	14/2/2023	美元 18,000	5.75%
華泰 B2302e	港幣 300,000	14/11/2022	14/2/2023	港幣 300,000	5.75%
華泰 B2302f	美元 10,700	16/11/2022	16/2/2023	美元 10,700	0.00%
華泰 B2302g	港幣 496,000	16/11/2022	16/2/2023	港幣 496,000	5.50%
華泰 B2302h	美元 5,499	18/11/2022	17/2/2023	美元 5,499	0.00%
華泰 B2311	美元 40,000	23/11/2022	22/11/2023	美元 40,000	6.05%
華泰 B2302i	港幣 23,390	18/11/2022	17/2/2023	港幣 23,390	0.00%
華泰 B2302j	港幣 150,000	22/11/2022	22/2/2023	港幣 150,000	0.00%
華泰 B2302k	美元 8,580	25/11/2022	24/2/2023	美元 8,580	0.00%
華泰 B2302l	美元 100,000	29/11/2022	27/2/2023	美元 100,000	0.00%
華泰 B2302m	美元 50,000	29/11/2022	27/2/2023	美元 50,000	0.00%
華泰 B2303a	美元 4,839	1/12/2022	1/3/2023	美元 4,839	0.00%
華泰 B2303b	港幣 14,000	1/12/2022	1/3/2023	港幣 14,000	0.00%
華泰 B2303c	美元 10,000	6/12/2022	3/3/2023	美元 10,000	5.70%
華泰 B2306b	美元 62,000	15/12/2022	15/6/2023	美元 62,000	0.00%
華泰 B2306c	美元 32,300	29/12/2022	29/6/2023	美元 32,300	5.60%
華泰 B2312	人民幣 440,000	13/12/2022	12/12/2023	人民幣 440,000	3.49%
華泰 B2304d	美元 30,000	13/1/2023	13/4/2023	美元 30,000	5.00%
華泰 B2304e	港幣 62,000	13/1/2023	13/4/2023	港幣 62,000	5.34%
華泰 B2304f	美元 20,000	17/1/2023	17/4/2023	美元 20,000	0.00%
華泰 B2304g	美元 20,000	17/1/2023	18/4/2023	美元 20,000	5.25%
華泰 B2305b	美元 6,600	10/2/2023	10/5/2023	美元 6,600	0.00%
華泰 B2305c	美元 13,350	17/2/2023	17/5/2023	美元 13,350	0.00%
華泰 B2305d	美元 15,000	21/2/2023	23/5/2023	美元 15,000	5.28%
華泰 B2305e	港幣 200,000	21/2/2023	23/5/2023	港幣 200,000	3.82%
華泰 B2306a	美元 11,820	8/3/2023	8/6/2023	美元 11,820	0.00%
華泰 B2306d	美元 20,000	10/3/2023	9/6/2023	美元 20,000	0.00%
華泰 B2307a	美元 10,000	8/5/2023	7/7/2023	美元 10,000	5.55%
華泰 B2307b	美元 40,000	10/5/2023	11/7/2023	美元 40,000	5.55%
華泰 B2307c	美元 12,500	16/5/2023	14/7/2023	美元 12,500	5.55%
華泰 B2307d	美元 20,000	17/1/2023	18/7/2023	美元 20,000	5.00%
華泰 B2307e	港幣 200,000	17/1/2023	18/7/2023	港幣 200,000	5.14%
華泰 B2307f	美元 17,000	19/4/2023	19/7/2023	美元 17,000	0.00%
華泰 B2307g	美元 6,300	20/4/2023	20/7/2023	美元 6,300	0.00%

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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

2023 年 6 月 30 日 - 續

名稱	面值 原幣	起息日	到期日	發行金額 原幣	票面利率
華泰 B2307h	美元 18,000	20/4/2023	20/7/2023	美元 18,000	0.00%
華泰 B2307i	美元 20,000	24/4/2023	21/7/2023	美元 20,000	5.55%
華泰 B2307j	美元 25,427	19/5/2023	21/7/2023	美元 25,427	5.00%
華泰 B2307k	港幣 100,000	29/5/2023	28/7/2023	港幣 100,000	4.85%
華泰 B2307l	美元 15,000	29/5/2023	28/7/2023	美元 15,000	5.73%
華泰 B2308a	美元 10,000	6/2/2023	4/8/2023	美元 10,000	5.50%
華泰 B2308b	美元 47,000	6/2/2023	7/8/2023	美元 47,000	0.00%
華泰 B2308c	美元 20,000	8/2/2023	8/8/2023	美元 20,000	5.55%
華泰 B2308d	美元 100,000	9/2/2023	9/8/2023	美元 100,000	0.00%
華泰 B2308e	美元 15,000	10/2/2023	10/8/2023	美元 15,000	0.00%
華泰 B2308f	美元 50,000	22/2/2023	15/8/2023	美元 50,000	5.00%
華泰 B2308g	港幣 250,000	14/6/2023	15/8/2023	港幣 250,000	4.65%
華泰 B2308h	美元 30,000	17/2/2023	17/8/2023	美元 30,000	5.46%
華泰 B2308i	美元 100,000	21/2/2023	18/8/2023	美元 100,000	0.00%
華泰 B2309a	美元 15,000	6/6/2023	6/9/2023	美元 15,000	5.88%
華泰 B2309b	美元 100,000	10/3/2023	12/9/2023	美元 100,000	0.00%
華泰 B2309c	美元 26,300	15/6/2023	15/9/2023	美元 26,300	0.00%
華泰 B2309d	美元 10,000	27/6/2023	27/9/2023	美元 10,000	5.50%
華泰 B2310	美元 50,000	19/1/2023	19/10/2023	美元 50,000	0.00%
華泰 B2311a	港幣 51,000	2/5/2023	2/11/2023	港幣 51,000	0.00%
華泰 B2311b	美元 20,000	9/5/2023	9/11/2023	美元 20,000	5.55%
華泰 B2311c	美元 10,000	16/5/2023	16/11/2023	美元 10,000	5.66%
華泰 B2311d	美元 5,150	19/5/2023	17/11/2023	美元 5,150	0.00%
華泰 B2311f	美元 39,000	23/6/2023	22/11/2023	美元 39,000	0.00%
華泰 B2311g	港幣 200,000	23/5/2023	24/11/2023	港幣 200,000	4.70%
華泰 B2311h	美元 10,500	26/6/2023	27/11/2023	美元 10,500	0.00%
華泰 B2311i	美元 25,500	30/6/2023	30/11/2023	美元 25,500	5.50%
華泰 B2312a	美元 60,000	17/1/2023	22/12/2023	美元 60,000	5.00%
華泰 B2401a	美元 25,800	13/1/2023	12/1/2024	美元 25,800	5.00%
華泰 B2401b	美元 20,000	19/1/2023	19/1/2024	美元 20,000	5.75%
華泰 B2402a	美元 15,000	3/2/2023	2/2/2024	美元 15,000	0.00%
華泰 B2402b	美元 20,600	6/2/2023	5/2/2024	美元 20,600	0.00%
華泰 B2403a	美元 30,000	27/3/2023	27/3/2024	美元 30,000	5.60%
華泰 B2405b	港幣 475,000	5/5/2023	3/5/2024	港幣 475,000	4.60%
華泰 B2406c	美元 50,000	13/6/2023	13/6/2024	美元 50,000	5.95%
結構性票據 (1)	人民幣 9,236,198	註釋(1)	註釋(1)	人民幣 9,236,198	註釋(1)



华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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

2023 年 6 月 30 日 - 續

名稱	2023 年 1 月 1 日 賬面價值 等值人民幣	增加 等值人民幣	減少 等值人民幣	2023 年 6 月 30 日 賬面價值 等值人民幣
22 華泰 F1	4,105,269	-	(4,105,269)	-
22 華泰 S2	5,032,777	7,417	(5,040,194)	-
23 華泰 S1	-	5,038,468	-	5,038,468
23 華泰 S2	-	5,036,331	-	5,036,331
華泰 B2304a	697,585	3,953	(701,538)	-
華泰 B2304b	697,585	3,953	(701,538)	-
華泰 B2304c	697,585	3,953	(701,538)	-
華泰 B2305a	354,025	3,523	(357,548)	-
華泰 B2302a	354,203	2,356	(356,559)	-
華泰 B2306	707,321	8,781	(716,102)	-
華泰 B2302b	271,621	175	(271,796)	-
華泰 B2308	105,092	6,084	-	111,176
華泰 B2302d	126,321	557	(126,878)	-
華泰 B2302e	269,950	1,433	(271,383)	-
華泰 B2302f	74,030	-	(74,030)	-
華泰 B2302g	445,902	2,541	(448,443)	-
華泰 B2302h	38,132	-	(38,132)	-
華泰 B2311	279,817	19,498	-	299,315
華泰 B2302i	20,749	-	(20,749)	-
華泰 B2302j	132,878	-	(132,878)	-
華泰 B2302k	59,279	-	(59,279)	-
華泰 B2302l	690,163	-	(690,163)	-
華泰 B2302m	345,082	-	(345,082)	-
華泰 B2303a	33,398	-	(33,398)	-
華泰 B2303b	12,390	-	(12,390)	-
華泰 B2303c	69,931	641	(70,572)	-
華泰 B2306b	420,182	-	(420,182)	-
華泰 B2306c	225,057	5,254	(230,311)	-
華泰 B2312	440,604	7,785	-	448,389
華泰 B2304d	-	216,489	(216,489)	-
華泰 B2304e	-	57,163	(57,163)	-
華泰 B2304f	-	142,527	(142,527)	-
華泰 B2304g	-	144,469	(144,469)	-
華泰 B2305b	-	47,063	(47,063)	-
華泰 B2305c	-	95,228	(95,228)	-
華泰 B2305d	-	108,352	(108,352)	-
華泰 B2305e	-	184,396	(184,396)	-
華泰 B2306a	-	84,265	(84,265)	-
華泰 B2306d	-	142,488	(142,488)	-
華泰 B2307a	-	72,794	-	72,794
華泰 B2307b	-	190,104	-	190,104
華泰 B2307c	-	90,885	-	90,885

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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

2023 年 6 月 30 日 - 續

名稱	2023 年 1 月 1 日 賬面價值 等值人民幣	增加 等值人民幣	減少 等值人民幣	2023 年 6 月 30 日 賬面價值 等值人民幣
華泰 B2307d	-	147,730	-	147,730
華泰 B2307e	-	188,635	-	188,635
華泰 B2307f	-	122,469	-	122,469
華泰 B2307g	-	45,384	-	45,384
華泰 B2307h	-	129,652	-	129,652
華泰 B2307i	-	145,946	-	145,946
華泰 B2307j	-	184,509	-	184,509
華泰 B2307k	-	92,595	-	92,595
華泰 B2307l	-	108,903	-	108,903
華泰 B2308a	-	73,821	-	73,821
華泰 B2308b	-	337,827	-	337,827
華泰 B2308c	-	147,631	-	147,631
華泰 B2308d	-	718,582	-	718,582
華泰 B2308e	-	107,770	-	107,770
華泰 B2308f	-	367,379	-	367,379
華泰 B2308g	-	230,893	-	230,893
華泰 B2308h	-	221,072	-	221,072
華泰 B2308i	-	717,561	-	717,561
華泰 B2309a	-	108,776	-	108,776
華泰 B2309b	-	714,625	-	714,625
華泰 B2309c	-	183,541	-	183,541
華泰 B2309d	-	72,175	-	72,175
華泰 B2310	-	355,421	-	355,421
華泰 B2311a	-	46,062	-	46,062
華泰 B2311b	-	145,438	-	145,438
華泰 B2311c	-	72,745	-	72,745
華泰 B2311d	-	36,223	-	36,223
華泰 B2311f	-	274,618	-	274,618
華泰 B2311g	-	185,311	-	185,311
華泰 B2311h	-	72,509	-	72,509
華泰 B2311i	-	183,748	-	183,748
華泰 B2312a	-	441,528	-	441,528
華泰 B2401a	-	189,907	-	189,907
華泰 B2401b	-	148,207	-	148,207
華泰 B2402a	-	104,945	-	104,945
華泰 B2402b	-	144,056	-	144,056
華泰 B2403a	-	219,747	-	219,747
華泰 B2405b	-	438,569	-	438,569
華泰 B2406c	-	362,014	-	362,014
結構性票據 (1)	9,065,676	920,476	(3,099,788)	6,886,364
總計	25,772,604	21,237,926	(20,248,180)	26,762,350

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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 12 月 31 日

名稱	面值 原幣	發行日期	到期日	發行金額 原幣	票面利率
21 華泰 S2	人民幣 4,000,000	28/6/2021	28/6/2022	人民幣 4,000,000	2.95%
21 華泰 S3	人民幣 2,000,000	9/7/2021	22/2/2022	人民幣 2,000,000	2.75%
21 華泰 S4	人民幣 4,000,000	9/7/2021	9/7/2022	人民幣 4,000,000	2.87%
21 華泰 S5	人民幣 3,000,000	19/7/2021	19/7/2022	人民幣 3,000,000	2.75%
21 華泰 S6	人民幣 4,000,000	9/8/2021	11/2/2022	人民幣 4,000,000	2.55%
21 華泰 S7	人民幣 4,000,000	16/8/2021	20/1/2022	人民幣 4,000,000	2.51%
21 華泰 S9	人民幣 2,300,000	6/12/2021	8/6/2022	人民幣 2,300,000	2.64%
21 華 S10	人民幣 2,700,000	6/12/2021	25/11/2022	人民幣 2,700,000	2.70%
21 華 S11	人民幣 2,000,000	13/12/2021	13/5/2022	人民幣 2,000,000	2.62%
21 華 S12	人民幣 1,000,000	21/12/2021	21/9/2022	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%
22 華泰 F1	人民幣 4,000,000	17/1/2022	17/1/2024	人民幣 4,000,000	2.75%
22 華泰 S1	人民幣 5,000,000	9/8/2022	9/11/2022	人民幣 5,000,000	1.65%
22 華泰 S2	人民幣 5,000,000	19/8/2022	17/2/2023	人民幣 5,000,000	1.78%
華泰 B2203a	美元 100,000	23/3/2021	21/3/2022	美元 100,000	0.35%
華泰 B2206	美元 100,000	11/6/2021	9/6/2022	美元 100,000	0.70%
華泰 B2203b	港幣 300,000	7/12/2021	10/3/2022	港幣 300,000	0.55%
華泰 B2203c	美元 30,000	29/12/2021	29/3/2022	美元 30,000	0.65%
華泰 B2204a	美元 100,000	18/1/2022	18/4/2022	美元 100,000	0.65%
華泰 B2204b	美元 60,000	24/1/2022	25/4/2022	美元 60,000	0.65%
華泰 B2207	美元 100,000	28/1/2022	28/7/2022	美元 100,000	0.80%
華泰 B2205a	美元 20,000	10/2/2022	10/5/2022	美元 20,000	1.05%
華泰 B2204c	美元 50,000	25/2/2022	25/4/2022	美元 50,000	0.70%
華泰 B2212a	美元 100,000	24/3/2022	23/12/2022	美元 100,000	1.00%
華泰 B2212b	美元 100,000	24/3/2022	23/12/2022	美元 100,000	1.00%
華泰 B2212c	美元 50,000	24/3/2022	23/12/2022	美元 50,000	1.00%
華泰 B2209a	美元 50,000	24/3/2022	23/9/2022	美元 50,000	1.65%
華泰 B2209b	美元 50,000	25/3/2022	26/9/2022	美元 50,000	0.95%
華泰 B2304a	美元 100,000	7/4/2022	6/4/2023	美元 100,000	1.50%
華泰 B2304b	美元 100,000	7/4/2022	6/4/2023	美元 100,000	1.50%
華泰 B2304c	美元 100,000	7/4/2022	6/4/2023	美元 100,000	1.50%
華泰 B2209c	美元 30,000	6/4/2022	30/9/2022	美元 30,000	1.75%
華泰 B2211a	美元 50,000	5/5/2022	4/11/2022	美元 50,000	2.04%
華泰 B2211b	美元 18,000	10/5/2022	10/11/2022	美元 18,000	2.15%
華泰 B2211c	美元 50,000	5/5/2022	4/11/2022	美元 50,000	1.75%

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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 12 月 31 日

名稱	面值 原幣	發行日期	到期日	發行金額 原幣	票面利率
華泰 B2208a	美元 60,000	4/5/2022	4/8/2022	美元 60,000	1.25%
華泰 B2305a	美元 50,000	27/5/2022	25/5/2023	美元 50,000	2.85%
華泰 B2302a	美元 50,000	27/5/2022	28/2/2023	美元 50,000	2.81%
華泰 B2208b	美元 30,000	2/6/2022	31/8/2022	美元 30,000	2.00%
華泰 B2208c	美元 20,000	2/6/2022	12/8/2022	美元 20,000	1.90%
華泰 B2306	美元 100,000	10/6/2022	8/6/2023	美元 100,000	2.86%
華泰 B2205b	港幣 280,000	10/2/2022	10/5/2022	港幣 280,000	1.00%
華泰 B2209d	港幣 800,000	1/4/2022	30/9/2022	港幣 800,000	0.65%
華泰 B2211d	港幣 300,000	10/5/2022	10/11/2022	港幣 300,000	1.50%
華泰 B2211e	港幣 490,000	13/5/2022	14/11/2022	港幣 490,000	1.73%
華泰 B2302b	港幣 300,000	13/5/2022	13/2/2023	港幣 300,000	2.15%
華泰 B2212d	美元 75,000	10/8/2022	23/12/2022	美元 75,000	3.00%
華泰 B2308	美元 15,000	10/8/2022	9/8/2023	美元 15,000	3.00%
華泰 B2211f	港幣 300,000	10/8/2022	10/11/2022	港幣 300,000	2.00%
華泰 B2212e	美元 50,800	20/9/2022	20/12/2022	美元 50,800	3.83%
華泰 B2302d	美元 18,000	14/11/2022	14/2/2023	美元 18,000	5.75%
華泰 B2302e	港幣 300,000	14/11/2022	14/2/2023	港幣 300,000	5.75%
華泰 B2302f	美元 10,700	16/11/2022	16/2/2023	美元 10,700	0.00%
華泰 B2302g	港幣 496,000	16/11/2022	16/2/2023	港幣 496,000	5.50%
華泰 B2302h	美元 5,499	18/11/2022	17/2/2023	美元 5,499	0.00%
華泰 B 2311	美元 40,000	23/11/2022	22/11/2023	美元 40,000	6.05%
華泰 B2302i	港幣 23,390	18/11/2022	17/2/2023	港幣 23,390	0.00%
華泰 B2302j	港幣 150,000	22/11/2022	22/2/2023	港幣 150,000	0.00%
華泰 B2302k	美元 8,580	25/11/2022	24/2/2023	美元 8,580	0.00%
華泰 B2302l	美元 100,000	29/11/2022	27/2/2023	美元 100,000	0.00%
華泰 B2302m	美元 50,000	29/11/2022	27/2/2023	美元 50,000	0.00%
華泰 B2303a	美元 4,839	1/12/2022	1/3/2023	美元 4,839	0.00%
華泰 B2303b	港幣 14,000	1/12/2022	1/3/2023	港幣 14,000	0.00%
華泰 B2303c	美元 10,000	6/12/2022	3/3/2023	美元 10,000	5.70%
華泰 B2306b	美元 62,000	15/12/2022	15/6/2023	美元 62,000	0.00%
華泰 B2306c	美元 32,300	29/12/2022	29/6/2023	美元 32,300	5.60%
華泰 B2211g	美元 150,000	30/8/2022	28/11/2022	美元 150,000	0.00%
華泰 B2312	人民幣 440,000	13/12/2022	12/12/2023	人民幣 440,000	3.49%
結構性票據 (1)	人民幣 9,062,109	註釋(1)	註釋(1)	人民幣 9,062,109	註釋(1)

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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 12 月 31 日 - 續

名稱	2022 年	增加	減少	2022 年
	1 月 1 日			12 月 31 日
	賬面價值	等值人民幣	等值人民幣	賬面價值
	等值人民幣	等值人民幣	等值人民幣	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	59,869	(4,114,800)	-
21 華泰 S5	3,037,258	45,242	(3,082,500)	-
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	65,608	(2,770,703)	-
21 華 S11	2,002,676	19,002	(2,021,678)	-
21 華 S12	1,000,798	19,470	(1,020,268)	-
21 華 S13	4,003,253	106,747	(4,110,000)	-
21 華 S14	4,000,887	100,072	(4,100,959)	-
22 華泰 F1	-	4,105,269	-	4,105,269
22 華泰 S1	-	5,020,795	(5,020,795)	-
22 華泰 S2	-	5,032,777	-	5,032,777
華泰 B2203a	636,859	62,025	(698,884)	-
華泰 B2206	639,724	61,585	(701,309)	-
華泰 B2203b	245,294	23,072	(268,366)	-
華泰 B2203c	191,212	18,061	(209,273)	-
華泰 B2204a	-	697,576	(697,576)	-
華泰 B2204b	-	418,553	(418,553)	-
華泰 B2207	-	699,223	(699,223)	-
華泰 B2205a	-	139,649	(139,649)	-
華泰 B2204c	-	348,624	(348,624)	-
華泰 B2212a	-	701,688	(701,688)	-
華泰 B2212b	-	701,688	(701,688)	-
華泰 B2212c	-	350,844	(350,844)	-
華泰 B2209a	-	351,111	(351,111)	-
華泰 B2209b	-	349,907	(349,907)	-
華泰 B2304a	-	697,585	-	697,585
華泰 B2304b	-	697,585	-	697,585
華泰 B2304c	-	697,585	-	697,585
華泰 B2209c	-	210,711	(210,711)	-
華泰 B2211a	-	351,792	(351,792)	-
華泰 B2211b	-	126,722	(126,722)	-
華泰 B2211c	-	351,285	(351,285)	-
華泰 B2208a	-	419,193	(419,193)	-
華泰 B2305a	-	354,025	-	354,025
華泰 B2302a	-	354,203	-	354,203
華泰 B2208b	-	209,968	(209,968)	-
華泰 B2208c	-	139,807	(139,807)	-
華泰 B2306	-	707,321	-	707,321
華泰 B2205b	-	250,734	(250,734)	-
華泰 B2209d	-	716,956	(716,956)	-
華泰 B2211d	-	270,016	(270,016)	-
華泰 B2211e	-	441,555	(441,555)	-
華泰 B2302b	-	271,621	-	271,621
華泰 B2212d	-	528,141	(528,141)	-
華泰 B2308	-	105,092	-	105,092
華泰 B2211f	-	269,341	(269,341)	-
華泰 B2212e	-	357,180	(357,180)	-
華泰 B2302d	-	126,321	-	126,321
華泰 B2302e	-	269,950	-	269,950

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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 12 月 31 日 - 續

名稱	2022 年 1 月 1 日 賬面價值 等值人民幣	增加 等值人民幣	減少 等值人民幣	2022 年 12 月 31 日 賬面價值 等值人民幣
華泰 B2302f	-	74,030	-	74,030
華泰 B2302g	-	445,902	-	445,902
華泰 B2302h	-	38,132	-	38,132
華泰 B 2311	-	279,817	-	279,817
華泰 B2302i	-	20,749	-	20,749
華泰 B2302j	-	132,878	-	132,878
華泰 B2302k	-	59,279	-	59,279
華泰 B2302l	-	690,163	-	690,163
華泰 B2302m	-	345,082	-	345,082
華泰 B2303a	-	33,398	-	33,398
華泰 B2303b	-	12,390	-	12,390
華泰 B2303c	-	69,931	-	69,931
華泰 B2306b	-	420,182	-	420,182
華泰 B2306c	-	225,057	-	225,057
華泰 B2211g	-	1,044,690	(1,044,690)	-
華泰 B2312	-	440,604	-	440,604
結構性票據 <sup>(1)</sup>	14,612,036	18,265,519	(23,811,879)	9,065,676
總計	53,598,658	51,130,444	(78,956,498)	25,772,604

- (1) 截至 2023 年 6 月 30 日止六個月，本公司已發行 91 期結構性票據，利率範圍為 1.80% - 6.58%，到期期限一年內。一年以上到期的結構性票據已分類至長期債券，詳見附註 46(於 2022 年度，本公司已發行 1,705 期結構性票據，利率範圍為 1.80% - 6.58%)。

40. 拆入資金

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
銀行同業拆借	34,017,697	25,877,713
向中國證券金融股份有限公司融入資金	672,367	-
總計	34,690,064	25,877,713

截至 2023 年 6 月 30 日，向銀行的拆入資金無擔保，年利率 1.21% - 5.90%，到期日為 179 天以內(截至 2022 年 12 月 31 日，向銀行的拆入資金無擔保，年利率 1.96% - 5.51%，到期日為 66 天以內)，向中國證券金融股份有限公司的融入資金設有擔保，年利率 2.16%- 2.65%，到期日為 178 天以內(2022 年 12 月 31 日：零)。

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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)

41. 應付經紀客戶賬款

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
客戶經紀業務保證金	142,109,935	133,173,079
客戶融資融券保證金	17,244,379	19,378,644
總計	<u>159,354,314</u>	<u>152,551,723</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。

鑒於該等業務之性質，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。

42. 其他應付款項及應計費用

非流動

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
租賃負債		
1 至 2 年(含 2 年)	379,405	537,830
2 至 5 年(含 5 年)	591,356	417,309
5 年以上	74,130	70,779
總計	<u>1,044,891</u>	<u>1,025,918</u>

本集團的租賃物主要是用於經營的土地及樓宇。大多數合約租賃期為 1 年至 5 年。

- (1) 截至 2023 年 6 月 30 日止六個月，短期租賃和低值租賃相關的費用為人民幣 19 元(截至 2022 年 6 月 30 日止六個月：人民幣 21 百萬元)計入當期損益。
- (2) 截至 2023 年 6 月 30 日，本集團已簽署但尚未開始租賃之租賃合約預計未來年度現金流不重大。

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
應付交易款項	99,432,885	92,616,101
應付經紀，交易商及結算所	5,907,237	6,765,938
應付股息	4,782,560	107,327
應付開放式基金款	7,190,758	5,359,599
代理承銷證券款	173,451	150,460
租賃負債	538,628	492,667
限制性回購義務	236,008	366,523
應付其他稅項	420,640	474,463
期貨風險準備金	224,779	209,833
應付外包服務費	199,201	187,423
應付傭金及手續費	74,675	120,537
應付證券投資者保護基金款項	68,495	63,090
應付寫字樓項目資金開支	24,677	27,794
預計負債 <sup>(1)</sup>	711,874	101
其他 <sup>(2)</sup>	1,144,514	1,154,716
總計	<u>121,130,382</u>	<u>108,096,572</u>

(1) 預計負債主要係未決訴訟產生的預提款項人民幣 570 百萬元(附註 55)以及美國證券交易委員會對於 AssetMark, Inc.監管檢查產生的預提款項人民幣 142 百萬元。

(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：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
債務證券	129,844,935	128,090,388
權益證券	16,119,948	11,960,616
貴金屬	-	4,066,994
總計	<u>145,964,883</u>	<u>144,117,998</u>

於 2023 年 6 月 30 日，本集團賣出回購金融資產款的質押抵押品價值為人民幣 175,746 元(於 2022 年 12 月 31 日：人民幣 164,709 百萬元)。

(2) 按市場分析：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
上海證券交易所	23,520,800	39,055,352
深圳證券交易所	12,895,146	10,751,999
銀行同業市場	79,101,975	68,008,692
場外	30,446,962	26,301,955
總計	<u>145,964,883</u>	<u>144,117,998</u>

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

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 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>5,565,830</u>	<u>5,569,938</u>

流動

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
持作交易金融負債	28,432,869	36,507,296
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>8,723,725</u>	<u>6,498,325</u>
總計	<u>37,156,594</u>	<u>43,005,621</u>

在簡明合併財務報表中，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。

在簡明合併財務報表中，由於結構性票據的主合約包含嵌入式衍生工具，本集團指定某些結構性票據以公允價值計量且其變動計入當期損益。

在簡明合併財務報表中，債券由本集團以公允價值計量且其變動計入當期損益，因為該指定可以顯著減少會計錯配。

於 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 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。

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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

2023 年 6 月 30 日

名稱	面值 原幣	起息日	到期日	發行金額 原幣	票面利率
13 華泰 02	人民幣 6,000,000	5/6/2013	5/6/2023	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	26/3/2020	26/3/2023	人民幣 8,000,000	2.99%
20 華泰 G6	人民幣 3,200,000	18/6/2020	18/6/2023	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	9/12/2020	9/12/2023	人民幣 4,000,000	3.79%
華泰 B2302c	美元 400,000	12/2/2020	12/2/2023	美元 400,000	LIBOR+0.95%
21 華泰 G1	人民幣 4,000,000	20/1/2021	20/1/2024	人民幣 4,000,000	3.58%
21 華泰 G3	人民幣 5,000,000	26/4/2021	26/4/2024	人民幣 5,000,000	3.42%
21 華泰 G5	人民幣 4,000,000	24/5/2021	24/5/2024	人民幣 4,000,000	3.28%
21 華泰 G7	人民幣 2,000,000	15/6/2021	15/6/2024	人民幣 2,000,000	3.40%
21 華泰 09	人民幣 2,500,000	21/6/2021	21/6/2024	人民幣 2,500,000	3.45%
華泰 B2404	美元 900,000	9/4/2021	9/4/2024	美元 900,000	1.30%
結構性票據 <sup>(1)</sup>	人民幣 542,500	註釋(1)	註釋(1)	人民幣 542,500	註釋(1)

名稱	2023 年 1 月 1 日			2023 年 6 月 30 日	
	賬面價值 等值人民幣	增加 等值人民幣	減少 等值人民幣	賬面價值 等值人民幣	
13 華泰 02	6,177,782	128,141	(6,305,923)	-	
18 華泰 G2	1,003,869	20,951	-	1,024,820	
20 華泰 G1	8,182,656	40,275	(8,222,931)	-	
20 華泰 G6	3,251,653	41,440	(3,293,093)	-	
20 華泰 G7	3,513,690	68,439	-	3,582,129	
20 華泰 G9	4,009,121	75,935	-	4,085,056	
華泰 B2302c	2,802,824	11,082	(2,813,906)	-	
21 華泰 G1	-	4,206,749	(143,200)	4,063,549	
21 華泰 G3	-	5,200,510	(171,000)	5,029,510	
21 華泰 G5	-	4,143,764	(131,200)	4,012,564	
21 華泰 G7	-	2,070,384	(68,000)	2,002,384	
21 華泰 09	-	2,587,835	(86,250)	2,501,585	
華泰 B2404	-	6,515,792	-	6,515,792	
結構性票據 <sup>(1)</sup>	121,154	423,173	(121,154)	423,173	
總計	29,062,749	25,534,470	(21,356,657)	33,240,562	

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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

2022 年 12 月 31 日

名稱	面值 原幣	發行日期	到期日	發行金額 原幣	票面利率
13 華泰 02	人民幣 6,000,000	5/6/2013	5/6/2023	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	19/3/2019	19/3/2022	人民幣 7,000,000	3.68%
19 華泰 G3	人民幣 5,000,000	22/4/2019	22/4/2022	人民幣 5,000,000	3.80%
19 華泰 02	人民幣 5,000,000	27/5/2019	27/5/2022	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	26/3/2020	26/3/2023	人民幣 8,000,000	2.99%
20 華泰 G6	人民幣 3,200,000	18/6/2020	18/6/2023	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	9/12/2020	9/12/2022	人民幣 4,000,000	3.67%
20 華泰 G9	人民幣 4,000,000	9/12/2020	9/12/2023	人民幣 4,000,000	3.79%
19 金融債 01	人民幣 6,000,000	21/8/2019	21/8/2022	人民幣 6,000,000	3.40%
華泰 B2205c	美元 500,000	23/5/2019	23/5/2022	美元 500,000	3.38%
華泰 B2302c	美元 400,000	12/2/2020	12/2/2023	美元 400,000	LIBOR + 0.95%
結構性票據 <sup>(1)</sup>	人民幣 121,154	註釋(1)	註釋(1)	人民幣 121,154	註釋(1)

名稱	2022 年 1 月 1 日			2022 年 12 月 31 日	
	賬面價值 等值人民幣	增加 等值人民幣	減少 等值人民幣	賬面價值 等值人民幣	
13 華泰 02	-	6,483,782	(306,000)	6,177,782	
18 華泰 G2	-	1,045,569	(41,700)	1,003,869	
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	120,552	(4,147,200)	-	
20 華泰 G1	-	8,421,856	(239,200)	8,182,656	
20 華泰 G6	-	3,350,853	(99,200)	3,251,653	
20 華泰 G7	-	3,650,190	(136,500)	3,513,690	
20 華泰 G8	4,008,705	138,095	(4,146,800)	-	
20 華泰 G9	-	4,160,721	(151,600)	4,009,121	
19 金融債 01	6,073,407	130,593	(6,204,000)	-	
華泰 B2205c	3,198,594	401,234	(3,599,828)	-	
華泰 B2302c	-	2,962,099	(159,275)	2,802,824	
結構性票據 <sup>(1)</sup>	615,359	168,102	(662,307)	121,154	
總計	35,372,308	31,228,651	(37,538,210)	29,062,749	

(1) 截止 2023 年 6 月 30 日，人民幣 423.17 百萬元結構性票據將於一年內到期(於 2022 年 12 月 31 日：人民幣 121.15 百萬元)。

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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 2023 年 6 月 30 日

名稱	面值 原幣	起息日	到期日	發行金額 原幣	票面利率
20 華泰 G3	人民幣 3,500,000	29/4/2020	29/4/2025	人民幣 3,500,000	2.90%
20 華泰 G4	人民幣 3,000,000	21/5/2020	21/5/2025	人民幣 3,000,000	3.20%
21 華泰 G1	人民幣 4,000,000	20/1/2021	20/1/2024	人民幣 4,000,000	3.58%
21 華泰 G3	人民幣 5,000,000	26/4/2021	26/4/2024	人民幣 5,000,000	3.42%
21 華泰 G4	人民幣 6,000,000	17/5/2021	17/5/2026	人民幣 6,000,000	3.71%
21 華泰 G5	人民幣 4,000,000	24/5/2021	24/5/2024	人民幣 4,000,000	3.28%
21 華泰 G6	人民幣 2,000,000	24/5/2021	24/5/2026	人民幣 2,000,000	3.63%
21 華泰 G7	人民幣 2,000,000	15/6/2021	15/6/2024	人民幣 2,000,000	3.40%
21 華泰 09	人民幣 2,500,000	21/6/2021	21/6/2024	人民幣 2,500,000	3.45%
21 華泰 11	人民幣 1,500,000	7/9/2021	7/9/2024	人民幣 1,500,000	3.03%
21 華泰 12	人民幣 2,700,000	7/9/2021	7/9/2031	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	14/2/2022	14/2/2025	人民幣 5,000,000	2.79%
22 華泰 G2	人民幣 2,000,000	15/8/2022	15/8/2024	人民幣 2,000,000	2.43%
22 華泰 G3	人民幣 3,000,000	26/8/2022	26/8/2024	人民幣 3,000,000	2.33%
22 華泰 G4	人民幣 2,000,000	5/9/2022	5/9/2025	人民幣 2,000,000	2.52%
22 華泰 G5	人民幣 3,000,000	13/9/2022	13/9/2025	人民幣 3,000,000	2.50%
22 華泰 G6	人民幣 3,600,000	21/11/2022	21/11/2024	人民幣 3,600,000	2.87%
22 華泰 G7	人民幣 1,400,000	21/11/2022	21/11/2027	人民幣 1,400,000	3.18%
22 華泰 G8	人民幣 1,500,000	5/12/2022	5/12/2024	人民幣 1,500,000	2.87%
22 華泰 10	人民幣 2,000,000	12/12/2022	12/12/2025	人民幣 2,000,000	3.35%
22 華泰 11	人民幣 500,000	12/12/2022	12/12/2027	人民幣 500,000	3.49%
22 華泰 12	人民幣 4,000,000	22/12/2022	22/12/2024	人民幣 4,000,000	3.24%
23 華泰 G1	人民幣 4,000,000	10/1/2023	10/1/2025	人民幣 4,000,000	2.92%
23 華泰 G2	人民幣 800,000	16/1/2023	16/1/2025	人民幣 800,000	3.00%
23 華泰 G3	人民幣 2,000,000	16/1/2023	16/1/2028	人民幣 2,000,000	3.48%
23 華泰 G4	人民幣 4,500,000	6/2/2023	6/2/2026	人民幣 4,500,000	3.23%
23 華泰 G5	人民幣 4,000,000	13/2/2023	13/2/2028	人民幣 4,000,000	3.39%
23 華泰 G6	人民幣 1,500,000	27/2/2023	27/2/2026	人民幣 1,500,000	3.14%
23 華泰 G7	人民幣 2,200,000	27/2/2023	27/2/2028	人民幣 2,200,000	3.36%
23 華泰 G8	人民幣 1,700,000	10/5/2023	10/7/2025	人民幣 1,700,000	2.82%
23 華泰 G9	人民幣 700,000	10/5/2023	10/5/2028	人民幣 700,000	3.07%
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 C1	人民幣 9,000,000	29/1/2021	29/1/2026	人民幣 9,000,000	4.50%
華泰 B2404	美元 900,000	9/4/2021	9/4/2024	美元 900,000	1.30%
華泰 B2604	美元 500,000	9/4/2021	9/4/2026	美元 500,000	2.00%
華泰 B2503	美元 1,000,000	3/3/2022	3/3/2025	美元 1,000,000	2.38%
華泰 B2509	人民幣 3,025,000	14/9/2022	14/9/2025	人民幣 3,025,000	2.85%
結構性票據 <sup>(1)</sup>	人民幣 3,117,600	註釋(1)	註釋(1)	人民幣 3,117,600	註釋(1)

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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 2023 年 6 月 30 日 - 續

名稱	2023 年 1 月 1 日 賬面價值 等值人民幣	增加 等值人民幣	減少 等值人民幣	2023 年 6 月 30 日 賬面價值 等值人民幣
20 華泰 G3	3,566,652	51,080	(101,500)	3,516,232
20 華泰 G4	3,057,447	48,281	(96,000)	3,009,728
21 華泰 G1	4,134,487	-	(4,134,487)	-
21 華泰 G3	5,114,197	-	(5,114,197)	-
21 華泰 G4	6,134,805	111,861	(222,600)	6,024,066
21 華泰 G5	4,077,517	-	(4,077,517)	-
21 華泰 G6	2,042,565	36,487	(72,600)	2,006,452
21 華泰 G7	2,036,063	-	(2,036,063)	-
21 華泰 09	2,544,308	-	(2,544,308)	-
21 華泰 11	1,513,806	22,896	-	1,536,702
21 華泰 12	2,730,676	51,111	-	2,781,787
21 華泰 13	2,113,678	34,198	-	2,147,876
21 華泰 14	3,427,081	67,861	-	3,494,942
21 華泰 15	2,212,859	35,496	-	2,248,355
21 華泰 16	1,107,833	21,680	-	1,129,513
22 華泰 G1	5,118,848	70,586	(139,500)	5,049,934
22 華泰 G2	2,017,070	24,710	-	2,041,780
22 華泰 G3	3,022,110	35,642	-	3,057,752
22 華泰 G4	2,014,753	25,470	-	2,040,223
22 華泰 G5	3,019,971	37,955	-	3,057,926
22 華泰 G6	3,610,774	51,844	-	3,662,618
22 華泰 G7	1,404,662	22,287	-	1,426,949
22 華泰 G8	1,502,007	21,811	-	1,523,818
22 華泰 10	2,002,083	33,749	-	2,035,832
22 華泰 11	500,556	8,761	-	509,317
22 華泰 12	3,999,798	65,719	-	4,065,517
23 華泰 G1	-	4,052,399	-	4,052,399
23 華泰 G2	-	810,390	-	810,390
23 華泰 G3	-	2,030,096	-	2,030,096
23 華泰 G4	-	4,554,327	-	4,554,327
23 華泰 G5	-	4,047,799	-	4,047,799
23 華泰 G6	-	1,514,594	-	1,514,594
23 華泰 G7	-	2,222,942	-	2,222,942
23 華泰 G8	-	1,706,955	-	1,706,955
23 華泰 G9	-	703,081	-	703,081
20 華泰 C1	5,027,690	112,363	-	5,140,053
21 華泰 C1	9,368,951	203,360	(405,000)	9,167,311
華泰 B2404	6,280,411	-	(6,280,411)	-
華泰 B2604	3,491,943	130,169	-	3,622,112
華泰 B2503	7,000,146	263,514	-	7,263,660
華泰 B2509	3,041,406	44,223	(42,509)	3,043,120
結構性票據 <sup>(1)</sup>	2,119,436	1,045,779	(8,100)	3,157,115
總計	110,356,589	24,321,476	(25,274,792)	109,403,273

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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 12 月 31 日

名稱	面值 原幣	發行日期	到期日	發行金額 原幣	票面利率
13 華泰 02	人民幣 6,000,000	5/6/2013	5/6/2023	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	26/3/2020	26/3/2023	人民幣 8,000,000	2.99%
20 華泰 G3	人民幣 3,500,000	29/4/2020	29/4/2025	人民幣 3,500,000	2.90%
20 華泰 G4	人民幣 3,000,000	21/5/2020	21/5/2025	人民幣 3,000,000	3.20%
20 華泰 G6	人民幣 3,200,000	18/6/2020	18/6/2023	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	9/12/2020	9/12/2023	人民幣 4,000,000	3.79%
21 華泰 G1	人民幣 4,000,000	20/1/2021	20/1/2024	人民幣 4,000,000	3.58%
21 華泰 G3	人民幣 5,000,000	26/4/2021	26/4/2024	人民幣 5,000,000	3.42%
21 華泰 G4	人民幣 6,000,000	17/5/2021	17/5/2026	人民幣 6,000,000	3.71%
21 華泰 G5	人民幣 4,000,000	24/5/2021	24/5/2024	人民幣 4,000,000	3.28%
21 華泰 G6	人民幣 2,000,000	24/5/2021	24/5/2026	人民幣 2,000,000	3.63%
21 華泰 G7	人民幣 2,000,000	15/6/2021	15/6/2024	人民幣 2,000,000	3.40%
21 華泰 09	人民幣 2,500,000	21/6/2021	21/6/2024	人民幣 2,500,000	3.45%
21 華泰 11	人民幣 1,500,000	7/9/2021	7/9/2024	人民幣 1,500,000	3.03%
21 華泰 12	人民幣 2,700,000	7/9/2021	7/9/2031	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%
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 C1	人民幣 9,000,000	29/1/2021	29/1/2026	人民幣 9,000,000	4.50%
22 華泰 G1	人民幣 5,000,000	14/2/2022	14/2/2025	人民幣 5,000,000	2.79%
22 華泰 G2	人民幣 2,000,000	15/8/2022	15/8/2024	人民幣 2,000,000	2.43%
22 華泰 G3	人民幣 3,000,000	26/8/2022	26/8/2024	人民幣 3,000,000	2.33%
22 華泰 G4	人民幣 2,000,000	5/9/2022	5/9/2025	人民幣 2,000,000	2.52%
22 華泰 G5	人民幣 3,000,000	13/9/2022	13/9/2025	人民幣 3,000,000	2.50%
22 華泰 G6	人民幣 3,600,000	21/11/2022	21/11/2024	人民幣 3,600,000	2.87%
22 華泰 G7	人民幣 1,400,000	21/11/2022	21/11/2027	人民幣 1,400,000	3.18%
22 華泰 G8	人民幣 1,500,000	5/12/2022	5/12/2024	人民幣 1,500,000	2.87%
22 華泰 10	人民幣 2,000,000	12/12/2022	12/12/2025	人民幣 2,000,000	3.35%
22 華泰 11	人民幣 500,000	12/12/2022	12/12/2027	人民幣 500,000	3.49%
22 華泰 12	人民幣 4,000,000	22/12/2022	22/12/2024	人民幣 4,000,000	3.24%
華泰 B2302c	美元 400,000	12/2/2020	12/2/2023	美元 400,000	LIBOR + 0.95%
華泰 B2404	美元 900,000	9/4/2021	9/4/2024	美元 900,000	1.30%
華泰 B2604	美元 500,000	9/4/2021	9/4/2026	美元 500,000	2.00%
華泰 B2503	美元 1,000,000	3/3/2022	3/3/2025	美元 1,000,000	2.38%
華泰 B2509	人民幣 3,025,000	14/9/2022	14/9/2025	人民幣 3,025,000	2.85%
結構性票據 <sup>(1)</sup>	人民幣 2,117,600	註釋(1)	註釋(1)	人民幣 2,117,600	註釋(1)

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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

2022 年 12 月 31 日 - 續

名稱	2022 年 1 月 1 日 賬面價值 等值人民幣	增加 等值人民幣	減少 等值人民幣	2022 年 12 月 31 日 賬面價值 等值人民幣
13 華泰 02	6,176,275	-	(6,176,275)	-
18 華泰 G2	1,003,674	-	(1,003,674)	-
20 華泰 G1	8,180,110	-	(8,180,110)	-
20 華泰 G3	3,566,005	102,147	(101,500)	3,566,652
20 華泰 G4	3,056,894	96,553	(96,000)	3,057,447
20 華泰 G6	3,251,065	-	(3,251,065)	-
20 華泰 G7	3,513,326	-	(3,513,326)	-
20 華泰 G9	4,008,862	-	(4,008,862)	-
21 華泰 G1	4,133,205	144,482	(143,200)	4,134,487
21 華泰 G3	5,112,607	172,590	(171,000)	5,114,197
21 華泰 G4	6,133,706	223,699	(222,600)	6,134,805
21 華泰 G5	4,076,248	132,469	(131,200)	4,077,517
21 華泰 G6	2,042,198	72,967	(72,600)	2,042,565
21 華泰 G7	2,035,430	68,633	(68,000)	2,036,063
21 華泰 09	2,543,518	87,040	(86,250)	2,544,308
21 華泰 11	1,513,470	45,786	(45,450)	1,513,806
21 華泰 12	2,730,519	102,217	(102,060)	2,730,676
21 華泰 13	2,113,536	68,392	(68,250)	2,113,678
21 華泰 14	3,427,022	135,719	(135,660)	3,427,081
21 華泰 15	2,212,710	70,989	(70,840)	2,212,859
21 華泰 16	1,107,814	43,359	(43,340)	1,107,833
20 華泰 C1	5,026,991	224,699	(224,000)	5,027,690
21 華泰 C1	9,367,298	406,653	(405,000)	9,368,951
22 華泰 G1	-	5,118,848	-	5,118,848
22 華泰 G2	-	2,017,070	-	2,017,070
22 華泰 G3	-	3,022,110	-	3,022,110
22 華泰 G4	-	2,014,753	-	2,014,753
22 華泰 G5	-	3,019,971	-	3,019,971
22 華泰 G6	-	3,610,774	-	3,610,774
22 華泰 G7	-	1,404,662	-	1,404,662
22 華泰 G8	-	1,502,007	-	1,502,007
22 華泰 10	-	2,002,083	-	2,002,083
22 華泰 11	-	500,556	-	500,556
22 華泰 12	-	3,999,798	-	3,999,798
華泰 B2302c	2,552,586	-	(2,552,586)	-
華泰 B2404	5,743,247	618,650	(81,486)	6,280,411
華泰 B2604	3,194,403	367,186	(69,646)	3,491,943
華泰 B2503	-	7,000,146	-	7,000,146
華泰 B2509	-	3,041,406	-	3,041,406
結構性票據 <sup>(1)</sup>	143,400	2,138,043	(162,007)	2,119,436
總計	97,966,119	43,576,457	(31,185,987)	110,356,589



## 华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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 2023 年 6 月 30 日止期間，本公司共發行 2 期長期結構性票據 (截至 2022 年 12 月 31 日的年度：6 期)。於 2023 年 6 月 30 日，2 期長期結構性票據將於一年內兌付，因此將其分類至「一年內到期的長期債券」(於 2022 年 12 月 31 日：3 期)，詳見附註 45。

### 47. 長期銀行借款

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
信用銀行借款	657,558	804,903
減：一年內到期的長期信用銀行借款	-	-
總計	<u>657,558</u>	<u>804,903</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：

	2023 年 6 月 30 日		2022 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)	7,356,543	7,356,543	7,356,543	7,356,543
H 股(每股人民幣 1 元)	<u>1,719,046</u>	<u>1,719,046</u>	<u>1,719,046</u>	<u>1,719,046</u>
總計	<u>9,075,589</u>	<u>9,075,589</u>	<u>9,075,589</u>	<u>9,075,589</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。

#### 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。

於 2022 年，本公司完成回購註銷 A 股限制性股票 1,060,973 股，註銷後本公司註冊資本為人民幣 9,075,589,027 元，本公司總股本為 9,075,589,027 股，每股面值為人民幣 1 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

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
永續次級債	19,200,000	19,200,000

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、2022 年 1 月 26 日、2022 年 7 月 11 日及 2022 年 10 月 21 日共發行六期永續次級債，即「21 華泰 Y1」、「21 華泰 Y2」、「21 華泰 Y3」、「22 華泰 Y1」、「22 華泰 Y2」及「22 華泰 Y3」，初始利率分別為 3.85%、4.00%、3.80%、3.49%、3.59% 及 3.20%。永續次級債均無到期日，但本公司有權於永續債第五個付息日或其後任何付息日按面值加應計利息(包括所有遞延支付的利息及其孳息)贖回該債券。

永續次級債票面利率在前 5 個計息年度內保持不變。自第 6 個計息年度起，永續次級債每 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。

## 华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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)

### 49. 其他權益工具 - 續

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。

由於本公司於 2023 年 6 月 30 日舉行的 2022 年度股東大會上宣佈向普通股股東分派股息，本公司已將永續次級債應付利息人民幣 705,430,000 元確認為應付股息。

本公司發行的永續次級債屬於權益性工具，在本集團財務狀況表列示於權益中。

### 50. 庫存股

	2023年1月1日	本期增加額	本期減少額	2023年6月30日
回購股份	835,802	-	-	835,802
A 股限制性股票股權 激勵計劃	366,522	-	(130,514)	236,008
總計	1,202,324	-	(130,514)	1,071,810

2023 年 3 月 30 日，公司董事會和監事會分別審議通過了《關於公司 A 股限制性股票股權激勵計畫第一個限售期解除限售條件成就的議案》。根據公司層面業績條件達成情況和激勵對象個人績效條件達成情況，本次可解除限售的限制性股票數量合計為 14,222,943 股，於 2023 年 4 月 24 日解除限售為無限售條件流通股份上市流通，公司 A 股限制性股票剩餘 30,204,084 股。根據 A 股計劃限制性股票激勵計劃的規則，本次股票回購義務相應減少人民幣 117.34 百萬元。

2023 年 6 月 30 日，根據 2022 年度股東大會決議，按 9,029,384,840 股(扣除存放於本公司回購專用證券帳戶的 A 股股份和擬回購註銷的 A 股股份)為基數，向股東每 10 股派發現金紅利人民幣 4.50 元(含稅)。根據 A 股計劃限制性股票激勵計劃的規則，股票回購義務相應減少人民幣 1317 萬元。

## 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的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虧損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，以彌補證券交易的虧損。

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%提取一般風險儲備金。

本公司的附屬公司根據適用的當地法規規定，按其盈利提取一般儲備。

**51. 儲備 - 續**

**(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工具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終止確認或重分類。該金額根據減值撥備金額進行調整。

**(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虧損中屬於有效套期的部分。

**(f) 外幣報表折算儲備**

外幣報表折算儲備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 2023 年 6 月 30 日股東大會決議，同意本公司以現有的總股本 9,075,589,027 股扣除存放於本公司回購專用證券帳戶的 A 股股份 45,278,495 股和擬回購註銷的 925,692 股，即以 9,029,384,840 股為基數，向股東每 10 股派發現金紅利人民幣 4.50 元(含稅)，現金股利總額為人民幣 40.63 億元。公司的現金股息已於 2023 年 8 月 11 日支付。

**53. 承諾**

**(a) 資本承諾**

於 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日尚未撥備至合併財務報表之資本承諾如下：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
已訂約但未撥備	3,472,951	3,130,051

上述資本承諾主要指本集團的證券承銷承諾。

#### 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。

於 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日，本集團合併結構實體數量分別為 61 個及 61 個，主要為資產管理計劃。於 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日，合併結構實體的總資產分別為人民幣 83,094 百萬元以及人民幣 71,870 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 76,809 百萬元及人民幣 69,505 百萬元。截至 2023 年 6 月 30 日止期間及截至 2022 年 12 月 31 日止年度，本集團並無向該等結構實體提供財務支持。

##### (b) 於本集團發起設立但並未合併的結構實體中的權益

本集團作為結構實體的普通合夥人或管理人，在報告期間對資產管理計劃擁有管理權。除了附註 54(a)所載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。此外，本集團並無向該等結構實體提供財務支持。因此本集團並未合併該等結構實體。

於 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日，上述由本集團管理的未合併結構實體資產總額分別為人民幣 524,733 百萬元和人民幣 528,130 百萬元。於 2023 年 6 月 30 日及 2022 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 6,905 百萬元及人民幣 9,032 百萬元。

截至 2023 年 6 月 30 日止六個月及 2022 年 6 月 30 日止六個月期間，本集團在上述未合併結構實體獲取收益分別為人民幣 459 百萬元及人民幣 47 百萬元。

54. 於結構實體的權益 - 續

(c) 於第三方機構發起設立的結構實體中的權益

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 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日，簡明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虧損風險，載列如下：

	2023 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	
		總計
基金	67,967,839	67,967,839
理財產品	20,161,081	20,161,081
總計	<u>88,128,920</u>	<u>88,128,920</u>
	2022 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	
		總計
基金	43,326,657	43,326,657
理財產品	19,633,246	19,633,246
總計	<u>62,959,903</u>	<u>62,959,903</u>

## 华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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

本集團於日常經營中會涉及索賠、法律訴訟或監管機構調查。於 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日，根據法庭裁決及管理層的判斷，已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 2023 年 6 月 30 日，本集團作為被告方的重大法律訴訟列示如下：

本集團子公司華泰聯合於 2020 年 9 月 25 日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美吉特 ABS 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證券股份有限公司(被告五)承擔連帶賠償責任，案件標的人民幣 5.27 億元及相關利息。上海金融法院分別於 2023 年 4 月 14 日一審判決華泰聯合證券有限責任公司承擔連帶賠償責任，4 月 26 日華泰聯合證券有限責任公司提交上訴申請，一審判決尚未生效。截至 2023 年 6 月 30 日，二審案件已正式立案，尚未開庭。結合一審判決結果以及企業會計準則的相關要求，本集團認為該案件已達到預計負債的確認條件，對該索賠金額計提預計負債人民幣 5.70 億元。

### 56. 股份支付

	附註	2023年1月1日	本期增加額	本期減少額	2023年6月30日
A 股限制性股票激勵					
計劃	(a)	223,981	47,435	(115,775)	155,641
海外附屬公司股份支付	(b)	1,273,641	69,826	-	1,343,467
總計		<u>1,497,622</u>	<u>117,261</u>	<u>(115,775)</u>	<u>1,499,108</u>
	附註	2022年1月1日	本期增加額	本期減少額	2022年12月31日
A 股限制性股票激勵					
計劃	(a)	98,209	125,772	-	223,981
海外附屬公司股份支付	(b)	1,150,320	123,321	-	1,273,641
總計		<u>1,248,529</u>	<u>249,093</u>	<u>-</u>	<u>1,497,622</u>



## 56. 股份支付 - 續

### (a) 本公司股份支付

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 2021 年 3 月 29 日，本公司授予 810 名激勵對象 45,488,000 股 A 股限制性股票，授予價格為每股人民幣 9.10 元。截至 2021 年 3 月 30 日，本公司已累計收到 810 名激勵對象的認購款人民幣 413,940,800 元。2023 年 3 月 30 日，公司董事會和監事會審議並批准了第一批鎖定期結束時可解除限制的限制性股份總數為 14,222,943 股(詳見第 50 項注釋)。

截至 2023 年 6 月 30 日，激勵計劃將在未來分兩期解除限售，激勵計劃的加權平均剩餘合約期限為 1.27 年。

於 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 6 月 30 日，該計劃詳情載列如下：

股数	截至 6 月 30 日止六個月	
	2023 年	2022 年
期初數量	43,788,054	44,463,027
本期授予	-	-
本期行權	(14,222,943)	-
本期失效	(286,719)	(36,000)
本期到期	-	-
期末數量	<u>29,278,392</u>	<u>44,427,027</u>
期末可行權數量	<u>29,278,392</u>	<u>44,427,027</u>

截至 2023 年 6 月 30 日及 2022 年 12 月 31 日，本公司資本公積中確認的累計金額分別為人民幣 155.64 百萬元和人民幣 223.98 百萬元。截至 2023 年 6 月 30 日止六個月及 2022 年 6 月 30 日止六個月期間，確認的費用總額分別為人民幣 47.44 百萬元及人民幣 63.91 百萬元。

截至 2023 年 6 月 30 日止期間，本公司就授予本公司主要管理人員的限制性股份確認以股份為基礎的付款開支人民幣 6.12 百萬元(截至 2022 年 6 月 30 日止期間：人民幣 7.96 百萬元)。

以限制性股票激勵計劃換取的服務公允價值參照股票的公允價值。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。

## 56. 股份支付 - 續

### (b) 附屬公司股份支付

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（「IPO」）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 普通股授予限制性股票激勵持有人。

#### (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、2021 年及 2022 年授予高級管理人員、特定僱員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以大致相等的分期方式於每一年間行權。AssetMark 於 2023 年上半年授予管理人員、特定僱員及獨立董事共計 579,758 份限制性股票單位 (RSUs)。上述限制性股票單位大部分在授予日起的四年內以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管理人員發行了股票增值權。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 日起四年內以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 年至 2022 年期間，AssetMark 再次向部分管理人員授予股票增值權 (SARs)，並計劃在授予日起四年內以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允價值超過執行價的部分(如有)。AssetMark 於 2023 年上半年向部分管理人員授予共計 109,889 份股票增值權 (SARs)，並計劃於授予日起四年內以大致相等的分期方式於每一年間行權。

**56. 股份支付 - 續**

**(b) 附屬公司股份支付 - 續**

AssetMark 于 2023 年上半年向部分高管授予共計 338,907 份以現金結算的股票增值權 (Cash-settled SARs)。以現金結算的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，前提是被授予者繼續受雇且簽有 10 年的合約。行權後，每一個 SARs 將以現金結算，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)。

**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) 本集團聯營公司**

本集團聯營公司詳細資料載於附註 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。

57. 關聯方關係及交易 - 續

(b) 關聯方交易及結餘

除本合併財務報表其他部分披露的情形外，本集團存在以下關聯方交易及結餘：

(i) 本集團與主要股東及其附屬公司之間的交易及結餘：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
期末 / 年末結餘：		
使用權資產	397	482
其他應收款及預付款項	41	41
以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產	100,002	53,275
應付經紀客戶賬款	109,457	52,450
其他應付款項及應計費用	3,211	3,211
已發行的短期債務工具	-	50,000
租賃負債	355	348
	<u>截至 6 月 30 日止六個月</u>	
	<u>2023 年</u>	<u>2022 年</u>
期間內交易：		
投資收益淨額	1,785	2,377
傭金及手續費收入	7,741	6,804
營業開支	199	-

截至 2023 年 6 月 30 日止六個月及 2022 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零元和人民幣 70 百萬元。

截至 2023 年 6 月 30 日止六個月及 2022 年 6 月 30 日止六個月，本集團認購主要股東債券分別為人民幣 99 百萬元和人民幣零元。

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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) 本集團與聯營公司的交易及結餘：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
期末 / 年末結餘：		
現金及銀行結餘	1,118,007	1,855,132
應收款項	131,417	220,638
租賃負債	60,967	64,136
使用權資產	51,969	54,416
應付經紀客戶賬款	46,408	27,882
其他應付款及應計款項	688	4,056
以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產	-	9,875
其他應收款及預付款項	2,438	2,966
拆入資金	1,100,180	500,143
	截至 6 月 30 日止六個月	
	2023 年	2022 年
期間內交易：		
傭金及手續費收入	154,677	187,517
傭金及手續費支出	(197)	-
其他收入及收益	1,095	1,619
業務及管理費	(1)	-
利息收入	12,790	3,820
利息開支	(7,734)	(9,997)
投資收益 (虧損) 淨額	263	(8,938)

截至 2023 年 6 月 30 日止六個月及 2022 年 6 月 30 日止六個月，聯營公司認購本集團企業債分別為人民幣 1,643 百萬元和人民幣零元。

截至 2023 年 6 月 30 日止六個月及 2022 年 6 月 30 日止六個月，聯營公司贖回本集團結構性票據分別為人民幣零元和人民幣 103 百萬元。

**57. 關聯方關係及交易 - 續**

**(b) 關聯方交易及結餘 - 續**

(ii) 本集團與聯營公司的交易及結餘： - 續

截至 2023 年 6 月 30 日止六個月及 2022 年 6 月 30 日止六個月，本集團向聯營公司注資金額分別為人民幣 787 百萬元和人民幣 81 百萬元；本集團對聯營公司撤資金額分別為人民幣 86 百萬元和 88 百萬元。

截至 2023 年 6 月 30 日止六個月及 2022 年 6 月 30 日止六個月，本集團與聯營公司簽訂回購協議分別為人民幣 53,167 百萬元和人民幣 67,979 百萬元。

截至 2023 年 6 月 30 日止六個月及 2022 年 6 月 30 日止六個月，本集團對聯營公司開展拆入資金業務金額分別為人民幣 39,970 百萬元和人民幣 49,350 百萬元。

截至 2023 年 6 月 30 日止六個月及 2022 年 6 月 30 日止六個月，本集團從聯營公司收到的股息金額分別為人民幣 668 百萬元和人民幣 1,005 百萬元。

截至 2023 年 6 月 30 日止六個月及 2022 年 6 月 30 日止六個月，本集團向聯營公司支付租金開支金額分別為人民幣 23 百萬元和人民幣 26 百萬元。

(iii) 本集團與合營企業的交易及結餘：

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
期末 / 年末結餘：		
應收賬款	12,581	7,935
應付經紀客戶賬款	2,375	6,178
	<u>截至 6 月 30 日止六個月</u>	<u>2022 年</u>
本期內交易：		
傭金及手續費收入	4,383	8,250

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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

(iii) 本集團與合營企業的交易及結餘： - 續

截至 2023 年 6 月 30 日止六個月及 2022 年 6 月 30 日止六個月，本集團對合營企業撤資金額分別為人民幣 151 百萬元和人民幣 10 百萬元。

截至 2023 年 6 月 30 日止六個月及 2022 年 6 月 30 日止六個月，本集團從合營企業收到的股息金額分別為人民幣 22 百萬元和人民幣零元。

(iv) 本集團與其他關聯方的交易及結餘

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
期末 / 年末結餘：		
應付經紀客戶賬款	9,899	7,725
	<u>截至 6 月 30 日止六個月</u>	<u>2023 年</u>
本期內交易：		<u>2022 年</u>
傭金及手續費收入	27	62

(c) 主要管理人員酬金

截至 2023 年 6 月 30 日止六個月，本公司董事、監事和高級管理人員從本公司領取的稅前薪酬總額為人民幣 21.66 百萬元(截至 2022 年 6 月 30 日止六個月：人民幣 30.90 百萬元)。截至 2023 年 6 月 30 日止六個月，本公司為董事、監事及高級管理人員支付的養老保險金額為人民幣 0.35 百萬元 (截至 2022 年 6 月 30 日止六個月：人民幣 0.32 百萬元)。

截至 2023 年 6 月 30 日止六個月及 2022 年 6 月 30 日止六個月，本公司向董事、監事和高級管理人員支付以往年度稅前延期薪酬為人民幣 14.41 百萬元和人民幣 7.60 百萬元。

薪酬總額計入「僱員成本」(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附屬公司的海外業務。
- 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，分佔聯營公司及合營企業利潤，運營資金利息開支以及中後臺的成本和費用。

### (a) 業務分部

截至 2023 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	9,841,278	6,081,523	1,903,191	3,926,125	1,054,887	22,807,004
- 分部間	25,614	19,731	-	-	1,305,829	1,351,174
其他收入及收益	875,106	(153,185)	70,732	2,166,202	219,461	3,178,316
分部收入及其他收入	10,741,998	5,948,069	1,973,923	6,092,327	2,580,177	27,336,494
分部開支	(6,877,949)	(4,014,967)	(781,979)	(5,286,316)	(2,626,613)	(19,587,824)
分部經營利潤	3,864,049	1,933,102	1,191,944	806,011	(46,436)	7,748,670
分佔聯營公司及合營企業 利潤/(虧損)	-	-	(189,908)	-	1,437,821	1,247,913
所得稅稅前利潤	3,864,049	1,933,102	1,002,036	806,011	1,391,385	8,996,583
利息收入	5,315,389	651,237	71,863	549,343	833,192	7,421,024
利息開支	(2,286,679)	(1,842,572)	(243,869)	(1,568,501)	(848,816)	(6,790,437)
折舊和攤銷費用	(284,971)	(101,165)	(44,184)	(214,248)	(281,677)	(926,245)
金融資產減值虧損撥回						
撥備淨額	487,274	10,692	(142)	(56,754)	(23,058)	418,012
本期非流動分部資產添置	63,716	31,061	14,131	103,300	184,655	396,863
2023 年 6 月 30 日						
分部資產	288,829,008	343,458,581	41,045,442	179,241,398	192,921,665	1,045,496,094
分部負債	(279,194,019)	(336,218,297)	(18,477,032)	(161,536,523)	(79,556,873)	(874,982,744)



华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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 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
分部收入及其他收入	12,395,626	3,786,093	893,317	4,184,585	2,318,972	23,578,593
分部開支	(8,007,493)	(2,977,089)	(549,527)	(2,926,501)	(2,822,819)	(17,283,429)
分部經營利潤/(虧損)	4,388,133	809,004	343,790	1,258,084	(503,847)	6,295,164
分佔聯營公司及合營企業利潤	-	-	(687,163)	-	1,150,636	463,473
所得稅稅前利潤/(虧損)	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
利息開支	(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)
其他資產減值虧損撥回淨額	-	-	-	-	-	-
金融資產減值虧損撥回/撥備淨額	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 12 月 31 日						
分部資產(經重述)	282,826,740	338,717,046	39,880,993	160,618,094	189,193,383	1,011,236,256
分部負債(經重述)	(278,153,206)	(333,267,313)	(18,205,051)	(144,243,708)	(69,510,368)	(843,379,646)

分部收入、損益、資產及負債對賬：

	截至 6 月 30 日止六個月	
	2023 年	2022 年
<b>收入</b>		
分部收入、其他收入及收益總額	27,336,494	23,578,593
分部間收入抵銷	(1,383,940)	(99,571)
合併收入、其他收入及收益總額	25,952,554	23,479,022
<b>利潤</b>		
分部所得稅稅前利潤總額	8,996,583	6,758,637
分部間利潤抵銷	(999,155)	15,359
合併所得稅稅前利潤	7,997,428	6,773,996

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日 (經重述)
<b>資產</b>		
分部總資產	1,045,496,094	1,011,236,256
分部間資產抵銷	(158,425,836)	(164,665,266)
合併總資產	<u>887,070,258</u>	<u>846,570,990</u>
<b>負債</b>		
分部總負債	(874,982,744)	(843,379,646)
分部間負債抵銷	158,425,836	164,665,266
合併總負債	<u>(716,556,908)</u>	<u>(678,714,380)</u>

截至 2023 年 6 月 30 日及 2022 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、於聯營公司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；如屬於聯營公司和合營企業權益，則按其營運地劃分。

	截至 2023 年 6 月 30 日止六個月			截至 2022 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	18,880,879	3,926,125	22,807,004	16,582,825	3,861,204	20,444,029
其他收入及收益	979,348	2,166,202	3,145,550	2,711,612	323,381	3,034,993
總計	<u>19,860,227</u>	<u>6,092,327</u>	<u>25,952,554</u>	<u>19,294,437</u>	<u>4,184,585</u>	<u>23,479,022</u>
	2023 年 6 月 30 日			2022 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>28,429,188</u>	<u>10,232,277</u>	<u>38,661,465</u>	<u>27,561,899</u>	<u>10,139,539</u>	<u>37,701,438</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

為了提高本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，保障本集團各項業務持續、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、本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，本集團於經營層面制定了《風險控制指標管理辦法》、《附屬公司風險管理辦法(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，本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序來識別和分析此等風險，並結合實際情況設定適當的風險指標、風險限額及風險內部控制流程，通過信息系統支持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僱員的共同責任，本集團通過培訓和考核的方式，促進全體僱員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、分支機構及附屬公司。

**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**

董事會承擔公司全面風險管理的最終責任。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管理層在風險管理方面的履職盡責情況並督促整改。管理層根據董事會的授權和批准，結合本公司經營目標，具體負責實施風險管理工作，並下設風險控制委員會。本公司設首席風險官，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，對管理層和本公司整體風險負責，牽頭管理市場風險、信用風險和操作風險。本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；本公司其他各部門、分支機構及附屬公司對各自條線的風險管理工作負責，落實本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。稽查部負責對本公司風險管理流程的有效性與執行情況進行稽核檢查，並牽頭對本公司全面風險管理體系進行評估。

**(b) 信用風險管理**

信用風險是指因融資方、發行人或交易對手等違約導致損失的風險。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，將境內外子公司納入統一管理範圍，實現信用風險管理全覆蓋。

本集團面臨的信用風險主要包括三類：一是在融資類業務中，融資方違約致使借出資券及息費遭受虧損的風險；二是在債券投資業務中，發行人違約造成的風險；三是在交易類業務(含擔保交收類業務)中，交易對手方出現違約，導致資產遭受虧損的風險。

融資類業務信用風險管理方面，公司執行嚴格的風險客戶與風險資產持續監控、及時化解的管控措施，強化動態的逆週期調節機制，建立市場系統性風險監測及應對機制，加強相關業務貸後管理，以控制業務常規風險、防範底線風險、靈活調節業務結構。

發行人信用風險管理方面，公司建立信用債發行人統一監控平臺，實現集團各業務信用債標的的統一監控，同時公司深化信用債全流程風險管控，建立常態化的風險券篩查處置機制，持續強化持倉債券監控預警機制，提升集團發行人信用風險防控成效。

59. 金融工具及風險管理 - 續

(b) 信用風險管理 - 續

交易對手信用風險管理方面，公司持續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，對於擔保交收類業務，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管控能力。

公司持續優化完善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强有力的風控保障。報告期內，公司未發生重大信用風險事件，各項業務平穩運行。

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，以分析違約風險程度，並將證券抵押借貸資產劃分三個階段，確定信用虧損撥備，具體如下：

描述	預期信用虧損階段	
履約比高於平倉綫且未發生逾期	未來 12 個月預期信用虧損	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虧損 未發生信用減值	第二階段
履約比低於平倉綫但不低於 100%、未發生逾期		
履約比低於平倉綫但不低於 100%、逾期天數不超過 90 天		
履約比低於 100%	整個存續期預期信用虧損 已發生信用減值	第三階段
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		

本集團為不同債務人及資產設置不同的平倉綫，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撥備。於 2023 年 6 月 30 日，第一階段風險合約減值損失率為 0.37%，無納入第二階段的風險合約(於 2022 年 12 月 31 日，第一階段風險合約減值損失率為 0.42%，無納入第二階段的風險合約)。

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，計提相應的信用減值撥備，減值損失率為 10% - 100% 不等。

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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) 最大信用風險敞口

本集團納入預期信用虧損減值評估範圍的金融工具的信用風險敞口按虧損所處階段劃分如下：

減值虧損撥備	2023 年 6 月 30 日			總計
	未來 12 個月 預期信用虧損	整個存續期 預期信用虧損 (未發生信用減值)	整個存續期 預期信用虧損 (已發生信用減值)	
銀行結餘	412	-	-	412
融出資金	507,341	862,732	136,561	1,506,634
買入返售金融資產	22,141	-	650,444	672,585
應收款項	-	73,944	1,800	75,744
以攤銷成本計量的債務工具 以公允價值計量且其變動計入 其他綜合收益的債務工具	5,139	-	-	5,139
其他應收款項及應收利息	63,318	11,217	-	74,535
總計	1,604	43,505	779,695	824,804
	599,955	991,398	1,568,500	3,159,853

減值虧損撥備	2022 年 12 月 31 日			總計
	未來 12 個月 預期信用虧損	整個存續期 預期信用虧損 (未發生信用減值)	整個存續期 預期信用虧損 (已發生信用減值)	
銀行結餘	833	-	-	833
融出資金	653,660	745,959	126,737	1,526,356
買入返售金融資產	28,128	-	1,110,285	1,138,413
應收款項	-	66,131	2,400	68,531
以攤銷成本計量的債務工具 以公允價值計量且其變動計入 其他綜合收益的債務工具	5,132	-	-	5,132
其他應收款項及應收利息	30,455	-	-	30,455
總計	1,224	25,062	775,627	801,913
	719,432	837,152	2,015,049	3,571,633

## 59. 金融工具及風險管理 - 續

### (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信息化水平，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

利率風險是指本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、長期債券及長期銀行借款等。

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量不變的假設下，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。

#### (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。本集團除了境外附屬公司持有以港幣或美元為記賬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附屬公司所購買的外幣金融資產。對於不是以記賬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、應付款項及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平。

**59. 金融工具及風險管理 - 續**

**(d) 市場風險管理 - 續**

**(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**

操作風險是指內部程序、人員、系統或外部事件不完善或有問題導致內部程序效率低下、人員操作失誤或未能嚴格執行既定程序而給本公司造成虧損的風險。風險管理部是本公司操作風險的牽頭管理部門，各部門、分支機構、子公司對各自條線的操作風險進行主動管理並對管理效果負責，承擔本組織操作風險管理的第一責任。本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。本公司運用風險與控制自我評估、關鍵風險指標監測、虧損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、原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本公司相關工作要求，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，全面梳理優化了本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，以保障本公司內控措施的到位以及風險管理的有效性。此外，本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。

**(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。



## 59. 金融工具及風險管理 - 續

### (f) 資本管理 - 續

證監會分別於 2020 年 1 月 23 日和 2020 年 3 月 20 日頒佈了《證券公司風險控制指標計算標準規定》修訂本及《證券公司風險控制指標管理辦法》修訂本，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撥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，本公司密切監測上述比率以確保其符合相關的資本要求。

本集團若干附屬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 2023 年 6 月 30 日止六個月期間及截至 2022 年 12 月 31 日止年度，該等附屬公司均遵守資本規定。

### (g) 金融資產轉讓

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，因此並未於簡明合併財務狀況表終止確認此類金融資產。

本集團與若干對手方訂立賣出回購協議，賣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及以攤銷成本計量的債務工具。賣出回購協議是指如下交易，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，因此並未於簡明合併財務狀況表終止確認此類金融資產。

59. 金融工具及風險管理 - 續

(g) 金融資產轉讓 - 續

本集團與客戶訂立融出證券協議，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。儘管客戶可於協議期間出售相關證券，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，因此並未於簡明合併財務狀況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：

2023 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		總計
	賣出回購協議	融出證券	
轉讓資產的賬面價值	4,038,536	2,326,129	6,364,665
相關負債的賬面價值	(3,694,923)	-	(3,694,923)
淨頭寸	343,613	2,326,129	2,669,742

2022 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		以攤銷成本計量 的債務工具		總計
	賣出回購協議	融出證券	賣出回購協議		
轉讓資產的賬面價值	4,514,082	2,902,260	50,458		7,466,800
相關負債的賬面價值	(4,125,761)	-	(48,486)		(4,174,247)
淨頭寸	388,321	2,902,260	1,972		3,292,553

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。

**60. 公允價值資料 - 續**

**(a) 金融工具公允價值 - 續**

**(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有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**

倘一項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其他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貼現法進行評估。

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銷成本計量的債務工具、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：

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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其他金融工具之公允價值 - 續

賬面價值

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
<b>金融資產</b>		
-以攤銷成本計量的債務工具	<u>50,322,360</u>	<u>48,552,570</u>
<b>金融負債</b>		
-已發行的短期債務工具	(26,762,350)	(25,772,604)
-長期債券	<u>(142,643,835)</u>	<u>(139,419,338)</u>
總計	<u>(169,406,185)</u>	<u>(165,191,942)</u>

公允價值

	2023 年 6 月 30 日			
	第一層級	第二層級	第三層級	總計
<b>金融資產</b>				
-以攤銷成本計量的債務工具	<u>-</u>	<u>51,123,655</u>	<u>-</u>	<u>51,123,655</u>
<b>金融負債</b>				
-已發行的短期債務工具	-	(10,085,305)	(16,687,552)	(26,772,857)
-長期債券	-	<u>(120,239,106)</u>	<u>(24,024,973)</u>	<u>(144,264,079)</u>
總計	<u>-</u>	<u>(130,324,411)</u>	<u>(40,712,525)</u>	<u>(171,036,936)</u>
	2022 年 12 月 31 日			
	第一層級	第二層級	第三層級	總計
<b>金融資產</b>				
-以攤銷成本計量的債務工具	<u>-</u>	<u>48,923,303</u>	<u>-</u>	<u>48,923,303</u>
<b>金融負債</b>				
-已發行的短期債務工具	-	(9,133,900)	(16,634,558)	(25,768,458)
-長期債券	-	<u>(115,183,301)</u>	<u>(24,857,323)</u>	<u>(140,040,624)</u>
總計	<u>-</u>	<u>(124,317,201)</u>	<u>(41,491,881)</u>	<u>(165,809,082)</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，本公司董事認為簡明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。

60. 公允價值資料 - 續

(c) 按公允價值列賬的金融工具之公允價值

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。

	2023 年 6 月 30 日			
	第一層級	第二層級	第三層級	總計
<b>資產</b>				
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	1,320,476	173,199,827	196,527	174,716,830
- 權益證券	106,711,057	9,674	14,712,201	121,432,932
- 基金	67,829,885	1,086,717	106,538	69,023,140
- 理財產品	-	20,782,563	-	20,782,563
- 貸款及墊款	-	-	2,725,057	2,725,057
以公允價值計量且其變動計入 其他綜合收益的債務工具	-	14,805,186	589,039	15,394,225
以公允價值計量且其變動計入 其他綜合收益的權益工具	-	163,721	107,057	270,778
其他投資				
- 於合營企業的未上市投資	-	-	539,353	539,353
衍生金融資產	145,089	11,014,964	3,879,887	15,039,940
總計	<u>176,006,507</u>	<u>221,062,652</u>	<u>22,855,659</u>	<u>419,924,818</u>
<b>負債</b>				
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	(773,487)	(27,659,382)	-	(28,432,869)
- 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	(199,925)	(2,144,523)	(11,945,107)	(14,289,555)
衍生金融負債	(126,687)	(10,364,041)	(3,433,122)	(13,923,850)
總計	<u>(1,100,099)</u>	<u>(40,167,946)</u>	<u>(15,378,229)</u>	<u>(56,646,274)</u>

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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) 按公允價值列賬的金融工具之公允價值 - 續

	2022 年 12 月 31 日			總計
	第一層級	第二層級	第三層級	
<b>資產</b>				
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	1,731,297	172,159,442	314,711	174,205,450
- 權益證券	90,450,244	48,204	16,878,323	107,376,771
- 基金	44,567,500	869,420	106,443	45,543,363
- 理財產品	-	20,575,405	-	20,575,405
- 貸款及墊款	-	-	3,103,556	3,103,556
以公允價值計量且其變動計入 其他綜合收益的債務工具	-	9,826,506	677,873	10,504,379
以公允價值計量且其變動計入 其他綜合收益的權益工具	-	153,793	87,794	241,587
其他投資				
- 於合營企業的未上市投資	-	-	741,464	741,464
衍生金融資產	109,080	12,443,939	3,235,282	15,788,301
總計	<u>136,858,121</u>	<u>216,076,709</u>	<u>25,145,446</u>	<u>378,080,276</u>
<b>負債</b>				
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	(1,275,845)	(35,231,451)	-	(36,507,296)
- 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	(315,303)	(2,092,813)	(9,660,147)	(12,068,263)
衍生金融負債	(130,351)	(8,226,125)	(1,281,649)	(9,638,125)
總計	<u>(1,721,499)</u>	<u>(45,550,389)</u>	<u>(10,941,796)</u>	<u>(58,213,684)</u>

截至 2023 年 6 月 30 日止六個月期間，本集團無由第二層級轉入第一層級的以公允價值計量的金融資產(截至 2022 年 12 月 31 日止年度：無)。

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至 2023 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) 按公允價值列賬的金融工具之公允價值 - 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當期損益的債務證券	第二層級	基於合約金額估算的未來現金流，並按反映債券信用風險的利率貼現。
- 以公允價值計量且其變動計入當期損益的權益證券	第二層級	最近市場成交價。
- 以公允價值計量且其變動計入當期損益的基金	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當期損益的理財產品	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	基於合約金額估算的未來現金流，並按反映債券信用風險的利率貼現。
- 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	現金流量貼現法。未來現金流根據期末可觀察到的遠期匯率及合約利率估計並按反映各交易對手信用風險貼現率進行貼現； 按標的股票、債券的權益回報與對手協議約定的固定收入之差計算。
- 交易性金融負債	第二層級	基於合約金額估算的未來現金流，並按反映債務工具信用風險的利率貼現。
- 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。

华泰证券股份有限公司

简明合并财务报表附註

截至2023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) 按公允價值列賬的金融工具之公允價值 - 續

(ii) 第三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	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
- 貸款、墊款及以公允價值計量且其變動計入當期損益的債務證券	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
- 以公允價值計量且其變動計入當期損益的未上市權益證券	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 布萊克-斯科爾斯期權定價模型	財務特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 財務特征如可比基金的價格波動率及流動性折扣率	預計現金流越高，公允價值越高 折扣率越高，公允價值越低 市場乘數越高，公允價值越高 價格波動率越高，折扣率越高 折扣率越高，公允價值越低
- 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	財務特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	預計現金流越高，公允價值越高 折扣率越高，公允價值越低 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 蒙特卡洛期權定價模型	標的資產的價格波動率	預計現金流越高，公允價值越高 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	財務特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 市場乘數越高，公允價值越高 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	布萊克-斯科爾斯期權定價模型 蒙特卡洛期權定價模型	標的資產的價格波動率	預計現金流越高，公允價值越高 價格波動率越高，對公允價值影響越大



华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至2023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) 按公允價值列賬的金融工具之公允價值 - 續

(ii) 第三層級金融工具的估值方法 - 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 且其變動計入 當期損益 的金融資產	其他投資	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	以公允價值計量 且其變動計入 當期損益 的金融負債	以公允價值計量 且其變動計入 當期損益 的金融負債	衍生金融負債	總計
2023年1月1日	20,403,033	741,464	677,873	87,794	(9,660,147)	(1,281,649)	(10,941,796)	
轉入	18,283	-	-	-	-	-	-	
轉出	(9,226,888)	-	-	-	-	-	-	
當期收益或虧損	593,575	(202,111)	19,210	-	505,796	(2,266,569)	(1,760,773)	
於其他綜合收益確認的 公允價值變動	-	-	(11,163)	17,863	-	(60,040)	(60,040)	
增加	6,964,664	-	107,741	1,400	(7,697,110)	(351,978)	(8,049,088)	
出售	(840,047)	-	-	-	-	275,364	275,364	
結算	(172,297)	-	(204,622)	-	4,906,354	251,750	5,158,104	
2023年6月30日	17,740,323	539,353	589,039	107,057	(11,945,107)	(3,433,122)	(15,378,229)	
計入報告期末所持資產/ 負債本期收益或虧損	269,262	(202,111)	-	-	(19,614)	(1,908,079)	(1,927,693)	
總額								722,430

华泰证券股份有限公司

簡明合併財務報表附註

截至2023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) 按公允價值列賬的金融工具之公允價值 - 續

(ii) 第三層級金融工具的估值方法 - 續

	以公允價值計量 且其變動計入 當期損益 的金融資產	其他投資	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	衍生金融資產	總計	以公允價值計量 且其變動計入 當期損益 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	144,869	-	-	-	-	144,869	-	-	-
轉出	-	-	-	-	-	-	-	-	-
本年收益或虧損 於其他綜合收益確認的 公允價值變動	2,150,416	(81,825)	186,181	-	2,192,347	4,447,119	39,004	(804,995)	(765,991)
增加	13,297,335	-	(18,757)	(812)	-	(19,569)	-	56,828	56,828
出售	(1,048,901)	-	367,758	-	1,053	13,666,146	(6,208,983)	(40,364)	(6,249,347)
結算	(2,373,933)	-	(766,834)	-	(12)	(1,048,913)	-	50,200	50,200
2022年12月31日	20,403,033	741,464	677,873	87,794	3,235,282	25,145,446	(9,660,147)	(1,281,649)	(10,941,796)
計入報告期末所持資產/ 負債本期收益或虧損 總額	(281,731)	(81,825)	-	-	1,063,425	699,869	(619,585)	(1,252,215)	(1,871,800)

截至2023年6月30日止期間，本集團持有人民幣18百萬元以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產因摘牌等原因，未應用可觀察市場報價，而使用估值技術確定其公允價值，已從第一層級重分類至第三層級(截至2022年12月31日：人民幣145百萬元)。

截至2023年6月30日止期間，本集團持有人民幣9,227百萬元以公允價值計量且其變動計入當期損益的金融資產因解除限售等原因，未使用估值技術，而應用可觀察市場報價確定其公允價值，已從第三層級重分類至第一層級(截至2022年12月31日：無)。

**61. 報告日期後事項**

**(a) 發行債券**

於 2023 年 6 月 30 日後至本報告日期，本公司發行公司債 1 期，規模為人民幣 20 億元，年利率為 2.64%；

於 2023 年 6 月 30 日後至本報告日期，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發行中期票據 23 筆，累計規模為美元 3.87 億元，港幣 4.29 億元，年利率範圍為 0.00%至 6.17%。

於 2023 年 6 月 30 日後至本報告日期，本集團境外間接全資子公司 Pioneer Reward Limited 發行中期票據 1 筆，規模為美元 8.00 億元，年利率為 5.25%。

**(b) 於會計期間後的提供債務擔保形成的或有負債及其財務影響**

於 2023 年 8 月，本公司作為擔保人與香港上海滙豐銀行有限公司（作為受託人）簽署擔保協定，為本集團子公司 Pioneer Reward Limited 發行的 8 億美元債券提供無條件及不可撤銷的保證擔保。擔保金額不超過上述債券本金、利息及其他相關費用。

**(c) 收購子公司的少數股東權益**

2023 年 8 月，本公司通過北京產權交易所摘牌方式受讓了華泰聯合證券有限責任公司（以下簡稱“華泰聯合”）另一股東中國東方航空集團有限公司所持有的華泰聯合 0.0812%股權。截至本報告出具日，華泰聯合的股權變更涉及的工商變更登記等手續尚在辦理。

---