

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



海通證券股份有限公司
HAITONG SECURITIES CO., LTD.*

(在中華人民共和國註冊成立之股份有限公司)

(股份代號：6837)

公告

2024年度日常關聯／連交易預計 及 建議本公司2024年度自營投資業務配置規模預計

海通證券股份有限公司（「本公司」及其附屬公司（統稱「本集團」）董事（「董事」）會（「董事會」）謹此宣佈：

一、2024年度日常關聯／連交易預計

本公司經中國證券監督管理委員會批准從事證券業務，開展證券及其他金融產品的交易和中介服務，交易對手和服務對象也包括公司的關聯方／關連人士。為做好關聯／連交易管理和信息披露工作，根據《中華人民共和國公司法》《上市公司治理準則》《上海證券交易所股票上市規則》（《上交所上市規則》）《上海證券交易所上市公司自律監管指引第5號—交易與關聯交易》《香港聯合交易所有限公司證券上市規則》（《香港上市規則》）及其他有關法律法規的規定，以及《公司章程》和《公司關聯交易管理辦法》的要求，結合公司日常經營和業務開展的需要，本公司對2024年日常關聯／連交易進行了預計。

（一）關聯／連交易履行的審議程序

1. 董事會的審議和表決情況

本公司於2024年3月28日召開的第八屆董事會第四次會議審議通過了《關於預計公司2024年度日常關聯／連交易的議案》。

2. 獨立董事專門會議審議和表決情況

本公司於2024年3月27日召開獨立董事專門會議，全體獨立非執行董事審議通過了《關於預計公司2024年度日常關聯／連交易的議案》。獨立非執行董事認為：(1)預計2024年度各項關聯／連交易為本公司在證券市場上提供的公開服務或交易，為本公司日常經營業務，交易以公允價格執行，不存在損害本公司及中小股東利益的情況；(2)相關業務的開展有利於促進本公司的業務增長，符合本公司實際業務需要，有利於本公司的長遠發展；及(3)有關的關聯交易情況應根據《上交所上市規則》在本公司的相關定期報告中予以披露。

本議案尚需提交本公司股東週年大會（「股東週年大會」）審議批准。股東週年大會審議該日常關聯／連交易議案時，關聯股東將迴避表決。

(二) 本公司2023年日常關聯／連交易執行情況

1. 《香港上市規則》項下的持續性關連交易

本公司於2022年12月30日與上海國盛（集團）有限公司（「上海國盛集團」）及其聯繫人簽署《上海國盛（集團）有限公司與海通證券股份有限公司之關聯交易／關連交易框架協議》（「新框架協議」）。新框架協議明確關連交易及相關服務的範圍、定價基準、管控流程等內容，並對2023至2025年持續關連交易的年度上限進行預計。

上述新框架協議經第七屆董事會第三十四次會議（臨時會議）審議通過。關聯／連董事屠旋旋先生已根據有關法律法規及公司內部規定迴避表決，本公司獨立非執行董事已針對新框架協議的簽署發表事前認可意見和獨立意見。相關董事會審議結果及新框架協議簽署公告均按照上海證券交易所及香港聯合交易所的相關要求進行披露。

2023年度，本集團與上海國盛集團及其聯繫人之間涉及證券和金融產品交易及證券和金融服務相關的持續關連交易執行情況如下：

單位：人民幣萬元

交易內容	2023年度 預計交易 上限	2023年度 實際發生 金額
證券和金融產品交易		
流入 ⁽¹⁾	250,000.00	12,261.22
流出 ⁽²⁾	210,000.00	333.06
證券和金融服務		
產生收入	10,000.00	950.59
支付費用	3,000.00	147.22

註：(1) 「流入」是指本集團從證券和金融產品交易產生的現金流入總額，包括固定收益產品和權益類產品銷售、固定收益產品相關的衍生產品所得利息及通過融資交易的借入／購回所產生的現金流入總額。

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

本公司聘請的境外審計機構羅兵咸永道會計師事務所已就上述持續關連交易執行審核程序，並向董事會發出鑑證報告確認：(1)無注意到任何事項令其相信該等已披露的持續關連交易未獲董事會批准；(2)就本集團提供貨品或服務所涉及的交易，並無注意到任何事項令其相信該等交易在各重大方面沒有按照本集團的定價政策進行；(3)並無注意到任何事項令其相信該等交易在各重大方面沒有根據有關該等交易的協議進行；及(4)就上述列表所載持續關連交易的總金額而言，並無注意到任何事項令其相信該等持續關連交易的金額超逾本公司訂立的全年上限。

獨立非執行董事已審核上述持續關連交易，並確認：(1)於本集團之日常業務中訂立；(2)按一般商業條款或更佳條款進行；及(3)根據有關交易的協議進行，其條款公平合理，並符合股東的整體利益。

2. 《上交所上市規則》項下的日常關聯交易

(1) 與上海國盛(集團)有限公司及上海國盛集團資產有限公司的關聯交易

單位：人民幣萬元

交易內容	2023年 發生金額	佔同類交易 金額的比例	備註
手續費及佣金 淨收入	181.03	0.02%	向關聯人收取的資產管理手續費及佣金收入
手續費及佣金 淨收入	37.93	0.00%	向關聯人收取的證券交易手續費及佣金收入
利息淨收入	47.74	0.01%	關聯人保證金產生的利息淨收入
衍生金融工具 交易淨損益 (註)	120.09	0.34%	報告期內，名義本金發生額人民幣1.09億元
			期末名義本金餘額人民幣0.52億元

註：關聯人作為交易對手方與公司進行衍生品交易產生的已實現及未實現投資收益，虧損以負值列示。

單位：人民幣萬元

往來項目	截至 2023/12/31 餘額	佔同類交易 金額的比例	備註
應收賬款	49.49	0.00%	應向關聯人收取的各項服務手續費餘額
應付賬款	5,161.44	0.34%	應付關聯人衍生金融工具保證金餘額
代理買賣證券款	0.02	0.00%	關聯人存放公司的客戶保證金餘額
衍生金融資產	159.11	0.07%	與關聯人開展衍生品交易產生的衍生金融資產餘額

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

單位：人民幣萬元

交易內容	2023年 發生金額	佔同類交易 金額的比例	備註
手續費及 佣金收入	17,850.97	1.91%	向關聯人收取的資產管理業務收入、銷售服務費收入、投資諮詢服務費收入等
手續費及 佣金收入	13.21	0.00%	向關聯人收取的證券交易手續費及佣金收入
保證金利息收入	51.52	0.01%	關聯人保證金產生的利息收入
銀行存款 利息收入	3,553.55	0.90%	關聯人銀行存款產生的利息收入
信用拆借交易 利息支出	155.68	0.45%	報告期內，信用拆借交易規模人民幣80億元 期限：1-7天
債券借貸交易 利息支出	94.13	0.08%	報告期內，債券借貸交易規模人民幣36.5億元 期限：1天-11個月
回購交易 利息支出	16.67	0.01%	報告期內，回購交易規模人民幣13億元 期限：1-7天
黃金租賃 利息支出	3,073.71	2.58%	報告期內，黃金租賃規模人民幣47.4億元 期限：356-365天
銀行貸款 利息支出	3,010.66	0.76%	向關聯人支付的銀行貸款利息支出
業務及管理費	54.29	0.00%	向關聯人支付的基金銷售服務費等支出
衍生金融工具 交易淨損益 (註)	-639.97	-1.82%	報告期內，名義本金發生額人民幣771.32億元 期末名義本金餘額人民幣107.19億元

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

單位：人民幣萬元

往來項目	截至 2023/12/31 餘額	佔同類交易 金額的比例	備註
銀行存款	362,119.50	2.64%	公司存放關聯人的銀行存款餘額
應收賬款	1,305.31	0.11%	應收關聯人各項業務報酬及預付業務保證金餘額等
衍生金融資產	1,242.82	0.55%	與關聯人進行衍生品交易產生的衍生金融資產餘額
代理買賣證券款	4,561.76	0.04%	關聯人存放公司的客戶保證金餘額
短期借款	181,995.34	5.86%	關聯人向公司發放的短期借款餘額
長期借款	32,077.24	0.76%	關聯人向公司發放的長期借款餘額
應付賬款	6.14	0.00%	應付關聯人各項業務服務費及待付業務保證金餘額
賣出回購金融資產	483,528.24	4.30%	與關聯人進行黃金租賃業務產生的賣出回購金融資產餘額
衍生金融負債	1,336.14	1.12%	與關聯人進行衍生品交易產生的衍生金融負債餘額
交易性金融負債	286.93	0.01%	與關聯人進行衍生品交易產生的交易性金融負債餘額

部分證券公司等關聯法人作為合格交易對手方與公司開展現券買賣交易，報告期內累計成交金額人民幣399.58億元。

(三) 本次日常關聯／連交易預計金額和類別

本公司對2024年度及至召開2024年度股東週年大會期間可能發生的日常關聯／連交易進行了預計。

1. 上海國盛集團及其聯繫人

依據《香港上市規則》《上交所上市規則》，本公司第七屆董事會第三十四次會議（臨時會議）批准本公司與上海國盛集團及其聯繫人簽訂《上海國盛（集團）有限公司與海通證券股份有限公司之關聯交易／關連交易框架協議》，本公司與上海國盛集團於2022年12月30日簽署上述協議，對2023至2025年持續關連／聯交易的上限進行預計。

交易類別	交易內容	預計交易上限及說明
證券和金融 產品服務	根據2022年12月30日 簽署的框架協議 執行	根據2022年12月30日 簽署的框架協議執 行，交易金額控制 在協議約定的2024 年度上限內。
證券和金融 產品交易	根據2022年12月30日 簽署的框架協議 執行	根據2022年12月30日 簽署的框架協議執 行，交易金額控制 在協議約定的2024 年度上限內。

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

交易類別	交易內容	預計交易上限及說明
證券和金融 產品服務	為關聯方提供證券、期貨經紀服務；向關聯方出租交易席位；向關聯方提供定向資產管理服務；為關聯方提供資產託管與運營外包服務；在關聯方銀行存款及存款利息；關聯方提供第三方資金存管服務；代銷關聯方金融產品；為關聯方提供承銷、保薦及財務顧問服務；為關聯方提供股票質押及融資融券服務；向關聯方提供投資諮詢服務；關聯方為公司提供銀行授信、借款等服務；向關聯方提供融資租賃業務；向關聯方支付股利；與關聯人共同投資。	因業務的發生及規模的不確定性，以實際發生數計算。
證券和金融 產品交易	與關聯方在銀行間市場進行買入返售或賣出回購交易；與關聯方在銀行間市場進行債券自營交易；與關聯方進行收益權轉讓交易；認購關聯方發行的債券、基金、理財產品或信託計劃；關聯方認購本公司發行的基金、資產管理計劃、理財產品、場外衍生品及非公開發行債券；與關聯方在全國股份轉讓系統進行掛牌股票的轉讓交易；與關聯人共同投資。	因業務的發生及規模的不確定性，以實際發生數計算。

(四) 預計2024年度確定發生關聯／連交易的關聯方及其關聯關係介紹

1. 上海國盛(集團)有限公司及其聯繫人

上海國盛(集團)有限公司為國有獨資的大型投資控股和資本運營公司，成立於2007年4月。截至2023年12月31日上海國盛(集團)有限公司及其全資子公司上海國盛集團資產有限公司合計持有本公司10.38%的股份。根據《上交所上市規則》第6.3.3條第二款第(四)項，上海國盛(集團)有限公司及其全資子公司上海國盛集團資產有限公司為本公司關聯人；根據《香港上市規則》第14A.07條第(1)/(4)款、第14A.13條第(1)款，上海國盛(集團)有限公司及其聯繫人為本公司關連人。

2. 其他關聯企業

根據《上交所上市規則》第6.3.3條第二款第(三)項，本公司董事、監事和高級管理人員擔任董事(不含同為雙方的獨立董事)、高級管理人員的除本公司、控股子公司及控制的其他主體以外的企業為公司關聯方，但不屬於《香港上市規則》項下的關連方。

(五) 定價原則

1. 證券和金融產品服務

主要包括但不限於因相關業務產生的：代理買賣證券手續費、證券金融產品銷售服務費、受託資產管理費與業績報酬、投資諮詢服務費、投行承銷費、財務顧問費、應收賬款及應付賬款等，定價參照市場化價格水平、行業慣例及第三方定價確定。

2. 證券和金融產品交易

主要包括但不限於因相關業務產生的：保證金利息收入、投資收益、交易性金融資產等，定價參照市場化價格水平、行業慣例及第三方定價確定。

上述日常關聯／連交易不存在損害本公司及股東特別是中小股東利益的情形。

(六) 交易目的及對本公司產生的影響

1. 上述關聯／連交易系日常關聯／連交易，均因本公司日常業務經營產生，均能為本公司產生一定的收益，有助於本公司業務的發展，但不對本公司正常經營產生重大影響。
2. 上述關聯／連交易是公允的，交易的定價參考了市場價格，不存在損害本公司及中小股東利益的情況；
3. 上述關聯／連交易不影響本公司的獨立性，本公司主要業務沒有因上述關聯／連交易而對關聯／連方形成依賴。

(七) 交易目的及對本公司產生的影響

上海國盛集團為香港上市規則第十四A章項下本公司的關連人士。因此，本集團與上海國盛集團及其聯繫人訂立的該等交易構成香港上市規則第十四A章項下本公司之持續關連交易。本公司已於2022年12月30日重續持續關連交易框架協議，並履行香港上市規則項下的申報、公告及年度審核等要求。詳見本公司日期為2022年12月30日的公告及本公司日期為2024年3月28日的年度業績公告。

根據適用的中國法律及法規，上述關聯交易須在本公司股東週年大會上提呈議案以供股東投票表決。一份載有(其中包括)該議案詳情的通函，連同股東週年大會的通告，將適時地向本公司股東寄發。

如果將來上述任何關聯交易將構成香港上市規則第十四A章項下規定的「關連交易」或不再受相關豁免，則本公司將嚴格按照香港上市規則第十四A章的規定履行相應合規義務(包括但不限於申報、公告、年度審查或獨立股東批准)。

二、建議本公司2024年度自營投資業務配置規模預計

為便於自營投資業務可根據市場環境波動、自營投資策略靈活調整自營投資規模，經綜合考慮宏觀經濟及證券市場情況，同意以下事宜：

1. 2024年度本公司自營投資業務額度如下：
 - (1) 自營權益類證券及其衍生品投資業務規模不超過上年度淨資本的80%；及
 - (2) 自營非權益類證券及其衍生品投資業務規模不超過上年度淨資本的400%。
2. 授權本公司經營管理層在符合中國證監會有關自營管理、風險管理的相關規定下，根據市場機會和本公司實際情況，在以上額度內確定、調整本公司年度資產負債配置方案。

上述額度不包括本公司長期股權投資，以及因承銷業務、融資融券業務所發生的被動型持倉。本公司自營投資業務規模按照中國證監會發佈的《證券公司風險控制指標管理辦法》《證券公司風險控制指標計算標準規定》中的相關公式計算。

承董事會命
海通證券股份有限公司
董事長
周杰

中國•上海
2024年3月28日

於本公告日期，本公司執行董事為周杰先生及李軍先生；本公司非執行董事為屠旋旋先生、石磊先生、肖荷花女士及許建國先生；本公司獨立非執行董事為周宇先生、范仁達先生、毛付根先生及毛惠剛先生。

* 僅供識別